

BlackRock[®]

Rapport annuel et états financiers révisés

BlackRock Strategic Funds

R.C.S. Luxembourg: B 127481

Sommaire

Informations générales	2
Lettre de la Présidente aux Actionnaires	5
Rapport des Gestionnaires Financiers par délégation	7
Rapport des Administrateurs	11
Rapport sur les rémunérations (non révisé)	15
Bilan	19
Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans	28
Compte de résultat et évolution de l'actif net	40
Variation du nombre d'actions en circulation	50
Portefeuille de titres	60
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	60
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	171
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	174
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	217
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund	223
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	228
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	231
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	235
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	245
BlackRock ESG Euro Bond Fund	252
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	267
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund	277
BlackRock European Absolute Return Fund	284
BlackRock European Opportunities Extension Fund	289
BlackRock European Select Strategies Fund	293
BlackRock European Unconstrained Equity Fund	313
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	314
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	325
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	357
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	403
BlackRock Global Event Driven Fund	406
BlackRock Global Real Asset Securities Fund	416
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	422
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	424
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	426
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	428
BlackRock Style Advantage Fund	430
BlackRock Style Advantage Screened Fund	478
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund	505
BlackRock Systematic Global Equity Fund	511
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund	519
BlackRock Total Advantage Fund	556
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	586
Annexe aux États Financiers	590
Rapport du Réviseur d'Entreprises Agréé	612
Annexe I – Catégories d'Actions (non révisée)	615
Annexe II – Exposition globale au risque de marché (non révisée)	618
Informations supplémentaires (non révisées)	621

Les souscriptions ne doivent être faites que sur la base du Prospectus en vigueur et du Document d'information clé pour les investisseurs (« DICI »), complétés par le rapport et les états financiers annuels révisés les plus récents ainsi que par le rapport intermédiaire et les états financiers non révisés, si ceux-ci sont publiés après ledit rapport annuel et les états financiers révisés. Des exemplaires sont disponibles au siège de BlackRock Strategic Funds (la « Société ») auprès de l'équipe locale de Services aux Investisseurs, de l'Agent de Transfert, de la Société de Gestion ou de l'un des Distributeurs. Pour de plus amples informations, veuillez consulter la section intitulée Informations générales.

Le rapport annuel et les comptes révisés sont présentés en anglais. La traduction française n'est publiée qu'à titre d'information.

Informations générales

Conseil d'administration

Denise Voss, présidente (nommée présidente avec effet le 29 octobre 2020)
Paul Freeman (a démissionné de la présidence avec effet le 29 octobre 2020)
Ursula Marchioni (nommée avec effet le 12 octobre 2020)
Barry O'Dwyer
Geoffrey D. Radcliffe
Keith Saldanha (nommé avec effet le 3 mai 2021)

Tous les Administrateurs sont des Administrateurs non exécutifs.

Ursula Marchioni, Barry O'Dwyer, Geoffrey D. Radcliffe et Keith Saldanha sont des employés du BlackRock Group (le groupe de Sociétés BlackRock, dont la société holding faitière est BlackRock, Inc., et dont la Société de Gestion, les Gestionnaires financiers par délégation et le Distributeur Principal font partie).

Paul Freeman est un ancien employé du BlackRock Group.

Denise Voss est une Administratrice indépendante.

Société de Gestion

BlackRock (Luxembourg) S.A.
35A, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Gestionnaires Financiers par délégation

BlackRock Financial Management, Inc.
Park Avenue Plaza,
55 East 52nd Street,
New York, NY 10055,
États-Unis

BlackRock Institutional Trust Company N.A.
400 Howard Street,
San Francisco CA 94105,
États-Unis

BlackRock Investment Management LLC
100 Bellevue Parkway,
Wilmington, Delaware 19809,
États-Unis

BlackRock Investment Management (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue,
Londres EC2N 2DL,
Royaume-Uni

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

Gestionnaires délégués

BlackRock Asset Management North Asia Limited
16/F Cheung Kong Center,
2 Queen's Road Central,
Hong Kong

BlackRock Investment Management (Australia) Limited
Level 26, 101 Collins Street,
Melbourne 3000,
Australie

BlackRock Japan Co., Ltd.
1-8-3 Marunouchi,
Chiyoda-ku,
Tokyo 100-8217,
Japon

Distributeur Principal

BlackRock Investment Management (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue,
Londres EC2N 2DL,
Royaume-Uni

Dépositaire et Agent comptable

State Street Bank International GmbH, Succursale de Luxembourg
49 avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Agent de Transfert et Teneur de registre

J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.
6C, route de Trèves,
L-2633 Senningerberg,
Grand-Duché de Luxembourg

Commissaire aux comptes

Deloitte Audit, S.à.r.l.
20, boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Conseillers juridiques

Linklaters LLP
35 avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Agent de prêt de titres

BlackRock Advisors (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue,
Londres EC2N 2DL,
Royaume-Uni

Agents Payeurs

Autriche
Raiffeisen Bank International AG
Am Stadtpark 9,
1030 Vienne,
Autriche

Belgique

J.P. Morgan Chase Bank, N.A.
Succursale de Bruxelles
1 Boulevard du Roi Albert II,
B-1210 Bruxelles,
Belgique

République tchèque

UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia a.s.
Prague 4 – Michle, Želetavská 1525/1,
Code postal 140 92,
République tchèque

Informations générales suite

France

CACEIS Bank
1-3 Place Valhubert,
75013 Paris,
France

Allemagne

J.P. Morgan AG
CIB / Investor Services – Trustee & Fiduciary
Taanustor 1 (TaanusTurm)
60310 Francfort-sur-le-Main
Allemagne

Irlande (chef de file)

J.P. Morgan
200 Capital Dock,
Sir John Rogerson's Quay, 79
D02 RK57 Dublin 2,
Irlande

Italie

Allfunds Bank, S.A.
Succursale de Milan
Via Santa Margherita, 7
20121 Milan,
Italie

BNP Paribas Securities Services

Succursale de Milan
Via Ansperto, 5
20123 Milan,
Italie

Société Générale Securities Services S.p.A.

Via Benigno Crespi
19/A, MAC II,
20159 Milan,
Italie

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.

Piazza Salimbeni 3,
53100 Sienne,
Italie

State Street Bank International GmbH

Succursale Italia
Via Ferrante Aporti, 10,
20125 Milan,
Italie

Banca Sella Holding S.p.A.

Piazza Gaudenzio Sella 1,
13900 Biella,
Italie

CACEIS Bank S.A.

Italy Branch
Piazza Cavour, 2,
20121 Milan,
Italie

ICCREA Banca S.p.A.

Via Lucrezia Romana 41/47,
00178 Rome,
Italie

Luxembourg

(Agent payeur central)
J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.
European Bank & Business Centre,
6C, route de Trèves,
L-2633 Senningerberg,
Grand-Duché de Luxembourg

Malte

MeDirect Bank Plc
The Centre, Tigne Point, Sliema TPO, 0001
Malte

Pologne

Citi Hadlowy
Bank Handlowy w Warszawie S.A.
ul. Senatorska 16
PL-00-923 Varsovie
Pologne

Suède

BlackRock Investment Management (UK)
Limited Stockholm Branch
Norrandsgatan 16
111 43 Stockholm
Suède

Suisse

State Street Bank International GmbH
Munich, succursale de Zurich
Beethovenstrasse 19,
CH-8027 Zurich, Suisse

Royaume-Uni

J.P. Morgan Europe Limited
Agent payeur au Royaume-Uni
3 Lochside View
Edinburgh
Royaume-Uni
EH12 9DH

Siège Social

49 avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Informations générales suite

Demandes de renseignements

En l'absence d'autres dispositions, les demandes de renseignements concernant la Société doivent être adressées comme suit :

Demandes de renseignements écrites :

BlackRock Investment Management (UK) Limited,
c/o BlackRock (Luxembourg) S.A.
P.O. Box 1058,
L-1010 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Autres demandes de renseignements :

Téléphone : + 44 207 743 3300,

Fax : +44 207 743 1143.

Email : investor.services@blackrock.com

Prospectus en vigueur

Le Prospectus de la Société et les DICI correspondants ainsi que des exemplaires du Bulletin de Souscription sont disponibles auprès du Centre de Services aux Investisseurs, de la Société de Gestion ou de tout autre Représentant ou Distributeur. Des exemplaires des Statuts de la Société, ainsi que du Rapport annuel, des états financiers annuels révisés, du Rapport intermédiaire et des états financiers non révisés peuvent être également obtenus gratuitement auprès de ces bureaux et auprès de tout Agent Payeur. Tous ces documents sont également disponibles à l'adresse www.blackrockinternational.com.

Représentants

Le représentant au Danemark est BlackRock Copenhagen Branch, filiale de BlackRock Investment Management (UK) Limited, Royaume-Uni, Harbour House, Sundkrogsgade 21, Copenhague, DK 2100, Danemark.

Le représentant en Israël est le Groupe Altshuler Shaham, 19A Habarzel St, Ramat Hahayal, Tel Aviv, Israël.

Le représentant en Pologne est Dubinski Fabrycki Jelenski, ul. Zielna 37, 00-108 Varsovie, Pologne.

Le représentant en Suisse est BlackRock Asset Management Switzerland Limited, Bahnhofstrasse 39, 8001 Zurich, Suisse.

Portefeuille de titres

Le classement des actions est fait en fonction, essentiellement, du pays de constitution de l'entité dans laquelle les Compartiments (individuellement un « Compartiment », collectivement les « Compartiments ») détiennent des actions.

Le classement des titres à revenu fixe et à revenu variable des entreprises et des États est fait en fonction, essentiellement, du pays de constitution de l'émetteur.

Les instruments de liquidité sont principalement classés par pays de constitution de l'émetteur.

Le classement des organismes de placement collectif (« OPC ») et des Exchange Traded Funds (« ETF ») est fait en fonction, essentiellement, du pays de domicile de l'OPC ou de l'ETF.

Achats et ventes

Une liste détaillée des titres de placement achetés et vendus pour n'importe quel Compartiment au cours de l'exercice est disponible, sur demande et gratuitement, au siège social ou dans les bureaux des représentants mentionnés ci-dessus.

Agréments

La Société est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») au sens de la Partie I de la Loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010 relative aux organismes de placement collectif en valeurs mobilières, telle que modifiée (la « Loi de 2010 »). Les consentements réglementaires ont été obtenus ou des notifications appropriées ont été données pour la distribution des actions des Compartiments de la Société dans les pays suivants : Autriche, Belgique, Chili, Chine, République tchèque, Danemark, Finlande, France, Allemagne, Grèce, Hongrie, Islande, Irlande, Italie, Luxembourg, Malte, Pays-Bas, Norvège, Pologne, Portugal, Singapour, République slovaque, Corée du Sud, Espagne, Suède, Suisse, Taïwan, Émirats arabes unis et Royaume-Uni.

Les actions de certains Compartiments de la Société peuvent également être offertes à Singapour en placement privé.

La Société est dûment enregistrée auprès de la Comisión Nacional de Mercado de Valores en Espagne sous le numéro 626.

Lettre de la Présidente aux Actionnaires

Mai 2021

Chers Actionnaires,

La présente lettre a pour but de vous communiquer nos récentes informations concernant les activités de BlackRock Strategic Funds (la « Société » ou « BSF »), au cours des 12 mois se terminant le 31 mai 2021. Au 31 mai 2021, la Société offrait les actions de 33 Compartiments (dénommés individuellement « Compartiment » et collectivement « Compartiments »).

Début 2020, une épidémie de maladie respiratoire infectieuse causée par un nouveau coronavirus connue sous le nom de COVID-19 est devenue une pandémie mondiale et son impact se faisait toujours sentir pendant la période examinée. Ce coronavirus a entraîné de nombreuses conséquences : restrictions de voyage, fermeture des frontières internationales, renforcement des contrôles de santé dans les ports d'entrée et ailleurs, interruptions et retards dans la préparation et la livraison de services de santé, prolongation des mesures de quarantaine, annulations, interruptions de la chaîne d'approvisionnement et baisse de la demande des consommateurs, en plus d'inquiétudes et d'incertitudes générales.

La COVID-19 a eu un impact négatif sur les économies de nombreux pays à l'échelle mondiale, les émetteurs individuels et les marchés de capitaux, et pourrait continuer dans des proportions qui ne sont pas nécessairement prévisibles. Par ailleurs, l'impact des maladies infectieuses dans les pays émergents peut être plus important en raison de systèmes de santé généralement moins solides. Les crises de santé publique provoquées par la récente épidémie de COVID-19 sont susceptibles d'exacerber, dans certains pays ou à l'échelle mondiale, d'autres risques politiques, sociaux et économiques préexistants.

Malgré les progrès impressionnants de la vaccination dans de nombreux gros pays du monde, la durée totale de l'épidémie de COVID-19 et ses effets ne peuvent toujours pas être déterminés avec certitude. La pandémie reste un défi majeur pour les décideurs politiques. Les systèmes de santé ne se sont pas encore rétablis de cet impact et de nombreuses entreprises restent dans une incertitude importante. Les nouvelles mutations du virus menacent de faire augmenter le nombre de cas plus rapidement que les vaccins ne peuvent les stopper. Certains pays émergents, comme l'Inde et le Brésil, ont notamment connu des nouvelles vagues du virus significatives.

De plus, l'accès à la vaccination reste extrêmement limité dans certaines parties du monde, ce qui constitue un obstacle à la reprise dans les zones concernées. Néanmoins, les gouvernements, les décideurs politiques et les investisseurs continuent d'anticiper un retour à la normale pour les économies au second semestre 2021.

Dans le contexte qui vient d'être décrit, les économies se sont de plus en plus adaptées aux restrictions liées au virus et présentent des signes évidents de rétablissement. Le Fonds monétaire international (le « FMI ») prévoit actuellement une croissance de l'économie mondiale de 6,00 % en 2021, avec une expansion respective de la Chine et des États-Unis de 8,4 et 6,4 %. D'une manière générale, le taux de chômage est loin d'être aussi catastrophique que selon certaines prédictions antérieures, et les faillites ont été limitées.

Les investisseurs ont désormais une nouvelle inquiétude : l'inflation. Les derniers chiffres de l'Indice des prix à la consommation des États-Unis ont présenté une hausse de l'inflation de 5,0 % sur une année glissante, soit la plus forte augmentation depuis 2008. Elle s'ajoute à une hausse de 4,2 % le mois précédent. Le choc inflationniste a été ressenti sur les marchés obligataires, qui ont commencé à tenir compte des données de l'inflation plus élevée. La force à long terme du secteur de la technologie a aussi été perturbée, ce secteur ayant profité de prévisions de taux d'intérêt « plus bas plus longtemps ».

La Réserve fédérale des États-Unis (la « Fed ») pense toujours que l'inflation du second semestre de l'année sera modérée, le rebond économique immédiat s'affaiblissant. Cependant, les entreprises signalent des problèmes d'approvisionnement de plus en plus nombreux, des hausses des prix des matières premières et des pénuries de main-d'œuvre. Dans de telles situations, les banques pourraient être forcées à réévaluer leur politique actuelle, et à augmenter les taux d'intérêt pour ralentir la croissance économique et adoucir les menaces d'inflation.

Pour l'instant, les économies restent correctement soutenues par les mesures des États et des banques centrales. Les taux d'intérêts restent bas dans le monde et les États ont réservé des capitaux significatifs au soutien aux individus et aux nouveaux bâtiments infrastructurels, notamment pour la transition vers une énergie propre. Pendant la période examinée, Joe Biden, le nouveau président des États-Unis, a validé une nouvelle loi de relance COVID-19 d'un montant de 1.900 milliards de dollars.

La reprise des marchés s'est aussi poursuivie sur la période, encouragée par les progrès de la vaccination. Cependant, à partir de novembre, alors que les résultats liés à la vaccination étaient annoncés, ce progrès était fermement ancré dans les actions de « reprise » comme celles de l'énergie, des services financiers ou du tourisme, plutôt que dans les actions technologiques à forte croissance qui avaient dominé la grande partie de 2020.

Les facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG ») deviennent de plus en plus importants pour les organismes de réglementation, les décisionnaires et les investisseurs. L'ensemble du Groupe BlackRock est fermement décidé à intégrer les informations ESG à ses processus d'investissement, y compris à la présente gamme de fonds. Nous sommes convaincus que des portefeuilles qui tiennent compte de la durabilité et du climat peuvent à long terme fournir aux investisseurs de meilleurs rendements ajustés au risque, et que les données sur la durabilité constituent un ensemble d'outils de plus en plus significatifs pour identifier les risques et les opportunités non évalués au sein des portefeuilles.

Lettre de la Présidente aux Actionnaires

Mai 2021 suite

Vous trouverez des informations plus détaillées sur les performances des Compartiments dans le rapport des Gestionnaires financiers par délégation, où nous présentons également notre point de vue sur les perspectives d'investissement. Dans l'ensemble, les actifs sous gestion («ASG») de la Société ont augmenté de 14,5 %, passant de 23.870 millions d'USD à 27.315 millions d'USD. Trois compartiments ont été clôturés sur la période : BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund, BlackRock Asia Extension Fund et BlackRock Macro Opportunities Fund. Un compartiment a été lancé sur la période : BlackRock ESG Euro Bond Fund.

Le Compartiment BlackRock Global Real Asset Securities Fund a eu le pourcentage de croissance le plus important, grimant de 228,3 %, à 315,2 millions d'USD. Le Compartiment BlackRock Global Equity Absolute Return Fund a également connu une forte croissance, avec une hausse de 214,4 %, atteignant 70,6 millions d'USD. La performance du Compartiment BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund a également été bonne, avec une hausse de 187,3 % à 385,4 millions d'EUR, malgré un climat difficile pour le revenu fixe.

Le Compartiment BlackRock Style Advantage Fund a fait partie des points faibles, avec une perte de 91,7 % de ses ASG, tombant à 178,5 millions d'USD. La gamme BlackRock Managed Index Portfolios n'a pas non plus obtenu de bons résultats, le portefeuille Conservatif étant tombé de 34,7 %, à 101,7 millions d'EUR, et le compartiment Defensif ayant reculé de 21,6 % à 159,2 millions d'EUR.

Les changements réglementaires se sont poursuivis dans toute l'Europe, ce qui pourrait avoir des conséquences pour les investisseurs. Évolutions importantes au cours de la période :

- ▶ Les autorités européennes de surveillance (AES) ont publié un document de consultation en octobre 2019 sur le contenu des documents d'informations clés (DIC) de produits d'investissement packagés de détail et fondés sur l'assurance (« PRIIP »). Le document est axé sur les scénarios de performance et les coûts. La Société bénéficiera de la période de transition dont dispose un OPCVM jusqu'au 1^{er} juillet 2022.
- ▶ La consultation de l'Union européenne sur le nouveau Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (« SFDR ») et les règlements de taxonomie se poursuit, les premières exigences relatives au SFDR devant entrer en vigueur en mars 2021. Le règlement imposera de nouvelles obligations de transparence et de déclaration aux sociétés de gestion de placement, tant au niveau de l'entreprise que du produit. Le gouvernement luxembourgeois a récemment pris de nouvelles mesures pour encourager les investissements dans les fonds écologiquement durables, en réduisant la taxe d'abonnement pour les fonds qui répondent à certains critères environnementaux.
- ▶ En juin 2020, l'Autorité européenne des marchés financiers (« AEMF ») a émis une directive de supervision à l'intention des organismes de réglementation locaux, visant à superviser les coûts et frais applicables aux OPCVM et aux fonds d'investissement alternatifs. Les frais pouvant avoir un impact significatif sur les rendements finaux des investisseurs, par cette publication, l'AEMF cherche à s'assurer que les coûts placés sur les produits d'investissement au détail sont justes et transparents, en mettant l'accent sur la prévention des frais indus.

Si vous avez des questions sur l'un de ces sujets, veuillez nous contacter sur notre site Internet à l'adresse suivante : www.blackrockinternational.com ou par e-mail : investor.services@blackrock.com.

Veuillez agréer l'expression de mes salutations distinguées,

Denise Voss
Présidente

Juin 2021

Rapport des Gestionnaires Financiers par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} juin 2020 au 31 mai 2021

Examen du marché

L'année examinée a fortement été marquée par une reprise des marchés, après d'importantes ventes liées à la pandémie. Cette reprise du marché s'est produite malgré des données économiques mitigées et des confinements, mais s'est accélérée et élargie quand il est devenu évident que les vaccins joueraient probablement un rôle pour stopper la pandémie.

Les marchés ont connu deux périodes : la plus grande partie de 2020 a été caractérisée par la solidité des actions de croissance et, notamment, celle des sociétés qui ont profité des confinements, qui ont créé une nouvelle dépendance à la technologie. Par conséquent, les groupes d'e-commerce, d'informatique cloud et de technologies de la communication ont prospéré.

Inversement, les loisirs, la grande distribution et l'hôtellerie ont tout d'abord été violemment touchés. Ces secteurs se sont en grande partie rétablis après les annonces sur la réussite des vaccins. Cependant, il était déjà trop tard pour certaines sociétés vulnérables : Hertz, Flybe, Intu Properties et les magasins JC Penney et Lord & Taylor ont tous fait faillite.

L'inflation a commencé à devenir un facteur important pour les marchés pendant la reprise économique. Les difficultés d'approvisionnement de biens essentiels, comme les matières premières et les semi-conducteurs, jointes à la demande latente des consommateurs et aux fortes dépenses infrastructurelles gouvernementales ont contribué à pousser les prix à la hausse. Les chiffres de l'inflation de l'indice des prix à la consommation (« IPC ») des États-Unis ont respectivement été de 4,2% et 5% en avril et mai 2021. La Réserve fédérale des États-Unis (la « Fed ») a continué à insister sur le caractère « transitoire » des changements, mais bon nombre d'investisseurs n'en sont pas convaincus.

Ces pressions inflationnistes ont été ressenties tant sur les marchés obligataires que sur les marchés boursiers. Elles ont poussé les rendements, qui évoluent dans le sens inverse des prix, sur les obligations d'État à long terme au premier trimestre 2021, bien qu'ils se soient ensuite stabilisés. Ceci a aussi eu un effet négatif sur le secteur de la technologie bien coté et dont les fortes évaluations étaient partiellement justifiées par les faibles taux d'intérêt à long terme.

Les facteurs ESG (les facteurs de durabilité « environnementaux », « sociaux » et « de gouvernance ») sont devenus des considérations plus importantes pour beaucoup d'investisseurs pendant la période examinée, ce qui devrait perdurer. De même, beaucoup de sociétés « vertes » ont profité de l'impulsion des gouvernements à « mieux reconstruire », ce qui a soutenu les cours de leurs actions. Alors que les flux des fonds communs ont généralement été ternes, les fonds ESG ont continué à attirer les investisseurs.

La période a été difficile pour ceux en recherche de revenus. Les dividendes ont été durement touchés, en particulier aux États-Unis et au Royaume-Uni, car les entreprises n'ont pas pu effectuer de distribution ou ont cherché à conserver des liquidités durant cette période d'incertitude. Certaines entreprises ont également subi des pressions réglementaires

pour stopper les paiements. En septembre 2020, les sociétés avaient commencé à reprendre les versements car elles avaient davantage de visibilité sur leurs bénéficiaires, mais le processus a été lent.

Les rendements des obligations d'État, qui évoluent dans le sens inverse des prix, ont initialement bénéficié d'un intérêt pour la qualité et d'un assouplissement monétaire de la part des banques centrales. Les rendements des bons du Trésor américain à 10 ans ont chuté d'environ 1,9% début 2020 à environ 0,7% début mars, et sont restés proches de ce niveau pour le reste de l'année considérée. Cependant, ils ont rapidement grimpé face à la peur de l'inflation et ont atteint 1,75% en mars 2021. Le spread (la différence de rendement entre obligations d'État et d'entreprise à échéances similaires) des obligations d'entreprise s'est fortement élargi au début de la crise mais s'est réduit depuis.

Performance des compartiments

Performance des compartiments d'actions

Un tableau présentant la performance de la principale catégorie d'actions de chaque Compartiment par rapport à tout indice de référence utilisé se trouve aux pages 9 et 10. Il est suivi par un court résumé de la performance du compartiment.

Le Compartiment BlackRock European Absolute Return Fund a progressé de 1,3%, surperformant le LIBOR Index (EUR) à trois mois, qui a chuté de 0,5%. Le Compartiment BlackRock UK Equity Absolute Return Fund a perdu 0,4% comparativement à un rendement de référence plat (le LIBOR Index (GBP) à trois mois). Le Compartiment BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund a chuté de 18,6% sur la période, derrière son indice de référence, qui était en hausse de 0,3%.

Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund a chuté de 9,5% sur la période, bien en deçà de son indice de référence, le 3 Month LIBOR Index (USD), en hausse de 0,3%. Le Compartiment BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund a chuté de 3,8%, derrière le 3 Month LIBOR Index (USD), en hausse de 0,3%.

Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund a augmenté de 41,6%, en deçà de son indice de référence, le MSCI Emerging Markets Index, en hausse de 51,0%. Le Compartiment BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund a gagné 3,2%, devant son indice de référence, le BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill, qui a progressé de 0,1%.

Le Compartiment BlackRock European Opportunities Extension Fund a augmenté de 41,1% surperformant son indice de référence, le S&P Europe BMI Index (Developed Markets Only), qui a augmenté de 32,5%. Le Compartiment BlackRock European Select Strategies Fund a progressé de 6,8%, devant son indice de référence, qui lui a progressé de 6,5%. Le Compartiment BlackRock Global Event Driven Fund a augmenté de 10,1%, contre une hausse de 0,1% pour son indice de référence, le BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill.

Rapport des Gestionnaires Financiers par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} juin 2020 au 31 mai 2021 suite

Le Compartiment BlackRock Systematic ESG World Equity Fund a progressé de 42,3%, devant son indice de référence, qui lui a progressé de 40,6%. Le Compartiment BlackRock Style Advantage Fund a chuté de 3,2%, tandis que son indice de référence, le LIBOR Index (USD) à trois mois, a progressé de 0,3%. La version « filtrée » a baissé de 4,2% par rapport au même indice de référence. Le Compartiment BlackRock Systematic Global Equity Fund a augmenté de 22,4%, tout comme son indice de référence. Le Compartiment Global Real Assets Securities a grimpé de 31,4%, contre une hausse de 26,3% pour son indice de référence.

Performance des Compartiments Obligations

Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund, qui n'évalue pas sa performance par rapport à un indice de référence, a progressé de 5,0% sur la période. Le Compartiment BlackRock Fixed Income Strategies Fund a augmenté de 4,3% sur la période, devant son indice de référence, l'Euro Overnight Index Average, en baisse de 0,4%. Le Compartiment BlackRock Global Absolute Return Bond Fund a reculé de 5,6%, devant son indice de référence, le 3 Month Euribor Index, qui a chuté de 0,5%.

Le Compartiment BlackRock ESG Euro Bond Fund a progressé de 0,4%, derrière son indice de référence, qui lui a progressé de 0,8%. Le Compartiment ESG Euro Corporate Bond Fund a progressé de 4,2%, derrière son indice de référence, le Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate Sustainable SRI Index, qui a pris 4,3%.

Performance des Compartiments diversifiés

Le Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund a augmenté de 11,4% sur la période, surperformant son indice de référence, l'Euro Overnight Index Average, qui a chuté de 0,4%. Les Compartiments BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, Growth et Moderate – ont progressé respectivement de 5,7%, 25,6% et 15,3%.

Perspective

À la fin du mois de mai 2021, le déploiement du vaccin contre la COVID-19 était bien établi, avec différents degrés de réussite selon les pays. Alors que de nombreuses grandes économies avaient vacciné leurs citoyens vulnérables, ce qui a résulté en une baisse du nombre d'hospitalisations et de décès, la flambée des cas en Inde et au Brésil a montré que le monde restait vulnérable aux nouveaux variants du virus.

Néanmoins, le redémarrage de l'économie mondiale s'est poursuivi. Chez BlackRock, nous pensons qu'une puissante reprise économique est en marche. Le FMI a prévu une hausse de 6,0% de la production mondiale en 2021, avec une expansion de 6,4% pour les États-Unis et de 8,4% pour la Chine.

Cette croissance peut toutefois provoquer de l'inflation, ce qui se remarque de plus en plus sur les marchés financiers. Nous prévoyons une hausse constante de l'inflation à moyen terme, la politique monétaire assouplie permettant à l'économie américaine de poursuivre sa course. Pour l'instant, la Fed estime que la hausse de l'inflation est « transitoire », certains redoutent encore de la voir perdurer.

Il est également clair que la COVID-19 a accéléré des changements profonds dans le fonctionnement des économies et des sociétés. Il y a une volonté croissante de durabilité et d'aborder certains sujets, comme les inégalités. Dans ce nouvel environnement, il est plausible qu'un nouveau modèle de capitalisme émerge. De nombreux bouleversements technologiques, comme le passage au numérique et l'e-commerce, semblent permanents, tandis que des parties du marché de la santé ont été révolutionnées. Le périmètre de ces changements et leurs conséquences pourraient rester flous quelques temps.

Les secteurs du bon côté de la « nouvelle normalité », comme la technologie et la santé, devraient connaître une poussée notable. La COVID-19 a également changé le paysage géopolitique. Les chaînes d'approvisionnement sont de plus en plus courtes, à rebours d'une tendance à la mondialisation depuis plusieurs décennies, qui a graduellement fait baisser l'inflation et augmenté les marges bénéficiaires des entreprises.

Le basculement vers l'investissement durable est une autre évolution importante et persistante. Dans sa lettre de 2021 aux PDG des entreprises dans lesquelles BlackRock investit les actifs de ses clients, Larry Fink, le PDG de BlackRock, a déclaré : « L'année dernière a connu d'importants engagements en faveur du net zéro carbone de la part de la Chine, de l'Union européenne, du Japon et de la Corée du Sud, et, la semaine passée, les États-Unis ont réintégré l'Accord de Paris. De plus en plus d'organismes de régulation financière rendent obligatoires la divulgation du risque climatique, les banques centrales réalisent des tests de résistance sur le risque climatique et les décideurs politiques du monde entier collaborent à l'atteinte d'objectifs climatiques communs. 127 gouvernements, responsables de plus de 60% des émissions mondiales, et plus de 1.100 sociétés ont pris des engagements net zéro carbone ou envisagent de le faire. Ces évolutions auront un impact considérable sur les investisseurs. » Les sociétés sont de plus en plus jugées sur leur empreinte carbone et leur vision de la durabilité en général, ces considérations doivent donc être prises en compte dans l'évaluation des investissements.

Le monde qui émerge de la pandémie de COVID-19 sera probablement différent du monde d'avant. Les investisseurs doivent se préparer à une nouvelle normalité. Cette pandémie a profondément et durablement choqué l'économie mondiale. Les répercussions s'en feront sentir pendant des années.

Juin 2021

Rapport des Gestionnaires Financiers par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} juin 2020 au 31 mai 2021 suite

Vous trouverez, dans le tableau ci-dessous, les rendements de la catégorie d'actions primaire pour chaque Compartiment, qui a été choisie à titre représentatif. Conformément aux objectifs d'investissement respectifs décrits dans le Prospectus, les Compartiments ne cherchent pas à reproduire la performance d'un indice de référence spécifique. Les rendements de l'indice de référence inclus dans le tableau ci-dessous sont fournis à titre de référence uniquement aux fins du présent Rapport annuel et des états financiers révisés. La catégorie d'actions primaire pour les Compartiments BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund, BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund, BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund est la catégorie D de capitalisation, pour le Compartiment BlackRock European Credit Strategies Fund la catégorie H de capitalisation, et pour les Compartiments BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth et BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate est la catégorie D de distribution. Pour tous les autres Compartiments, la catégorie d'actions primaire est la catégorie A de capitalisation. Le rendement de toute autre catégorie d'actions peut être mis à disposition sur demande.

La performance passée n'est pas indicatrice de la performance future et ne doit pas être le seul facteur pris en considération pour le choix d'un produit. Tous les investissements financiers comportent un élément de risque. Par conséquent, la valeur de votre investissement et le revenu qu'il génère peuvent fluctuer. Le montant initialement investi ne peut pas être garanti. Les Compartiments investissent une part importante d'actifs libellés dans plusieurs devises; par conséquent, les variations des taux de change concernés affecteront la valeur de l'investissement. Les chiffres de la performance ne tiennent pas compte des frais et commissions qui peuvent être prélevés au moment de la souscription ou du rachat d'actions. Les taux et les bases d'imposition peuvent varier de temps à autre. Les souscriptions ne doivent être faites que sur la base du Prospectus en vigueur et du DICI, complétés par le rapport et les états financiers annuels révisés les plus récents ainsi que par le rapport intermédiaire et les états financiers non révisés, si ceux-ci sont publiés après ledit rapport annuel et les états financiers révisés. Des exemplaires sont disponibles auprès de l'équipe locale de Services aux Investisseurs (des sociétés ou succursales du BlackRock Group locales ou de leurs administrateurs), de l'Agent de Transfert, de la Société de Gestion ou de l'un des Représentants ou Distributeurs ainsi qu'au siège de la Société. BSF est réservé aux non-ressortissants américains qui ne résident pas aux États-Unis. Les Compartiments ne sont pas offerts à la vente ni vendus aux États-Unis, pas plus que dans les territoires ou les possessions des États-Unis.

Nom du Compartiment	Performance de l'année financière au 31 mai 2021				Date de lancement
	1 an	2020	2019	2018	
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist	(3,84)%	(2,84)%	2,19%	0,56%	17 février 2012
3 Month LIBOR Index (USD)	0,28%	1,08%	2,60%	2,08%	
BlackRock Asia Extension Fund 'A' Class Non Dist⁽¹⁾	7,80%	(8,69)%	12,52%	(14,21)%	10 février 2012
MSCI All Country Asia ex Japan	7,40%	(5,59)%	18,45%	(14,12)%	
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist	13,20%	8,43%	4,08%	(4,19)%	31 août 2016
3 Month LIBOR Index (USD)	0,28%	1,08%	2,60%	2,08%	
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist	18,59%	7,54%	(1,98)%	5,16%	22 février 2017
3 Month LIBOR Index (USD)	0,28%	1,08%	2,60%	2,08%	
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund 'A' Class Non Dist	11,38%	7,19%	8,55%	(4,68)%	28 janvier 2011
Euro Overnight Index Average	(0,45)%	(0,44)%	(0,38)%	(0,35)%	
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist⁽²⁾	11,54%	10,48%	14,24%	(2,38)%	17 octobre 2018
3 month LIBOR Index (GBP)	0,07%	0,29%	0,81%	0,18%	
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist	9,53%	(19,70)%	1,61%	14,28%	15 novembre 2012
3 Month LIBOR Index (USD)	0,28%	1,08%	2,60%	2,08%	
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund 'A' Class Non Dist	41,57%	(9,86)%	23,24%	(0,79)%	18 septembre 2015
MSCI Emerging Markets Index	51,00%	18,31%	18,42%	(14,57)%	
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund 'A' Class Non Dist	5,00%	14,07%	5,66%	(12,01)%	12 juin 2013
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund 'A' Class Non Dist	13,03%	8,41%	6,50%	(0,45)%	6 décembre 2017
J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified 1-3 year Index	7,99%	0,46%	4,02%	0,59%	
BlackRock ESG Euro Bond Fund 'A' Class Non Dist	0,44%	4,16%	5,69%	(0,47)%	23 août 2016
Bloomberg Barclays MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Index	0,78%	4,21%	5,91%	0,42%	
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund 'A' Class Non Dist	4,24%	2,79%	1,01%	—	21 juin 2019
Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate Sustainable SRI Index	4,33%	2,70%	0,91%	—	
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund⁽³⁾	(0,38)%	—	—	—	1 mars 2021
Bloomberg Barclays MSCI Euro Aggregate 1-3 Years Sustainable SRI Index	(0,10)%	—	—	—	
BlackRock European Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist	1,33%	8,72%	0,54%	3,69%	27 février 2009
3 Month LIBOR Index (EUR)	(0,52)%	(0,43)%	(0,39)%	(0,37)%	

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

Rapport des Gestionnaires Financiers par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} juin 2020 au 31 mai 2021 suite

Nom du Compartiment	Performance de l'année financière au 31 mai 2021				Date de lancement
	1 an	2020	2019	2018	
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist⁽¹⁾	(0,07)%	(5,61)%	5,93%	(19,88)%	6 août 2010
3 Month LIBOR Index (EUR)	—	(0,15)%	(0,39)%	(0,37)%	
BlackRock European Opportunities Extension Fund 'A' Class Non Dist	41,13%	10,99%	31,64%	(10,71)%	31 août 2007
S&P Europe BMI Index (Developed Markets only) (EUR)	32,49%	(1,45)%	27,77%	(10,60)%	
BlackRock European Select Strategies Fund 'A' Class Non Dist	6,84%	2,24%	9,94%	(4,95)%	19 août 2015
75 % Barclays Pan European Aggregate Index (Hedged EUR) / 25 % MSCI Europe Index (Hedged EUR)	6,54%	3,24%	10,13%	(2,60)%	
BlackRock European Unconstrained Equity Fund 'A' Class Non Dist	25,41%	10,75%	39,23%	(1,89)%	6 décembre 2018
MSCI Europe Index (Net Total Return)	29,67%	(3,32)%	26,05%	(1,62)%	
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund 'A' Class Non Dist	4,77%	1,15%	1,88%	—	11 juin 2019
Euro Overnight Index Average	(0,45)%	(0,44)%	(0,22)%	—	
BlackRock Fixed Income Strategies Fund 'A' Class Non Dist	4,32%	3,44%	2,23%	(2,92)%	30 septembre 2009
Euro Overnight Index Average	(0,45)%	(0,44)%	(0,38)%	(0,35)%	
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund 'A' Class Non Dist	5,62%	2,65%	1,29%	(3,69)%	25 mai 2012
3 month Euribor Index	(0,45)%	(0,39)%	(0,34)%	(0,33)%	
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist	18,92%	14,89%	6,34%	(1,14)%	12 décembre 2018
3 Month LIBOR Index (USD)	0,28%	1,08%	2,60%	0,14%	
BlackRock Global Event Driven Fund 'A' Class Non Dist	10,07%	6,74%	6,93%	4,35%	5 août 2015
BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill	0,11%	0,67%	2,28%	1,87%	
BlackRock Global Real Asset Securities Fund 'A' Class Non Dist	31,84%	6,51%	25,18%	(6,34)%	30 novembre 2017
FTSE Custom Developed Core Infrastructure 50/50 EPRA/Nareit Developed Dividend+ Net Index	26,28%	(6,80)%	21,79%	(6,46)%	
BlackRock Macro Opportunities Fund 'A' Class Non Dist⁽¹⁾	0,29%	(1,96)%	3,88%	(2,84)%	29 novembre 2017
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative 'A' Class Non Dist	11,11%	0,35%	14,80%	(7,01)%	26 janvier 2018
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive 'D' Class Dist	5,70%	(0,22)%	11,41%	(3,86)%	10 avril 2015
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth 'D' Class Dist	25,64%	7,36%	23,36%	(8,40)%	10 avril 2015
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate 'D' Class Dist	15,27%	0,37%	18,91%	(6,75)%	10 avril 2015
BlackRock Style Advantage Fund 'A' Class Non Dist	(3,21)%	(23,28)%	(2,61)%	(5,52)%	29 février 2016
3 month LIBOR Index (USD)	0,28%	1,08%	2,60%	2,08%	
BlackRock Style Advantage Screened Fund 'A' Class Non Dist	(4,22)%	(19,51)%	0,82%	1,94%	29 octobre 2018
3 Month LIBOR Index (USD)	0,28%	1,08%	2,60%	0,40%	
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund 'A' Class Non Dist	42,27%	17,69%	27,48%	(10,03)%	20 août 2015
MSCI World Index (Net Total Return)	40,63%	15,90%	27,67%	(8,71)%	
BlackRock Systematic Global Equity Fund 'A' Class Non Dist	41,30%	15,83%	24,72%	(13,13)%	18 septembre 2015
MSCI All Country World Index (Net Total Return)	41,85%	16,25%	26,60%	(9,41)%	
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund 'A' Class Non Dist⁽²⁾	3,24%	(0,61)%	(1,20)%	0,45%	2 juin 2014
BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill	0,11%	0,67%	2,28%	1,87%	
BlackRock Total Advantage Fund 'A' Class Non Dist	6,74%	(12,70)%	10,28%	(8,17)%	11 décembre 2017
3 month Euribor Index	(0,45)%	(0,39)%	(0,34)%	(0,33)%	
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist	(0,44)%	(1,37)%	9,20%	(5,39)%	18 août 2016
3 month LIBOR Index (GBP)	0,07%	0,29%	0,81%	0,72%	

⁽¹⁾ Le Compartiment a été liquidé durant l'année, voir la Note 1 pour plus de détails. La performance indiquée représente la performance du Compartiment du 1^{er} juin 2020 à la date de liquidation.

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Compartiment lancé, voir note 1 pour de plus amples informations. La performance indiquée représente la performance du Fonds depuis sa date de lancement jusqu'au 31 mai 2021.

Les rendements des Compartiments sont fondés sur les cours de négociation avec dividendes nets (après déduction de la retenue à la source) réinvestis et sont indiqués après déduction des commissions. Sources indiciaires : Indices – Financial Times, MSCI, Citigroup, DataStream, MorningStar; Fonds – BlackRock Investment Management (UK) Limited.

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

Rapport des Administrateurs

Déclaration sur le gouvernement d'entreprise

Introduction

BlackRock Strategic Funds (la « Société ») est une Société anonyme constituée, conformément aux lois du Grand-Duché de Luxembourg, en tant que Société d'investissement à capital variable. La Société a été autorisée par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (la « CSSF ») comme organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») conformément aux dispositions de la Partie I de la loi du 17 décembre 2010, telle qu'amendée de temps en temps, et est régie par cette loi. La Société respecte les principes fixés par la révision du code de conduite 2013 (le « Code ») de l'Association luxembourgeoise des fonds d'investissement (« ALFI ») publié par cette dernière en juin 2013.

Le Conseil d'administration de la Société (le « Conseil ») s'engage à maintenir les plus hauts niveaux de gouvernance d'entreprise et est responsable vis-à-vis des actionnaires de la gouvernance des affaires de la Société. Le Conseil a pris en compte les principes et les recommandations du Code et a mis en place un cadre de gouvernance d'entreprise qu'il juge approprié pour une adhésion aux principes du Code, au vu de la nature de sa structure en tant que société d'investissement. Le Conseil d'administration considère que la Société a respecté les principes du Code pour l'exercice clos le 31 mai 2021.

Cette déclaration résume la structure et les processus de gouvernance d'entreprise de la Société pour la période examinée allant du 1^{er} juin 2020 au 31 mai 2021.

Composition du Conseil

À l'heure actuelle, le Conseil est composé de six Administrateurs non exécutifs (y compris un Administrateur indépendant). Le Conseil s'engage à conserver un juste équilibre des compétences, de l'expérience, de l'indépendance et des connaissances de ses membres.

Les parcours professionnels des Administrateurs, aux pages 13 et 14, illustrent collectivement l'étendue de leurs connaissances et de leur expérience en matière d'investissement, leurs compétences dans le domaine des affaires et de la finance ainsi que leur maîtrise des réglementations, qui leur permettent d'assurer une gestion stratégique efficace, une supervision et une gouvernance appropriée de la Société. BlackRock estime que la composition actuelle constitue un bon équilibre pour le Conseil.

L'article 13 des statuts de la Société prévoit, conformément au droit luxembourgeois, que les Administrateurs soient élus par les actionnaires lors de leur assemblée générale annuelle pour une période se terminant à l'assemblée générale annuelle suivante et jusqu'à l'élection de leurs successeurs. Tout Administrateur qui quitte ses fonctions est tenu de confirmer au Conseil et à la CSSF que sa démission n'est pas liée à de quelconques problèmes en relation avec la Société ou de quelconques réclamations à l'encontre de cette dernière.

Le Conseil est favorable à un renouvellement planifié et progressif du Conseil. BlackRock s'engage à veiller à ce que les Administrateurs candidats à l'élection par les actionnaires possèdent les compétences nécessaires au maintien de cet équilibre. Le Conseil s'engage à effectuer un examen annuel de sa performance et de ses activités.

Les Administrateurs sont constamment tenus de veiller à ce qu'ils aient suffisamment de temps pour remplir leurs tâches. Des informations détaillées sur les autres nominations et engagements de chaque Administrateur (y compris le Président) sont consultables auprès du Conseil et du groupe BlackRock.

Avant qu'un nouvel Administrateur ne soit proposé aux actionnaires, ce dernier bénéficiera d'une initiation complète comprenant la communication d'informations importantes concernant ses tâches et responsabilités en tant qu'Administrateur et concernant la Société. En outre, un nouvel Administrateur est tenu d'accorder un peu de temps aux représentants de BlackRock, afin de se familiariser avec les différents processus jugés nécessaires pour une bonne exécution de ses tâches et responsabilités envers la Société.

La politique de la Société est d'encourager les Administrateurs à se tenir informés des développements relatifs à la Société. Les Administrateurs ont assisté et continueront d'assister à des séances d'actualisation et d'information organisées par les entités BlackRock. De plus, les Administrateurs reçoivent régulièrement des comptes rendus provenant, notamment, de commissaires aux comptes, de spécialistes en stratégie d'investissement, de spécialistes du risque, de dépositaires et de conseillers juridiques en lien avec tout développement de produit proposé ou toute modification des lois et réglementations qui pourrait affecter la Société.

Responsabilités du Conseil

Le Conseil se réunit au moins tous les trimestres et, au besoin, de façon ponctuelle. Le Conseil reçoit des informations en temps voulu, sous une forme et d'une qualité lui permettant de remplir ses fonctions. Le Conseil est responsable de la réussite à long terme de la Société et reconnaît être responsable de la gestion, de la direction et du contrôle de la Société, dans le cadre de contrôles prudents et efficaces permettant d'évaluer et de gérer les risques. Le Conseil se réserve la faculté de prendre toutes les décisions liées à la détermination de la politique et des objectifs d'investissement, à toute modification de la stratégie d'investissement, à la conclusion de tout contrat important, au remplacement de tout membre du conseil, de tout auditeur externe, à la défense judiciaire ou au règlement de tout litige important pour la Société et à toute évolution majeure des politiques ou pratiques comptables. En outre, le Conseil approuve le prospectus et tout addendum à ce dernier, toute circulaire aux actionnaires, tout état financier de même que toute autre documentation légale concernée.

La principale responsabilité du Président est de diriger et de gérer le Conseil, d'encourager les discussions critiques et de favoriser une communication efficace au sein du Conseil. Il est également chargé de promouvoir les bonnes pratiques, la gouvernance d'entreprise et une communication efficace avec les actionnaires.

Rapport des Administrateurs suite

Les Administrateurs bénéficient, en cas de besoin, des conseils et des services d'un conseiller externe et du personnel de BlackRock Group ainsi que de BlackRock (Luxembourg) S.A. (la « Société de Gestion »). Si nécessaire, dans l'exercice de leurs fonctions, le Conseil et chaque Administrateur peuvent demander l'avis d'un professionnel indépendant. Le Conseil est responsable de veiller à ce que les registres comptables de la Société soient dûment tenus, lesquels doivent faire apparaître à tout moment, avec une précision raisonnable, la situation financière de la Société et permettre au Conseil de s'assurer que les états financiers sont conformes aux normes comptables concernées. Le Conseil est chargé de présenter une évaluation équilibrée et compréhensible de la situation financière de la Société, comprenant les états financiers intermédiaires et autres rapports mis à la disposition des actionnaires et du public. Le Conseil est chargé de prendre des mesures raisonnables pour la sauvegarde des actifs de la Société et pour la prévention et la détection des fraudes et autres irrégularités.

Assurance

La Société souscrit une assurance couvrant de manière appropriée la responsabilité des Administrateurs et des cadres.

Délégation des responsabilités

La Société étant une société d'investissement à capital variable, la plupart de ses activités journalières de gestion et d'administration sont déléguées à des sociétés du BlackRock Group comme la Société de Gestion, qui emploie des professionnels spécialisés dans la conformité et le risque. La Société de Gestion nomme les Gestionnaires Financiers par délégation et d'autres prestataires de services tiers. Le Conseil a délégué les domaines de responsabilités suivants :

Gestion et administration

Le Conseil a délégué la gestion des investissements, l'administration, la commercialisation et la distribution de la Société et de ses Fonds à la Société de Gestion. La Société a nommé State Street Bank International GmbH, succursale luxembourgeoise, comme Dépositaire de ses actifs, avec pour responsabilité la garde de ces actifs, conformément aux réglementations. Le Dépositaire est une filiale de State Street Bank & Trust Co.

La Société de Gestion a délégué la gestion du portefeuille de titres aux Gestionnaires Financiers par délégation. Les Gestionnaires Financiers par délégation observent les lignes directrices déterminées par le Conseil et indiquées dans le Prospectus de la Société portant sur les Compartiments de cette dernière. Les Gestionnaires Financiers par délégation concernés sont directement responsables des décisions concernant la gestion quotidienne des Fonds de la Société et répondent de la performance des investissements des Fonds vis-à-vis de la Société de Gestion. Le Conseil a également délégué l'exercice des droits de vote attachés aux titres détenus dans le portefeuille aux Gestionnaires Financiers par délégation respectifs, qui peuvent à leur tour le déléguer à BlackRock Investment Management (U.K.) Limited (« BIM UK »). Le vote pour le compte d'actionnaires s'effectue de manière à servir au mieux les intérêts économiques des actionnaires en tant qu'investisseurs à long terme.

La Société de Gestion a délégué ses responsabilités relatives aux services administratifs de la Société et de ses Fonds à State Street Bank International GmbH, succursale de Luxembourg (l'« Agent administratif »). L'Agent administratif est responsable de l'administration des affaires de la Société, y compris le calcul de la valeur liquidative et la préparation des états financiers de la Société, sous réserve de la supervision générale de la Société de Gestion. L'Agent administratif est une filiale de State Street Bank & Trust Co. La Société de Gestion a délégué les services d'agent de transfert et d'enregistrement des actions à J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.

La Société de Gestion a délégué la distribution, la promotion et la commercialisation des Actions, ainsi que l'administration et la commercialisation connexes courantes à BIM UK en tant que Distributeur principal. En tant que Distributeur principal, BIM UK est responsable de l'offre de vente, de la promotion et de la commercialisation des actions de tout fonds. BIM UK est responsable envers la Société de Gestion de la distribution et de la commercialisation des Actions.

La Société de Gestion est responsable envers le Conseil de toutes les activités qui lui sont déléguées ou qu'elle délègue, y compris, entre autres, celles décrites ci-dessus.

La Société de Gestion présente un rapport au Conseil tous les trimestres et, au besoin et à titre exceptionnel, de manière ponctuelle. Les rapports sont produits afin de veiller à ce que le Conseil puisse superviser efficacement les mesures prises par ses délégués.

La Société de Gestion est responsable de la gestion des risques et des contrôles internes de la Société, ainsi que de la vérification de leur efficacité, de manière à veiller à ce que les informations financières publiées ou utilisées dans le cadre de l'activité soient fiables, et à surveiller régulièrement la conformité aux réglementations régissant le fonctionnement de la Société. La Société de Gestion vérifie, en continu, l'efficacité des systèmes de gestion des contrôles internes et des risques, afin d'identifier, d'évaluer et de gérer les risques importants de la Société. Ce processus comprend des procédures conçues pour détecter et évaluer tout(e) défaut ou faiblesse. Si le Conseil considère une affaire comme importante, il existe des procédures visant à assurer que les mesures nécessaires sont prises pour remédier aux défauts.

Les processus de contrôle des risques identifiés, couvrant la gestion des finances, des opérations, de la conformité et des risques, font partie intégrante des opérations de BlackRock Group, de la Société de Gestion et d'autres parties, notamment l'Agent administratif et le Dépositaire. Un processus de surveillance et de transmission de rapports, mené par le service d'audit d'entreprise de BlackRock dans le but d'analyser ces contrôles, était en vigueur durant la période examinée et jusqu'à la date du présent rapport.

Les unités de BlackRock chargées de la gestion des risques d'audit et du risque opérationnel présentent, sur une base trimestrielle, un rapport à la Société de Gestion. La Société de Gestion reçoit également, de la part de l'Agent administratif et du Dépositaire, un rapport sur les contrôles internes des activités de garde et des activités

Rapport des Administrateurs suite

administratives de la Société. Le Conseil reconnaît que ces systèmes de contrôle peuvent uniquement gérer et non éliminer les risques de non-réalisation des objectifs des fonds et qu'ils peuvent garantir de manière raisonnable mais non absolue contre toute anomalie ou perte importante ; ledit Conseil s'appuie sur les contrôles opérationnels mis en place par les prestataires de services.

Rapports financiers

Le Conseil est également responsable de l'établissement et du bon fonctionnement des systèmes de gestion des contrôles internes et des risques de la Société, en relation avec le processus de production de rapports financiers. Ces systèmes sont conçus pour gérer et non pour éliminer le risque de non-réalisation des objectifs de la Société s'agissant de la production de rapports financiers. La Société dispose de procédures visant à garantir la bonne tenue et l'accessibilité de tous les registres comptables concernés et, notamment, la production des états financiers annuels et semestriels. Ces procédures comprennent la désignation de l'Agent administratif pour la tenue des registres comptables de la Société, indépendamment du Gestionnaire d'investissements et du Dépositaire. Les états financiers sont préparés conformément au droit applicable et aux principes comptables généralement reconnus, et sont approuvés par le Conseil d'administration de la Société. Les données comptables communiquées dans le rapport annuel doivent être révisées et le rapport du commissaire aux comptes agréé, y compris toute réserve, est entièrement reproduit dans le rapport annuel de la Société.

Rémunération

La Société est une société d'investissement et ne possède aucun employé ni aucun Administrateur exécutif. Aucun Administrateur (ancien ou actuel) n'a droit à une quelconque prestation de retraite de la part de la Société, et la Société n'a attribué aucune option sur actions ou prime de rendement à long terme. Aucun élément de rémunération des Administrateurs n'est lié au rendement. Les Administrateurs qui sont également des employés de BlackRock Group n'ont droit à aucune rémunération en tant qu'Administrateur (jeton). Tous les autres Administrateurs reçoivent une rémunération soumise à l'approbation des actionnaires lors de l'assemblée générale annuelle et communiquée à la page 592. Le Conseil estime que le niveau de rémunération des Administrateurs qui perçoivent une commission correspond au temps consacré à cette fonction et aux responsabilités y afférentes. Le montant maximal de rémunération payable aux Administrateurs est approuvé par le Conseil.

Communication avec les actionnaires

Le Conseil est responsable de la convocation à l'assemblée générale annuelle et à toutes les autres assemblées générales de la Société. Les actionnaires sont encouragés à participer et voter aux assemblées générales. L'avis de convocation aux assemblées générales est émis conformément aux statuts de la Société et l'avis de convocation à l'assemblée générale annuelle est envoyé au moins 8 jours avant l'assemblée. Toutes les questions de fond portées devant l'assemblée générale sont traitées au moyen d'une résolution distincte. Les chiffres des votes par procuration sont notés par le président de l'assemblée générale.

La prochaine Assemblée générale annuelle des Actionnaires se tiendra le 25 novembre 2021 et les actionnaires seront invités à examiner les points habituellement abordés lors de ces assemblées, notamment :

- ▶ Approbation des états financiers et paiement des dividendes
- ▶ Approbation des commissions des Administrateurs
- ▶ Élection ou réélection des administrateurs
- ▶ Élection ou réélection du commissaire aux comptes
- ▶ Quitus aux Administrateurs – cette résolution est requise par la loi luxembourgeoise et le quitus n'est valable que si les états financiers ne contiennent pas d'omission ou de fausses informations qui masquent la situation financière réelle de la Société. Le quitus est accordé sur la base des faits divulgués et des informations mises à la disposition des actionnaires lors de l'Assemblée générale annuelle.

Les procédures relatives aux assemblées générales sont régies par les statuts de la Société.

En tant que Distributeur principal, BIM UK est chargé de gérer la relation entre la Société et ses actionnaires, et le Conseil a mis en place des contrôles lui permettant d'être informé des plaintes des actionnaires.

Parcours professionnels des Administrateurs

Denise Voss (Présidente) (de nationalité américaine) :

Mme Voss est un administrateur non exécutif de sociétés de services financiers et exerce ses activités à Luxembourg. Elle siège comme Administratrice aux Conseils d'administration de fonds phare de grands promoteurs de fonds, y compris BlackRock Global Funds et BlackRock Strategic Funds. Mme Voss a travaillé auparavant pour Franklin Templeton au Luxembourg pendant plus de 25 ans en tant que Dirigeante et Administratrice des activités OPCVM et de gestion de fonds d'investissement alternatifs de la société. Avant de rejoindre Franklin Templeton, elle a travaillé 10 ans chez Coopers & Lybrand à Boston, aux États-Unis et au Luxembourg. Elle est titulaire d'une licence CPA Massachusetts et a obtenu un diplôme de premier cycle à l'Université Tufts, ainsi qu'un diplôme de Master en comptabilité de l'Université de Bentley. Mme Voss est présidente de LuxFLAG, une agence indépendante dont le siège est situé au Luxembourg, qui décerne des labels reconnus de finance durable aux structures d'investissement éligibles. De 2015 à 2019, elle a été présidente de l'ALFI (Association luxembourgeoise des fonds d'investissement), et de 2007 à 2019, membre du Conseil d'administration de l'ALFI.

Geoffrey D. Radcliffe (double nationalité britannique et luxembourgeoise, résident luxembourgeois) : M. Radcliffe est Managing Director chez BlackRock et exerce ses activités à Luxembourg. Il est membre de l'équipe chargée des services internationaux Comptabilité et Produits de BlackRock Business Operations & Technology, et est responsable de la surveillance des produits, de la gouvernance internationale et des alternatives internationales pour BlackRock EMEA & Asia Pacific. M. Radcliffe est Membre de l'Institute of Chartered Accountants d'Angleterre et du Pays de Galles ainsi que

Rapport des Administrateurs suite

du Chartered Institute of Bankers. Après plus de 30 années d'expérience dans les fonds communs de placement, la comptabilité et les services bancaires acquise au Luxembourg, aux Bermudes, à Londres et à l'île de Man, M. Radcliffe a rejoint le Groupe BlackRock en 1998. Il siège actuellement aux Conseils d'administration de BlackRock Luxembourg S.A. et BlackRock Fund Management Company S.A. et aux Conseils de plusieurs fonds d'investissement BlackRock. Il est membre du conseil d'administration de l'ALFI (Association luxembourgeoise des fonds d'investissement) depuis 2013.

Barry O'Dwyer (irlandais) : M. O'Dwyer est Managing Director chez BlackRock. Il est Responsable de la gouvernance des fonds pour la gamme de fonds communs de placement européens de BlackRock et a été Directeur des opérations pour l'activité irlandaise de BlackRock. Il siège aux conseils d'administration de plusieurs sociétés, fonds et sociétés de gestion BlackRock domiciliés en Irlande, au Luxembourg, en Suisse et en Allemagne, de même qu'au conseil de la société de BlackRock UK Life. Il a été président de l'Irish Funds Industry Association en 2014-2015, siège au Conseil d'administration de Financial Services Ireland et est membre d'un comité consultatif dans le secteur des services financiers pour le chef du gouvernement irlandais. Il est entré chez BlackRock Advisors (UK) Limited en 1999, en tant que responsable de la gestion du risque, et a intégré ses fonctions actuelles en 2006. Avant de travailler pour BlackRock Advisors (UK) Limited, M. O'Dwyer a occupé les fonctions de gestionnaire du risque chez Gartmore Investment Management et HypoVereinsbank ainsi qu'à la National Westminster Bank. M. O'Dwyer a étudié au Trinity College Dublin, où il a obtenu, en 1991, un diplôme en Business Studies and Economics. Il est membre de la Chartered Association of Certified Accountants et est titulaire d'un MBA de la London City University Business School.

Paul Freeman (Britannique) : M. Freeman siège actuellement au conseil d'administration de plusieurs sociétés et fonds d'investissement du BlackRock Group. Jusqu'en décembre 2015, il était Managing Director de BlackRock, où il était entré en août 2005 (à l'époque l'entité était dénommée Merrill Lynch Investment Managers). Avant juillet 2011, Paul Freeman était directeur du développement de produits et de la gestion de la gamme pour la région EMEA, responsable du développement et de la gestion continue des produits de tous les fonds domiciliés dans cette région et distribués par BlackRock sur une base transfrontalière. Entre juillet 2011 et décembre 2015, M. Freeman a travaillé en étroite collaboration avec l'équipe de BlackRock chargée des affaires gouvernementales et siégé à différents comités de gouvernance internes de même qu'aux conseils de

plusieurs filiales et fonds gérés du groupe. M. Freeman a œuvré dans le secteur des services financiers pendant plus de 35 ans et, avant son entrée chez BlackRock, a occupé des fonctions de haute direction chez Schroders, Rothschild Asset Management, Henderson Investors et GT Management (qui appartient aujourd'hui à Invesco). M. Freeman est expert-comptable.

Ursula Marchioni (de double nationalité britannique et italienne, résidente du Royaume-Uni) : Mme Marchioni est Managing Director chez BlackRock et responsable de l'activité BlackRock Portfolio Consulting pour l'Europe, le Moyen-Orient et l'Afrique. Elle est membre du comité de BlackRock chargé de l'investissement européen, et du comité exécutif chargé des ETF et des investissements indiciels européens. Mme Marchioni a rejoint BlackRock en août 2012 à la fonction iShares Investment and Product Strategy. Elle est devenue Directrice d'équipe et Chief Strategist d'iShares pour la région EMEA en mars 2016. Elle a pris ses fonctions actuelles en janvier 2017 et cumule 20 ans d'expérience dans le secteur des services financiers. Avant de rejoindre BlackRock, Mme Marchioni a travaillé pour Crédit Suisse et Société Générale dans les divisions Asset Management et Investment Banking. Elle a commencé sa carrière chez KPMG Financial Advisory Services. Mme Marchioni est titulaire d'un diplôme de physique avec mention de l'Université de Trente, en Italie.

Keith Saldanha (de nationalité britannique) : M. Saldanha est Managing Director de BlackRock et est Directeur du Wealth Product Group pour l'Europe, le Moyen-Orient et l'Afrique. Il est responsable de la définition et de l'exécution des plans pour les produits alpha et alternatifs de l'activité BlackRock EMEA Wealth. Par ailleurs, M. Saldanha dirige le segment Fund Selection and Manager Research pour l'organisation des ventes EMEA iShares & Wealth. Il est membre du Comité exécutif Wealth EMEA, du Comité de développement des produits EMEA et du Comité de gestion des capacités EMEA. Il a rejoint BlackRock en 2015 après avoir quitté le Man Group, où il était Global Head of Investment Marketing, responsable de plusieurs équipes de spécialistes produits, de développement commercial et de service à la clientèle pour les activités de gestion des investissements de Man. Avant cela, il a consacré plusieurs années à la création et l'exécution de l'activité de fusions et acquisitions de fonds spéculatifs de Man, tout en dirigeant la stratégie d'entreprise pour l'activité de fonds spéculatifs. M. Saldanha a commencé sa carrière dans le conseil en stratégie. Il est analyste en placements alternatifs agréé et est titulaire d'un BSc (Hons) en Économie de l'Université de Warwick.

Rapport sur les rémunérations (non révisé)

Les informations ci-dessous concernent les politiques de rémunération du BlackRock Group (« BlackRock »), telles qu'elles s'appliquent à BlackRock (Luxembourg) S.A. (le « Gestionnaire »). Les informations sont transmises conformément à la Directive 2009/65/CE portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant les organismes de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM »), telle que modifiée, notamment la Directive 2014/91/UE du Parlement européen et du Conseil du 23 juillet 2014, (la « Directive »), et aux « Lignes directrices dans le cadre des directives OPCVM et AIFM » émises par l'Autorité européenne des marchés financiers.

Chez BlackRock, la politique de rémunération applicable aux OPCVM (la « Politique de rémunération applicable aux OPCVM ») sera applicable aux entités de l'Espace économique européen (« EEE »), au sein du BlackRock Group, agréées en tant que société de gestion d'OPCVM conformément à la Directive, et assurera la conformité aux exigences de l'Article 14b de la Directive.

Le Gestionnaire a adopté la Politique de Rémunération applicable aux OPCVM, résumée ci-dessous.

Gouvernance en matière de rémunération

La gouvernance de la rémunération de BlackRock dans la zone EMEA fonctionne sous la forme d'une structure à plusieurs niveaux qui comprend : (a) le Comité de gestion, de développement et de rémunération (« CGDR ») (qui est le comité de rémunération indépendant et mondial de BlackRock, Inc. et (b) le conseil d'administration du Gestionnaire (le « Conseil du Gestionnaire »). Ces organes sont responsables de la détermination des politiques de rémunération de BlackRock.

(a) CGDR

Le principal objectif du CGDR est de :

fournir un aperçu :

- ▶ des programmes de rémunération des dirigeants de BlackRock ;
- ▶ des systèmes d'indemnités des salariés de BlackRock ; et
- ▶ des autres systèmes de rémunération qui peuvent être établis, le cas échéant, par BlackRock et dont le CGDR est réputé être l'agent administratif ;
- ▶ examiner et discuter, conjointement avec la direction, de l'analyse des rémunérations figurant dans la circulaire annuelle de sollicitation de procurations (proxy statement) de BlackRock, Inc., et approuver le rapport du CGDR pour une intégration dans la circulaire de sollicitation des procurations ;
- ▶ examiner, évaluer et présenter des rapports et des recommandations au Conseil d'administration de BlackRock, Inc. (le « Conseil de BlackRock Inc. »), le cas échéant, sur le développement de talents et la planification de la relève de BlackRock, en mettant l'accent sur la performance et la relève aux plus hauts niveaux de la direction ; et
- ▶ aider les conseils d'administration des entités de la Société réglementées EMEA à s'acquitter de leurs obligations en matière de rémunération en supervisant la conception.

Le CGDR conserve son propre conseiller indépendant en matière de rémunération, Semler Brossy Consulting Group LLC, qui n'a aucun lien avec BlackRock, Inc. ou avec le Conseil de BlackRock, Inc. pouvant interférer avec sa faculté de fournir des conseils de façon indépendante au CGDR sur les questions liées à la rémunération.

Le Conseil de BlackRock, Inc. a décrété que tous les membres du CGDR doivent être « indépendants » au sens des normes d'inscription à la cote de la Bourse des valeurs de New York (NYSE), laquelle exige que chacun d'entre eux soit en conformité avec une norme d'« administrateur non-salarié ».

Le CGDR s'est réuni 9 fois en 2020. La charte du CGDR peut être consultée sur le site Internet de BlackRock, Inc. (www.blackrock.com).

Par suite de ses examens réguliers, le CGDR demeure satisfait des principes de la politique et de l'approche de BlackRock en matière de rémunération.

(b) Le Conseil du Gestionnaire

Le Conseil du Gestionnaire a pour tâche de superviser et de surveiller la politique de rémunération de l'OPCVM telle qu'appliquée au Gestionnaire et à son Personnel identifié.

Le Conseil du Gestionnaire (par le biais d'un examen indépendant des fonctions de contrôle pertinentes) reste satisfait de la mise en œuvre de la politique de rémunération de l'OPCVM telle qu'appliquée au Gestionnaire et à son Personnel identifié.

Processus de prise de décision

Les décisions relatives à la rémunération des employés sont prises une fois par an, en janvier, après la clôture de l'exercice. Ce calendrier permet de prendre en considération les résultats financiers de la totalité de l'exercice ainsi que les autres objectifs non financiers. Bien que le cadre dans lequel les décisions relatives aux rémunérations sont prises soit lié à la performance financière, les rémunérations individuelles variables sont fixées avec discernement sur la base de l'obtention de résultats stratégiques et opérationnels et autres considérations comme les capacités de gestion et de leadership.

Aucune formule n'est établie et aucune donnée de référence n'est utilisée dans la détermination des primes annuelles. Pour déterminer certains montants de rémunération individuelle spécifiques, plusieurs facteurs sont pris en considération, notamment les objectifs non financiers, la performance financière générale et la performance en matière d'investissement. Ces résultats sont étudiés dans leur ensemble, sans pondération particulière, et il n'existe aucun lien direct entre une mesure de performance donnée et la prime annuelle qui en découle. La rémunération variable attribuée à une ou plusieurs personnes physiques pour la performance d'une année en particulier peut aussi être égale à zéro.

Les primes annuelles versées sont prélevées sur une somme globale affectée aux primes (bonus pool).

Le montant de la somme globale prévue, comprenant les primes en liquidités et les primes en actions, est revu tout au long de l'année par le CGDR, et la somme globale définitive est approuvée après la clôture de l'exercice. Dans le cadre de cette révision, le CGDR reçoit des données financières

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

réelles et prévisionnelles tout au long de l'exercice, ainsi que des données finales de clôture. Les données financières que le CGDR reçoit et examine comprennent le compte de résultat prévisionnel et autres mesures financières, en comparaison avec l'exercice précédent et le budget de l'exercice en cours. Le CGDR examine d'autres mesures de la performance financière de BlackRock (par exemple les entrées nettes d'ASG et la performance des investissements), de même que les données concernant les conditions du marché et les niveaux de rémunération concurrentiels.

Le CGDR examine régulièrement les recommandations de la direction s'agissant du pourcentage de résultat d'exploitation avant primes qui sera cumulé et comptabilisé en tant que charge de rémunération tout au long de l'exercice, pour la partie liquide de la somme globale annuelle affectée aux primes (le « taux d'accumulation »). Le taux d'accumulation de la partie liquide de la somme globale annuelle affectée aux primes peut être modifié par le CGDR en cours d'exercice, sur la base de son examen des données financières indiquées ci-dessus. Le CGDR n'applique aucune pondération particulière ni aucune formule aux données qu'il examine lors de la détermination du montant de la somme globale affectée aux primes ou des sommes cumulées pour la partie liquide de la somme globale affectée aux primes.

Après la clôture de l'exercice, le CGDR approuve le montant de la somme globale affectée aux primes.

Dans le cadre du processus d'examen de clôture d'exercice, les services chargés du risque d'entreprise et de la conformité aux réglementations présentent au CGDR un rapport sur les activités, les incidents ou les événements qui méritent d'être pris en considération dans les décisions prises en matière de rémunération.

Les personnes concernées ne participent pas à l'établissement de leur propre rémunération.

Fonctions de contrôle

Chacune des fonctions de contrôle (risque d'entreprise, affaires juridiques et conformité, et audit interne) possède sa propre structure, laquelle est indépendante des unités d'entreprise. La personne responsable de chaque fonction de contrôle est soit un membre du comité exécutif international, le comité de gestion international, soit tenu de présenter un rapport au Conseil d'administration de BlackRock Group Limited, la société mère de toutes les entités réglementées de BlackRock dans la région EMEA, y compris le Gestionnaire.

Les sommes globales affectées aux primes pour chaque fonction sont déterminées en référence à la performance de chacune des fonctions. La rémunération des cadres supérieurs des fonctions de contrôle est directement supervisée par le CGDR.

Lien entre la paye et la performance

Une philosophie de rétribution au rendement de même que des programmes de rémunération clairs et bien définis ont été conçus pour atteindre les objectifs clés suivants, décrits ci-dessous :

- ▶ équilibrer les résultats financiers de BlackRock de façon appropriée entre les actionnaires et les employés ;

- ▶ attirer, fidéliser et motiver les employés capables de contribuer de manière significative à la réussite de l'entreprise à long terme ;
- ▶ aligner les intérêts des cadres supérieurs sur ceux des actionnaires en attribuant des actions de BlackRock, Inc. comme part importante des primes annuelles et à long terme ;
- ▶ contrôler les coûts fixes en veillant à ce que les frais de rémunération varient en fonction de la rentabilité ;
- ▶ lier une part importante de la rémunération totale d'un employé à la performance financière et opérationnelle de l'entreprise ainsi qu'à la performance de ses actions ordinaires ;
- ▶ décourager la prise de risque excessive ; et
- ▶ veiller à ce que les intérêts des clients ne soient pas défavorablement touchés par la rémunération attribuée à court, moyen et/ou long terme.

Pour instaurer une culture du haut rendement, il faut être en mesure d'évaluer les performances par rapport à des objectifs, des valeurs et des comportements, de façon claire et cohérente. Les Gestionnaires utilisent une échelle de notation à 5 points pour l'évaluation générale de la performance d'un employé ; en outre, les employés fournissent une autoévaluation. La note générale finale fait l'objet d'un rapprochement lors de chaque évaluation de la performance d'un employé. Les employés sont évalués par rapport à la façon dont l'objectif est atteint et par rapport à la performance absolue en elle-même.

Dans le respect de la philosophie de rémunération au rendement, les notes sont utilisées pour différencier et récompenser une performance individuelle – mais ne servent pas à préétablir les rémunérations. Les décisions relatives aux rémunérations demeurent discrétionnaires et sont prises dans le cadre du processus de rémunération de fin d'exercice.

Lorsque les niveaux de rémunération sont fixés, d'autres facteurs sont pris en considération, outre la performance individuelle, parmi lesquels :

- ▶ la performance du Gestionnaire, les fonds gérés par le Gestionnaire et/ou le service concerné de la fonction ;
- ▶ les facteurs concernant un employé de façon individuelle ; les relations avec les clients et les collègues ; le travail en équipe ; les compétences ; et les problèmes de conduite ; et, sous réserve de toute politique applicable, l'impact que tout congé autorisé peut avoir sur la contribution à l'entreprise ;
- ▶ la gestion du risque dans le cadre de profils de risque appropriés pour les clients de BlackRock ;
- ▶ les besoins stratégiques de l'entreprise, y compris ses intentions en matière de fidélisation ;
- ▶ la compréhension des marchés ; et
- ▶ la criticité pour l'entreprise.

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

Un outil essentiel est la gestion des risques et, lorsque les employés sont rémunérés pour une excellente performance dans leur gestion des actifs des clients, il leur est demandé de gérer le risque dans le cadre des profils de risque appropriés pour leurs clients. Par conséquent, les employés ne sont pas récompensés pour avoir engagé des transactions hautement risquées en dehors de paramètres établis. Les pratiques de rémunération ne prévoient pas de primes indues pour la planification à court terme ou pour les bénéfices financiers à court terme, ne récompensent pas le risque déraisonnable et offrent un équilibre raisonnable entre les différents risques substantiels inhérents à l'activité de gestion d'investissements, de gestion des risques et de services de conseil.

BlackRock utilise un modèle de rémunération globale qui comprend un salaire de base, lequel est contractuel, et un régime de primes discrétionnaires.

BlackRock utilise un régime de primes discrétionnaires annuelles. Bien que les employés puissent avoir droit à une prime discrétionnaire, aucune obligation contractuelle n'impose d'octroyer une prime à un employé en vertu de son régime de primes discrétionnaires. Lors de l'attribution d'une prime discrétionnaire, les facteurs indiqués ci-dessus (sous le titre « Lien entre la paye et la performance ») peuvent être pris en compte en plus des autres questions connexes à l'exercice de ce pouvoir discrétionnaire au cours de l'année concernée.

L'attribution de primes discrétionnaires à tous les employés, y compris les dirigeants, est soumise aux lignes directrices qui déterminent la part payée en liquide et la part payée en actions BlackRock, Inc., de même qu'aux autres conditions de dévolution et de récupération (clawback). L'attribution d'actions est soumise à un ajustement ultérieur de la performance, par le biais d'une variation du prix de l'action de BlackRock, Inc. durant la période d'indisponibilité. Lorsque la rémunération annuelle totale augmente, une part plus importante est dévolue en actions. Le CGDR a adopté cette approche en 2006, pour faire croître substantiellement la valeur pour l'entreprise et l'alignement du régime de rémunération sur les actionnaires pour les employés éligibles, y compris les dirigeants. La part en actions est dévolue en trois versements égaux durant les trois années suivant l'attribution.

Outre la prime discrétionnaire annuelle décrite ci-dessus, des attributions d'actions peuvent être accordées pour sélectionner des individus afin d'assurer un meilleur lien avec les résultats futurs de l'entreprise. Ces attributions de primes à long terme ont été établies individuellement, afin d'offrir une incitation significative pour une performance constante sur plusieurs années en reconnaissance de la portée du travail de l'individu, de ses compétences professionnelles et de ses aptitudes au leadership.

Dans le cadre du « Système de primes au rendement de BlackRock » (« SPRB ») certains cadres dirigeants peuvent recevoir des primes ajustées au rendement sous forme d'actions. Les primes du SPRB utilisent une période de performance de trois ans basée sur une mesure Comme marge d'exploitation ajustée⁽¹⁾ et Croissance organique⁽²⁾ Le versement sera déterminé en fonction des résultats de

l'entreprise par rapport aux résultats financiers cibles, à la fin de l'exercice. Le maximum d'actions pouvant être accordées est de 165 % de la prime, lorsque les deux paramètres atteignent les objectifs financiers préalablement fixés. Aucune action ne peut être accordée si les résultats de l'entreprise, pour les deux paramètres ci-dessus, sont inférieurs à un seuil de performance préétabli. Ces paramètres ont été choisis comme mesures clés de la valeur pour l'actionnaire, qui perdurent tout au long des différents cycles du marché.

Un nombre limité de professionnels de l'investissement se voient attribuer une partie de leurs primes annuelles discrétionnaires (comme indiqué ci-dessus) en liquidités différées qui suivent théoriquement l'évolution des investissements dans des produits choisis gérés par l'employé. Ces primes ont pour but d'aligner les professionnels de l'investissement sur les rendements des produits qu'ils gèrent, au moyen de la rémunération différée s'agissant de ces produits. De plus en plus, les clients et les évaluateurs externes voient d'un œil favorable les produits avec lesquels les investisseurs clés « risquent leur peau », c'est-à-dire dans lesquels ils ont des intérêts propres significatifs en jeu.

Personnel identifié

La Politique de rémunération applicable aux OPCVM fixe le processus qui sera mis en œuvre pour identifier le personnel en tant que « personnel identifié », à savoir les catégories de personnel du Gestionnaire, comprenant la haute direction, les preneurs de risque, les fonctions de contrôle et tout employé recevant une rémunération totale qui le place dans la même catégorie de rémunération que la haute direction et les preneurs de risque, dont les activités professionnelles ont un impact important sur les profils de risque de la Société de Gestion ou des fonds qu'il gère.

La liste des membres du « personnel identifié » sera régulièrement révisée, une révision officielle étant effectuée, mais de façon non limitative, dans les circonstances suivantes :

- ▶ changements organisationnels ;
- ▶ nouvelles initiatives de l'entreprise ;
- ▶ changements dans les listes des fonctions dont l'influence est significative ;
- ▶ changements des responsabilités attribuées aux différents postes ; et
- ▶ révision de l'orientation réglementaire.

Informations quantitatives relatives à la rémunération (pour l'Irlande, le Royaume-Uni et le Luxembourg)

Le Gestionnaire doit, en vertu de l'OPCVM, communiquer des informations quantitatives sur la rémunération. De telles communications sont faites conformément à l'interprétation de BlackRock des orientations réglementaires actuellement disponibles en matière d'informations quantitatives sur la rémunération. En fonction de l'évolution des pratiques des marchés ou des pratiques réglementaires, BlackRock peut juger approprié de modifier la façon dont les informations quantitatives sur la rémunération sont calculées. Lorsque

⁽¹⁾ Comme marge d'exploitation ajustée : comme indiqué dans les déclarations externes de BlackRock, ce terme désigne le Revenu d'exploitation ajusté divisé par le Chiffre d'affaires total hors frais de distribution, dépenses courantes et amortissement des commissions de vente différées.

⁽²⁾ Croissance organique : égale aux nouvelles commissions de base nettes plus le nouveau chiffre d'affaires Aladdin net généré au cours de l'exercice (en dollars US).

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

de telles modifications sont apportées, il est possible que les informations relatives à un fonds ne soient pas comparables à celles communiquées l'année précédente, ou à celles d'autres Fonds BlackRock au cours de cette même année.

Des informations sont communiquées concernant (a) le personnel du Gestionnaire; (b) le personnel de la haute direction; (c) le personnel qui est en capacité d'affecter de façon importante le profil de risque de la Société, y compris les individus à qui, bien qu'ils ne soient pas directement employés par le Gestionnaire, leur employeur a confié la mission d'exécuter des services directement pour le Gestionnaire.

Toutes les personnes physiques comprises dans les chiffres recueillis et communiqués sont rémunérées conformément à la politique de rémunération de BlackRock, pour leurs responsabilités dans le domaine d'activité concerné de BlackRock. Toutes les personnes physiques ayant plusieurs domaines de responsabilité, seule la partie de la rémunération pour les services de ces personnes attribuable à la Société est comprise dans les chiffres recueillis et communiqués.

Les membres du personnel et la haute direction du Gestionnaire fournissent habituellement des services OPCVM et non-OPCVM au niveau des compartiments multiples, des clients et des fonctions du Gestionnaire, ainsi qu'à l'échelle de tout le BlackRock Group. Par conséquent, les chiffres

communiqués sont une somme de la part de rémunération de chaque personne physique attribuable au Gestionnaire, conformément à une méthode de répartition objective qui reconnaît la nature multi-services du Gestionnaire. Ainsi, les chiffres ne sont pas représentatifs de la rémunération réelle d'une quelconque personne physique ou de sa structure de rémunération.

Le montant de la rémunération totale versée par le Gestionnaire à son personnel, attribué à l'activité OPCVM du Gestionnaire au titre de l'exercice comptable du Gestionnaire clôturé le 31 décembre 2020, est de 166,3 millions d'USD. Ce chiffre est composé d'une rémunération fixe de 11,7 millions d'USD et d'une rémunération variable de 154,6 millions d'USD. Au total, la rémunération indiquée ci-dessus a été versée à 155 bénéficiaires.

Le montant de la rémunération globale versée par le Gestionnaire à sa haute direction, attribué à l'activité OPCVM du Gestionnaire au titre de l'exercice comptable du Gestionnaire clôturé le 31 décembre 2020, était de 0,2 million d'USD, et celui attribué aux membres de son personnel dont l'action a un impact important sur le profil de risque de la Société était de 166,1 millions d'USD.

Bilan

au 31 mai 2021

		BlackRock Strategic Funds combinés	BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	BlackRock Asia Extension Fund ⁽¹⁾	BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund
	Note	USD	USD	USD	USD	USD
Actif						
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		24.615.467.924	649.950.412	—	29.965.082	34.811.365
Plus-values/(moins-values) non réalisées		1.271.720.251	1.086.307	—	3.743.492	—
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	25.887.188.175	651.036.719	—	33.708.574	34.811.365
Avoir en banque	2(a)	1.419.363.442	3.155.353	8.686	1.027.669	356.341
Dus par le courtier	15	414.077.514	73.830	30.000	841.327	—
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	93.535.811	70.063	—	41.688	262.609
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	479.879.023	166.809.291	—	747.167	7.230.221
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	130.016.737	33.214.619	—	75	3.291
Plus-value non réalisée sur :						
Contrats à terme	2(d)	19.198.878	—	—	—	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	193.506.968	3.611.072	—	21.671	226.810
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	293.403.639	64.072.776	—	261.997	4.028.842
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	20.545.946	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	77.663.838	—	—	—	—
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	8.529.157	—	—	—	—
Autres éléments de l'actif	2(a)	661.814	—	—	406	10.742
Total des actifs		29.037.570.942	922.043.723	38.686	36.650.574	46.930.221
Passif						
Sommes dues à la banque	2(a)	106.770.749	335	—	2.501	—
Dus au courtier	15	53.636.804	—	—	33.007	727.535
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	17.751.126	2.725.316	—	122.606	175.293
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	678.825.474	160.995.883	—	174.367	5.979.924
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	61.021.737	967.268	—	—	2.067
Distribution de revenu payable	2(a),11	6.564.260	—	—	—	—
Moins-value non réalisée sur :						
Contrats à terme	2(d)	66.335.986	—	—	115.724	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	119.803.924	864.966	—	10	1.236
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	260.321.114	66.489.912	—	1.368.721	4.062.008
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	14.108.231	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	156.539.001	—	—	—	179.540
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	18.490.992	—	—	—	—
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	2(a),4,5,6,7,8	164.728.037	2.863.160	38.686	156.473	597.143
Total du passif		1.724.897.435	234.906.840	38.686	1.973.409	11.724.746
Total de l'actif net		27.312.673.507	687.136.883	—	34.677.165	35.205.475

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Bilan

au 31 mai 2021 suite

	BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ⁽²⁾	BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund
Note	EUR	GBP	USD	USD
Actif				
Portefeuille de titres au coût d'acquisition	1.037.905.814	792.403.872	11.873.676	870.304.565
Plus-values/(moins-values) non réalisées	133.207.551	5.330.128	33.330	34.647.645
Portefeuille de titres à la valeur de marché	1.171.113.365	797.734.000	11.907.006	904.952.210
Avoir en banque	50.128.864	20.503.448	297.013	2.681.585
Dus par le courtier	7.346.813	45.726.216	490.143	6.772.898
Intérêts et dividendes à recevoir	1.013.134	364.366	11.192	2.178.516
A recevoir sur placements vendus	—	7.830.658	489.322	20.623.234
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	1.512.751	1.042.011	183	174.448
Plus-value non réalisée sur :				
Contrats à terme	4.777.156	—	—	677.670
Opérations de change à terme en cours	5.076.733	25.153	46.026	411.967
« <i>Contracts for difference</i> »	—	36.765.507	208.125	18.878.859
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	8.802.635	—	—	—
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	937.407	—	—	—
Autres éléments de l'actif	17.404	4.427	191	12.135
Total des actifs	1.250.726.262	909.995.786	13.449.201	957.363.522
Passif				
Sommes dues à la banque	—	—	2	2.284
Dus au courtier	8.401.864	18.597.366	—	109
Intérêts et dividendes à payer	134.651	240.059	8.828	300.788
Placements achetés à payer	—	16.533.502	289.591	11.763.820
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	816.012	3.069.389	8.341	7.431.085
Distribution de revenu payable	—	—	—	40
Moins-value non réalisée sur :				
Contrats à terme	4.067.219	19.008.687	13.218	549.135
Opérations de change à terme en cours	3.141.574	5.143.988	1.126	8.339
« <i>Contracts for difference</i> »	—	10.465.422	463.336	28.016.332
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	3.478.123	—	—	—
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	—	—	—	—
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	1.049.312	15.939.610	43.122	3.856.763
Total du passif	21.088.755	88.998.023	827.564	51.928.695
Total de l'actif net	1.229.637.507	820.997.763	12.621.637	905.434.827

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Bilan

au 31 mai 2021 suite

		BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	BlackRock ESG Euro Bond Fund	BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund
	Note	USD	USD	EUR	EUR
Actif					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		1.527.322.644	70.729.346	641.940.771	270.886.195
Plus-values/(moins-values) non réalisées		(121.134.782)	(1.205.077)	(367.964)	1.797.917
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	1.406.187.862	69.524.269	641.572.807	272.684.112
Avoir en banque	2(a)	160.128.708	6.566.101	2.276.709	547.480
Dus par le courtier	15	84.205.238	1.557.349	3.017.444	727.296
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	30.528.136	898.722	2.905.629	1.419.313
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	25.761.092	—	1.478.723	205.994
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	46.083	396.246	761.581	79.763
Plus-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	—	80.515	110.298	75.258
Opérations de change à terme en cours	2(d)	58.847.377	1.236.718	151.567	195.911
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	—	—	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	39.012.502	83.346	65.635	227.921
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	3.063.339	42.908	2.842	1.171
Autres éléments de l'actif	2(a)	10.958	1.585	3.109	3.053
Total des actifs		1.807.791.295	80.387.759	652.346.344	276.167.272
Passif					
Sommes dues à la banque	2(a)	91.814.635	502.779	675.788	201.002
Dus au courtier	15	4	130.638	77.278	301.918
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	4.060.882	80.975	—	—
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	26.313.153	—	6.459.234	3.094.194
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	985.515	24.097	837.378	61.930
Distribution de revenu payable	2(a),11	1.824.140	—	—	—
Moins-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	919.779	16.417	55.992	41.912
Opérations de change à terme en cours	2(d)	56.555.472	1.204.895	119.789	60.586
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	—	—	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	92.280.129	743.026	564.329	215.136
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	—	—	681.264	185.745
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	2(a),4,5,6,7,8	750.457	69.198	375.693	187.709
Total du passif		275.504.166	2.772.025	9.846.745	4.350.132
Total de l'actif net		1.532.287.129	77.615.734	642.499.599	271.817.140

Bilan

au 31 mai 2021 suite

		BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund ⁽³⁾	BlackRock European Absolute Return Fund	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾	BlackRock European Opportunities Extension Fund
	Note	EUR	EUR	EUR	EUR
Actif					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		237.446.472	1.459.305.422	—	377.077.431
Plus-values/(moins-values) non réalisées		(358.866)	169.159.777	—	292.821.030
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	237.087.606	1.628.465.199	—	669.898.461
Avoir en banque	2(a)	675.343	50.361.581	24.993	1.990.117
Dus par le courtier	15	728.688	9.922.672	—	—
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	788.542	1.808.461	—	2.137.669
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	284.775	20.206.456	—	2.552.145
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	—	911.213	—	—
Plus-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	132.375	—	—	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	33.470	128.288	—	—
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	16.414.300	—	5.887.885
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	6.439	—	—	—
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	104	—	—	—
Autres éléments de l'actif	2(a)	16.201	4.386	—	7.552
Total des actifs		239.753.543	1.728.222.556	24.993	682.473.829
Passif					
Sommes dues à la banque	2(a)	—	131.903	—	36.892
Dus au courtier	15	23.262	643	—	163.327
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	1.485	2.949.168	—	135.442
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	1.106.108	165.439.808	—	4.466.388
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	104.586	9.640.804	—	218.671
Distribution de revenu payable	2(a),11	—	—	—	79.808
Moins-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	28.032	—	—	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	43.685	177.316	—	102.880
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	14.711.880	—	5.009.368
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	129.408	—	—	—
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	192.070	—	—	—
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	2(a),4,5,6,7,8	84.347	6.799.091	24.993	12.218.957
Total du passif		1.712.983	199.850.613	24.993	22.431.733
Total de l'actif net		238.040.560	1.528.371.943	—	660.042.096

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 mai 2021 suite

		BlackRock European Select Strategies Fund	BlackRock European Unconstrained Equity Fund	BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	BlackRock Fixed Income Strategies Fund
	Note	EUR	EUR	EUR	EUR
Actif					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		439.261.043	36.691.612	349.513.655	4.923.627.742
Plus-values/(moins-values) non réalisées		28.107.309	10.007.939	2.272.271	29.832.103
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	467.368.352	46.699.551	351.785.926	4.953.459.845
Avoir en banque	2(a)	15.937.998	152.363	32.051.922	624.642.731
Dus par le courtier	15	3.801.459	—	4.784.112	101.468.972
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	1.878.962	9.976	1.844.340	25.163.259
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	4.481.821	—	2.049.282	69.175.491
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	471.987	25.202	712.384	21.892.765
Plus-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	608.098	—	777.451	5.184.607
Opérations de change à terme en cours	2(d)	736.968	16.896	358.755	23.818.741
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	11.472	—	1.142	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	321.986	—	554.482	16.409.922
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	2.596	—	1.592	1.462.268
Autres éléments de l'actif	2(a)	3.356	253	2.649	29.437
Total des actifs		495.625.055	46.904.241	394.924.037	5.842.708.038
Passif					
Sommes dues à la banque	2(a)	—	—	3.068	5.299.441
Dus au courtier	15	151.309	—	959.919	4.534.072
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	18.460	—	21.441	1.738.160
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	4.377.141	—	7.041.047	54.305.405
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	852.013	25.469	156.248	20.729.181
Distribution de revenu payable	2(a),11	23.800	—	—	2.032.681
Moins-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	1.086.383	—	6.880	3.377.753
Opérations de change à terme en cours	2(d)	1.459.919	28.121	174.334	20.302.935
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	—	6.397	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	751.444	—	786.913	38.167.681
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	417.966	—	204.098	10.148.053
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	2(a),4,5,6,7,8	783.451	56.896	163.283	5.785.918
Total du passif		9.921.886	110.486	9.523.628	166.421.280
Total de l'actif net		485.703.169	46.793.755	385.400.409	5.676.286.758

Bilan

au 31 mai 2021 suite

		BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	BlackRock Global Event Driven Fund	BlackRock Global Real Asset Securities Fund
	Note	EUR	USD	USD	USD
Actif					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		144.427.888	58.082.027	5.477.067.788	284.939.962
Plus-values/(moins-values) non réalisées		(1.385.330)	7.843.044	316.025.773	23.116.388
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	143.042.558	65.925.071	5.793.093.561	308.056.350
Avoir en banque	2(a)	10.499.181	3.119.999	203.490.457	2.770.795
Dus par le courtier	15	7.529.004	2.778.061	43.453.099	6.445.135
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	1.348.619	28.393	5.105.395	886.554
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	33.528.389	115.685	61.762.443	3.164.506
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	99.700	—	45.707.456	6.205.177
Plus-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	381.375	893	18.963	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	1.560.287	157.534	60.995.457	59.266
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	577.219	115.855.432	3.876
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	16.835.410	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	1.391.324	—	—	—
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	2.033.842	—	—	—
Autres éléments de l'actif	2(a)	1.339	—	47.411	2.231
Total des actifs		218.251.028	72.702.855	6.329.529.674	327.593.890
Passif					
Sommes dues à la banque	2(a)	4.201.071	49.268	430.756	11.449
Dus au courtier	15	398.269	290.338	388.735	2
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	4.051	91.908	3.431.045	12
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	36.621.701	5	72.902.292	8.185.517
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	14.967	—	3.686.394	363.697
Distribution de revenu payable	2(a),11	11	—	—	1.648.667
Moins-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	215.724	1.067.916	20.804.813	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	407.003	77.588	1.858.272	547
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	495.823	106.680.690	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	11.560.327	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	3.040.097	—	4.842.234	—
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	1.819.737	—	—	1.833.825
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	2(a),4,5,6,7,8	513.826	78.398	94.064.133	328.709
Total du passif		58.796.784	2.151.244	309.089.364	12.372.425
Total de l'actif net		159.454.244	70.551.611	6.020.440.310	315.221.465

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Bilan

au 31 mai 2021 suite

		BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	BlackRock Managed Index Portfolios – Growth
	Note	USD	EUR	EUR	EUR
Actif					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		—	95.868.257	155.294.656	328.967.625
Plus-values/(moins-values) non réalisées		—	5.313.784	3.310.505	38.453.332
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	—	101.182.041	158.605.161	367.420.957
Avoir en banque	2(a)	60.802	11.919	33.171	498.487
Dus par le courtier	15	—	—	—	—
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	—	—	—	—
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	—	280.887	554.968	—
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	—	11.098	115.365	1.035.932
Plus-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	—	—	—	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	—	1.023.438	1.481.837	2.503.066
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	—	—	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	—	—	—	—
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	—	—	—	—
Autres éléments de l'actif	2(a)	—	3.348	9.005	22.113
Total des actifs		60.802	102.512.731	160.799.507	371.480.555
Passif					
Sommes dues à la banque	2(a)	—	61.280	218.458	—
Dus au courtier	15	—	—	—	—
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	—	—	—	—
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	—	—	—	—
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	—	172.327	333.413	403.111
Distribution de revenu payable	2(a),11	—	131.745	4.244	2.919
Moins-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	—	—	—	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	—	306.708	927.976	926.917
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	—	—	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	—	—	—	—
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	—	—	—	—
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	2(a),4,5,6,7,8	60.802	112.446	146.383	300.128
Total du passif		60.802	784.506	1.630.474	1.633.075
Total de l'actif net		—	101.728.225	159.169.033	369.847.480

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Bilan

au 31 mai 2021 suite

		BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	BlackRock Style Advantage Fund	BlackRock Style Advantage Screened Fund	BlackRock Systematic ESG World Equity Fund
	Note	EUR	USD	USD	USD
Actif					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		642.057.049	130.934.980	21.095.879	304.309.842
Plus-values/(moins-values) non réalisées		48.897.057	7.375	615.306	49.541.426
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	690.954.106	130.942.355	21.711.185	353.851.268
Avoir en banque	2(a)	465.341	22.798.017	3.030.021	3.438.381
Dus par le courtier	15	—	19.391.364	3.115.947	599.516
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	271.993	872.445	51.036	635.310
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	—	7.540.074	672.547	178.905
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	1.649.229	18.226	—	6.520.253
Plus-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	—	2.532.175	482.185	880
Opérations de change à terme en cours	2(d)	5.812.426	13.318.070	859.334	1.499
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	5.388.111	894.538	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	—	4.054.732	352.837	—
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	—	—	—	—
Autres éléments de l'actif	2(a)	9.789	—	55.080	10.181
Total des actifs		699.162.884	206.855.569	31.224.710	365.236.193
Passif					
Sommes dues à la banque	2(a)	—	—	—	148.985
Dus au courtier	15	—	5.675.884	1.037.000	7
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	—	105.862	16.484	—
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	—	5.685.432	479.126	6.260.688
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	830.242	9.581	—	222.800
Distribution de revenu payable	2(a),11	257.905	—	—	—
Moins-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	—	2.405.667	422.083	736
Opérations de change à terme en cours	2(d)	2.328.770	8.968.163	1.042.865	44.242
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	5.984.881	918.340	—
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	—	949.211	13.908	—
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	—	—	—	—
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	2(a),4,5,6,7,8	492.026	920.277	241.972	220.064
Total du passif		3.908.943	30.704.958	4.171.778	6.897.522
Total de l'actif net		695.253.941	176.150.611	27.052.932	358.338.671

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Bilan

au 31 mai 2021 suite

		BlackRock Systematic Global Equity Fund	BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund ⁽²⁾	BlackRock Total Advantage Fund	BlackRock UK Equity Absolute Return Fund
	Note	USD	USD	EUR	GBP
Actif					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		162.493.365	43.375.175	14.099.272	141.312.152
Plus-values/(moins-values) non réalisées		19.924.028	49.949	67.014	482.391
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	182.417.393	43.425.124	14.166.286	141.794.543
Avoir en banque	2(a)	2.479.979	4.016.692	2.126.373	2.607.784
Dus par le courtier	15	77.111	1.221.004	1.339.229	4.619.894
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	376.765	—	17.413	1.067.898
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	1.733	5.541.272	214.509	2.381.782
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	465.669	51.797	—	852
Plus-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	21.934	315.921	291.134	—
Opérations de change à terme en cours	2(d)	6.792	422.869	677.589	40.440
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	1.768.437	259.379	1.283.795
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	—	—	194.591	—
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	—	—	—	—
Autres éléments de l'actif	2(a)	2.352	339.924	—	—
Total des actifs		185.849.728	57.103.040	19.286.503	153.796.988
Passif					
Sommes dues à la banque	2(a)	581.923	10.231	—	—
Dus au courtier	15	7	327.835	273.368	162
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	8	88.183	4.765	64.335
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	—	5.179.006	164.676	4.038.743
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	—	16.078	—	—
Distribution de revenu payable	2(a),11	—	—	—	—
Moins-value non réalisée sur :					
Contrats à terme	2(d)	—	129.061	157.590	1.353.294
Opérations de change à terme en cours	2(d)	126	54.796	416.768	2.882.108
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	—	1.886.998	325.119	3.283.101
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
Swaps à la valeur de marché	2(d)	—	—	1.497	—
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	—	—	—	—
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	2(a),4,5,6,7,8	200.348	1.545.196	244.192	211.312
Total du passif		782.412	9.237.384	1.587.975	11.833.055
Total de l'actif net		185.067.316	47.865.656	17.698.528	141.963.933

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	687.136.883	937.142.511	1.240.896.160
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation en AUD	AUD	170,72	207,03	193,21
Action de Catégorie A de capitalisation en EUR	EUR	90,95	103,78	100,78
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	120,10	125,53	125,05
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	131,19	136,43	132,72
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	117,77	123,55	123,33
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	GBP	146,85	175,23	167,39
Action de Catégorie D de capitalisation	USD	113,03	116,95	113,21
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	98,68	103,32	102,97
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	122,08	127,47	126,74
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	108,83	112,83	110,81
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	94,29	99,43	99,76
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	99,92	104,03	103,04
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	9.650,34	10.001,49	9.901,72
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	SEK	92,79	96,24	95,14
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	107,53	110,94	107,08
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	160,83	164,27	156,99
BlackRock Asia Extension Fund⁽¹⁾				
Total de l'actif net	USD	—	139.118.351	146.921.082
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	—	130,59	140,35
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	—	119,80	133,10
Action de Catégorie E de capitalisation	USD	—	125,64	135,70
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	—	129,51	136,75
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	34.677.165	30.464.640	27.168.138
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	EUR	104,61	92,79	93,12
Action de Catégorie A de capitalisation en EUR	EUR	104,88	101,49	99,22
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	GBP	100,65	101,81	97,96
Action de Catégorie D de capitalisation	USD	117,65	103,93	101,45
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	EUR	108,33	104,66	101,66
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	107,49	95,06	94,93
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	GBP	110,23	97,58	96,50
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	102,93	99,77	98,05
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	103,96	92,26	93,09
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	127,23	108,88	104,93
Action de Catégorie Z de capitalisation	USD	118,98	104,24	101,50
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	CHF	106,88	94,23	94,24
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	EUR	108,20	95,52	95,15
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	35.205.475	26.406.843	23.413.208
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	123,43	104,08	102,16
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	113,58	96,16	96,45
Action de Catégorie D de capitalisation	USD	125,48	105,78	103,31
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	114,79	96,90	96,71
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	111,15	94,68	95,40
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	136,78	110,29	106,37
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	EUR	118,53	99,38	98,68
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	128,61	107,15	104,24
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	121,72	101,46	99,72

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.229.637.507	1.034.442.870	941.468.821
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	132,13	118,63	115,96
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	134,68	120,70	117,97
Action de Catégorie AI de capitalisation	EUR	111,17	99,81	—
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	140,87	125,59	121,93
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	126,17	113,84	111,85
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	144,61	128,63	124,61
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	CAD	134,25	118,58	112,99
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	11.674,51	10.348,04	10.000,51
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	SEK	144,84	128,76	124,71
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	114,40	100,92	—
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	153,24	135,55	130,59
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	GBP	820.997.763	633.318.122	190.609.615
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	119,18	108,27	100,86
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH ⁽³⁾	CNH	1.074,29	—	—
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	122,72	111,34	102,99
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	123,18	110,86	101,05
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	121,46	109,28	100,96
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	122,40	110,92	102,76
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	123,91	111,94	103,10
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	126,42	113,34	103,69
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	129,54	116,00	104,86
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	119,14	106,51	—
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	CHF	123,47	111,60	103,16
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	127,60	114,10	104,08
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	124,74	112,40	103,34
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	130,89	116,94	105,37
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	127,08	113,66	103,72
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	137,34	119,14	105,72
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	CHF	124,83	112,30	103,35
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	129,23	115,11	104,58
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	126,27	113,26	103,66
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	132,40	117,81	105,59
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	12.621.637	14.513.860	34.564.157
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	92,27	85,25	110,63
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	100,11	91,79	117,37
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	88,46	82,05	107,09
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	96,65	88,78	114,60
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	107,80	98,42	125,31
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	96,40	89,07	115,69
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	85,29	79,52	104,32
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	GBP	107,04	111,75	138,99
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	82,87	75,99	—
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	EUR	125,32	124,77	157,75
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	101,01	91,46	118,46
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	94,97	86,39	109,61
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	108,38	97,57	122,61

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund				
Total de l'actif net	USD	905.434.827	585.619.249	614.966.478
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	210,52	148,70	181,95
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	101,30	72,45	91,08
Action de Catégorie D de distribution	USD	110,47	78,17	95,52
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	102,57	72,97	91,13
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	182,71	129,96	161,91
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	202,27	142,15	173,07
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR	EUR	176,48	136,16	165,26
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	GBP	120,60	97,28	116,26
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	166,98	130,10	159,43
Action de Catégorie I de capitalisation	USD	117,77	82,54	100,20
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	EUR	106,48	81,91	99,09
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	233,11	161,71	194,37
Action de Catégorie Z de capitalisation en GBP	GBP	127,95	102,56	121,78
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	224,34	156,72	189,66
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	1.532.287.129	1.581.561.191	2.816.904.920
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	85,81	85,60	89,19
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	120,50	114,76	112,08
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	107,00	103,00	102,90
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	93,20	89,50	90,21
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	92,83	89,38	89,55
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	101,48	97,66	—
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	93,57	93,54	98,60
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR	EUR	87,64	96,17	100,15
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	86,04	86,93	90,85
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	GBP	87,40	100,04	100,07
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	85,19	84,91	88,91
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	128,37	121,33	117,61
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	95,40	91,36	90,89
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	114,75	109,62	109,07
Action de Catégorie E de capitalisation	USD	115,89	110,93	108,89
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	104,40	101,00	101,43
Action de Catégorie I de distribution en EUR	EUR	83,93	92,17	95,12
Action de Catégorie I de distribution couverte en EUR	EUR	85,06	85,63	89,49
Action de Catégorie I de distribution (G) couverte en EUR	EUR	79,97	80,83	86,24
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	79,95	79,63	88,37
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	100,28	95,61	94,66
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	127,33	120,13	116,25
Action de Catégorie X de distribution en EUR	EUR	85,05	93,30	95,38
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	139,82	130,92	125,75
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	AUD	118,31	111,17	109,27
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CAD	CAD	103,79	97,43	94,72

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	77.615.734	69.623.667	69.720.601
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	118,60	104,93	105,43
Action de Catégorie AI de distribution couverte en EUR	EUR	99,46	93,16	—
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	108,36	96,86	—
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	120,04	105,84	106,00
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	110,95	98,89	101,43
Action de Catégorie E de distribution en EUR	EUR	104,67	106,49	112,01
Action de Catégorie E de distribution couverte en EUR	EUR	95,66	89,59	96,78
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	117,58	114,75	115,53
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	107,77	96,89	100,16
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	111,23	99,06	101,50
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	122,04	107,08	106,71
BlackRock ESG Euro Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	642.499.599	423.582.725	134.380.021
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	104,01	103,56	100,95
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	104,09	103,63	101,01
Action de Catégorie AI de capitalisation	EUR	103,36	102,93	—
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	105,81	104,98	101,97
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	101,62	101,70	99,62
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	106,54	105,55	102,38
Action de Catégorie X de distribution (G) ⁽³⁾	EUR	98,94	—	—
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	108,50	107,07	103,44
Action de Catégorie Z de capitalisation	EUR	107,98	106,81	103,45
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	271.817.140	182.474.888	—
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	102,60	98,43	—
Action de Catégorie AI de capitalisation	EUR	101,65	97,51	—
Action de Catégorie D de distribution ⁽³⁾	EUR	99,69	—	—
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	103,40	98,80	—
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	100,67	97,09	—
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	103,69	98,93	—
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	104,47	99,28	—
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund⁽⁴⁾				
Total de l'actif net	EUR	238.040.560	—	—
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	99,62	—	—
Action de Catégorie AI de capitalisation	EUR	99,62	—	—
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	99,72	—	—
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	99,50	—	—
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	99,74	—	—
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	99,85	—	—
Action de Catégorie Z de capitalisation	EUR	99,81	—	—

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock European Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.528.371.943	1.263.445.114	1.712.365.331
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	143,48	141,59	135,67
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	143,52	141,64	135,73
Action de Catégorie D de distribution	EUR	147,83	145,45	138,79
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	145,16	143,54	137,57
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	150,41	147,85	141,09
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	159,38	156,14	147,50
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD ⁽³⁾	USD	98,03	—	—
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	136,71	135,47	130,35
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	153,57	150,59	143,35
Action de Catégorie S de capitalisation	EUR	106,81	105,03	—
Action de Catégorie X de capitalisation ⁽³⁾	EUR	97,32	—	—
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund⁽¹⁾				
Total de l'actif net	EUR	—	3.682.260	43.682.999
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	—	95,44	104,03
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	—	91,96	100,57
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	—	97,84	106,54
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	—	99,94	108,97
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	—	72,78	78,74
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	—	106,97	113,88
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	—	98,59	106,88
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	—	107,54	114,78
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	—	91,63	100,33
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	—	103,15	111,45
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	—	124,54	132,57
BlackRock European Opportunities Extension Fund				
Total de l'actif net	EUR	660.042.096	827.548.340	976.232.401
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	GBP	452,57	335,26	315,20
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	530,04	375,58	358,68
Action de Catégorie D de distribution (G)	EUR	193,51	137,68	131,74
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	GBP	465,61	343,60	321,74
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	548,87	387,37	368,46
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	505,90	359,94	344,92
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	291,50	205,25	194,77
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	346,17	237,37	218,69
BlackRock European Select Strategies Fund				
Total de l'actif net	EUR	485.703.169	524.910.242	534.364.061
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	112,38	105,42	104,54
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	113,59	106,32	105,43
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CZK	CZK	1.116,18	1.041,02	1.022,14
Action de Catégorie AI de capitalisation	EUR	104,40	97,72	—
Action de Catégorie D de distribution couverte en USD	USD	122,89	114,19	111,49
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	117,60	109,42	107,86
Action de Catégorie E de distribution	EUR	110,14	103,61	103,28
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	110,36	103,82	103,46
Action de Catégorie I de distribution	EUR	110,57	103,82	102,88
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	114,61	106,43	104,71
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	123,00	113,57	111,09

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock European Unconstrained Equity Fund				
Total de l'actif net	EUR	46.793.755	23.685.016	6.048.155
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	167,90	133,88	117,75
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	169,88	134,70	117,98
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	169,82	134,11	118,16
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	163,63	130,95	115,84
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	129,64	102,01	—
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	170,39	135,17	118,01
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	171,44	134,63	118,19
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	184,49	144,91	120,87
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund				
Total de l'actif net	EUR	385.400.409	134.136.086	—
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	103,33	98,63	—
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	103,33	98,63	—
Action de Catégorie AI de capitalisation	EUR	102,49	97,84	—
Action de Catégorie D de distribution	EUR	104,19	99,06	—
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	104,13	99,01	—
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	102,28	98,12	—
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	104,55	99,21	—
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	105,78	99,77	—
BlackRock Fixed Income Strategies Fund				
Total de l'actif net	EUR	5.676.286.758	6.110.615.059	7.468.536.607
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	108,25	103,80	103,67
Action de Catégorie A de distribution couverte en CHF	CHF	104,12	100,07	100,36
Action de Catégorie A de distribution couverte en USD	USD	119,73	113,77	111,17
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	104,42	100,38	100,67
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	JPY	10.484,10	10.012,68	10.011,78
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	120,15	114,18	111,57
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	124,33	119,18	119,02
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	109,80	104,59	103,72
Action de Catégorie AI de capitalisation	EUR	103,48	99,23	—
Action de Catégorie D de distribution	EUR	107,43	102,86	102,59
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	112,72	107,27	106,33
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	118,37	112,21	109,44
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	106,55	102,05	101,95
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	122,38	115,83	112,73
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	130,08	124,27	123,61
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	115,29	109,40	107,93
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	117,47	113,23	113,65
Action de Catégorie I de distribution	EUR	126,97	121,52	121,21
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	131,21	125,08	124,19
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	SEK	—	—	1.046,06
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	112,29	106,08	103,06
Action de Catégorie X de distribution	EUR	105,35	100,85	100,57
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	140,37	133,00	131,26

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	159.454.244	135.075.502	403.117.483
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	105,63	100,01	101,15
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	1.033,93	976,61	986,30
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	115,06	107,93	106,30
Action de Catégorie D de distribution couverte en GBP ⁽³⁾	GBP	99,85	—	—
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	110,33	103,91	104,56
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	103,08	96,83	97,61
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	101,15	96,21	97,78
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	106,78	100,37	100,81
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	GBP	107,15	100,12	99,98
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	SEK	1.064,15	997,97	1.000,48
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	118,12	110,47	110,41
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	70.551.611	22.443.888	20.798.321
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	EUR	117,04	99,47	101,20
Action de Catégorie D de capitalisation	USD	123,66	103,99	102,88
Action de Catégorie D de capitalisation EUR de fonds	EUR	116,29	107,26	105,74
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	113,65	105,79	105,38
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	EUR	112,64	103,47	101,62
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	132,41	106,39	103,92
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD ⁽³⁾	AUD	101,74	—	—
Action de Catégorie Z de capitalisation	USD	125,79	104,52	103,16
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	CHF	119,48	100,36	101,52
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	EUR	120,23	100,87	101,66
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	122,21	102,19	102,12

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Global Event Driven Fund				
Total de l'actif net	USD	6.020.440.310	3.349.256.567	2.222.743.667
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	EUR	112,56	103,29	101,25
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	132,75	120,60	115,82
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	117,34	107,77	106,38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	1.100,63	998,17	—
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	109,91	99,84	—
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	117,25	107,49	105,36
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	108,86	99,58	—
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP ⁽³⁾	GBP	107,41	—	—
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	119,78	109,57	107,38
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	135,72	122,77	117,45
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	120,69	110,19	107,55
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	124,81	113,39	109,84
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	122,12	122,27	117,50
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	117,60	108,27	106,56
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	126,67	114,31	109,01
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	117,61	107,09	104,79
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	120,37	109,09	105,43
Action de Catégorie I de capitalisation en BRL	BRL	87,34	74,95	—
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	11.717,71	10.621,44	10.350,96
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	125,40	113,16	107,93
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	115,46	105,35	103,13
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	122,71	111,76	108,83
Action de Catégorie IA de capitalisation	USD	119,73	108,48	103,25
Action de Catégorie IA de capitalisation couverte en EUR	EUR	108,98	99,81	—
Action de Catégorie S de capitalisation	USD	111,01	100,04	—
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	109,63	99,79	—
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	155,50	136,10	127,82
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	CHF	126,22	114,32	111,30
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	141,69	127,06	120,81
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	128,65	116,33	112,86
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	133,95	120,64	116,22
BlackRock Global Real Asset Securities Fund				
Total de l'actif net	USD	315.221.465	96.029.475	5.560.181
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	103,02	85,60	—
Action de Catégorie A de distribution couverte en HKD de fonds déclarant au Royaume-Uni	HKD	103,65	86,81	—
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	100,71	84,20	—
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	SGD	102,79	86,32	—
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	138,79	105,27	106,96
Action de Catégorie D de distribution	USD	104,42	86,68	—
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	141,69	106,82	107,91
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	133,11	111,39	113,34
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	145,98	109,12	109,29
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	143,19	107,62	108,39

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Macro Opportunities Fund⁽¹⁾				
Total de l'actif net	USD	—	38.089.075	159.152.959
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	—	98,12	98,12
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	—	96,77	—
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	EUR	—	103,02	102,05
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	—	99,63	99,10
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	—	96,53	98,06
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	—	95,94	96,75
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	—	107,41	107,53
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	—	90,79	93,55
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	USD	—	74,03	99,64
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	EUR	—	104,61	103,47
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	—	101,56	100,18
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en BRL	USD	—	63,00	84,73
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	CHF	—	92,50	94,23
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	—	99,96	99,17
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	—	93,36	94,77
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	—	95,47	96,26
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative				
Total de l'actif net	EUR	101.728.225	155.738.897	139.371.110
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	109,60	98,80	98,24
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	110,07	99,06	98,41
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	117,47	104,89	102,32
Action de Catégorie D de distribution	EUR	109,64	98,83	98,43
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	112,43	100,54	99,25
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	119,95	106,42	103,18
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	114,57	101,91	100,60
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	104,37	94,40	—
Action de Catégorie I de capitalisation ⁽³⁾	EUR	108,52	—	—
Action de Catégorie IndexInvest Balance de distribution	EUR	109,59	98,80	98,25
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Moderat de distribution - Ausgewogen	EUR	114,96	103,60	103,04
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive				
Total de l'actif net	EUR	159.169.033	202.971.849	139.233.055
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	108,56	103,36	103,16
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	109,40	103,54	102,71
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	124,34	117,42	114,60
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	111,29	105,97	105,28
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	104,48	99,47	99,41
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	109,10	103,23	103,01
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	121,27	114,53	112,39
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	107,93	102,45	101,58
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	129,22	121,25	117,46
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	115,80	109,56	108,17
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	116,14	109,22	107,57
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	100,09	95,77	—
Action de Catégorie I de capitalisation ⁽³⁾	EUR	103,78	—	—
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	116,83	109,56	106,15
Action de Catégorie IndexInvest Substanz de distribution	EUR	103,81	98,84	98,65
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Defensiv de distribution	EUR	108,51	103,30	103,12
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	114,30	107,63	105,82

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth				
Total de l'actif net	EUR	369.847.480	278.497.988	211.502.093
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	149,81	120,00	115,69
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	129,34	103,16	100,01
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	175,88	139,89	132,97
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	146,15	117,07	112,86
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	143,57	114,36	109,60
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	166,75	131,95	124,63
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	146,72	116,31	112,01
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	140,39	112,05	107,63
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	180,77	142,88	135,05
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	161,92	128,88	123,48
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	147,21	116,68	112,36
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	117,26	94,40	—
Action de Catégorie I de capitalisation ⁽³⁾	EUR	119,98	—	—
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	142,33	112,30	106,05
Action de Catégorie IndexInvest Chance de distribution	EUR	123,70	99,08	95,52
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Wachstum de distribution	EUR	134,75	107,33	102,83
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	148,53	117,67	112,25
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate				
Total de l'actif net	EUR	695.253.941	695.725.488	550.633.567
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	EUR	128,60	112,26	111,44
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	117,12	101,71	101,27
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	148,70	128,81	125,54
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	126,98	110,85	110,05
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	121,75	106,12	105,36
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	126,10	109,18	108,19
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	142,14	122,94	120,15
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	122,47	106,55	105,42
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	153,50	132,11	127,94
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	137,10	118,93	117,33
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	129,60	111,86	110,66
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	106,41	93,35	—
Action de Catégorie I de distribution	EUR	118,21	103,04	102,26
Action de Catégorie I de capitalisation ⁽³⁾	EUR	112,59	—	—
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	127,30	109,47	106,27
Action de Catégorie IndexInvest Wachstum de distribution	EUR	111,92	97,70	96,99
Action de Catégorie IndexInvest Wachstum de distribution couverte en CHF	CHF	121,30	106,20	105,74
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Ausgewogende de distribution	EUR	119,18	103,90	103,11
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	129,70	111,99	109,97
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	GBP	124,83	107,26	105,59
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD	USD	128,93	110,47	106,85

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Style Advantage Fund				
Total de l'actif net	USD	176.150.611	2.150.166.004	3.245.426.903
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution	USD	83,40	86,16	106,29
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	EUR	75,62	78,78	99,40
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	82,07	84,79	104,62
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	66,82	69,57	87,87
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	68,74	71,25	89,53
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	68,93	71,55	89,83
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	EUR	77,56	87,23	106,55
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	85,52	87,73	107,43
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	77,10	79,82	100,01
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	74,14	76,20	94,37
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	73,07	83,25	102,91
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	72,91	76,34	96,82
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en CHF	CHF	71,19	73,69	92,11
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en EUR	EUR	78,66	81,13	101,38
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	USD	52,21	50,61	83,34
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	CHF	69,47	71,90	90,29
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	76,09	77,97	95,35
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	77,84	80,42	100,61
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	74,20	76,24	94,73
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en JPY	JPY	7.918,17	8.162,20	10.175,36
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	89,48	91,12	110,60
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD ⁽⁵⁾	AUD	89,80	91,81	111,75
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	73,46	75,30	93,42
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	NZD	90,03	91,00	110,98
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	87,26	86,47	106,63
Action de Catégorie Z de capitalisation	USD	86,16	88,28	107,92
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	EUR	77,84	80,39	100,55
BlackRock Style Advantage Screened Fund				
Total de l'actif net	USD	27.052.932	27.998.224	25.907.945
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	87,98	91,86	102,74
Action de Catégorie D de capitalisation	USD	89,35	92,73	103,10
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	84,77	88,73	101,23
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	GBP	86,64	90,11	101,87
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	82,01	94,49	105,82
Action de Catégorie I de capitalisation	USD	89,82	93,05	103,25
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	EUR	84,74	96,34	106,46
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	85,26	89,05	101,38
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	GBP	87,09	90,40	102,01
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	91,10	93,88	103,59
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	AUD	85,43	88,17	—
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	358.338.671	220.697.286	186.266.828
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	196,28	137,96	128,84
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	EUR	183,58	141,09	130,80
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	184,88	143,36	134,07
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	174,96	123,47	116,58
Action de Catégorie I de capitalisation en JPY	JPY	19.441,15	13.336,58	12.536,81
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	19.668,58	13.794,26	13.076,90
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	GBP	228,82	182,81	165,92

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 mai 2021 suite

	Devise	31 mai 2021	31 mai 2020	31 mai 2019
BlackRock Systematic Global Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	185.067.316	161.584.844	288.073.809
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	190,08	134,52	130,44
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	EUR	181,53	140,40	135,23
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	172,55	134,71	130,82
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	167,05	119,92	118,56
Action de Catégorie I de capitalisation	USD	164,06	115,34	111,14
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	EUR	180,05	138,98	133,45
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	148,44	103,94	99,76
Action de Catégorie X de capitalisation en EUR	EUR	145,19	111,64	106,77
Action de Catégorie X de capitalisation en GBP	GBP	222,06	178,42	167,99
Action de Catégorie X de capitalisation en JPY	JPY	14.023,59	9.634,73	9.353,57
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	USD	47.865.656	72.200.396	103.685.956
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	USD	112,00	108,48	112,23
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	96,86	94,73	100,48
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	977,04	952,17	1.008,03
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	97,77	95,56	—
Action de Catégorie C de capitalisation	USD	100,72	98,53	102,95
Action de Catégorie D de capitalisation	USD	111,63	107,46	110,52
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	104,72	101,81	107,35
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	108,11	104,55	109,26
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	96,96	95,30	101,60
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	99,27	96,22	—
Action de Catégorie J de distribution	USD	116,76	112,41	115,62
Action de Catégorie X de capitalisation	USD	129,52	122,84	124,47
BlackRock Total Advantage Fund				
Total de l'actif net	EUR	17.698.528	30.967.819	34.507.624
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation	EUR	90,75	85,02	96,69
Action de Catégorie D de capitalisation	EUR	92,52	86,20	97,48
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	99,11	91,61	101,48
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	94,66	87,65	99,00
Action de Catégorie E de capitalisation	EUR	94,53	88,55	100,70
Action de Catégorie I de capitalisation	EUR	93,16	86,61	97,75
Action de Catégorie X de capitalisation	EUR	94,90	87,75	98,55
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	GBP	141.963.933	153.650.726	71.743.502
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	EUR	100,23	101,42	101,66
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	101,00	102,14	102,32
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	105,23	105,70	105,05
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	102,60	103,28	103,10
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	EUR	109,30	104,28	105,22
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	103,76	104,21	104,29
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	110,80	110,36	107,62
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	108,60	108,32	107,00
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	EUR	101,57	98,15	99,92
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	98,06	99,69	100,41
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	101,33	101,60	100,98
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	10.637,96	10.616,54	10.557,09
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	108,08	107,41	104,53
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	115,40	113,89	111,25

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Nouvelle Catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

⁽⁴⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ VL par action à la valorisation Close, voir point 2 de l'Annexe pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021

	Note	BlackRock Strategic Funds combinés USD	BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund USD	BlackRock Asia Extension Fund ⁽¹⁾ USD	BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund USD
Actif net au début de l'exercice		23.869.517.648	937.142.511	139.118.351	30.464.640
Revenus					
Intérêt bancaire	2(c)	2.980.635	583.855	24.169	130
Intérêts obligataires	2(c)	234.823.795	2.147.022	44.622	4.437
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	401.478	1.486	—	423
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	68.546.712	19.228	—	—
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	78.674.029	—	—	431.484
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	144.152.284	40.310.706	25.552	10.095
Prêts de titres	2(c)	2.470.418	—	—	3.832
Remise sur la commission de gestion	4	3.826.833	—	—	—
Autre revenu		721.746	—	—	5.199
Total des revenus		536.597.930	43.062.297	94.343	455.600
Frais					
Intérêt bancaire	2(c)	6.772.100	9.311	10.922	720
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	51.001.847	13.412.933	—	206.588
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	74.925.476	22.550	—	—
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	9.067.591	—	—	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	142.352.234	54.245.222	—	481.272
Frais de gestion annuels	5	35.480.532	1.520.868	3.861	39.689
Commissions du Dépositaire	2(i),6	10.312.904	2.542.426	10.313	10.944
Fiscalité	8	15.854.109	273.307	—	7.186
Commissions de performance	7	126.266.113	128	—	109.871
Commissions de distribution	4	7.237.994	43.914	13	10.942
Commissions d'engagement de prêt	14	30.026	766	—	61
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	205.364.774	9.981.045	174	89.231
Autres frais		298.295	—	—	110
Total des dépenses avant remboursement		684.963.995	82.052.470	25.283	956.614
Remboursement des dépenses	4	3.392.333	—	—	—
Total des dépenses après remboursement		681.571.662	82.052.470	25.283	956.614
Revenu/(déficit) net de l'investissement		(144.973.732)	(38.990.173)	69.060	(501.014)
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:					
Placements	2(a),2(b)	1.237.642.526	6.771.133	96.588	8.284.430
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	774.431	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	(17.691.031)	(8.515.291)	(1.085)	(5.007.131)
Contrats à terme	2(d)	(115.384.887)	—	11.863.494	(2.527.659)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	584.475.870	43.363.572	155	815.742
Opérations de swap	2(d)	(44.627.803)	(1.931.327)	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	(18.112.784)	—	—	—
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		1.627.076.322	39.688.087	11.959.152	1.565.382
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:					
Placements	2(a)	1.130.578.393	1.026.305	—	4.793.983
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	81.337	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	18.500.698	(4.083.704)	61.743	(842.313)
Contrats à terme	2(d)	14.837.335	—	(1.113.079)	(42.541)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	(83.713.676)	(8.053.157)	2.386	8.791
Opérations de swap	2(d)	29.486.472	1.353.800	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	(2.827.297)	—	—	—
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		1.106.943.262	(9.756.756)	(1.048.950)	3.917.920
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		2.589.045.852	(9.058.842)	10.979.262	4.982.288
Mouvements du capital social					
Encaissement net sur l'émission d'actions		11.520.377.413	379.340.076	—	1.140.213
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(12.131.245.022)	(620.286.862)	(150.097.613)	(1.909.976)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(610.867.609)	(240.946.786)	(150.097.613)	(769.763)
Dividendes déclarés	11	(21.029.724)	—	—	—
Ajustement de change	2(f)	1.486.007.339	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		27.312.673.506	687.136.883	—	34.677.165

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund USD	BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund EUR	BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ⁽²⁾ GBP	BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund USD
Actif net au début de l'exercice		26.406.843	1.034.442.870	633.318.122	14.513.860
Revenus					
Intérêt bancaire	2(c)	17.485	—	151.906	—
Intérêts obligataires	2(c)	56.802	1.167.265	623.721	3.791
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	—	—	36.002	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	1.340.848	—	—
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	—	5.829.111	318.491	155.867
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	2.507.565	—	9.546.676	73.930
Prêts de titres	2(c)	—	77.864	17.237	1.632
Remise sur la commission de gestion	4	—	232.243	—	—
Autre revenu		6.655	—	15.692	76.949
Total des revenus		2.588.507	8.647.331	10.709.725	312.169
Frais					
Intérêt bancaire	2(c)	3.815	203.871	69.860	1.458
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	946.214	—	2.854.094	74.563
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	610.480	2.004.495	—	—
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	—	115.063	—	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	1.652.635	—	7.824.394	168.105
Frais de gestion annuels	5	42.412	1.079.096	1.268.469	24.522
Commissions du Dépositaire	2(i),6	288.985	101.699	114.328	2.633
Fiscalité	8	7.679	172.648	225.966	4.110
Commissions de performance	7	318.418	—	14.949.521	—
Commissions de distribution	4	3.515	698.981	—	9.098
Commissions d'engagement de prêt	14	49	1.301	1.238	—
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	62.172	7.340.341	7.533.981	148.792
Autres frais		—	192.048	—	13.745
Total des dépenses avant remboursement		3.936.374	11.909.543	34.841.851	447.026
Remboursement des dépenses	4	258.185	—	227	—
Total des dépenses après remboursement		3.678.189	11.909.543	34.841.624	447.026
Revenu/(déficit) net de l'investissement		(1.089.682)	(3.262.212)	(24.131.899)	(134.857)
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:					
Placements	2(a),2(b)	534	43.477.922	28.840.371	903.808
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	17.441.687	—	134.710.318	(3.510.155)
Contrats à terme	2(d)	—	(34.933.387)	(63.618.868)	(372.703)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	1.150.421	2.349.737	(25.834.420)	449.187
Opérations de swap	2(d)	(10.035.362)	34.982.176	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	(40.584)	—	—
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		8.557.280	45.835.864	74.097.401	(2.529.863)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:					
Placements	2(a)	—	68.905.724	5.276.422	3.489.741
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	(1.399.781)	—	7.624.802	578.711
Contrats à terme	2(d)	—	18.333.840	(5.410.299)	30.413
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	211.220	(1.823.407)	(13.799.075)	(63.009)
Opérations de swap	2(d)	1.279.713	(5.920.988)	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	957.003	—	—
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		91.152	80.452.172	(6.308.150)	4.035.856
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		7.558.750	123.025.824	43.657.352	1.371.136
Mouvements du capital social					
Encaissement net sur l'émission d'actions		2.915.723	296.062.775	369.232.214	1.154.645
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(1.675.841)	(223.893.962)	(225.209.925)	(4.418.004)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		1.239.882	72.168.813	144.022.289	(3.263.359)
Dividendes déclarés	11	—	—	—	—
Ajustement de change	2(f)	—	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		35.205.475	1.229.637.507	820.997.763	12.621.637

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund USD	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund USD	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund USD	BlackRock ESG Euro Bond Fund EUR
Actif net au début de l'exercice		585.619.249	1.581.561.191	69.623.667	423.582.725
Revenus					
Intérêt bancaire	2(c)	11	38.157	11.784	3.762
Intérêts obligataires	2(c)	—	90.194.053	3.606.894	2.813.258
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	—	—	—	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	48.839.122	505.245	68.818
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	15.696.758	1.548.672	—	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	6.171.743	—	—	—
Prêts de titres	2(c)	210.229	222.348	19.408	30.516
Remise sur la commission de gestion	4	—	122.049	—	—
Autre revenu		14.863	—	28.290	—
Total des revenus		22.093.604	140.964.401	4.171.621	2.916.354
Frais					
Intérêt bancaire	2(c)	18.516	386.179	169	15.810
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	1.810.953	—	—	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	37.773.668	301.715	59.654
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	—	—	—	681.573
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	4.806.178	—	—	—
Frais de gestion annuels	5	1.621.757	957.075	37.533	485.929
Commissions du Dépositaire	2(i),6	162.489	377.440	6.183	125.215
Fiscalité	8	5.775.683	938.364	14.388	201.825
Commissions de performance	7	—	—	—	—
Commissions de distribution	4	239.022	191.081	14.739	152.038
Commissions d'engagement de prêt	14	300	1.142	348	1.002
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	7.456.051	3.619.925	183.365	1.179.832
Autres frais		—	—	—	—
Total des dépenses avant remboursement		21.890.949	44.244.874	558.440	2.902.878
Remboursement des dépenses	4	—	—	—	—
Total des dépenses après remboursement		21.890.949	44.244.874	558.440	2.902.878
Revenu/(déficit) net de l'investissement		202.655	96.719.527	3.613.181	13.476
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:					
Placements	2(a),2(b)	32.589.122	90.612.841	721.408	4.410.194
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	(24.745.296)	—	—	—
Contrats à terme	2(d)	(2.938.417)	(29.610.651)	510.006	1.958.286
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	(4.218.008)	133.275.489	3.548.664	(59.377)
Opérations de swap	2(d)	—	(132.024.851)	(815.483)	240.498
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	(15.759.385)	—	34.323
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		687.401	46.493.443	3.964.595	6.583.924
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:					
Placements	2(a)	227.273.154	78.776.429	5.288.325	(5.100.176)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	7.176.546	—	—	—
Contrats à terme	2(d)	128.535	(822.946)	31.637	176.327
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	(576.470)	(12.666.335)	(854.544)	(72.806)
Opérations de swap	2(d)	—	22.949.942	247.823	(473.753)
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	(11.451)	(11.460)	(34.073)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		234.001.765	88.225.639	4.701.781	(5.504.481)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		234.891.821	231.438.609	12.279.557	1.092.919
Mouvements du capital social					
Encaissement net sur l'émission d'actions		538.422.300	37.522.138	13.774.040	331.519.427
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(453.498.503)	(312.752.542)	(18.040.937)	(113.695.437)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		84.923.797	(275.230.404)	(4.266.897)	217.823.990
Dividendes déclarés	11	(40)	(5.482.267)	(20.593)	(35)
Ajustement de change	2(f)	—	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		905.434.827	1.532.287.129	77.615.734	642.499.599

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund ⁽³⁾	BlackRock European Absolute Return Fund	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾
		EUR	EUR	EUR	EUR
Actif net au début de l'exercice		182.474.888	—	1.263.445.114	3.682.260
Revenus					
Intérêt bancaire	2(c)	22.700	—	—	—
Intérêts obligataires	2(c)	2.347.044	97.265	2.079	—
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	—	—	519	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	154.961	819	—	—
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	—	—	5.926.367	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	—	—	6.432.430	—
Prêts de titres	2(c)	8.681	—	86.593	—
Remise sur la commission de gestion	4	—	—	—	—
Autre revenu		—	—	10.236	—
Total des revenus		2.533.386	98.084	12.458.224	0
Frais					
Intérêt bancaire	2(c)	28.718	1.248	179.232	165
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	—	—	8.931.541	209
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	179.210	3.050	—	—
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	—	223.399	6.221.722	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	—	—	17.887.020	—
Frais de gestion annuels	5	129.588	49.716	3.828.011	121
Commissions du Dépositaire	2(i),6	68.174	15.791	223.566	66
Fiscalité	8	176.075	22.036	683.927	—
Commissions de performance	7	—	—	4.580.919	—
Commissions de distribution	4	18.382	6	171.135	91
Commissions d'engagement de prêt	14	330	—	1.557	—
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	833.574	124.483	23.938.304	585
Autres frais		—	—	6.604	—
Total des dépenses avant remboursement		1.434.051	439.729	66.653.538	1.237
Remboursement des dépenses	4	166.151	49.739	—	26
Total des dépenses après remboursement		1.267.900	389.990	66.653.538	1.211
Revenu/(déficit) net de l'investissement		1.265.486	(291.906)	(54.195.314)	(1.211)
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:					
Placements	2(a),2(b)	1.793.330	(18.149)	112.871.291	(772)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	—	—	(166.654.247)	4.370
Contrats à terme	2(d)	1.520.826	146.773	—	—
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	(134.287)	40.127	5.780.222	753
Opérations de swap	2(d)	226.261	(260)	(5.454)	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	31.009	9.483	—	—
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		3.437.139	177.974	(48.008.188)	4.351
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:					
Placements	2(a)	5.271.101	(358.866)	80.438.786	111
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	—	—	22.061.513	4.053
Contrats à terme	2(d)	(63.273)	104.343	—	—
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	6.124	(13.776)	(1.750.758)	5.553
Opérations de swap	2(d)	(217.637)	(123.842)	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	(23.720)	(175)	—	—
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		4.972.595	(392.316)	100.749.541	9.717
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		9.675.220	(506.248)	(1.453.961)	12.857
Mouvements du capital social					
Encaissement net sur l'émission d'actions		108.899.430	240.287.706	1.903.091.006	—
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(29.232.398)	(1.740.898)	(1.636.710.216)	(3.695.117)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		79.667.032	238.546.808	266.380.790	(3.695.117)
Dividendes déclarés	11	—	—	—	—
Ajustement de change	2(f)	—	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		271.817.140	238.040.560	1.528.371.943	—

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock European Opportunities Extension Fund EUR	BlackRock European Select Strategies Fund EUR	BlackRock European Unconstrained Equity Fund EUR	BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund EUR
Actif net au début de l'exercice		827.548.340	524.910.242	23.685.016	134.136.086
Revenus					
Intérêt bancaire	2(c)	—	88.714	—	971
Intérêts obligataires	2(c)	1.135	3.460.362	—	3.229.718
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	81.711	—	—	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	153.744	—	273.056
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	7.219.670	6.271.239	447.991	65.741
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	5.340.943	—	—	—
Prêts de titres	2(c)	106.434	53.727	2.192	15.911
Remise sur la commission de gestion	4	—	26.508	—	11.987
Autre revenu		34.604	—	—	—
Total des revenus		12.784.497	10.054.294	450.183	3.597.384
Frais					
Intérêt bancaire	2(c)	21.915	51.822	550	172.173
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	3.472.819	57.896	—	3.339
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	337.057	—	672.732
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	218.114	—	—	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	3.718.203	251.201	—	48.750
Frais de gestion annuels	5	2.240.020	649.605	45.662	162.711
Commissions du Dépositaire	2(i),6	52.574	132.037	9.194	64.423
Fiscalité	8	374.418	171.955	8.955	37.053
Commissions de performance	7	11.159.904	—	23.177	—
Commissions de distribution	4	401.319	968.851	8.027	29.153
Commissions d'engagement de prêt	14	384	631	46	364
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	10.139.664	4.915.799	90.897	108.695
Autres frais		16.718	901	—	—
Total des dépenses avant remboursement		31.816.052	7.537.755	186.508	1.299.393
Remboursement des dépenses	4	—	—	—	—
Total des dépenses après remboursement		31.816.052	7.537.755	186.508	1.299.393
Revenu/(déficit) net de l'investissement		(19.031.555)	2.516.539	263.675	2.297.991
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:					
Placements	2(a),2(b)	225.375.448	21.905.084	838.342	3.940.690
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	13.891.394	(4.160.978)	—	(204.495)
Contrats à terme	2(d)	—	3.559.444	—	6.345.284
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	2.945.999	(570.488)	(203.098)	(373.631)
Opérations de swap	2(d)	(1.277)	(337.310)	—	(775.842)
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	(2.889.905)	—	(1.656.458)
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		242.211.564	17.505.847	635.244	7.275.548
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:					
Placements	2(a)	57.488.713	19.504.613	7.285.414	3.815.373
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	(13.535.743)	235.617	—	9.962
Contrats à terme	2(d)	—	276.551	—	76.391
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	3.738.046	(3.587.197)	67.193	(178.926)
Opérations de swap	2(d)	—	523.073	—	13.393
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	(78.997)	—	(22.610)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		47.691.016	16.873.660	7.352.607	3.713.583
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		270.871.025	36.896.046	8.251.526	13.287.122
Mouvements du capital social					
Encaissement net sur l'émission d'actions		6.159.353	138.418.809	20.505.476	288.309.208
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(443.882.151)	(214.494.842)	(5.648.263)	(50.332.007)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(437.722.798)	(76.076.033)	14.857.213	237.977.201
Dividendes déclarés	11	(654.471)	(27.086)	—	—
Ajustement de change	2(f)	—	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		660.042.096	485.703.169	46.793.755	385.400.409

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock Fixed Income Strategies Fund EUR	BlackRock Global Absolute Return Bond Fund EUR	BlackRock Global Equity Absolute Return Fund USD	BlackRock Global Event Driven Fund USD
Actif net au début de l'exercice		6.110.615.059	135.075.502	22.443.888	3.349.256.567
Revenus					
Intérêt bancaire	2(c)	51.307	133.446	—	1.668.445
Intérêts obligataires	2(c)	74.484.310	4.769.788	—	24.279.645
Intérêts sur contrats for difference	2(c),2(d)	—	64	205	216.604
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	7.925.866	1.718.391	—	4.915.201
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	925.596	20.892	339.408	3.936.148
Dividendes des contrats for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	—	1.721	116.103	39.300.341
Prêts de titres	2(c)	265.374	8.591	—	680.124
Remise sur la commission de gestion	4	225.554	10.477	—	—
Autre revenu		419.230	—	1.596	—
Total des revenus		84.297.237	6.663.370	457.312	74.996.508
Frais					
Intérêt bancaire	2(c)	3.721.466	147.944	3.596	34.253
Intérêts sur contrats for difference	2(c),2(d)	—	41	83.725	8.057.476
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	14.278.110	1.890.327	—	13.014.133
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	—	—	—	—
Dividendes des contrats for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	—	—	360.581	18.689.668
Frais de gestion annuels	5	8.109.604	96.214	20.772	7.190.980
Commissions du Dépositaire	2(i),6	1.025.147	565.970	4.112	418.256
Fiscalité	8	3.307.886	41.799	4.354	1.345.267
Commissions de performance	7	—	—	46.909	87.035.955
Commissions de distribution	4	2.278.066	2.732	1.034	954.850
Commissions d'engagement de prêt	14	5.001	61	46	6.314
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	42.354.240	524.024	13.382	47.558.094
Autres frais		698	—	—	—
Total des dépenses avant remboursement		75.080.218	3.269.112	538.511	184.305.246
Remboursement des dépenses	4	—	427.621	24	—
Total des dépenses après remboursement		75.080.218	2.841.491	538.487	184.305.246
Revenu/(déficit) net de l'investissement		9.217.019	3.821.879	(81.175)	(109.308.738)
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur :					
Placements	2(a),2(b)	180.225.911	1.392.384	6.286.647	145.870.301
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	652.772	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	—	20.462	(1.482.994)	97.878.824
Contrats à terme	2(d)	97.252.646	1.728.870	(5.067.785)	(27.520.118)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	(55.560.116)	409.663	(351.953)	313.938.148
Opérations de swap	2(d)	(9.360.759)	(412.678)	—	29.206.477
Contrats d'options/swaptions	2(d)	4.787.277	709.130	—	—
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		217.344.959	4.500.603	(616.085)	559.373.632
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur :					
Placements	2(a)	36.784.420	867.939	5.803.586	317.621.083
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	68.559	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	—	(1.428)	140.337	5.801.217
Contrats à terme	2(d)	295.983	145.101	401.504	(25.340.213)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	(22.569.790)	(96.613)	128.138	11.836.756
Opérations de swap	2(d)	9.312.830	105.380	—	(7.344.173)
Contrats d'options/swaptions	2(d)	(3.004.496)	(925.941)	—	—
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		20.818.947	162.997	6.473.565	302.574.670
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		247.380.925	8.485.479	5.776.305	752.639.564
Mouvements du capital social					
Encaissement net sur l'émission d'actions		1.553.414.737	68.543.546	42.533.436	3.164.026.305
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(2.232.056.092)	(52.650.272)	(202.018)	(1.245.482.126)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(678.641.355)	15.893.274	42.331.418	1.918.544.179
Dividendes déclarés	11	(3.067.871)	(11)	—	—
Ajustement de change	2(f)	—	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		5.676.286.758	159.454.244	70.551.611	6.020.440.310

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock Global Real Asset Securities Fund USD	BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾ USD	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative EUR	BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive EUR
Actif net au début de l'exercice		96.029.475	38.089.075	155.738.897	202.971.849
Revenus					
Intérêt bancaire	2(c)	—	5.034	—	—
Intérêts obligataires	2(c)	—	22.949	—	—
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	—	—	—	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	50.359	—	—
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	5.805.496	2.463	1.604.114	1.807.025
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	1.179	—	—	—
Prêts de titres	2(c)	32.117	33	28.265	52.091
Remise sur la commission de gestion	4	—	—	276.423	360.344
Autre revenu		—	3.335	—	1.534
Total des revenus		5.838.792	84.173	1.908.802	2.220.994
Frais					
Intérêt bancaire	2(c)	21.205	1.434	7.135	5.644
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	138	—	—	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	19.939	—	—
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	—	—	—	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	—	—	—	—
Frais de gestion annuels	5	340.996	10.175	83.535	113.433
Commissions du Dépositaire	2(i),6	43.014	7.972	22.542	22.670
Fiscalité	8	80.626	935	65.649	86.832
Commissions de performance	7	—	—	—	—
Commissions de distribution	4	3.710	391	26	36
Commissions d'engagement de prêt	14	384	560	760	413
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	1.023.050	33.418	1.123.554	1.336.307
Autres frais		—	3.848	—	—
Total des dépenses avant remboursement		1.513.123	78.672	1.303.201	1.565.335
Remboursement des dépenses	4	—	—	—	—
Total des dépenses après remboursement		1.513.123	78.672	1.303.201	1.565.335
Revenu/(déficit) net de l'investissement		4.325.669	5.501	605.601	655.659
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:					
Placements	2(a),2(b)	13.479.317	231.385	6.803.583	1.869.967
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	(227)	—	—	—
Contrats à terme	2(d)	17.262	162.176	—	—
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	4.090.077	723.177	5.086.902	498.255
Opérations de swap	2(d)	—	(24.747)	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	(3.139.720)	(112.408)	—	—
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		14.446.709	979.583	11.890.485	2.368.222
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:					
Placements	2(a)	28.378.918	(356.977)	1.030.800	(443.576)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	3.876	—	—	—
Contrats à terme	2(d)	—	(34.869)	—	—
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	49.615	247.839	(220.890)	1.293.278
Opérations de swap	2(d)	—	26.287	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	960.513	(77.896)	—	—
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		29.392.922	(195.616)	809.910	849.702
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		48.165.300	789.468	13.305.996	3.873.583
Mouvements du capital social					
Encaissement net sur l'émission d'actions		202.423.281	118.596	15.969.436	42.804.202
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(21.369.932)	(38.997.139)	(83.137.055)	(90.266.447)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		181.053.349	(38.878.543)	(67.167.619)	(47.462.245)
Dividendes déclarés	11	(10.026.659)	—	(149.049)	(214.154)
Ajustement de change	2(f)	—	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		315.221.465	—	101.728.225	159.169.033

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock Managed Index Portfolios – Growth EUR	BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate EUR	BlackRock Style Advantage Fund USD
Actif net au début de l'exercice		278.497.988	695.725.488	2.150.166.004
Revenus				
Intérêt bancaire	2(c)	—	—	14.194
Intérêts obligataires	2(c)	—	—	3.720.014
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	—	—	35.715
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	—	375.886
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	1.073.704	5.522.122	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	—	—	21.156.332
Prêts de titres	2(c)	158.154	119.085	—
Remise sur la commission de gestion	4	653.753	1.325.510	—
Autre revenu		—	—	—
Total des revenus		1.885.611	6.966.717	25.302.141
Frais				
Intérêt bancaire	2(c)	8.296	11.662	641.001
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	—	—	6.472.457
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	—	122.550
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	—	—	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	—	—	21.166.966
Frais de gestion annuels	5	192.891	382.942	455.300
Commissions du Dépositaire	2(i),6	44.211	82.768	637.429
Fiscalité	8	164.547	306.152	66.972
Commissions de performance	7	—	—	—
Commissions de distribution	4	345	305	3.125
Commissions d'engagement de prêt	14	366	1.043	1.730
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	2.535.251	4.739.803	1.861.029
Autres frais		—	—	—
Total des dépenses avant remboursement		2.945.907	5.524.675	31.428.559
Remboursement des dépenses	4	—	—	—
Total des dépenses après remboursement		2.945.907	5.524.675	31.428.559
Revenu/(déficit) net de l'investissement		(1.060.296)	1.442.042	(6.126.418)
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:				
Placements	2(a),2(b)	31.732.675	29.659.157	1.840.542
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	—	—	(89.258.511)
Contrats à terme	2(d)	—	—	(65.503.041)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	2.823.718	17.190.799	153.213.696
Opérations de swap	2(d)	—	—	39.702.418
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	—	—
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		34.556.393	46.849.956	39.995.104
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	32.954.665	32.303.540	(1.094.930)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	—	—	(5.165.707)
Contrats à terme	2(d)	—	—	25.494.397
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	1.189.619	3.877.690	(26.468.905)
Opérations de swap	2(d)	—	—	6.827.999
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	—	—
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		34.144.284	36.181.230	(407.146)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		67.640.381	84.473.228	33.461.540
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		136.383.739	193.853.563	14.633.315
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(112.649.975)	(278.299.551)	(2.022.110.248)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		23.733.764	(84.445.988)	(2.007.476.933)
Dividendes déclarés	11	(24.653)	(498.787)	—
Ajustement de change	2(f)	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		369.847.480	695.253.941	176.150.611

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock Style Advantage Screened Fund USD	BlackRock Systematic ESG World Equity Fund USD	BlackRock Systematic Global Equity Fund USD
Actif net au début de l'exercice		27.998.224	220.697.286	161.584.844
Revenus				
Intérêt bancaire	2(c)	6.271	9	—
Intérêts obligataires	2(c)	21.806	—	—
Intérêts sur contrats for difference	2(c),2(d)	170	—	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	36.544	—	—
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	—	4.202.656	2.540.607
Dividendes des contrats for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	535.589	—	—
Prêts de titres	2(c)	—	52.531	22.807
Remise sur la commission de gestion	4	—	—	—
Autre revenu		—	—	5.268
Total des revenus		600.380	4.255.196	2.568.682
Frais				
Intérêt bancaire	2(c)	25.272	3.032	2.599
Intérêts sur contrats for difference	2(c),2(d)	147.404	—	—
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	15.595	—	—
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	79.824	—	—
Dividendes des contrats for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	499.921	—	—
Frais de gestion annuels	5	13.980	196.658	96.285
Commissions du Dépositaire	2(i),6	300.495	82.379	48.447
Fiscalité	8	2.841	56.871	19.600
Commissions de performance	7	—	—	—
Commissions de distribution	4	143	74.894	8.666
Commissions d'engagement de prêt	14	58	355	—
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	579	407.630	503.784
Autres frais		—	449	2.049
Total des dépenses avant remboursement		1.086.112	822.268	681.430
Remboursement des dépenses	4	297.770	—	—
Total des dépenses après remboursement		788.342	822.268	681.430
Revenu/(déficit) net de l'investissement		(187.962)	3.432.928	1.887.252
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur :				
Placements	2(a),2(b)	3.749	54.591.682	45.717.740
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	(734.304)	—	—
Contrats à terme	2(d)	(874.618)	1.015.185	513.134
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	986.874	4.230.312	2.889.313
Opérations de swap	2(d)	325.626	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	—	—
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		(292.673)	59.837.179	49.120.187
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur :				
Placements	2(a)	368.606	33.647.803	13.680.903
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	(27.115)	—	—
Contrats à terme	2(d)	90.671	(136.840)	(86.212)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	(194.726)	(37.944)	6.857
Opérations de swap	2(d)	181.075	—	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	—	—	—
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		418.511	33.473.019	13.601.548
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(62.124)	96.743.126	64.608.987
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		678.770	101.287.922	72.555.690
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(1.561.938)	(60.389.663)	(113.682.205)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(883.168)	40.898.259	(41.126.515)
Dividendes déclarés	11	—	—	—
Ajustement de change	2(f)	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		27.052.932	358.338.671	185.067.316

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Note	BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund ⁽²⁾ USD	BlackRock Total Advantage Fund EUR	BlackRock UK Equity Absolute Return Fund GBP
Actif net au début de l'exercice		72.200.396	30.967.819	153.650.726
Revenus				
Intérêt bancaire	2(c)	—	—	38.524
Intérêts obligataires	2(c)	57.681	66.061	124.085
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	902	209	39
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	10	—
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	—	—	25.478
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	1.231.944	270.640	4.257.560
Prêts de titres	2(c)	—	—	—
Remise sur la commission de gestion	4	—	—	—
Autre revenu		—	—	4.700
Total des revenus		1.290.527	336.920	4.450.386
Frais				
Intérêt bancaire	2(c)	51.182	22.955	4.644
Intérêts sur contracts for difference	2(c),2(d)	455.781	74.138	485.603
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	—	134	—
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	—	115.972	—
Dividendes des contracts for difference, après déduction des retenues à la source	2(c),2(d)	1.585.054	265.176	1.463.869
Frais de gestion annuels	5	160.796	12.692	75.588
Commissions du Dépositaire	2(i),6	1.857.387	256.824	16.737
Fiscalité	8	25.739	2.293	14.370
Commissions de performance	7	—	—	78.012
Commissions de distribution	4	65.682	1.090	750
Commissions d'engagement de prêt	14	20	184	219
Commissions de gestion et commissions des Sous-gestionnaires financiers par délégation	4	869.333	1.349	1.002.057
Autres frais		23	17.433	—
Total des dépenses avant remboursement		5.070.997	770.240	3.141.849
Remboursement des dépenses	4	1.782.246	244.378	305
Total des dépenses après remboursement		3.288.751	525.862	3.141.544
Revenu/(déficit) net de l'investissement		(1.998.224)	(188.942)	1.308.842
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:				
Placements	2(a),2(b)	2.144	357.081	210.865
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	1.354.770	(797.955)	4.841.361
Contrats à terme	2(d)	1.310.935	485.370	(3.061.238)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	5.540.427	(231.813)	(15.707.536)
Opérations de swap	2(d)	—	1.551.598	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	(268.992)	—	—
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		7.939.284	1.364.281	(13.716.548)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	49.949	(2.307)	408.090
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	—	—	—
« Contracts for difference »	2(d)	(114.671)	(15.086)	(3.143.224)
Contrats à terme	2(d)	463.274	(4.120)	36.704
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d),2(e),2(j)	(1.006.360)	393.957	(3.333.463)
Opérations de swap	2(d)	—	122.376	—
Contrats d'options/swaptions	2(d)	30.001	—	—
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		(577.807)	494.820	(6.031.893)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		5.363.253	1.670.159	(18.439.599)
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		42.898.119	101.071	53.889.956
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(72.596.112)	(15.040.521)	(47.137.150)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(29.697.993)	(14.939.450)	6.752.806
Dividendes déclarés	11	—	—	—
Ajustement de change	2(f)	—	—	—
Actif net à la clôture de l'exercice		47.865.656	17.698.528	141.963.933

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation en AUD	149	—	—	149
Action de Catégorie A de capitalisation en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1.881.101	1.742.676	2.068.879	1.554.898
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	353.261	60.755	196.445	217.571
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1.968.095	785.108	1.277.945	1.475.258
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	9.256	397	9.193	460
Action de Catégorie D de capitalisation	428.222	157.566	338.405	247.383
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	19.529	716	15.841	4.404
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	473.060	240.170	326.200	387.030
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	865	—	719	146
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	109.970	1.630	58.352	53.248
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	356.609	470.480	453.925	373.164
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	2.557.822	922.019	1.503.239	1.976.602
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	1.047.661	308.410	5.195	1.350.876
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.395.570	346.382	976.896	765.056
Action de Catégorie X de capitalisation	94.160	22.194	24.372	91.982
BlackRock Asia Extension Fund⁽¹⁾				
Action de Catégorie A de capitalisation	1.223	—	1.223	—
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	32	—	32	—
Action de Catégorie E de capitalisation	368	—	368	—
Action de Catégorie X de capitalisation	1.072.533	—	1.072.533	—
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	44	—	—	44
Action de Catégorie A de capitalisation en EUR	1.355	50	49	1.356
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	41	—	—	41
Action de Catégorie D de capitalisation	3.057	—	—	3.057
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	1.614	3.327	1.093	3.848
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	18.131	613	4.615	14.129
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	45	5.160	344	4.861
Action de Catégorie X de capitalisation	199.650	—	—	199.650
Action de Catégorie Z de capitalisation	46.232	—	1.700	44.532
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	11.958	—	8.720	3.238
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	339	—	—	339
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	100	—	—	100
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	94	—	—	94
Action de Catégorie D de capitalisation	100	4.073	17	4.156
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	47	—	—	47
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	5.323	3.353	1.337	7.339
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	159.941	969	4.730	156.180
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	94	—	—	94
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	4.655	3.937	—	8.592
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	61.132	9.244	5.577	64.799
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	440.243	24.907	18.241	446.909
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1.651.747	48.919	224.366	1.476.300
Action de Catégorie AI de capitalisation	166.126	568.942	201.703	533.365
Action de Catégorie D de capitalisation	35.311	18.754	458	53.607
Action de Catégorie E de capitalisation	1.203.764	656.104	656.289	1.203.579
Action de Catégorie I de capitalisation	5.218.212	923.586	796.106	5.345.692
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	68	—	—	68
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	381.375	125	—	381.500
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	164.076	—	160.253	3.823
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	50	—	—	50
Action de Catégorie X de capitalisation	729.959	139.574	48.231	821.302

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund⁽²⁾				
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	8.375	2.664	300	10.739
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH ⁽³⁾	—	33	—	33
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	11.006	16.774	11.342	16.438
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	9.568	178.299	11.996	175.871
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	42.782	86.305	5.938	123.149
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	22.166	33.580	1.075	54.671
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	290.178	252.702	77.498	465.382
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	691.315	564.862	212.404	1.043.773
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	182.388	101.065	47.829	235.624
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	80.844	180.697	21.613	239.928
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	193.345	44.559	64.822	173.082
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	54.851	26.576	14.708	66.719
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	2.923.631	943.799	971.713	2.895.717
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	464.928	584.293	448.214	601.007
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	642.444	378.671	98.474	922.641
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	45	—	—	45
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	140.499	—	29.310	111.189
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	121.859	4.688	13.858	112.689
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	188.719	—	94.815	93.904
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	70.005	—	3.250	66.755
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	36	146	—	182
Action de Catégorie A de capitalisation	14.525	4.105	7.490	11.140
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	26.796	77	2.581	24.292
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	121	13	91	43
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	22.817	3.116	11.306	14.627
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	10.906	100	10.899	107
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	26.675	2.643	12.937	16.381
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	33	—	—	33
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	39	—	—	39
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	53	8	26	35
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1	—	—	1
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	56.057	—	—	56.057
Action de Catégorie X de capitalisation	1.804	1.844	1.611	2.037
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	987.189	726.783	796.078	917.894
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	5.597	584	712	5.469
Action de Catégorie D de distribution	170	—	120	50
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	70.464	10.927	52.236	29.155
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	280.403	129.522	243.625	166.300
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	782.725	273.815	572.161	484.379
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR	229.948	51.661	158.357	123.252
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	104.593	147.921	26.932	225.582
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	339.924	84.165	174.788	249.301
Action de Catégorie I de capitalisation	616.502	2.677.359	472.207	2.821.654
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	495.123	60.953	171.422	384.654
Action de Catégorie X de capitalisation	109.075	11.814	98.119	22.770
Action de Catégorie Z de capitalisation en GBP	1.935	—	177	1.758
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	452.100	—	142.841	309.259

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	5.539	—	5.141	398
Action de Catégorie A de capitalisation	74.385	6.697	28.391	52.691
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	30.065	14.276	7.410	36.931
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	10.185	9.077	13.257	6.005
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	51	—	—	51
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	108.531	18.231	51.648	75.114
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR	41	—	—	41
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	14.352	7.500	3.500	18.352
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	47.187	552	24.276	23.463
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	123.959	16.854	82.627	58.186
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	65.843	1.826	20.242	47.427
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	2.051	—	1.150	901
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	171.480	58.595	140.621	89.454
Action de Catégorie E de capitalisation	56.258	5.478	20.963	40.773
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	300.441	11.880	90.933	221.388
Action de Catégorie I de distribution en EUR	125.214	—	85.421	39.793
Action de Catégorie I de distribution couverte en EUR	336.779	19.135	126.081	229.833
Action de Catégorie I de distribution (G) couverte en EUR	754.111	36.334	594.402	196.043
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	50	480	—	530
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	159.867	866	159.823	910
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.083.378	104.199	69.192	2.118.385
Action de Catégorie X de distribution en EUR	44	—	—	44
Action de Catégorie X de capitalisation	2.992.260	1.321	1.048.111	1.945.470
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	7.184.515	—	—	7.184.515
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CAD	2.370.126	—	—	2.370.126
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	50	3.453	—	3.503
Action de Catégorie AI de distribution couverte en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.037	50.729	19	51.747
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3.317	24.392	2.900	24.809
Action de Catégorie E de distribution en EUR	1.238	2.510	—	3.748
Action de Catégorie E de distribution couverte en EUR	1.107	8.639	154	9.592
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	17.562	8.134	5.547	20.149
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	128	3.006	566	2.568
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	362.043	10.000	134.000	238.043
Action de Catégorie X de capitalisation	249.750	—	—	249.750
BlackRock ESG Euro Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution	38.368	227.199	57.739	207.828
Action de Catégorie A de capitalisation	13.208	85.848	50.802	48.254
Action de Catégorie AI de capitalisation	47	—	—	47
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	125.130	172.691	43.617	254.204
Action de Catégorie E de capitalisation	98.079	394.953	89.945	403.087
Action de Catégorie I de capitalisation	785.646	1.224.944	309.962	1.700.628
Action de Catégorie X de distribution (G) ⁽³⁾	—	5.171	—	5.171
Action de Catégorie X de capitalisation	1.648.084	918.694	153.808	2.412.970
Action de Catégorie Z de capitalisation	1.270.851	40.945	343.922	967.874
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	44	2	—	46
Action de Catégorie AI de capitalisation	44	3.145	—	3.189
Action de Catégorie D de distribution ⁽³⁾	—	41	—	41
Action de Catégorie D de capitalisation	44	84.857	41.548	43.353
Action de Catégorie E de capitalisation	6.201	58.938	10.675	54.464
Action de Catégorie I de capitalisation	1.511.450	738.360	180.294	2.069.516
Action de Catégorie X de capitalisation	325.711	171.715	48.116	449.310

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund⁽⁴⁾				
Action de Catégorie A de capitalisation	—	34.333	—	34.333
Action de Catégorie AI de capitalisation	—	42	—	42
Action de Catégorie D de capitalisation	—	42	—	42
Action de Catégorie E de capitalisation	—	42	—	42
Action de Catégorie I de capitalisation	—	933.064	—	933.064
Action de Catégorie X de capitalisation	—	717.720	17.373	700.347
Action de Catégorie Z de capitalisation	—	717.552	50	717.502
BlackRock European Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de distribution	99.976	76.958	37.020	139.914
Action de Catégorie A de capitalisation	4.215.762	3.679.070	4.471.302	3.423.530
Action de Catégorie D de distribution	13.666	104.553	40.420	77.799
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	53.861	174.636	31.192	197.305
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.365.001	1.787.600	1.604.376	1.548.225
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.482	38.634	3.908	36.208
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD ⁽³⁾	—	169.686	34.148	135.538
Action de Catégorie E de capitalisation	190.308	112.608	60.030	242.886
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.756.533	6.323.966	4.721.722	4.358.777
Action de Catégorie S de capitalisation	45	129.443	40.894	88.594
Action de Catégorie X de capitalisation ⁽³⁾	—	176.195	2.652	173.543
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund⁽⁴⁾				
Action de Catégorie A de capitalisation	7.646	—	7.646	—
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	71	—	71	—
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	89.890	—	89.890	—
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	882	—	882	—
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1	—	1	—
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	296	—	296	—
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3.293	—	3.293	—
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1	—	1	—
Action de Catégorie E de capitalisation	18.093	—	18.093	—
Action de Catégorie I de capitalisation	1	—	1	—
Action de Catégorie X de capitalisation	1	—	1	—
BlackRock European Opportunities Extension Fund				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	5.414	—	456	4.958
Action de Catégorie A de capitalisation	797.384	539	407.910	390.013
Action de Catégorie D de distribution (G)	473.339	3	324	473.018
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	21.905	—	9.033	12.872
Action de Catégorie D de capitalisation	712.190	11.793	356.667	367.316
Action de Catégorie E de capitalisation	207.042	19	34.946	172.115
Action de Catégorie I de capitalisation	497.485	—	279.558	217.927
Action de Catégorie X de capitalisation	37	—	—	37
BlackRock European Select Strategies Fund				
Action de Catégorie A de distribution	78.623	16.181	31.920	62.884
Action de Catégorie A de capitalisation	212.866	41.127	70.861	183.132
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CZK	42.367	—	5.917	36.450
Action de Catégorie AI de capitalisation	87.075	69.973	54.595	102.453
Action de Catégorie D de distribution couverte en USD	4.987	—	—	4.987
Action de Catégorie D de capitalisation	126.331	75.368	51.685	150.014
Action de Catégorie E de distribution	786.905	35.906	369.938	452.873
Action de Catégorie E de capitalisation	1.341.231	127.047	585.430	882.848
Action de Catégorie I de distribution	291.244	147	284.930	6.461
Action de Catégorie I de capitalisation	2.052.792	886.462	501.752	2.437.502
Action de Catégorie X de capitalisation	43	—	—	43

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock European Unconstrained Equity Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	285	341	164	462
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	31.906	77.197	22.178	86.925
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	5.835	7.160	2.378	10.617
Action de Catégorie E de capitalisation	9.395	5.024	3.717	10.702
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	24.869	14.545	14.178	25.236
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	80	19.403	30	19.453
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	105	9	69	45
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	103.114	16.675	—	119.789
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund				
Action de Catégorie A de distribution	50	—	—	50
Action de Catégorie A de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie AI de capitalisation	5.955	104.348	17.103	93.200
Action de Catégorie D de distribution	50	—	—	50
Action de Catégorie D de capitalisation	50	1.000	—	1.050
Action de Catégorie E de capitalisation	62.191	12.726	22.949	51.968
Action de Catégorie I de capitalisation	2.013	—	—	2.013
Action de Catégorie X de capitalisation	1.275.272	2.665.811	441.291	3.499.792
BlackRock Fixed Income Strategies Fund				
Action de Catégorie A de distribution	3.165.236	258.333	779.801	2.643.768
Action de Catégorie A de distribution couverte en CHF	92.604	7.238	8.926	90.916
Action de Catégorie A de distribution couverte en USD	20.752	2.035	4.625	18.162
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	889.659	28.606	146.732	771.533
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	4.874	—	—	4.874
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	419.119	192.146	148.681	462.584
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	14.043.583	4.203.686	6.178.746	12.068.523
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	37.664	8.413	3.171	42.906
Action de Catégorie AI de capitalisation	4.060	8.733	3.387	9.406
Action de Catégorie D de distribution	1.977.379	213.103	820.677	1.369.805
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	46.244	35.083	68.964	12.363
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	2.962	9.200	140	12.022
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	469.937	68.338	87.112	451.163
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	423.030	100.689	177.634	346.085
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	6.131.504	1.882.857	2.317.381	5.696.980
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	15.471	8.363	6.020	17.814
Action de Catégorie E de capitalisation	4.488.643	275.462	1.422.754	3.341.351
Action de Catégorie I de distribution	1.743.731	62.234	255.063	1.550.902
Action de Catégorie I de capitalisation	12.448.493	4.545.321	4.079.423	12.914.391
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	1.602.771	326.905	1.182.653	747.023
Action de Catégorie X de distribution	1.487.937	—	—	1.487.937
Action de Catégorie X de capitalisation	2.435.859	195.143	691.127	1.939.875
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	4.978	180.396	126.871	58.503
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	8.505	27	3.509	5.023
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1.619	3.756	742	4.633
Action de Catégorie D de distribution couverte en GBP ⁽³⁾	—	36	—	36
Action de Catégorie D de capitalisation	100.407	17.143	24.969	92.581
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	2	—	—	2
Action de Catégorie E de capitalisation	5.222	2.751	1.079	6.894
Action de Catégorie I de capitalisation	708.017	75.807	27.875	755.949
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	30.300	—	6.768	23.532
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	24.677	8.583	14.403	18.857
Action de Catégorie X de capitalisation	415.678	331.068	274.553	472.193

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	44	—	—	44
Action de Catégorie D de capitalisation	50	1.400	200	1.250
Action de Catégorie D de capitalisation EUR de fonds	44	—	—	44
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	622	1.835	—	2.457
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	45	1.410	1.410	45
Action de Catégorie X de capitalisation	199.700	187.785	—	387.485
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD ⁽³⁾	—	196.927	—	196.927
Action de Catégorie Z de capitalisation	2.874	—	—	2.874
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	49	4.674	—	4.723
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	44	—	—	44
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	6.293	6.586	—	12.879
BlackRock Global Event Driven Fund				
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	2.869	19.784	2.150	20.503
Action de Catégorie A de capitalisation	437.114	979.405	111.696	1.304.823
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	54.308	32.638	19.573	67.373
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	39	—	—	39
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	70	30.081	—	30.151
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	5.358.688	3.509.786	2.344.856	6.523.618
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP ⁽³⁾	—	5.121	—	5.121
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	224.571	92.863	18.739	298.695
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.477.636	1.466.690	510.356	2.433.970
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1.518.314	1.306.207	710.440	2.114.081
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.651.426	1.684.263	539.904	2.795.785
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	377.460	306.628	160.054	524.034
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	862.146	719.180	240.042	1.341.284
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	183.628	92.151	102.604	173.175
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	12.936	237.975	203	250.708
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3.377.112	1.753.159	748.578	4.381.693
Action de Catégorie I de capitalisation en BRL	42.571	1.168.000	1.900	1.208.671
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	1.506.560	291.086	1.053.181	744.465
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.735.190	2.459.420	463.042	3.731.568
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	182.984	23.670	63.079	143.575
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	6.901.497	6.447.234	1.991.866	11.356.865
Action de Catégorie IA de capitalisation	514.648	17.404	569	531.483
Action de Catégorie IA de capitalisation couverte en EUR	65.835	314.878	18.516	362.197
Action de Catégorie S de capitalisation	50	10.472	—	10.522
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	45	433.497	11.860	421.682
Action de Catégorie X de capitalisation	31.560	72.334	10.210	93.684
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	52.432	—	—	52.432
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	125.146	—	2.787	122.359
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	375.282	—	222.011	153.271
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	225.439	—	3.563	221.876
BlackRock Global Real Asset Securities Fund				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	48.880	850.866	44.192	855.554
Action de Catégorie A de distribution couverte en HKD de fonds déclarant au Royaume-Uni	15.353	96.789	—	112.142
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	45	34.667	1.201	33.511
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni SGD hedged	32.935	10.431	4.522	38.844
Action de Catégorie A de capitalisation	84.916	76.125	23.062	137.979
Action de Catégorie D de distribution	342.539	861.829	121.590	1.082.778
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	38.300	116.071	12.386	141.985
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	2.693	18.632	954	20.371
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	382.257	1.428	11	383.674
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	46.591	4.621	—	51.212

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Macro Opportunities Fund⁽¹⁾				
Action de Catégorie A de capitalisation	220	—	220	—
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	45	—	45	—
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	44	—	44	—
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	369	—	369	—
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	44	—	44	—
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	12.355	—	12.355	—
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	1.640	128	1.768	—
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	568	—	568	—
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	9.313	1.344	10.657	—
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	76.831	—	76.831	—
Action de Catégorie X de capitalisation	51	—	51	—
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en BRL	76.651	—	76.651	—
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	50	—	50	—
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	50	—	50	—
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	206.043	—	206.043	—
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3.716	—	3.716	—
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative				
Action de Catégorie A de distribution	9.989	1.553	3.769	7.773
Action de Catégorie A de capitalisation	16.280	14.205	9.986	20.499
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	3.228	2.052	1.102	4.178
Action de Catégorie D de distribution	23.225	3.622	11.403	15.444
Action de Catégorie D de capitalisation	216.003	86.878	264.563	38.318
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	294.785	3.312	176.315	121.782
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	7.381	3.903	6.794	4.490
Action de Catégorie E de capitalisation	45	39	—	84
Action de Catégorie I de capitalisation ⁽³⁾	—	3.808	16	3.792
Action de Catégorie IndexInvest Balance de distribution	1.009.808	30.702	317.625	722.885
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Moderat de distribution - Ausgewogen	45	—	—	45
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive				
Action de Catégorie A de distribution	416.346	73.726	194.458	295.614
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	12.198	4.113	4.646	11.665
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	199.151	42.151	104.949	136.353
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	106.123	25.533	28.144	103.512
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	170.700	31.260	91.200	110.760
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	5.805	484	2.867	3.422
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	131.326	61.751	20.961	172.116
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	12.664	8.050	4.348	16.366
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	411.276	51.165	204.999	257.442
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	88.496	46.946	99.610	35.832
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	60.744	30.776	17.927	73.593
Action de Catégorie E de capitalisation	45	99	—	144
Action de Catégorie I de capitalisation ⁽³⁾	—	3.338	—	3.338
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	50.902	10.752	4.826	56.828
Action de Catégorie IndexInvest Substanz de distribution	270.081	7.118	66.972	210.227
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Defensiv de distribution	2.365	2.280	—	4.645
Action de Catégorie X de capitalisation	50	—	—	50

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth				
Action de Catégorie A de distribution	579.933	212.608	140.366	652.175
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	8.175	4.483	2.995	9.663
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	161.010	31.316	42.474	149.852
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	181.439	142.252	34.124	289.567
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	212.310	155.244	63.091	304.463
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	18.633	22.996	11.821	29.808
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.523	318	42	2.799
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	13.053	5.112	4.022	14.143
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	203.255	38.777	114.825	127.207
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	144.194	163.166	128.950	178.410
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	75.290	139.938	19.525	195.703
Action de Catégorie E de capitalisation	154	1.356	—	1.510
Action de Catégorie I de capitalisation ⁽³⁾	—	5.485	—	5.485
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	153.028	22.478	150.255	25.251
Action de Catégorie IndexInvest Chance de distribution	667.496	46.402	165.989	547.909
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Wachstum de distribution	20.645	8.770	—	29.415
Action de Catégorie X de capitalisation	43	—	—	43
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate				
Action de Catégorie A de distribution	1.046.893	81.967	275.913	852.947
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	19.243	8.532	10.677	17.098
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	487.003	72.818	294.684	265.137
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	524.180	470.146	86.871	907.455
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	288.582	79.010	89.266	278.326
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	573	1.010	—	1.583
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	159.179	45.601	39.490	165.290
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	16.531	10.878	1.272	26.137
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	470.134	285.220	249.210	506.144
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	362.206	205.152	281.948	285.410
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	587.132	177.359	97.170	667.321
Action de Catégorie E de capitalisation	302	609	257	654
Action de Catégorie I de distribution	618.016	2.379	263.143	357.252
Action de Catégorie I de capitalisation ⁽³⁾	—	5.576	—	5.576
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	315.737	68.096	198.150	185.683
Action de Catégorie IndexInvest Wachstum de distribution	1.407.367	52.373	510.630	949.110
Action de Catégorie IndexInvest Wachstum de distribution couverte en CHF	17.978	3.002	5.122	15.858
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Ausgewogene de distribution	49.617	—	12.222	37.395
Action de Catégorie X de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	1.838	1.932	1.251	2.519
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD	2.231	8.592	219	10.604

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Style Advantage Fund				
Action de Catégorie A de distribution	152	360	49	463
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	1.857	216	304	1.769
Action de Catégorie A de capitalisation	8.637	2.220	5.998	4.859
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	129	—	84	45
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	440	—	—	440
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	5.369	—	—	5.369
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	46	—	—	46
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	54.270	13.114	55.907	11.477
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1.029.434	9.225	1.008.859	29.800
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3.718	317	1.355	2.680
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	6.901	3.607	6.944	3.564
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	3.165	207	1.497	1.875
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en CHF	276.538	—	276.488	50
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en EUR	15.129	137	12.665	2.601
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	50.186	—	50.136	50
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	48	—	—	48
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	853.113	4.300	390.376	467.037
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	2.104.362	32.452	1.991.189	145.625
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.677.619	26.950	1.543.371	161.198
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en JPY	1.862.526	—	726.593	1.135.933
Action de Catégorie X de capitalisation	571.186	346	570.873	659
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	17.141.879	97.839	16.891.579	348.139
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	42	—	—	42
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	841.786	—	841.784	2
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3.038.590	—	3.038.555	35
Action de Catégorie Z de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	79.409	—	79.363	46
BlackRock Style Advantage Screened Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie D de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	44	—	—	44
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	39	—	—	39
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	219	110	110	219
Action de Catégorie I de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	44	—	—	44
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	44	—	—	44
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	39	—	—	39
Action de Catégorie X de capitalisation	249.650	—	—	249.650
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	76.938	11.042	23.696	64.284
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	29.165	30.117	14.753	44.529
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	152.534	253.404	73.755	332.183
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	44.037	115.622	33.491	126.168
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	49	18.879	18.879	49
Action de Catégorie I de capitalisation en JPY	70.532	74.460	1.311	143.681
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	15.267	41.918	2.406	54.779
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	775.171	—	123.200	651.971

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2021 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Systematic Global Equity Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	53	1.565	—	1.618
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	1.426	50	334	1.142
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	5.948	5.394	2.501	8.841
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2.680	4.323	3.595	3.408
Action de Catégorie I de capitalisation	1.020.975	210.276	621.360	609.891
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	51.551	2.450	53.076	925
Action de Catégorie X de capitalisation	2.617	1.025	206	3.436
Action de Catégorie X de capitalisation en EUR	41	247.500	19.609	227.932
Action de Catégorie X de capitalisation en GBP	54.471	4.494	13.855	45.110
Action de Catégorie X de capitalisation en JPY	246.736	—	38.770	207.966
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund⁽²⁾				
Action de Catégorie A de capitalisation	48.096	3.713	13.262	38.547
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	134.935	—	92.120	42.815
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	584	377	372	589
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie C de capitalisation	1.148	—	110	1.038
Action de Catégorie D de capitalisation	42.701	8.199	43.578	7.322
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	246.772	59.127	157.456	148.443
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	4.506	1.670	2.517	3.659
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	113.255	299.017	310.099	102.173
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	11.085	1.485	3.676	8.894
Action de Catégorie J de distribution	44.414	—	11.918	32.496
Action de Catégorie X de capitalisation	10.633	2.482	5.425	7.690
BlackRock Total Advantage Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie D de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	60	—	—	60
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	45	—	—	45
Action de Catégorie E de capitalisation	2.866	1.096	1.407	2.555
Action de Catégorie I de capitalisation	50	—	—	50
Action de Catégorie X de capitalisation	349.750	—	166.051	183.699
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	49	—	—	49
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	45	—	—	45
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	39	—	—	39
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	49	—	—	49
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	49	—	—	49
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	153.097	2.227	152.647	2.677
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	50	—	—	50
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	999	—	432	567
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	311	262	—	573
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1.465	151	656	960
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	139.937	201.574	96.735	244.776
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	1.480.385	337.172	265.700	1.551.857
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	52.206	127.318	10.653	168.871
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	29.400	1.195	21.891	8.704

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Nouvelle Catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

⁽⁴⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché USD	% de l'actif net			Valeur de marché USD	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Îles Caïmans							
152.274	Apollo Strategic Growth Capital II (Unit)	1.522.740	0,22	USD 12.400.000	Bank of America NA 0,20% 1/12/2021	12.400.000	1,80
		1.522.740	0,22	USD 10.000.000	Bank of Montreal 0,27% 12/8/2021	10.000.000	1,45
États-Unis				USD 10.000.000	Bank of Nova Scotia 0,28% 24/11/2021	10.000.000	1,46
3.242	Alkami Technology Inc	107.861	0,02	USD 6.000.000	Bank of Nova Scotia 0,23% 4/5/2022	6.000.000	0,87
8.408	Bumble Inc 'A'	401.230	0,06	USD 7.000.000	BNP Paribas 0,22% 1/2/2022	7.000.000	1,02
17.358	DoubleVerify Holdings Inc	640.337	0,09	USD 4.500.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 0,24% 4/5/2022	4.500.000	0,65
2.773	Figs Inc 'A'	94.698	0,01	USD 7.000.000	DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss 0,14% 9/7/2021	7.000.000	1,02
5.016	Flywire Corp	172.249	0,03	USD 10.000.000	Mitsubishi Ufj Trust And Banking Corp 0,15% 16/8/2021	10.000.000	1,46
12.768	Ikena Oncology Inc	229.824	0,03	USD 15.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,22% 11/8/2021	15.000.000	2,18
17.663	Innovage Holding Corp	377.988	0,05	USD 10.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp 0,29% 18/6/2021	10.000.000	1,45
45.776	Inspired Entertainment Inc	524.593	0,08	USD 14.900.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0,23% 4/8/2021	14.900.000	2,17
9.413	Olo Inc 'A'	318.630	0,05	USD 8.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0,19% 6/7/2021	8.000.078	1,16
10.623	ON24 Inc	341.848	0,05	USD 3.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0,15% 11/8/2021	3.000.000	0,44
22.048	Paymentus Holdings Inc 'A'	672.464	0,10	USD 3.900.000	Swedbank AB 0,18% 8/9/2021	3.900.428	0,57
16.935	Privia Health Group Inc	554.282	0,08	USD 6.500.000	UBS AG 0,27% 11/3/2022	6.500.000	0,95
4.876	Procure Technologies Inc	421.384	0,06	USD 5.000.000	Westpac Banking Corp 0,24% 30/3/2022	5.000.000	0,73
8.231	Qualtrics International Inc 'A'	283.476	0,04				
7.172	Recursion Pharmaceuticals Inc 'A'	189.054	0,03				
7.795	UiPath Inc 'A'	622.197	0,09				
		5.952.115	0,87				
Total des actions ordinaires		7.474.855	1,09			133.200.506	19,38
OBLIGATIONS				Total des Certificats de dépôts			
États-Unis				BILLET DE TRÉSORERIE			
USD 24.450.000	United States Cash Management Bill 3/8/2021 (Zero Coupon)	24.449.022	3,56	USD 5.000.000	Australie ANZ New Zealand International Ltd FRN 8/11/2021	4.996.222	0,73
USD 15.000.000	United States Treasury Bill 10/6/2021 (Zero Coupon)	14.999.644	2,18	USD 1.100.000	Westpac Banking Corp 1/4/2022 (Zero Coupon)	1.097.864	0,16
USD 17.000.000	United States Treasury Bill 1/7/2021 (Zero Coupon)	16.998.725	2,47			6.094.086	0,89
USD 15.500.000	United States Treasury Bill 12/8/2021 (Zero Coupon)	15.499.709	2,26	Canada			
USD 15.000.000	United States Treasury Bill 26/8/2021 (Zero Coupon)	14.998.029	2,18	USD 4.200.000	Alberta 7/6/2021 (Zero Coupon)	4.199.902	0,61
USD 15.000.000	United States Treasury Bill 2/9/2021 (Zero Coupon)	14.998.954	2,18	USD 9.500.000	National Bank of Canada 1/7/2021 (Zero Coupon)	9.498.892	1,38
USD 5.000.000	United States Treasury Bill 27/1/2022 (Zero Coupon)	4.997.000	0,73	USD 2.000.000	National Bank of Canada FRN 14/3/2022	1.996.346	0,29
		106.941.083	15,56	USD 9.000.000	Ontario Teachers' Finance Trust FRN 14/9/2021	8.996.587	1,31
Total des obligations		106.941.083	15,56	USD 9.000.000	Toronto-Dominion Bank 16/6/2021 (Zero Coupon)	8.999.437	1,31
CERTIFICAT DE DÉPÔTS				USD 6.000.000	Toronto-Dominion Bank FRN 6/8/2021	5.998.350	0,87
Australie						39.689.514	5,77
USD 10.700.000	Westpac Banking Corp 0,39% 9/6/2021	10.700.000	1,56	France			
		10.700.000	1,56	USD 15.000.000	BPCE SA 1/7/2021 (Zero Coupon)	14.994.125	2,18
Japon						14.994.125	2,18
USD 2.000.000	The Norinchukin Bank FRN 13/8/2021	2.000.026	0,29	Allemagne			
		2.000.026	0,29	USD 10.000.000	Erste Abwicklungsanstalt 10/8/2021 (Zero Coupon)	9.997.083	1,45
Suisse						9.997.083	1,45
USD 5.000.000	Credit Suisse AG FRN 15/2/2022	5.000.000	0,73				
		5.000.000	0,73				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Irlande				États-Unis suite			
USD 7.000.000	Matchpoint Finance Plc FRN 12/10/2021	6.994.569	1,02	USD 945.000	Fairway Finance Co LLC 2/6/2021 (Zero Coupon)	944.997	0,14
		6.994.569	1,02	USD 6.000.000	Federation des Caisses Desjardins FRN 2/7/2021	5.999.251	0,87
Japon				USD 7.000.000	Federation Des Caisses Desjardins 3/6/2021 (Zero Coupon)	6.999.965	1,02
USD 6.050.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 9/8/2021 (Zero Coupon)	6.049.072	0,88	USD 11.500.000	FMS Wertmanagement 2/6/2021 (Zero Coupon)	11.499.954	1,67
		6.049.072	0,88	USD 2.800.000	ING US Funding LLC FRN 18/2/2022	2.795.924	0,41
Nouvelle-Zélande				USD 4.500.000	Ionic Capital II Trust 16/6/2021 (Zero Coupon)	4.499.662	0,65
USD 4.500.000	ASB Finance Ltd FRN 12/11/2021	4.496.105	0,66	USD 15.000.000	JP Morgan Securities LLC FRN 4/4/2022	14.969.300	2,18
USD 5.500.000	BNZ International Funding 9/6/2021 (Zero Coupon)	5.499.841	0,80	USD 10.000.000	La Fayette Asset Securitization LLC 16/6/2021 (Zero Coupon)	9.999.333	1,46
USD 10.000.000	BNZ International Funding FRN 1/11/2021	9.991.500	1,45	USD 10.000.000	La Fayette Asset Securitization LLC 8/7/2021 (Zero Coupon)	9.998.458	1,45
		19.987.446	2,91	USD 1.100.000	Lime Funding LLC 17/6/2021 (Zero Coupon)	1.099.917	0,16
Norvège				USD 15.000.000	Macquarie Bank Ltd FRN 7/6/2021	14.999.587	2,18
USD 7.500.000	DNB Bank ASA 15/7/2021 (Zero Coupon)	7.498.213	1,09	USD 5.000.000	Macquarie Bank Ltd 27/8/2021 (Zero Coupon)	4.997.946	0,73
		7.498.213	1,09	USD 8.000.000	Manhattan Asset Funding Co LLC 2/7/2021 (Zero Coupon)	7.999.311	1,16
Singapour				USD 8.000.000	Mont Blanc Capital Corp FRN 10/8/2021	7.997.356	1,16
USD 10.000.000	DBS Bank Ltd FRN 2/8/2021	9.997.244	1,46	USD 15.000.000	Old Line Funding LLC FRN 17/6/2021	14.999.033	2,18
USD 13.500.000	Oversea-Chinese Banking Corp 14/6/2021 (Zero Coupon)	13.499.220	1,96	USD 5.000.000	Ridgefield Funding Co LLC 7/6/2021 (Zero Coupon)	4.999.758	0,73
		23.496.464	3,42	USD 10.000.000	Societe Generale SA 2/6/2021 (Zero Coupon)	9.999.917	1,46
Espagne				USD 3.000.000	Societe Generale SA 20/7/2021 (Zero Coupon)	2.999.143	0,44
USD 6.500.000	Banco Santander SA FRN 10/8/2021	6.497.978	0,94	USD 15.000.000	Suncorp Metway Ltd 31/8/2021 (Zero Coupon)	14.992.796	2,18
		6.497.978	0,94	USD 5.000.000	Suncorp Metway Ltd FRN 7/9/2021	4.997.278	0,73
Suède						200.217.134	29,14
USD 7.400.000	Nordea Bank Abp FRN 8/11/2021	7.394.738	1,08	Total des billets de trésorerie		385.720.249	56,13
USD 5.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 26/7/2021 (Zero Coupon)	4.998.243	0,73	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		651.036.719	94,74
USD 1.500.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 7/9/2021 (Zero Coupon)	1.499.306	0,22	Portefeuille de titres à la valeur de marché		651.036.719	94,74
USD 10.100.000	Svenska Handelsbanken AB 5/10/2021 (Zero Coupon)	10.093.637	1,47	Autres éléments de l'actif net		36.100.164	5,26
USD 5.250.000	Svenska Handelsbanken AB FRN 5/5/2022	5.238.663	0,76	Total de l'actif net (USD)		687.136.883	100,00
USD 1.500.000	Swedbank AB 1/6/2021 (Zero Coupon)	1.500.000	0,22				
USD 6.500.000	Swedbank AB 5/10/2021 (Zero Coupon)	6.496.360	0,94				
		37.220.947	5,42				
Royaume-Uni							
USD 7.000.000	Standard Chartered Bank FRN 4/5/2022	6.983.618	1,02				
		6.983.618	1,02				
États-Unis							
USD 4.000.000	ABN Amro Funding USA LLC FRN 4/2/2022	3.994.213	0,58				
USD 5.000.000	Barton Capital SA FRN 27/9/2021	4.996.558	0,73				
USD 10.000.000	BNG Bank NV 1/6/2021 (Zero Coupon)	10.000.000	1,46				
USD 3.000.000	CAFCO LLC FRN 1/9/2021	2.999.157	0,44				
USD 4.000.000	Charta LLC FRN 1/9/2021	3.998.876	0,58				
USD 8.465.000	Citigroup Global Markets Inc FRN 1/4/2022	8.447.844	1,23				
USD 8.000.000	Crown Point Capital LLC 5/10/2021 (Zero Coupon)	7.991.600	1,16				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				États-Unis suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(6.177)	3D Systems Corp	Barclays Bank	(9.266)
Bermudes				(7.136)	3D Systems Corp	Goldman Sachs	(47.811)
(12.964)	Liberty Latin America Ltd 'C'	Goldman Sachs	(25)	(5.468)	3M Co	Barclays Bank	(2.351)
(19.812)	Liberty Latin America Ltd 'C'	Morgan Stanley	1.932	(6.435)	3M Co	HSBC	27.182
			1.907	(13.155)	3M Co	Morgan Stanley	(5.657)
Brésil				3.129	4D Molecular Therapeutics Inc	Bank of America	
13.100	Agrenco Ltd'	Morgan Stanley	(395)		4D Molecular Therapeutics Inc	Merrill Lynch	(512)
(3)	Banco ABC Brasil SA (Pref)	Morgan Stanley	(1)	11.850	4D Molecular Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.608
13.700	Laep Investments Ltd'	Goldman Sachs	(730)	1.751	4D Molecular Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(423)
24.300	Laep Investments Ltd'	Morgan Stanley	(1.280)	1.304	4D Molecular Therapeutics Inc	HSBC	(452)
			(2.406)	4.473	89bio Inc	Bank of America	
Canada					89bio Inc	Merrill Lynch	(12.748)
744	Advanz Pharma Corp Ltd	Morgan Stanley	304	9.658	8x8 Inc	Goldman Sachs	(3.863)
1.858	Bellatrix Exploration Ltd'	Morgan Stanley	(565)	18.518	8x8 Inc	HSBC	(84.998)
(26.058)	Poseidon Concepts Corp'	Morgan Stanley	5.811	3.449	8x8 Inc	Morgan Stanley	655
12.100	Sears Canada Inc'	Morgan Stanley	(6.175)	(3.485)	908 Devices Inc	Bank of America	
			(625)	(3.605)	908 Devices Inc	Merrill Lynch	(18.924)
Allemagne				(1.147)	908 Devices Inc	Barclays Bank	(13.266)
3.775	Perpetua Resources Corp	Barclays Bank	343.906	(1.147)	908 Devices Inc	Goldman Sachs	(6.228)
1.600	Perpetua Resources Corp	Goldman Sachs	145.024	6.749	A O Smith Corp	Barclays Bank	12.756
			488.930	8.026	A O Smith Corp	Goldman Sachs	1.605
Heard And Mcdonald Islands				6.077	A O Smith Corp	HSBC	(7.171)
(16.176)	Eagle Bulk Shipping Inc	Barclays Bank	20.313	(4.282)	A O Smith Corp	Morgan Stanley	(2.813)
			20.313	4.577	A10 Networks Inc	Bank of America	
Pérou					A10 Networks Inc	Merrill Lynch	1.922
7.452	Tahoe Resources Inc	Morgan Stanley	—	34.266	A10 Networks Inc	Goldman Sachs	14.392
			—	(22.029)	AAON Inc	Bank of America	
Singapour				(3.456)	AAON Inc	Merrill Lynch	26.745
(948)	Maxeon Solar Technologies Ltd	Barclays Bank	19	(9.197)	AAON Inc	Barclays Bank	380
			19	(1.436)	AAON Inc	Goldman Sachs	14.899
États-Unis				(9.442)	AAON Inc	HSBC	(474)
(3.830)	10X Genomics Inc 'A'	Bank of America		(6.357)	AAR Corp	Morgan Stanley	985
		Merrill Lynch	(138.532)	(8.343)	AAR Corp	Barclays Bank	(14.303)
(757)	10X Genomics Inc 'A'	HSBC	(34.186)	1.616	Aaron's Co Inc	Goldman Sachs	(12.431)
(4.151)	10X Genomics Inc 'A'	Morgan Stanley	(57.408)		Aaron's Co Inc	Bank of America	
12.111	180 Life Sciences Corp	Goldman Sachs	11.142	3.278	Aaron's Co Inc	Merrill Lynch	18
28.595	1-800-Flowers.com Inc 'A'	Morgan Stanley	(44.608)	6.353	Aaron's Co Inc	Barclays Bank	4.513
8.175	1Life Healthcare Inc	Bank of America		2.621	Aaron's Co Inc	HSBC	15.722
		Merrill Lynch	32.863	(1.226)	Abbott Laboratories	Morgan Stanley	(77)
(741)	1Life Healthcare Inc	Bank of America		(2.241)	Abbott Laboratories	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.979)	(29.683)	Abbott Laboratories	Merrill Lynch	110
1.530	1Life Healthcare Inc	Barclays Bank	5.997	10.082	AbbVie Inc	Barclays Bank	1.434
(2.046)	1Life Healthcare Inc	Barclays Bank	(8.020)	(1.789)	AbbVie Inc	Goldman Sachs	2.671
8.431	1Life Healthcare Inc	Goldman Sachs	33.892	11.509	Abeona Therapeutics Inc	Goldman Sachs	3.338
13.923	1Life Healthcare Inc	Morgan Stanley	54.579	24.840	Abeona Therapeutics Inc	Morgan Stanley	2.484
(1.773)	1Life Healthcare Inc	Morgan Stanley	(6.950)	(20.241)	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Barclays Bank	(102.419)
5.723	1st Constitution Bancorp	Bank of America		916	ABIOMED Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	6.810	2.248	ABIOMED Inc	Merrill Lynch	15.233
3.831	1st Constitution Bancorp	Barclays Bank	(843)	458	ABIOMED Inc	Barclays Bank	10.817
6.479	1st Constitution Bancorp	Goldman Sachs	7.710	704	ABIOMED Inc	Goldman Sachs	2.981
24.122	1st Constitution Bancorp	HSBC	62.958	1.185	ABIOMED Inc	HSBC	6.556
24.706	1st Constitution Bancorp	Morgan Stanley	(5.435)	22.246	ABM Industries Inc	Morgan Stanley	5.670
(6.807)	1st Source Corp	Bank of America		39.117	ABM Industries Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.451)	8.131	ABM Industries Inc	Merrill Lynch	(66.516)
(14.087)	1st Source Corp	Barclays Bank	(12.819)	1.979	ABM Industries Inc	Barclays Bank	12.126
(39.075)	1st Source Corp	Goldman Sachs	(14.067)	(14.205)	Acacia Research Corp	Goldman Sachs	(24.312)
(19.856)	1st Source Corp	HSBC	(29.784)	5.891	Acacia Research Corp	Morgan Stanley	613
(8.168)	1st Source Corp	Morgan Stanley	(7.433)		Academy Sports & Outdoors Inc	HSBC	2.699
6.692	2U Inc	Bank of America		(39.504)	Academy Sports & Outdoors Inc	Morgan Stanley	9.876
		Merrill Lynch	9.837		Acadia Healthcare Co Inc	Barclays Bank	16.907
2.612	2U Inc	Barclays Bank	52	8.625	Acadia Healthcare Co Inc	Barclays Bank	16.907
(1.322)	2U Inc	Goldman Sachs	(1.943)	(2.930)	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs	10.091
(6.138)	3D Systems Corp	Bank of America			Acadia Healthcare Co Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(41.125)			Merrill Lynch	(2.520)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(6.640)	Acadia Healthcare Co Inc	Barclays Bank	(10.690)	13.117	Activision Blizzard Inc	Barclays Bank	9.838
(2.705)	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs	(2.326)	16.065	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs	79.522
1.489	Acadia Healthcare Co Inc	HSBC	2.319	1.323	Actua Corp	Bank of America	
(7.686)	Acadia Healthcare Co Inc	Morgan Stanley	(12.374)			Merrill Lynch	(1.191)
916	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Bank of America		1.498	Acuity Brands Inc	Bank of America	
(3.850)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	1.017			Merrill Lynch	6.831
		Bank of America		(1.242)	Acushnet Holdings Corp	Bank of America	
5.322	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	(4.274)			Merrill Lynch	385
		Barclays Bank	5.428	(19.779)	Acushnet Holdings Corp	Barclays Bank	(36.196)
(1.922)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(1.960)	(1.092)	Acushnet Holdings Corp	Goldman Sachs	339
2.873	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	3.189	1.613	Acutus Medical Inc	Goldman Sachs	151
1.732	ACADIA Pharmaceuticals Inc	HSBC	2.286	5.167	Acutus Medical Inc	Morgan Stanley	8.319
17.414	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	17.763	40.319	Adamas Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
30.289	Acadia Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	6.966			Merrill Lynch	18.984
26.272	Accel Entertainment Inc	Bank of America		3.772	Adamas Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	1.660
		Merrill Lynch	(9.195)	13.847	Adamas Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	7.639
24.405	Accel Entertainment Inc	Barclays Bank	5.613	27.570	Adamas Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	9.559
13.122	Accel Entertainment Inc	Goldman Sachs	(4.593)	681	Adams Resources & Energy Inc	Bank of America	
11.265	Accel Entertainment Inc	HSBC	9.125			Merrill Lynch	(735)
9.848	Accel Entertainment Inc	Morgan Stanley	2.265	904	Adams Resources & Energy Inc	Barclays Bank	(145)
(14.125)	Accelerate Diagnostics Inc	Barclays Bank	(10.170)	736	Adams Resources & Energy Inc	Goldman Sachs	(795)
(245)	Accelerate Diagnostics Inc	Goldman Sachs	(157)	6.457	Adams Resources & Energy Inc	HSBC	(2.583)
(1.191)	Acceleron Pharma Inc	Bank of America		3.128	Adams Resources & Energy Inc	Morgan Stanley	(500)
		Merrill Lynch	(5.705)	7.980	AdaptHealth Corp	Bank of America	
(1.378)	Acceleron Pharma Inc	Barclays Bank	(841)			Merrill Lynch	16.598
(999)	Acceleron Pharma Inc	Goldman Sachs	(4.785)	(8.071)	AdaptHealth Corp	Barclays Bank	(8.555)
(875)	Acceleron Pharma Inc	HSBC	(12.591)	8.398	AdaptHealth Corp	Goldman Sachs	17.468
922	Acceleron Pharma Inc	HSBC	13.268	(1.535)	AdaptHealth Corp	Goldman Sachs	(1.489)
(4.943)	Acceleron Pharma Inc	Morgan Stanley	(3.015)	(769)	AdaptHealth Corp	HSBC	(969)
5.167	Accenture Plc 'A'	Bank of America		(1.554)	AdaptHealth Corp	Morgan Stanley	(1.647)
		Merrill Lynch	(25.008)	3.843	AdaptHealth Corp	Morgan Stanley	4.074
1.705	Accenture Plc 'A'	Barclays Bank	(4.586)	8.865	Adaptive Biotechnologies Corp	Barclays Bank	10.638
3.833	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	(18.552)	3.051	Adaptive Biotechnologies Corp	Goldman Sachs	10.373
7.440	Accenture Plc 'A'	Morgan Stanley	(20.014)	803	Adaptive Biotechnologies Corp	Morgan Stanley	964
14.539	ACCO Brands Corp	Barclays Bank	(6.688)	(808)	Addus HomeCare Corp	Barclays Bank	(1.252)
87.069	ACCO Brands Corp	Goldman Sachs	(47.017)	(6.203)	Addus HomeCare Corp	Goldman Sachs	(11.041)
74.432	ACCO Brands Corp	HSBC	(248)	(4.974)	Addus HomeCare Corp	HSBC	647
50.495	ACCO Brands Corp	Morgan Stanley	(15.154)	(3.536)	Addus HomeCare Corp	Morgan Stanley	(5.481)
(8.794)	Accolade Inc	Bank of America		(11.138)	Adicet Bio Inc	Barclays Bank	9.467
		Merrill Lynch	(73.518)	(11.240)	Adient Plc	Barclays Bank	(27.431)
(1.188)	Accolade Inc	Barclays Bank	717	14.796	Adient Plc	Barclays Bank	35.658
(2.407)	Accolade Inc	Goldman Sachs	(20.123)	(4.757)	Adient Plc	Goldman Sachs	(3.901)
53.767	Accuray Inc	Goldman Sachs	(6.452)	313	Adient Plc	Goldman Sachs	257
72.508	Accuray Inc	Morgan Stanley	(15.952)	(13.476)	Adient Plc	HSBC	(21.562)
(80.572)	AcelRx Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(8.057)	(5.349)	Adient Plc	Morgan Stanley	(12.891)
(18.887)	AcelRx Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(3.966)	72.719	ADMA Biologics Inc	Bank of America	
(11.355)	AcelRx Pharmaceuticals Inc	HSBC	(3.066)			Merrill Lynch	1.454
20.235	ACI Worldwide Inc	Bank of America		117.238	ADMA Biologics Inc	Barclays Bank	4.690
		Merrill Lynch	(32.376)	81.548	ADMA Biologics Inc	Goldman Sachs	1.631
33.620	ACI Worldwide Inc	Barclays Bank	(56.145)	33.193	ADMA Biologics Inc	HSBC	2.655
50.133	ACI Worldwide Inc	Goldman Sachs	(80.212)	13.644	ADMA Biologics Inc	Morgan Stanley	546
7.042	ACI Worldwide Inc	HSBC	(3.732)	553	Adobe Inc	Bank of America	
23.646	ACI Worldwide Inc	Morgan Stanley	(39.489)			Merrill Lynch	1.817
(900)	ACM Research Inc 'A'	Barclays Bank	(6.633)	5.297	Adobe Inc	Barclays Bank	30.814
(1.813)	ACM Research Inc 'A'	HSBC	(15.954)	605	Adobe Inc	Goldman Sachs	13.213
1.668	ACNB Corp	Bank of America		608	Adobe Inc	HSBC	13.312
		Merrill Lynch	350	13.344	Adobe Inc	Morgan Stanley	89.545
5.858	ACNB Corp	Barclays Bank	3.749	(2.015)	ADT Inc	Barclays Bank	302
4.971	ACNB Corp	Goldman Sachs	1.044	(2.450)	ADT Inc	Morgan Stanley	368
13.805	ACNB Corp	HSBC	966				
14.025	ACNB Corp	Morgan Stanley	8.976				
1.855	ACRES Commercial Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	(371)				
(2.581)	Activision Blizzard Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(12.776)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(16.940)	Adtalem Global Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.211	24.516	AES Corp	Barclays Bank	(7.110)
(4.036)	Adtalem Global Education Inc	Goldman Sachs	6.377	(16.378)	AES Corp	Barclays Bank	4.750
(11.392)	Adtalem Global Education Inc	HSBC	10.253	12.254	AES Corp	Goldman Sachs	1.371
(17.337)	Adtalem Global Education Inc	Morgan Stanley	(3.987)	667	AES Corp	HSBC	(212)
18.837	ADTRAN Inc	HSBC	4.144	(11.633)	AES Corp	HSBC	3.723
1.840	Aduro Biotech Inc*	Barclays Bank	5.520	5.605	AES Corp	Morgan Stanley	(863)
2.984	Aduro Biotech Inc*	Goldman Sachs	8.952	(27.135)	AES Corp	Morgan Stanley	7.869
4.665	Aduro Biotech Inc*	Morgan Stanley	13.995	2.495	AFC Gamma Inc	Barclays Bank	1.198
329	Advance Auto Parts Inc	Goldman Sachs	(233)	1.580	AFC Gamma Inc	Morgan Stanley	758
646	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	440	(1.372)	Affiliated Managers Group Inc	Barclays Bank	(8.342)
(1.174)	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	1.080	4.346	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	28.032
3.258	Advanced Drainage Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.924	(435)	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	734
7.440	Advanced Drainage Systems Inc	Barclays Bank	(12.875)	12.532	Affirmed NV	Barclays Bank	(2.130)
5.365	Advanced Drainage Systems Inc	Goldman Sachs	2.822	(14.671)	Affirm Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48.104)
1.175	Advanced Drainage Systems Inc	HSBC	(2.319)	(11.103)	Affirm Holdings Inc	Barclays Bank	(85.049)
16.599	Advanced Drainage Systems Inc	Morgan Stanley	(37.696)	(5.436)	Aflac Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.413)
(3.743)	Advanced Emissions Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.133)	678	Aflac Inc	Bank of America Merrill Lynch	3
(16.628)	Advanced Emissions Solutions Inc	Barclays Bank	(13.136)	(23.591)	Aflac Inc	Barclays Bank	(7.313)
(16.175)	Advanced Emissions Solutions Inc	HSBC	(53.539)	(9.317)	Aflac Inc	Goldman Sachs	(2.422)
(15.235)	Advanced Emissions Solutions Inc	Morgan Stanley	(12.036)	12.179	Aflac Inc	Goldman Sachs	3.199
1.845	Advanced Energy Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	15.479	(21.986)	Aflac Inc	HSBC	(3.298)
2.418	Advanced Energy Industries Inc	Barclays Bank	4.836	599	AGCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.537
3.628	Advanced Energy Industries Inc	Goldman Sachs	30.439	2.686	AGCO Corp	Barclays Bank	13.242
5.340	Advanced Energy Industries Inc	Morgan Stanley	10.680	4.589	AGCO Corp	Goldman Sachs	3.152
12.383	Advanced Micro Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	36.142	203	AGCO Corp	HSBC	(1.961)
11.623	Advanced Micro Devices Inc	Barclays Bank	6.411	16.433	AGCO Corp	Morgan Stanley	60.718
12.003	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	64.188	16.641	Agenus Inc	Bank of America Merrill Lynch	16.641
3.190	Advanced Micro Devices Inc	HSBC	6.406	47.075	Agenus Inc	Barclays Bank	10.827
6.997	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	16.162	40.646	Agenus Inc	Goldman Sachs	40.646
(3.827)	AdvanSix Inc	HSBC	(2.602)	16.438	Agenus Inc	Morgan Stanley	3.781
11.095	Adverum Biotechnologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.331)	(25.249)	Agile Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.262)
45.814	Adverum Biotechnologies Inc	Barclays Bank	1.833	(82.645)	Agile Therapeutics Inc	Barclays Bank	4.132
15.788	Adverum Biotechnologies Inc	Goldman Sachs	(1.895)	(8.293)	Agile Therapeutics Inc	HSBC	(1.659)
6.876	Adverum Biotechnologies Inc	Morgan Stanley	275	1.303	Agilent Technologies Inc	Barclays Bank	865
(14.623)	AECOM	Goldman Sachs	22.373	7.139	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs	57.255
15.109	Aeglea BioTherapeutics Inc	Goldman Sachs	(12.994)	18.985	Agilent Technologies Inc	Morgan Stanley	90.938
19.844	Aeglea BioTherapeutics Inc	Morgan Stanley	(7.342)	(3.411)	Agiliti Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24.355)
(5.907)	Aemetis Inc	Barclays Bank	(13.350)	(5.498)	Agiliti Inc	Barclays Bank	(21.057)
(6.963)	Aemetis Inc	Goldman Sachs	(23.674)	1.903	agilon health Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.094
(4.647)	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	(12.268)	4.793	agilon health Inc	Barclays Bank	9.634
(8.726)	Aerie Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.075	2.034	agilon health Inc	Goldman Sachs	8.905
(7.552)	Aerie Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	6.948	(425)	Agilysys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.534)
(9.506)	Aerie Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	9.886	(1.334)	Agilysys Inc	Barclays Bank	(774)
(3.310)	AeroVironment Inc	Goldman Sachs	(621)	(2.694)	Agilysys Inc	Goldman Sachs	(8.999)
1.474	AerSale Corp	Bank of America Merrill Lynch	(206)	(12.916)	Agilysys Inc	Morgan Stanley	(7.491)
4.001	AES Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.455	(1.874)	Agios Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(112)
				(3.804)	Agios Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	3.081
				(4.157)	Agios Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(249)
				(2.561)	Agios Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2.074
				(17.012)	AGNC Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(5.614)
				(36.212)	AGNC Investment Corp (REIT)	Barclays Bank	1.448
				2.309	AGNC Investment Corp (REIT)	Barclays Bank	(92)
				(20.142)	AGNC Investment Corp (REIT)	HSBC	(5.237)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(7.865)	AGNC Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	315	(2.048)	Akoustis Technologies Inc	Morgan Stanley	(1.126)
(9.211)	Agree Realty Corp (REIT)	Bank of America		1.812	Akoya Biosciences Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.198)			Merrill Lynch	(243)
(3.685)	Agree Realty Corp (REIT)	Barclays Bank	(995)	1.734	Akoya Biosciences Inc	Barclays Bank	(2.029)
(23.323)	Agree Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	(20.757)	4.721	Akoya Biosciences Inc	Goldman Sachs	3.069
(4.066)	Agree Realty Corp (REIT)	HSBC	81	3.441	Akoya Biosciences Inc	Morgan Stanley	(4.026)
(15.011)	Agree Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	(4.053)	(1.350)	Alamo Group Inc	Barclays Bank	(1.337)
19.165	AgroFresh Solutions Inc	Bank of America		(3.609)	Alamo Group Inc	HSBC	24.794
		Merrill Lynch	(2.683)	(1.293)	Alamo Group Inc	Morgan Stanley	(1.280)
14.500	AgroFresh Solutions Inc	Barclays Bank	(1.015)	(7.950)	Alarm.com Holdings Inc	Barclays Bank	(1.736)
17.009	AgroFresh Solutions Inc	Goldman Sachs	(2.381)	(5.021)	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(11.900)
29.560	AgroFresh Solutions Inc	Morgan Stanley	(2.069)	(6.007)	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(4.396)
(586)	Air Lease Corp	Bank of America		(2.924)	Alaska Air Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(481)			Merrill Lynch	307
5.083	Air Lease Corp	Bank of America		410	Alaska Air Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.995			Merrill Lynch	(1.013)
1.139	Air Lease Corp	Barclays Bank	663	(5.704)	Alaska Air Group Inc	Barclays Bank	285
593	Air Lease Corp	Goldman Sachs	727	1.117	Alaska Air Group Inc	Barclays Bank	(56)
1.884	Air Lease Corp	HSBC	2.958	(8.364)	Alaska Air Group Inc	Goldman Sachs	8.773
(13.450)	Air Lease Corp	Morgan Stanley	(17.889)	3.021	Alaska Air Group Inc	Goldman Sachs	45
(358)	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America		9.232	Alaska Air Group Inc	HSBC	8.516
		Merrill Lynch	712	(335)	Alaska Air Group Inc	Morgan Stanley	100
2.245	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America		2.889	Alaska Air Group Inc	Morgan Stanley	(332)
		Merrill Lynch	(1.898)	(361)	Albany International Corp 'A'	Bank of America	
(329)	Air Products and Chemicals Inc	Barclays Bank	(30)	(576)	Albany International Corp 'A'	Merrill Lynch	(1.227)
6.337	Air Products and Chemicals Inc	Barclays Bank	1.130	(8.321)	Albany International Corp 'A'	Goldman Sachs	(1.958)
701	Air Products and Chemicals Inc	Morgan Stanley	(86)	(13.718)	Albany International Corp 'A'	HSBC	(12.149)
(14.866)	Air Transport Services Group Inc	Bank of America				Morgan Stanley	(74.763)
		Merrill Lynch	5.054	375	Albemarle Corp	Bank of America	
(18.054)	Air Transport Services Group Inc	Barclays Bank	(8.485)	(1.371)	Albemarle Corp	Merrill Lynch	(565)
(10.948)	Air Transport Services Group Inc	Goldman Sachs	3.722	(657)	Albemarle Corp	Barclays Bank	(10.347)
(23.430)	Air Transport Services Group Inc	HSBC	20.384	326	Albemarle Corp	Goldman Sachs	(5.323)
(9.052)	Air Transport Services Group Inc	Morgan Stanley	(4.254)	(4.672)	Albemarle Corp	HSBC	2.901
1.923	Airbnb Inc	Barclays Bank	8.634	209	Albemarle Corp	Morgan Stanley	(30.965)
3.657	Airbnb Inc	Morgan Stanley	16.420	16.677	Albertsons Cos Inc	Morgan Stanley	(33)
(6.303)	Airgain Inc	Bank of America		(3.536)	Albireo Pharma Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(5.799)	(5.271)	Albireo Pharma Inc	Merrill Lynch	(5.337)
(3.644)	Airgain Inc	Barclays Bank	(292)	(5.351)	Albireo Pharma Inc	Goldman Sachs	(11.810)
(30.288)	Airgain Inc	Goldman Sachs	(27.133)	(9.862)	Alcoa Corp	HSBC	(23.983)
(1.484)	Akamai Technologies Inc	Bank of America				Morgan Stanley	(6.100)
		Merrill Lynch	(1.068)	(9.862)	Alcoa Corp	Bank of America	
(840)	Akamai Technologies Inc	Barclays Bank	134	(3.811)	Alcoa Corp	Merrill Lynch	9.961
(3.796)	Akamai Technologies Inc	HSBC	(11.312)	(3.811)	Alcoa Corp	Barclays Bank	(12.081)
(4.823)	Akamai Technologies Inc	Morgan Stanley	772	16.953	Alcoa Corp	Barclays Bank	53.741
4.700	Akazoo SA`	Bank of America		9.817	Alcoa Corp	Goldman Sachs	10.985
		Merrill Lynch	(5.452)	3.080	Alcoa Corp	HSBC	11.226
5.417	Akazoo SA`	Barclays Bank	(6.284)	(16.872)	Alcoa Corp	Morgan Stanley	(53.484)
11.200	Akazoo SA`	Goldman Sachs	(12.992)	(4.159)	Aldeyra Therapeutics Inc	HSBC	(1.996)
7.099	Akazoo SA`	Morgan Stanley	(8.256)	(2.614)	Alector Inc	Bank of America	
(24.603)	Akebia Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2.460)	(2.096)	Alector Inc	Merrill Lynch	667
6.019	Akero Therapeutics Inc	HSBC	(3.250)	(8.436)	Alector Inc	Barclays Bank	184
1.323	Akero Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(265)	11.797	Alerus Financial Corp	Goldman Sachs	(248)
5.236	Akouos Inc	Bank of America		13.568	Alerus Financial Corp	Goldman Sachs	11.126
		Merrill Lynch	52	24.447	Alerus Financial Corp	HSBC	108.300
10.424	Akouos Inc	Barclays Bank	9.590	14.999	Alerus Financial Corp	Morgan Stanley	11.549
3.397	Akouos Inc	HSBC	1.868	29.715	Alexander & Baldwin Inc (REIT)	Bank of America	
(18.182)	Akoustis Technologies Inc	Bank of America				Merrill Lynch	16.570
		Merrill Lynch	(20.000)	40.703	Alexander & Baldwin Inc (REIT)	Barclays Bank	15.467
(50.786)	Akoustis Technologies Inc	Barclays Bank	(25.911)	18.779	Alexander & Baldwin Inc (REIT)	Goldman Sachs	18.929
(4.969)	Akoustis Technologies Inc	HSBC	(5.118)	11.231	Alexander & Baldwin Inc (REIT)	HSBC	11.006

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
45.212	Alexander & Baldwin Inc (REIT)	Morgan Stanley	17.578	(1.612)	Allegiant Travel Co	Goldman Sachs	12.686
(4.235)	Alexander's Inc (REIT)	Bank of America		1.527	Allegiant Travel Co	HSBC	(171)
(5.399)	Alexander's Inc (REIT)	Merrill Lynch	(19.009)	1.110	Allegiant Travel Co	Morgan Stanley	(255)
(5.334)	Alexander's Inc (REIT)	Barclays Bank	(33.417)	2.871	Allegion Plc	Bank of America	
(1.409)	Alexander's Inc (REIT)	Goldman Sachs	(24.907)	4.236	Allegion Plc	Merrill Lynch	4.450
(2.456)	Alexander's Inc (REIT)	HSBC	4.157	16.100	Allegion Plc	Barclays Bank	7.413
(348)	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	Morgan Stanley	(15.129)	6.479	Allegion Plc	Goldman Sachs	24.006
2.156	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	Bank of America		2.966	Allegion Plc	HSBC	(13.412)
(1.178)	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	Merrill Lynch	(1.883)	8.923	Allegro MicroSystems Inc	Morgan Stanley	5.190
8.953	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	Barclays Bank	582	14.669	Allegro MicroSystems Inc	Barclays Bank	11.689
(1.739)	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	Barclays Bank	(318)	11.664	Allegro MicroSystems Inc	Goldman Sachs	35.352
(1.157)	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	Goldman Sachs	48.436	(4.621)	ALLETE Inc	Morgan Stanley	15.280
2.825	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	Goldman Sachs	(9.408)	(4.782)	ALLETE Inc	Bank of America	
(1.756)	Alico Inc	HSBC	1.018	(16.557)	ALLETE Inc	Merrill Lynch	3.697
(8.827)	Alico Inc	Morgan Stanley	763	(45.170)	ALLETE Inc	Barclays Bank	6.169
(13.828)	Alico Inc	Bank of America		(622)	Alliance Data Systems Corp	HSBC	38.743
(1.837)	Alico Inc	Merrill Lynch	931	(285)	Alliance Data Systems Corp	Morgan Stanley	58.269
(5.761)	Alico Inc	Barclays Bank	883	(986)	Alliance Data Systems Corp	Bank of America	
802	Align Technology Inc	HSBC	1.018	(1.096)	Alliance Data Systems Corp	Merrill Lynch	(707)
2.001	Align Technology Inc	Morgan Stanley	763	(285)	Alliance Data Systems Corp	Barclays Bank	(1.161)
583	Align Technology Inc	Bank of America		(986)	Alliance Data Systems Corp	Goldman Sachs	1.035
890	Align Technology Inc	Merrill Lynch	931	(1.096)	Alliance Data Systems Corp	Morgan Stanley	(1.033)
1.262	Align Technology Inc	Barclays Bank	883	16.635	Alliance Data Systems Corp	Morgan Stanley	45.746
3.904	Aligos Therapeutics Inc	HSBC	1.018	31.890	Alliant Energy Corp	Goldman Sachs	21.366
2.054	Aligos Therapeutics Inc	Morgan Stanley	763	45.309	Alliant Energy Corp	Morgan Stanley	(41.232)
(2.416)	Alkermes Plc	Bank of America		2.773	Allied Motion Technologies Inc	Bank of America	
(33.562)	Alkermes Plc	Merrill Lynch	24.565	7.645	Allied Motion Technologies Inc	Merrill Lynch	(438)
(11.262)	Alkermes Plc	Barclays Bank	(28.615)	3.257	Allied Motion Technologies Inc	Barclays Bank	(1.602)
(1.327)	Alkermes Plc	Goldman Sachs	17.857	9.683	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.899)
(421)	Allakos Inc	HSBC	17.857	(9.487)	Allison Transmission Holdings Inc	Barclays Bank	(13.363)
(1.412)	Allakos Inc	Morgan Stanley	31.729	(13.559)	Allison Transmission Holdings Inc	Barclays Bank	8.280
(1.603)	Allakos Inc	Bank of America		2.599	Allison Transmission Holdings Inc	Goldman Sachs	22.269
(2.815)	Allakos Inc	Merrill Lynch	(18.269)	(4.219)	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.587)
(314)	Allakos Inc	Barclays Bank	(598)	(8.491)	Allogene Therapeutics Inc	Morgan Stanley	5.822
999	Alleghany Corp	HSBC	1.018	(4.202)	Allogene Therapeutics Inc	Barclays Bank	(4.415)
710	Alleghany Corp	Morgan Stanley	763	(3.273)	Allovir Inc	Morgan Stanley	(2.185)
43	Alleghany Corp	Bank of America		(2.882)	Allovir Inc	Goldman Sachs	(839)
1.212	Alleghany Corp	Merrill Lynch	2.387	47.120	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Morgan Stanley	1.400
(8.871)	Allegheny Technologies Inc	Barclays Bank	1.519	42.152	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Barclays Bank	25.445
(20.548)	Allegheny Technologies Inc	Goldman Sachs	367	4.688	Allstate Corp	Morgan Stanley	22.762
(1.628)	Allegheny Technologies Inc	HSBC	(1.042)	6.253	Allstate Corp	Bank of America	
(4.271)	Allegheny Technologies Inc	Morgan Stanley	(41.395)	5.569	Allstate Corp	Merrill Lynch	(11.298)
(34.210)	Allegheny Technologies Inc	Bank of America		(5.971)	Allstate Corp	Barclays Bank	(3.939)
(6.690)	Allegiance Bancshares Inc	Merrill Lynch	276	2.141	Allstate Corp	Goldman Sachs	(13.421)
(20.467)	Allegiance Bancshares Inc	Barclays Bank	(1.363)	20.223	Ally Financial Inc	HSBC	(12.659)
(15.761)	Allegiance Bancshares Inc	Goldman Sachs	(1.096)	21.580	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	(1.349)
1.920	Allegiant Travel Co	HSBC	(1.433)	24.766	Ally Financial Inc	Barclays Bank	24.268
(2.267)	Allegiant Travel Co	Morgan Stanley	(1.734)	15.379	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	11.437
779	Allegiant Travel Co	Bank of America		(1.387)	Ally Financial Inc	HSBC	25.757
(1.502)	Allegiant Travel Co	Merrill Lynch	(15.110)	211	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	11.597
347	Allegiant Travel Co	Barclays Bank	9.637	(1.245)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.664)
		Goldman Sachs	(1.036)	(246)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1.287
		HSBC	345		Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Barclays Bank	(7.595)
		Goldman Sachs	(2.731)	3.065		Merrill Lynch	(913)
							8.337

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.960	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Barclays Bank	1.691	(34.418)	Altria Group Inc	Goldman Sachs	34.074
2.913	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Goldman Sachs	2.380	(9.697)	Altria Group Inc	HSBC	14.158
3.654	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Morgan Stanley	3.907	(12.001)	Altria Group Inc	Morgan Stanley	13.201
(12.196)	Alpha Metallurgical Resources Inc	HSBC	(57.199)	(3.972)	ALX Oncology Holdings Inc	Barclays Bank	(10.566)
(4.722)	Alpha Metallurgical Resources Inc	Morgan Stanley	(17.708)	(2.344)	ALX Oncology Holdings Inc	Goldman Sachs	(4.149)
(5.004)	Alpha Pro Tech Ltd	Barclays Bank	400	3.807	Amalgamated Financial Corp	Barclays Bank	(305)
602	Alphabet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	40.894	29.015	Amalgamated Financial Corp	Goldman Sachs	3.772
(49)	Alphabet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	656	2.147	A-Mark Precious Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.233)
719	Alphabet Inc 'A'	Barclays Bank	(3.013)	4.502	A-Mark Precious Metals Inc	Barclays Bank	(1.035)
(14)	Alphabet Inc 'A'	Barclays Bank	59	(199)	Amazon.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.417
486	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	33.014	(621)	Amazon.com Inc	Barclays Bank	13.612
(23)	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.562)	54	Amazon.com Inc	HSBC	787
19	Alphabet Inc 'A'	HSBC	1.237	116	Amazon.com Inc	Morgan Stanley	(3.826)
(1.057)	Alphabet Inc 'A'	HSBC	(68.811)	(1.960)	Ambac Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.431)
(302)	Alphabet Inc 'A'	Morgan Stanley	1.265	(8.264)	Ambac Financial Group Inc	Barclays Bank	(3.636)
11.486	Alphatec Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.135)	(7.638)	Ambac Financial Group Inc	HSBC	5.194
5.386	Alphatec Holdings Inc	Barclays Bank	(4.040)	(38.792)	Ambac Financial Group Inc	Morgan Stanley	(17.068)
11.478	Alphatec Holdings Inc	Goldman Sachs	(4.132)	896	Ambarella Inc	Bank of America Merrill Lynch	(386)
4.521	Alphatec Holdings Inc	HSBC	2.170	2.228	Ambarella Inc	Barclays Bank	1.824
888	Alphatec Holdings Inc	Morgan Stanley	(666)	2.418	Ambarella Inc	Goldman Sachs	(808)
(13.714)	Alpine Immune Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	26.879	246	Ambarella Inc	HSBC	758
(11.987)	Alpine Immune Sciences Inc	Barclays Bank	2.877	1.918	Ambarella Inc	Morgan Stanley	118
(40.789)	Alta Equipment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.750	3.380	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	42.047
(15.006)	Altabancorp	Bank of America Merrill Lynch	(38.415)	(2.558)	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	HSBC	(26.017)
(25.299)	Altabancorp	Barclays Bank	2.530	(598)	AMC Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.746)
(10.370)	Altabancorp	Goldman Sachs	(26.547)	(11.134)	AMC Networks Inc 'A'	Barclays Bank	(36.297)
(1.958)	Altabancorp	Morgan Stanley	196	(1.309)	AMC Networks Inc 'A'	Goldman Sachs	(5.788)
10.654	Altair Engineering Inc 'A'	Barclays Bank	16.620	(821)	AMC Networks Inc 'A'	Morgan Stanley	(2.676)
11.253	Altair Engineering Inc 'A'	Goldman Sachs	24.194	85.384	Ancor Plc	Bank of America Merrill Lynch	(41.838)
1.588	Alteryx Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.095	26.505	Ancor Plc	Barclays Bank	(3.711)
10.047	Alteryx Inc 'A'	Barclays Bank	16.477	73.769	Ancor Plc	Goldman Sachs	(36.147)
11.038	Alteryx Inc 'A'	Goldman Sachs	7.616	37.779	Ancor Plc	Morgan Stanley	(5.289)
417	Alteryx Inc 'A'	HSBC	73	(10.248)	Amdocs Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(141)
4.762	Alteryx Inc 'A'	Morgan Stanley	5.421	4.806	Amdocs Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48
(4.245)	Alice USA Inc 'A'	Barclays Bank	4.882	(19.551)	Amdocs Ltd	Barclays Bank	(6.528)
2.688	Alice USA Inc 'A'	HSBC	(4.702)	(13.584)	Amdocs Ltd	Goldman Sachs	(291)
(8.200)	Altimmune Inc	Barclays Bank	(5.000)	(2.159)	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	(691)
(5.402)	Altimmune Inc	Goldman Sachs	8.265	247	Amedisys Inc	Goldman Sachs	(634)
12.281	Altisource Portfolio Solutions SA	Bank of America Merrill Lynch	3.085	(2.214)	Amedisys Inc	Morgan Stanley	1.174
7.472	Altisource Portfolio Solutions SA	Barclays Bank	2.765	242	Amedisys Inc	Morgan Stanley	(184)
14.740	Altisource Portfolio Solutions SA	Goldman Sachs	7.812	5.031	Amerant Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.472
2.654	Altisource Portfolio Solutions SA	HSBC	2.229	14.157	Amerant Bancorp Inc	Barclays Bank	14.985
7.320	Altisource Portfolio Solutions SA	Morgan Stanley	2.708	1.525	Amerant Bancorp Inc	Goldman Sachs	1.113
(5.502)	Alto Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.208)	5.715	Amerant Bancorp Inc	HSBC	17.152
(25.289)	Alto Ingredients Inc	Barclays Bank	(9.104)	196	AMERCO	Bank of America Merrill Lynch	(8.485)
1.801	Altra Industrial Motion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.581)	124	AMERCO	Goldman Sachs	(5.368)
16.119	Altra Industrial Motion Corp	Barclays Bank	14.173	1.361	AMERCO	HSBC	(77.523)
4.467	Altra Industrial Motion Corp	Goldman Sachs	(4.824)	1.098	AMERCO	Morgan Stanley	(3.393)
3.134	Altra Industrial Motion Corp	HSBC	(972)	10.296	Ameren Corp	Barclays Bank	(4.736)
16.430	Altra Industrial Motion Corp	Morgan Stanley	15.773	5.465	Ameren Corp	HSBC	(8.963)
8.908	Altria Group Inc	Barclays Bank	(9.799)	57.206	Ameren Corp	Morgan Stanley	(26.315)
				2.517	Ameresco Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	11.150
				1.047	Ameresco Inc 'A'	Barclays Bank	2.262
				10.778	Ameresco Inc 'A'	Morgan Stanley	23.280

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
7.166	American Airlines Group Inc	Barclays Bank	8.958	(5.123)	American Financial Group Inc	Morgan Stanley	(6.762)
11.957	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs	10.642	(167)	American Homes 4 Rent 'A' (REIT)	Bank of America	(75)
(43.551)	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs	(73.277)	(6.070)	American Homes 4 Rent 'A' (REIT)	Merrill Lynch	(75)
5.160	American Assets Trust Inc (REIT)	Bank of America	5.882	(54.906)	American Homes 4 Rent 'A' (REIT)	Barclays Bank	304
3.855	American Assets Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	3.123	(32.691)	American Homes 4 Rent 'A' (REIT)	HSBC	(60.397)
4.535	American Assets Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	5.170	2.875	American International Group Inc	Morgan Stanley	1.635
32.087	American Assets Trust Inc (REIT)	HSBC	52.623	14.942	American National Bankshares Inc	Barclays Bank	2.760
39.834	American Assets Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	32.266	7.750	American National Bankshares Inc	Bank of America	(10.310)
(4.348)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Bank of America	(1.696)	(1.824)	American National Bankshares Inc	Merrill Lynch	(5.348)
(2.354)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Barclays Bank	(659)	643	American National Group Inc	Goldman Sachs	(5.012)
(34.760)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	HSBC	(29.546)	(3.511)	American National Group Inc	Bank of America	5.012
(26.975)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.553)	(299)	American National Group Inc	Barclays Bank	(2.186)
18.901	American Campus Communities Inc (REIT)	Barclays Bank	22.681	(13.301)	American Outdoor Brands Inc	Goldman Sachs	(691)
(5.561)	American Campus Communities Inc (REIT)	Barclays Bank	(6.673)	(272)	American Outdoor Brands Inc	Morgan Stanley	23
10.108	American Campus Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	5.054	2.619	American Public Education Inc	Barclays Bank	(12.636)
(16.275)	American Campus Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	(8.138)	3.726	American Public Education Inc	Morgan Stanley	(258)
6.391	American Campus Communities Inc (REIT)	HSBC	4.665	3.436	American Public Education Inc	Goldman Sachs	(52)
(603)	American Campus Communities Inc (REIT)	HSBC	(440)	(2.026)	American Realty Investors Inc	HSBC	(9.166)
8.546	American Campus Communities Inc (REIT)	Morgan Stanley	10.255	(73.007)	American Software Inc 'A'	Morgan Stanley	344
(726)	American Campus Communities Inc (REIT)	Morgan Stanley	59	(40.218)	American Software Inc 'A'	Barclays Bank	(61)
12.360	American Eagle Outfitters Inc	Bank of America	(22.124)	(1.020)	American Software Inc 'A'	Barclays Bank	(2.920)
25.720	American Eagle Outfitters Inc	Barclays Bank	67.712	2.247	American States Water Co	Goldman Sachs	(19.305)
31.470	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs	(56.331)	(1.863)	American States Water Co	Morgan Stanley	17
11.595	American Eagle Outfitters Inc	HSBC	(10.053)	3.548	American States Water Co	Barclays Bank	449
25.944	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	68.688	14.389	American States Water Co	Barclays Bank	(373)
(9.386)	American Electric Power Co Inc	Bank of America	(5.162)	(3.311)	American States Water Co	Goldman Sachs	6.706
(30.452)	American Electric Power Co Inc	Merrill Lynch	(5.162)	(25.998)	American Superconductor Corp	HSBC	6.331
(20.802)	American Electric Power Co Inc	Barclays Bank	16.218	(1.234)	American Tower Corp (REIT)	Morgan Stanley	(662)
(13.987)	American Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	(10.312)	(4.208)	American Tower Corp (REIT)	Morgan Stanley	(9.879)
(26.832)	American Electric Power Co Inc	HSBC	21.820	(1.168)	American Tower Corp (REIT)	Barclays Bank	(3.307)
(5.098)	American Equity Investment Life Holding Co	Morgan Stanley	(2.549)	(8.201)	American Vanguard Corp	Goldman Sachs	(40.271)
615	American Express Co	Barclays Bank	916	(27.291)	American Vanguard Corp	HSBC	(7.989)
(983)	American Express Co	Barclays Bank	133	(16.139)	American Vanguard Corp	Goldman Sachs	4.839
10.272	American Express Co	Goldman Sachs	33.589	(1.767)	American Water Works Co Inc	HSBC	32.476
(309)	American Express Co	Goldman Sachs	(525)	(5.172)	American Water Works Co Inc	Morgan Stanley	3.551
8.481	American Express Co	Morgan Stanley	12.637	(937)	American Water Works Co Inc	Bank of America	(7.368)
(10.018)	American Express Co	Morgan Stanley	(17.810)	(1.261)	American Water Works Co Inc	Merrill Lynch	(931)
63.430	American Finance Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	133	(1.118)	American Well Corp 'A'	Goldman Sachs	(3.907)
(7.487)	American Financial Group Inc	Barclays Bank	(9.883)	(6.294)	American Well Corp 'A'	Morgan Stanley	(227)
(7.620)	American Financial Group Inc	HSBC	(39.853)	(2.284)	American Woodmark Corp	Bank of America	(525)
				(2.429)	American Woodmark Corp	Merrill Lynch	(5.790)
				(9.336)	American Woodmark Corp	Barclays Bank	20.373
						Goldman Sachs	16.833
							78.126

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
921	America's Car-Mart Inc	Goldman Sachs	11.918	20.615	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(21.440)
1.800	Americold Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	144	22.933	Amphastar Pharmaceuticals Inc	HSBC	(5.275)
2.746	Americold Realty Trust (REIT)	Barclays Bank	82	73.260	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(61.538)
(8.353)	Americold Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(194)	(9.867)	Amphenol Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4.404)
2.691	Americold Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	215	(28.877)	Amphenol Corp 'A'	Barclays Bank	(4.276)
4.435	Americold Realty Trust (REIT)	HSBC	(2.528)	(7.075)	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	(1.397)
(29.647)	Americold Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	(889)	(1.622)	Amphenol Corp 'A'	HSBC	(324)
1.527	Ameriprise Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	385	(43.714)	Amphenol Corp 'A'	Morgan Stanley	(8.306)
938	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs	3.623	6.614	Amyris Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.145
(532)	Ameriprise Financial Inc	HSBC	2.266	10.696	Amyris Inc	Barclays Bank	8.985
(955)	Ameris Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(35)	2.887	Amyris Inc	Goldman Sachs	4.865
(22.177)	Ameris Bancorp	Goldman Sachs	34.818	3.272	Amyris Inc	HSBC	9.129
(12.299)	Ameris Bancorp	HSBC	10.208	1.810	Amyris Inc	Morgan Stanley	1.520
(18.100)	Ameris Bancorp	Morgan Stanley	21.177	(607)	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(679)
(12.820)	AMERISAFE Inc	Barclays Bank	(6.795)	(13.419)	Analog Devices Inc	Barclays Bank	(28.046)
(11.934)	AMERISAFE Inc	Goldman Sachs	13.247	(3.751)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	(61.892)
(4.214)	AMERISAFE Inc	HSBC	(6.279)	(1.154)	Analog Devices Inc	HSBC	(15.937)
(9.605)	AMERISAFE Inc	Morgan Stanley	(5.091)	8.728	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	18.242
5.798	AmerisourceBergen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19.539)	(2.100)	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	(4.389)
2.589	AmerisourceBergen Corp	Barclays Bank	(6.727)	(7.972)	Anaplan Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.154
9.661	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs	(31.536)	(14.724)	Anaplan Inc	Barclays Bank	91.142
2.648	AmerisourceBergen Corp	HSBC	(18.685)	(8.785)	Anaplan Inc	HSBC	26.355
6.244	AmerisourceBergen Corp	Morgan Stanley	(23.602)	(1.395)	Anaplan Inc	Morgan Stanley	8.635
(14.471)	Ames National Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.525	(9.185)	AnaptysBio Inc	Barclays Bank	7.256
(7.994)	Ames National Corp	Barclays Bank	2.398	(2.055)	AnaptysBio Inc	Goldman Sachs	4.213
(24.106)	Ames National Corp	Goldman Sachs	12.535	(1.480)	Anavex Life Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.732)
(1.650)	Ames National Corp	HSBC	(83)	(6.340)	Anavex Life Sciences Corp	Goldman Sachs	(7.418)
(4.150)	Ames National Corp	Morgan Stanley	1.245	(6.055)	Anavex Life Sciences Corp	Morgan Stanley	(6.237)
17.538	AMETEK Inc	Morgan Stanley	24.729	1.635	Andersons Inc	Bank of America Merrill Lynch	98
(484)	Amgen Inc	Goldman Sachs	6.989	16.260	Andersons Inc	Barclays Bank	(325)
(339)	Amgen Inc	HSBC	4.977	9.159	Andersons Inc	Goldman Sachs	584
6.350	Amgen Inc	Morgan Stanley	(62.294)	3.698	Andersons Inc	HSBC	41
12.108	Amicus Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	363	13.440	Andersons Inc	Morgan Stanley	3
(2.685)	Amicus Therapeutics Inc	Barclays Bank	(752)	(29.173)	Angi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46.917)
18.974	Amicus Therapeutics Inc	Barclays Bank	5.313	(30.399)	Angi Inc	Barclays Bank	7.397
6.137	Amicus Therapeutics Inc	Goldman Sachs	184	(53.540)	Angi Inc	Goldman Sachs	(85.084)
(8.985)	Amicus Therapeutics Inc	HSBC	1.168	(3.847)	Angi Inc	HSBC	(6.155)
(7.509)	Amicus Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(2.103)	(22.451)	Angi Inc	Morgan Stanley	5.837
15.474	Amicus Therapeutics Inc	Morgan Stanley	4.333	3.938	AngioDynamics Inc	Goldman Sachs	(79)
(18.732)	Amkor Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33.530)	16.555	AngioDynamics Inc	Morgan Stanley	(14.072)
(10.538)	Amkor Technology Inc	Barclays Bank	(7.376)	8.900	Angion Biomedica Corp	Bank of America Merrill Lynch	14.418
(14.506)	Amkor Technology Inc	Goldman Sachs	(25.966)	3.617	Angion Biomedica Corp	Barclays Bank	904
(43.450)	Amkor Technology Inc	Morgan Stanley	(30.415)	2.845	Angion Biomedica Corp	Morgan Stanley	711
(4.487)	AMMO Inc	Barclays Bank	(2.558)	(6.656)	ANI Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	16.174
(3.881)	AMMO Inc	Morgan Stanley	105	(8.869)	ANI Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	4.878
849	AMN Healthcare Services Inc	Goldman Sachs	(425)	(18.693)	ANI Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	45.424
8.751	AMN Healthcare Services Inc	Morgan Stanley	(12.514)	(2.632)	ANI Pharmaceuticals Inc	HSBC	(3.816)
(5.311)	Amneal Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(53)	(3.745)	ANI Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2.060
(58.401)	Amneal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	7.008	(4.762)	Anika Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18.238)
9.232	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.601)	(7.909)	Anika Therapeutics Inc	Barclays Bank	(21.908)
26.407	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(22.182)	133.795	Annaly Capital Management Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	13.380
				124.453	Annaly Capital Management Inc (REIT)	Barclays Bank	1.245
				4.557	Annaly Capital Management Inc (REIT)	Goldman Sachs	456

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
9.141	Annaly Capital Management Inc (REIT)	HSBC	27	(7.840)	Apogee Enterprises Inc	Morgan Stanley	(1.635)
(4.701)	Annexon Inc	Bank of America		(29.912)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT)	Morgan Stanley	(7.179)
		Merrill Lynch	(1.692)	17.292	Apollo Global Management Inc	Barclays Bank	(2.094)
(637)	Annexon Inc	Barclays Bank	(363)	(18.298)	Apollo Medical Holdings Inc	Barclays Bank	732
(6.079)	Annexon Inc	Goldman Sachs	(2.188)	(10.872)	Apollo Medical Holdings Inc	HSBC	(2.935)
(625)	ANSYS Inc	Barclays Bank	519	(4.192)	Apollo Medical Holdings Inc	Morgan Stanley	168
773	ANSYS Inc	Barclays Bank	(642)	(3.551)	Appfolio Inc 'A'	Bank of America	
(343)	ANSYS Inc	Goldman Sachs	(5.732)	(5.204)	Appfolio Inc 'A'	Merrill Lynch	(30.680)
886	ANSYS Inc	Goldman Sachs	1.277	(4.617)	Appfolio Inc 'A'	Barclays Bank	(4.735)
(1.135)	ANSYS Inc	HSBC	(16.764)	(672)	Appfolio Inc 'A'	Goldman Sachs	(39.126)
(3.277)	ANSYS Inc	Morgan Stanley	2.720	(1.972)	Appfolio Inc 'A'	HSBC	(5.060)
429	ANSYS Inc	Morgan Stanley	(356)	1.341	Appian Corp	Morgan Stanley	(1.795)
(44.735)	Antares Pharma Inc	Bank of America			Appian Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.131	(2.826)	Appian Corp	Merrill Lynch	12.042
(20.970)	Antares Pharma Inc	Barclays Bank	2.307	1.103	Appian Corp	Barclays Bank	(18.058)
(24.065)	Antares Pharma Inc	HSBC	(4.091)	1.008	Appian Corp	Barclays Bank	7.048
(9.830)	Antares Pharma Inc	Morgan Stanley	1.081	966	Appian Corp	Goldman Sachs	9.051
(7.697)	Anterix Inc	Bank of America		276	Appian Corp	HSBC	3.168
		Merrill Lynch	(18.319)	(39.685)	Apple Hospitality Inc (REIT)	Morgan Stanley	1.764
(987)	Anterix Inc	Barclays Bank	(1.086)	(48.384)	Apple Hospitality Inc (REIT)	Bank of America	
(3.032)	Anterix Inc	Goldman Sachs	(3.811)	(43.631)	Apple Hospitality Inc (REIT)	Merrill Lynch	(16.109)
(2.171)	Anterix Inc	HSBC	(2.974)	(5.597)	Apple Hospitality Inc (REIT)	Barclays Bank	(20.395)
(6.466)	Anterix Inc	Morgan Stanley	(7.113)	(73.152)	Apple Hospitality Inc (REIT)	Goldman Sachs	(16.200)
26.318	Antero Midstream Corp	Bank of America		14.925	Apple Inc	HSBC	(2.947)
		Merrill Lynch	(8.422)	21.765	Apple Inc	Morgan Stanley	(28.248)
32.849	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	5.584	1.326	Apple Inc	Bank of America	
1.689	Anthem Inc	Morgan Stanley	6.553	2.363	Apple Inc	Merrill Lynch	(24.097)
(2.845)	Aon Plc 'A'	Barclays Bank	(541)	15.079	Applied Genetic Technologies Corp	Barclays Bank	(54.195)
(507)	Aon Plc 'A'	Goldman Sachs	190	4.641	Applied Genetic Technologies Corp	Goldman Sachs	(1.852)
(3.738)	APA Corp	Bank of America		5.742	Applied Genetic Technologies Corp	HSBC	(1.731)
		Merrill Lynch	5.084	21.202	Applied Industrial Technologies Inc	Bank of America	
(49.667)	APA Corp	Barclays Bank	3.973	11.156	Applied Industrial Technologies Inc	Merrill Lynch	(100.285)
(9.850)	APA Corp	Goldman Sachs	13.396	13.785	Applied Industrial Technologies Inc	Barclays Bank	10.710
(36.848)	APA Corp	Morgan Stanley	2.948	13.766	Applied Industrial Technologies Inc	Goldman Sachs	(65.203)
(3.944)	Apartment Income Corp (REIT)	Bank of America		4.227	Applied Industrial Technologies Inc	HSBC	(95.737)
		Merrill Lynch	(7.336)	13.627	Applied Industrial Technologies Inc	Morgan Stanley	684
(3.770)	Apartment Income Corp (REIT)	Barclays Bank	(2.149)	(12.029)	Applied Materials Inc	Bank of America	
1.086	Apartment Income Corp (REIT)	Barclays Bank	619	8.655	Applied Materials Inc	Merrill Lynch	198.409
(13.528)	Apartment Income Corp (REIT)	HSBC	(28.544)	(2.345)	Applied Materials Inc	Barclays Bank	(41.062)
(7.577)	Apartment Income Corp (REIT)	Morgan Stanley	(4.319)	(251)	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	(33.422)
92.995	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Barclays Bank	2.790	9.885	Applied Materials Inc	HSBC	(3.373)
				(10.426)	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	35.092
139.569	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Goldman Sachs	51.641	(4.100)	Applied Molecular Transport Inc	Morgan Stanley	(37.012)
				(1.082)	Applied Molecular Transport Inc	Bank of America	
27.862	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Morgan Stanley	836	6.308	Applied Molecular Transport Inc	Merrill Lynch	(3.608)
(988)	Apellis Pharmaceuticals Inc	Bank of America			Applied Optoelectronics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.181)	11.181	Applied Optoelectronics Inc	Merrill Lynch	2.839
(6.705)	Apellis Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(60.881)	19.386	Applied Optoelectronics Inc	Barclays Bank	4.249
(13.220)	Apellis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(42.569)	17.071	Applied Optoelectronics Inc	Goldman Sachs	8.724
(3.142)	Apellis Pharmaceuticals Inc	HSBC	(34.970)	20.252	Applied Optoelectronics Inc	HSBC	11.950
(2.310)	Apellis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(20.975)	4.034	Applied Optoelectronics Inc	Morgan Stanley	7.696
(17.708)	API Group Corp	Bank of America			Applied Therapeutics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(30.812)	(5.111)	Applied Therapeutics Inc	Merrill Lynch	18.435
(25.064)	API Group Corp	Barclays Bank	(24.061)	(11.031)	Applied Therapeutics Inc	Goldman Sachs	12.101
4.479	API Group Corp	Barclays Bank	4.300		Applied Therapeutics Inc	HSBC	21.207
(15.461)	API Group Corp	Goldman Sachs	(26.902)				
(6.639)	API Group Corp	Morgan Stanley	(133)				
(9.167)	Apogee Enterprises Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(5.806)				
		Barclays Bank	(1.650)				
		Goldman Sachs	(8.363)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.365	AppLovin Corp 'A'	Barclays Bank	5.460	(3.470)	Archer-Daniels-Midland Co	HSBC	3.817
941	AppLovin Corp 'A'	Goldman Sachs	11.170	(39.072)	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	3.516
1.134	AppLovin Corp 'A'	HSBC	21.331	16.632	Archrock Inc	Goldman Sachs	(7.651)
530	AppLovin Corp 'A'	Morgan Stanley	2.120	9.112	Archrock Inc	HSBC	(2.551)
(23.756)	Apra Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(475)	73.230	Archrock Inc	Morgan Stanley	(9.760)
3.657	Apria Inc	Bank of America		(19.557)	Arcimoto Inc	Barclays Bank	(30.118)
		Merrill Lynch	4.169	(1.682)	Arconic Corp	Barclays Bank	(913)
1.247	Apria Inc	Goldman Sachs	1.422	(4.174)	Arconic Corp	Goldman Sachs	(938)
2.292	AptarGroup Inc	Bank of America		(11.433)	Arconic Corp	Morgan Stanley	(10.176)
		Merrill Lynch	(13.294)	(4.799)	Arcosa Inc	Bank of America	
4.729	AptarGroup Inc	Barclays Bank	(9.222)			Merrill Lynch	(5.110)
(2.271)	AptarGroup Inc	Goldman Sachs	13.172	(24.161)	Arcosa Inc	Barclays Bank	(19.447)
4.764	AptarGroup Inc	HSBC	(38.922)	(6.365)	Arcosa Inc	Goldman Sachs	(8.149)
7.687	AptarGroup Inc	Morgan Stanley	(14.990)	(1.292)	Arcosa Inc	Morgan Stanley	(1.202)
(1.528)	AptarGroup Inc	Morgan Stanley	2.980	(2.211)	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Bank of America	
1.768	Aptevo Therapeutics Inc	Bank of America		(3.965)	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Merrill Lynch	(1.039)
		Merrill Lynch	5.304				
14.633	Aptinix Inc	Goldman Sachs	(293)	(4.167)	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Barclays Bank	(3.727)
40.945	Aptinix Inc	HSBC	3.276	(840)	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.958)
61.021	Aptinix Inc	Morgan Stanley	(3.661)	(6.695)	Arcus Biosciences Inc	HSBC	(260)
(664)	Aptiv Plc	Bank of America		(2.934)	Arcus Biosciences Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.083)	(3.998)	Arcus Biosciences Inc	Merrill Lynch	21.089
(2.272)	Aptiv Plc	Barclays Bank	(20.357)	1.033	Arcutis Biotherapeutics Inc	Barclays Bank	1.136
2.262	Aptiv Plc	Goldman Sachs	25.742	4.140	Arcutis Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	5.258
5.844	Aptiv Plc	HSBC	38.804	4.485	Arcutis Biotherapeutics Inc	HSBC	(27.807)
(5.072)	Aptiv Plc	Morgan Stanley	(45.445)	14.729	Ardagh Group SA	Morgan Stanley	(21.652)
(6.728)	Apyx Medical Corp	Bank of America		(40.292)	Ardelyx Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.547			Merrill Lynch	(12.893)
(9.287)	Apyx Medical Corp	Barclays Bank	4.644	(33.496)	Ardelyx Inc	Barclays Bank	(7.034)
(30.004)	Apyx Medical Corp	Goldman Sachs	6.901	(62.432)	Ardelyx Inc	Goldman Sachs	(19.978)
(6.926)	Apyx Medical Corp	Morgan Stanley	3.463	(2.921)	Ardelyx Inc	HSBC	(1.753)
(6.394)	Aqua Metals Inc	Bank of America		(17.672)	Ardelyx Inc	Morgan Stanley	(3.711)
		Merrill Lynch	(2.238)	18.887	Ardmore Shipping Corp	Barclays Bank	(7.177)
(63.743)	Aqua Metals Inc	Morgan Stanley	(22.310)	67.226	Ardmore Shipping Corp	Goldman Sachs	(19.496)
(21.788)	AquaBounty Technologies Inc	Barclays Bank	(5.665)	(4.375)	Arena Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
		Bank of America		(4.608)	Arena Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	(963)
7.911	Aquestive Therapeutics Inc	Merrill Lynch	1.820	(4.134)	Arena Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	7.834
		Barclays Bank	6.952	(4.861)	Arena Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(909)
24.829	Aquestive Therapeutics Inc	Barclays Bank	6.952	(22.780)	Ares Commercial Real Estate Corp (REIT)	Morgan Stanley	8.264
11.329	Aquestive Therapeutics Inc	Morgan Stanley	3.172	(29.881)	Ares Commercial Real Estate Corp (REIT)	Bank of America	
27.934	Aramark	Bank of America		(53.724)	Ares Commercial Real Estate Corp (REIT)	Merrill Lynch	(6.606)
		Merrill Lynch	(29.582)			Barclays Bank	2.988
8.376	Aramark	Barclays Bank	(754)	1.677	Ares Management Corp 'A'	Goldman Sachs	(15.580)
3.707	Aramark	Goldman Sachs	(4.745)	12.730	Ares Management Corp 'A'	Bank of America	5.484
(4.025)	Aramark	HSBC	1.087	1.474	Ares Management Corp 'A'	Merrill Lynch	11.712
1.613	Aramark	Morgan Stanley	(145)	1.496	Ares Management Corp 'A'	Goldman Sachs	120
(4.185)	Aramark	Morgan Stanley	377	(14.930)	Argan Inc	Morgan Stanley	1.376
(5.036)	Aravive Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.460)	(2.428)	Argan Inc	Merrill Lynch	3.882
(15.454)	Aravive Inc	Goldman Sachs	(4.482)	(3.188)	Argan Inc	Barclays Bank	2.161
(1.683)	Aravive Inc	HSBC	(488)	(6.962)	Argan Inc	Goldman Sachs	829
(2.756)	Aravive Inc	Morgan Stanley	(248)	(7.728)	Argan Inc	HSBC	(627)
11.787	Arbor Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America		7.442	Argo Group International Holdings Ltd	Morgan Stanley	6.878
		Merrill Lynch	5.894		Argo Group International Holdings Ltd	Bank of America	
33.108	Arbor Realty Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	24.500	2.946	Argo Group International Holdings Ltd	Merrill Lynch	(30.289)
39.748	Arbor Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	19.874	961	Argo Group International Holdings Ltd	Barclays Bank	(1.385)
13.659	Arbor Realty Trust Inc (REIT)	HSBC	9.092	5.016	Argo Group International Holdings Ltd	Goldman Sachs	(3.911)
33.150	Arbor Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	24.531	546	Arista Networks Inc	HSBC	(19.312)
62.980	ARC Document Solutions Inc	Bank of America		(322)	Arista Networks Inc	Barclays Bank	1.594
		Merrill Lynch	4.409			Goldman Sachs	356
8.327	ArcBest Corp	Barclays Bank	4.247				
3.470	ArcBest Corp	Goldman Sachs	(16.483)				
5.053	ArcBest Corp	Morgan Stanley	2.577				
28.652	Arch Capital Group Ltd	Barclays Bank	(1.146)				
2.504	Arch Capital Group Ltd	HSBC	(75)				
(6.187)	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	247				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
297	Arista Networks Inc	Goldman Sachs	3.584	(3.577)	Arvinas Inc	Bank of America	
(890)	Arista Networks Inc	HSBC	(11.730)			Merrill Lynch	(25.676)
(3.017)	Arista Networks Inc	Morgan Stanley	(8.810)	(1.202)	Arvinas Inc	Barclays Bank	(8.149)
2.407	Arista Networks Inc	Morgan Stanley	7.028	(886)	Arvinas Inc	Goldman Sachs	(4.873)
(15.434)	Arko Corp	Barclays Bank	3.550	(315)	Arvinas Inc	Morgan Stanley	(2.278)
(47.845)	Arlington Asset Investment Corp 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(2.392)	(6.301)	Asana Inc 'A'	Barclays Bank	(5.574)
(74.648)	Arlington Asset Investment Corp 'A' (REIT)	HSBC	(746)	(3.467)	Asana Inc 'A'	Goldman Sachs	(11.076)
(8.561)	Arlington Asset Investment Corp 'A' (REIT)	Morgan Stanley	171	(926)	Asana Inc 'A'	HSBC	(53)
(36.686)	Arlo Technologies Inc	Goldman Sachs	(16.142)	(3.772)	Asana Inc 'A'	Morgan Stanley	(2.806)
26.782	Armada Höffler Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	6.160	1.232	Asbury Automotive Group Inc	Barclays Bank	1.454
4.751	Armada Höffler Properties Inc (REIT)	HSBC	(570)	335	Asbury Automotive Group Inc	Goldman Sachs	(2.747)
94.087	Armada Höffler Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	14.113	253	Asbury Automotive Group Inc	HSBC	(1.822)
(2.223)	ARMOUR Residential Inc (REIT)	Bank of America	(57)	(11.680)	Ascent Global Logistics Inc	Bank of America	
(51.360)	ARMOUR Residential Inc (REIT)	Merrill Lynch	(514)	(16.747)	Ascent Global Logistics Inc	Merrill Lynch	117
(7.149)	ARMOUR Residential Inc (REIT)	Barclays Bank	(71)	(3.298)	Ascent Global Logistics Inc	Goldman Sachs	17
(40.892)	ARMOUR Residential Inc (REIT)	Goldman Sachs	(409)	(9.988)	Ascent Global Logistics Inc ^{TT}	HSBC	—
(4.091)	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	655	(38.624)	Asensus Surgical Inc	Morgan Stanley	—
(4.911)	Armstrong World Industries Inc	Bank of America	(1.572)	8.751	ASGN Inc	Barclays Bank	(11.973)
(4.890)	Armstrong World Industries Inc	Merrill Lynch	(13.105)	4.101	ASGN Inc	Bank of America	(1.663)
(2.970)	Array Technologies Inc	Goldman Sachs	(889)	(104)	ASGN Inc	Merrill Lynch	861
(3.678)	Array Technologies Inc	Barclays Bank	(7.540)	4.244	ASGN Inc	Barclays Bank	20
(428)	Arrow Electronics Inc	Goldman Sachs	73	(4.858)	ASGN Inc	HSBC	(8.700)
(4.979)	Arrow Electronics Inc	HSBC	(14.987)	22.044	ASGN Inc	Morgan Stanley	(1.020)
(10.752)	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	35.697	(9.507)	ASGN Inc	Morgan Stanley	4.629
8.990	Arrow Financial Corp	Bank of America	1.349	(7.212)	Ashland Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(49.627)
23.038	Arrow Financial Corp	Merrill Lynch	19.582	(20.635)	Ashland Global Holdings Inc	HSBC	(50.412)
11.349	Arrow Financial Corp	Barclays Bank	1.702	(7.986)	Ashland Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(99.667)
17.360	Arrow Financial Corp	Goldman Sachs	(11.631)	(17.096)	Aspen Aerogels Inc	Morgan Stanley	(1.922)
14.548	Arrow Financial Corp	HSBC	12.366	(19.979)	Aspen Group Inc/CO	Bank of America	
(12.005)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(13.105)	(6.305)	Aspen Group Inc/CO	Merrill Lynch	(10.258)
(11.395)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Bank of America	5.290	(16.808)	Aspen Group Inc/CO	Barclays Bank	(1.598)
(1.064)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	25.525	(571)	Aspen Technology Inc	Barclays Bank	(3.783)
(1.289)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(8.379)	3.743	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	(1.345)
(6.351)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	13.535	(668)	Aspen Technology Inc	Barclays Bank	4.397
4.086	Artesian Resources Corp 'A'	HSBC	3.963	(3.380)	Aspen Technology Inc	Barclays Bank	(28.821)
15.414	Artesian Resources Corp 'A'	Morgan Stanley	4.162	(5.828)	Aspen Technology Inc	Goldman Sachs	4.420
(2.125)	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America	(234)	(10.832)	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	26.026
(10.819)	Arthur J Gallagher & Co	Merrill Lynch	(16.445)	(38.116)	Aspira Women's Health Inc	Morgan Stanley	(29.722)
(1.455)	Arthur J Gallagher & Co	Barclays Bank	(2.211)	(14.850)	Aspira Women's Health Inc	Bank of America	(3.089)
2.071	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Morgan Stanley	(104)	(14.194)	Aspira Women's Health Inc	Barclays Bank	(357)
808	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Merrill Lynch	(129)	(8.122)	Assembly Biosciences Inc	HSBC	(28.206)
535	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Barclays Bank	(27)	(1.234)	Assembly Biosciences Inc	Morgan Stanley	(1.188)
9.857	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Goldman Sachs	(52.143)	(3.519)	Assembly Biosciences Inc	Barclays Bank	(1.277)
21.697	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	HSBC	(3.471)	22.675	AssetMark Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	81
		Morgan Stanley		19.102	AssetMark Financial Holdings Inc	HSBC	(86)
				19.752	AssetMark Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(317)
				32.466	AssetMark Financial Holdings Inc	Bank of America	32.879
				(106.070)	Associated Banc-Corp	Merrill Lynch	32.879
				(34.584)	Associated Banc-Corp	Barclays Bank	16.237
				(23.930)	Associated Banc-Corp	HSBC	62.811
				(39.064)	Associated Banc-Corp	Morgan Stanley	27.596
				(7.819)	Associated Capital Group Inc 'A'	Bank of America	36.064
				(2.131)	Associated Capital Group Inc 'A'	Merrill Lynch	(692)
					Associated Capital Group Inc 'A'	Goldman Sachs	8.136
					Associated Capital Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(781)
					Associated Capital Group Inc 'A'	Bank of America	(6.568)
					Associated Capital Group Inc 'A'	Merrill Lynch	(1.428)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.139)	Associated Capital Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(957)	(1.430)	Atlantic Union Bankshares Corp	Goldman Sachs	(259)
(3.102)	Associated Capital Group Inc 'A'	HSBC	(2.947)	(55.245)	Atlantic Union Bankshares Corp	HSBC	(64.637)
(2.262)	Associated Capital Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.516)	(113.372)	Atlantic Union Bankshares Corp	Morgan Stanley	50.086
6.447	Assurant Inc	Bank of America		(4.740)	Atlanticus Holdings Corp	Bank of America	
3.601	Assurant Inc	Merrill Lynch	(1.127)			Merrill Lynch	(32.327)
2.647	Assurant Inc	Barclays Bank	7.238	(7.607)	Atlanticus Holdings Corp	Barclays Bank	(9.737)
(2.462)	Assurant Inc	Goldman Sachs	(1.350)	(4.031)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Bank of America	
(14.076)	Assurant Inc	HSBC	(2.930)	(7.611)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Merrill Lynch	(645)
600	Assurant Inc	Morgan Stanley	(28.293)			Barclays Bank	(6.545)
(1.741)	Assured Guaranty Ltd	Morgan Stanley	1.206	(4.782)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(765)
		Merrill Lynch	(992)	(10.554)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	(9.076)
(10.705)	Assured Guaranty Ltd	Barclays Bank	(10.812)	11	Atlas Financial Holdings Inc	Bank of America	
(1.758)	Assured Guaranty Ltd	Goldman Sachs	(1.002)			Merrill Lynch	—
(6.040)	Assured Guaranty Ltd	Morgan Stanley	(6.100)	20.374	Atlas Technical Consultants Inc	Bank of America	(2.037)
(8.025)	Astec Industries Inc	Morgan Stanley	(8.747)	1.696	Atlassian Corp Plc 'A'	Bank of America	
23.627	Astronics Corp	Bank of America				Merrill Lynch	35.582
		Merrill Lynch	30.006	(1.176)	Atlassian Corp Plc 'A'	Barclays Bank	(12.560)
12.932	Astronics Corp	Barclays Bank	8.406	677	Atlassian Corp Plc 'A'	Barclays Bank	7.230
15.040	Astronics Corp	HSBC	19.251	(6.028)	Atlassian Corp Plc 'A'	Goldman Sachs	(126.467)
6.760	Astronics Corp	Morgan Stanley	4.394	1.151	Atlassian Corp Plc 'A'	Goldman Sachs	12.279
2.017	AstroNova Inc	Bank of America		5.893	Atlassian Corp Plc 'A'	Morgan Stanley	62.937
		Merrill Lynch	1.392	12.656	Atmos Energy Corp	Barclays Bank	9.365
2.350	AstroNova Inc	HSBC	2.797	(13.654)	Atmos Energy Corp	Barclays Bank	1.092
3.017	Asure Software Inc	Bank of America		17.163	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	11.328
		Merrill Lynch	1.297	(4.053)	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	133
3.230	Asure Software Inc	Goldman Sachs	1.389	3.519	Atmos Energy Corp	HSBC	(15.272)
1.820	Asure Software Inc	HSBC	1.183	17.323	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	12.819
737	AT&T Inc	Goldman Sachs	(301)	(280)	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	(158)
(19.936)	AT&T Inc	HSBC	63.795	4.726	ATN International Inc	Bank of America	
21.473	AT&T Inc	Morgan Stanley	(6.871)			Merrill Lynch	(4.442)
17.008	Atara Biotherapeutics Inc	Bank of America		13.874	ATN International Inc	Barclays Bank	7.353
		Merrill Lynch	(13.776)	5.014	ATN International Inc	Goldman Sachs	(3.679)
14.853	Atara Biotherapeutics Inc	Barclays Bank	(446)	1.487	ATN International Inc	HSBC	45
6.745	Atara Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	(5.463)	4.606	ATN International Inc	Morgan Stanley	2.441
8.221	Atara Biotherapeutics Inc	Morgan Stanley	(247)	(3.205)	Atomera Inc	Bank of America	
(5.866)	Atea Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	1.526			Merrill Lynch	(7.372)
(200)	Aterian Inc	Barclays Bank	(143)	(14.755)	Atomera Inc	Barclays Bank	(18.296)
3.496	Athene Holding Ltd 'A'	Barclays Bank	(245)	(12.395)	Atomera Inc	HSBC	(38.053)
(10.050)	Athenex Inc	Bank of America		3.876	Atreca Inc 'A'	Barclays Bank	1.047
		Merrill Lynch	(653)	3.103	Atreca Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.489)
(7.243)	Athenex Inc	Goldman Sachs	(471)	4.260	Atreca Inc 'A'	HSBC	(2.939)
(13.054)	Athenex Inc	Morgan Stanley	(392)	3.580	AtriCure Inc	Bank of America	
1.900	Athersys Inc	Bank of America				Merrill Lynch	8.333
		Merrill Lynch	57	8.477	AtriCure Inc	Barclays Bank	19.497
44.264	Athersys Inc	Goldman Sachs	1.328	1.802	AtriCure Inc	Goldman Sachs	(528)
115.269	Athersys Inc	HSBC	14.985	726	AtriCure Inc	HSBC	2.395
44.484	Athersys Inc	Morgan Stanley	445	992	Atrion Corp	Morgan Stanley	33.629
9.034	Athira Pharma Inc	Barclays Bank	11.925	(29.820)	Audacity Inc	Bank of America	
1.876	Atkore Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(5.666)
		Merrill Lynch	(9.530)	(30.648)	Audacity Inc	Barclays Bank	(919)
2.403	Atkore Inc	Barclays Bank	1.298	(15.874)	Audacity Inc	Goldman Sachs	(2.857)
2.609	Atkore Inc	Goldman Sachs	(8.900)	(7.892)	AudioEye Inc	Bank of America	
3.334	Atkore Inc	HSBC	(30.056)			Merrill Lynch	(16.415)
808	Atkore Inc	Morgan Stanley	436	1.637	Autodesk Inc	Barclays Bank	(2.652)
5.504	Atlantic Capital Bancshares Inc	Bank of America		(219)	Autodesk Inc	Goldman Sachs	(2.427)
		Merrill Lynch	716	18.014	Autoliv Inc	Barclays Bank	40.532
24.019	Atlantic Capital Bancshares Inc	Barclays Bank	22.818	4.171	Automatic Data Processing Inc	Bank of America	
32.811	Atlantic Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs	4.265	4.435	Automatic Data Processing Inc	Merrill Lynch	6.048
12.405	Atlantic Capital Bancshares Inc	Morgan Stanley	11.785	(628)	Automatic Data Processing Inc	Barclays Bank	(4.524)
(2.786)	Atlantic Union Bankshares Corp	Bank of America				Barclays Bank	641
(431)	Atlantic Union Bankshares Corp	Merrill Lynch	(1.869)				
		Barclays Bank	198				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
3.447	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	4.998	5.775	Avient Corp	Bank of America	
(9.378)	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	(13.598)	22.241	Avient Corp	Merrill Lynch	(4.955)
156	Automatic Data Processing Inc	HSBC	220	16.956	Avient Corp	Barclays Bank	(1.283)
(2.398)	Automatic Data Processing Inc	HSBC	(3.030)	8.101	Avient Corp	Goldman Sachs	(24.247)
306	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	(312)	6.622	Avient Corp	Goldman Sachs	11.584
(5.141)	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	5.244	(5.319)	Avient Corp	HSBC	(4.967)
(6.263)	AutoNation Inc	Barclays Bank	(10.931)	52.009	Avient Corp	HSBC	3.989
(4.574)	AutoNation Inc	Goldman Sachs	(2.406)	(3.275)	Avient Corp	Morgan Stanley	(6.137)
(1.908)	AutoNation Inc	Morgan Stanley	2.316	(7.479)	Avis Budget Group Inc	Morgan Stanley	393
(443)	AutoZone Inc	Bank of America		(391)	Avis Budget Group Inc	Bank of America	
(1.128)	AutoZone Inc	Merrill Lynch	913	(11.499)	Avis Budget Group Inc	Merrill Lynch	1.758
(221)	AutoZone Inc	Barclays Bank	12.441	(2.347)	Avis Budget Group Inc	Barclays Bank	(1.290)
(2.178)	AutoZone Inc	Goldman Sachs	9.055	21.050	Avista Corp	Goldman Sachs	1.971
(2.539)	Avalara Inc	Morgan Stanley	85.127	(33.185)	Avista Corp	Morgan Stanley	(7.745)
(370)	Avalara Inc	Bank of America		(1.054)	Avita Medical Inc	Bank of America	
(3.212)	Avalara Inc	Merrill Lynch	(28.589)	(14.428)	Avita Medical Inc	Merrill Lynch	(464)
(5.805)	AvalonBay Communities Inc (REIT)	Barclays Bank	(50.329)	6.886	Avnet Inc	Barclays Bank	(577)
(2.830)	AvalonBay Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	(10.018)	(12.151)	Avnet Inc	Barclays Bank	(5.509)
(3.804)	AvalonBay Communities Inc (REIT)	Merrill Lynch	(32.981)	(4.906)	Avnet Inc	Barclays Bank	9.721
(4.420)	AvalonBay Communities Inc (REIT)	Barclays Bank	(43.979)	23.225	Avnet Inc	HSBC	294
(2.812)	AvalonBay Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	(9.530)	(833)	Avnet Inc	Morgan Stanley	(18.580)
3.962	Avangrid Inc	Merrill Lynch	(991)	1.292	Avrobio Inc	Morgan Stanley	666
21.024	Avangrid Inc	Barclays Bank	24.178	9.280	Avrobio Inc	HSBC	1.486
(10.363)	Avanos Medical Inc	Goldman Sachs		69.061	Avrobio Inc	Morgan Stanley	2.227
(919)	Avanos Medical Inc	Bank of America		(7.290)	Axalta Coating Systems Ltd	Bank of America	
(2.547)	Avanos Medical Inc	Merrill Lynch	(3.253)	9.681	Axalta Coating Systems Ltd	Merrill Lynch	(30.387)
(37.772)	Avanos Medical Inc	Barclays Bank	28	(11.204)	Axalta Coating Systems Ltd	Bank of America	
(9.267)	Avantor Inc	Goldman Sachs	518	24.389	Axalta Coating Systems Ltd	Merrill Lynch	478
(11.100)	Avantor Inc	Merrill Lynch	1.133	(15.789)	Axalta Coating Systems Ltd	Barclays Bank	8.229
(2.357)	Avantor Inc	Barclays Bank	(11.584)	602	Axalta Coating Systems Ltd	Barclays Bank	(9.523)
(1.416)	Avaya Holdings Corp	Goldman Sachs	(4.995)	280	Axalta Coating Systems Ltd	Goldman Sachs	(10.731)
(1.279)	Avaya Holdings Corp	Merrill Lynch	(3.325)	(4.779)	Axcelis Technologies Inc	Goldman Sachs	(7.783)
(5.579)	Avaya Holdings Corp	Barclays Bank	(4.739)	(6.363)	Axcelsis Technologies Inc	HSBC	(746)
11.529	Aveanna Healthcare Holdings Inc	Goldman Sachs	12.451	(5.788)	Axcelsis Technologies Inc	Morgan Stanley	238
(44.928)	Avenue Therapeutics Inc	Merrill Lynch	(34.145)	(17.884)	Axcelsis Technologies Inc	Bank of America	
(4.634)	Avenue Therapeutics Inc	Barclays Bank	(3.522)	(17.774)	Axcelsis Technologies Inc	Merrill Lynch	(13.876)
6.021	AVEO Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	2.589	6.985	Axcelsis Technologies Inc	Barclays Bank	(5.165)
9.213	AVEO Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	2.558	3.521	Axcelsis Technologies Inc	Goldman Sachs	(1.061)
(649)	Avery Dennison Corp	Barclays Bank	681	1.207	Axis Capital Holdings Ltd	HSBC	(49.002)
(3.158)	Avery Dennison Corp	Goldman Sachs	(5.432)	1.818	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	(14.041)
2.151	Aviat Networks Inc	Merrill Lynch	(91)	941	Axis Capital Holdings Ltd	Bank of America	
1.150	Aviat Networks Inc	Barclays Bank	1.202	2.651	Axis Capital Holdings Ltd	Merrill Lynch	(3.042)
(6.584)	Avid Bioservices Inc	Goldman Sachs	(6.782)	(15.531)	Axis Capital Holdings Ltd	Barclays Bank	(1.036)
(4.209)	Avid Bioservices Inc	Merrill Lynch	(4.588)	6.381	Axogen Inc	Goldman Sachs	(2.371)
(27.730)	Avid Bioservices Inc	Barclays Bank	(28.562)	10.260	Axogen Inc	HSBC	(8.351)
(3.219)	Avid Bioservices Inc	Goldman Sachs	(5.022)	2.508	Axogen Inc	Morgan Stanley	8.853
(5.182)	Avid Bioservices Inc	Merrill Lynch	(5.648)	6.722	Axogen Inc	Morgan Stanley	222
(10.074)	Avid Technology Inc	Barclays Bank	(8.160)	1.522	Axon Enterprise Inc	Barclays Bank	(7.490)
1.618	Avidity Biosciences Inc	Goldman Sachs	4.563	213	Axon Enterprise Inc	HSBC	(3.712)
3.054	Avidity Biosciences Inc	Merrill Lynch	5.497	970	Axon Enterprise Inc	Morgan Stanley	(4.907)
		Barclays Bank		295	Axon Enterprise Inc	Bank of America	10.654
		Goldman Sachs		5.054	Axon Enterprise Inc	Merrill Lynch	2.258
		HSBC		(6.589)	Axonics Inc	Barclays Bank	2.58
		Morgan Stanley		(31.899)	Axos Financial Inc	Goldman Sachs	6.790
		Barclays Bank		(9.358)	Axos Financial Inc	HSBC	3.419
		Goldman Sachs		(3.595)	Axos Financial Inc	Morgan Stanley	53.572
		HSBC		(32.448)	Axos Financial Inc	Goldman Sachs	(21.612)
		Morgan Stanley				Barclays Bank	(52.633)
						Goldman Sachs	(8.329)
						HSBC	(6.363)
						Morgan Stanley	(53.539)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
336	Axsome Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	588	1.628	Bandwidth Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	7.612
3.669	Axsome Therapeutics Inc	Barclays Bank	20.840	2.754	Bandwidth Inc 'A'	Barclays Bank	735
653	Axsome Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1.143	138	Bandwidth Inc 'A'	Goldman Sachs	788
2.659	Axsome Therapeutics Inc	Morgan Stanley	15.103	2.797	Bandwidth Inc 'A'	HSBC	5.306
(37.549)	AXT Inc	Morgan Stanley	(3.755)	1.332	Bandwidth Inc 'A'	Morgan Stanley	2.398
8.072	Aytu BioPharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.278)	(10.897)	Bank First Corp	Barclays Bank	10.679
37.341	Aytu BioPharma Inc	Goldman Sachs	(19.791)	(43.767)	Bank of America Corp	Barclays Bank	10.504
4.878	AZEK Co Inc	Goldman Sachs	1.073	(26.052)	Bank of America Corp	Goldman Sachs	9.118
747	Aziyo Biologics Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.158	(5.785)	Bank of America Corp	HSBC	(1.967)
3.029	Aziyo Biologics Inc 'A'	Barclays Bank	2.120	(45.696)	Bank of America Corp	Morgan Stanley	10.967
1.765	Aziyo Biologics Inc 'A'	Goldman Sachs	2.736	95.585	Bank of Commerce Holdings	Bank of America Merrill Lynch	55.439
471	Aziyo Biologics Inc 'A'	HSBC	547	26.297	Bank of Commerce Holdings	Goldman Sachs	15.252
1.730	Aziyo Biologics Inc 'A'	Morgan Stanley	1.211	16.442	Bank of Commerce Holdings	Morgan Stanley	4.111
(34.789)	AZZ Inc	Barclays Bank	7.306	4.740	Bank of Hawaii Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15.500)
(14.906)	AZZ Inc	Goldman Sachs	9.838	2.124	Bank of Hawaii Corp	Barclays Bank	(1.020)
4.616	B Riley Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.093)	13.242	Bank of Hawaii Corp	Goldman Sachs	(43.301)
5.234	B Riley Financial Inc	Barclays Bank	(733)	8.480	Bank of Hawaii Corp	HSBC	(29.256)
(25.963)	B&G Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39.237)	12.321	Bank of Hawaii Corp	Morgan Stanley	(5.914)
(14.789)	B&G Foods Inc	Barclays Bank	(18.634)	5.609	Bank of Marin Bancorp	Barclays Bank	(4.095)
(6.261)	B&G Foods Inc	Goldman Sachs	(2.150)	19.838	Bank of Marin Bancorp	Goldman Sachs	(42.850)
(18.922)	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	Barclays Bank	(11.732)	3.776	Bank of Marin Bancorp	Morgan Stanley	(2.756)
(3.755)	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	Goldman Sachs	(2.854)	10.480	Bank of New York Mellon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(105)
1.287	Badger Meter Inc	Bank of America Merrill Lynch	(628)	7.562	Bank of New York Mellon Corp	Barclays Bank	2.571
7.196	Badger Meter Inc	Morgan Stanley	21.300	(7.722)	Bank of New York Mellon Corp	Barclays Bank	(2.625)
3.309	Baker Hughes Co	Bank of America Merrill Lynch	(6.320)	8.643	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs	(86)
21.958	Baker Hughes Co	HSBC	5.595	(4.117)	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs	1
12.006	Baker Hughes Co	Morgan Stanley	(9.005)	12.585	Bank of New York Mellon Corp	HSBC	(2.391)
2.510	Balchem Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25)	(2.032)	Bank of New York Mellon Corp	HSBC	386
13.050	Balchem Corp	Morgan Stanley	21.533	25.462	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	8.657
(4.382)	Ball Corp	Bank of America Merrill Lynch	26.201	(5.347)	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	(1.626)
(13.496)	Ball Corp	Barclays Bank	63.425	(5.303)	Bank of Princeton	Bank of America Merrill Lynch	5.038
12.357	Ball Corp	Barclays Bank	(18.239)	(1.049)	Bank of Princeton	HSBC	136
(20.103)	Ball Corp	Goldman Sachs	126.018	(3.062)	Bank of Princeton	Morgan Stanley	2.848
1.686	Ball Corp	Goldman Sachs	(10.908)	3.205	Bank OZK	Bank of America Merrill Lynch	(2.340)
3.006	Ball Corp	HSBC	(21.341)	15.392	Bank OZK	HSBC	(3.540)
(20.392)	Ball Corp	Morgan Stanley	100.940	7.890	Bank OZK	Morgan Stanley	1.578
10.863	Ball Corp	Morgan Stanley	(27.291)	463	Bank7 Corp	Bank of America Merrill Lynch	458
(298)	Bally's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.383)	2.080	Bank7 Corp	Barclays Bank	1.435
(627)	Bally's Corp	Goldman Sachs	(2.909)	3.117	Bank7 Corp	Goldman Sachs	3.086
(6.276)	Bally's Corp	HSBC	(17.949)	11.846	Bank7 Corp	HSBC	14.571
(1.129)	Banc of California Inc	Bank of America Merrill Lynch	169	2.378	Bank7 Corp	Morgan Stanley	1.641
(1.998)	Banc of California Inc	Barclays Bank	440	62.511	BankFinancial Corp	Bank of America Merrill Lynch	18.753
(2.672)	Banc of California Inc	Goldman Sachs	401	57.827	BankFinancial Corp	Goldman Sachs	17.348
(63.893)	Banc of California Inc	HSBC	13.418	48.456	BankFinancial Corp	Morgan Stanley	9.207
(44.729)	Banc of California Inc	Morgan Stanley	9.840	(21.875)	BankUnited Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.844
(26.311)	BancFirst Corp	Bank of America Merrill Lynch	89.984	(19.506)	BankUnited Inc	Barclays Bank	(7.997)
(466)	BancFirst Corp	Goldman Sachs	1.594	(19.002)	BankUnited Inc	Goldman Sachs	2.470
(3.667)	BancFirst Corp	Morgan Stanley	(183)	(42.216)	BankUnited Inc	HSBC	(13.087)
5.618	Bancorp Inc	HSBC	(4.270)	(56.202)	BankUnited Inc	Morgan Stanley	(23.043)
26.126	BancorpSouth Bank	Bank of America Merrill Lynch	(20.962)				
26.644	BancorpSouth Bank	Barclays Bank	(2.132)				
34.622	BancorpSouth Bank	Goldman Sachs	(37.045)				
3.247	BancorpSouth Bank	HSBC	(86)				
14.432	BancorpSouth Bank	Morgan Stanley	(1.155)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(26.098)	Bankwell Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.132	(3.107)	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	5.685
(1.928)	Bankwell Financial Group Inc	Barclays Bank	(713)	2.298	Bed Bath & Beyond Inc	HSBC	6.503
(1.183)	Bankwell Financial Group Inc	Morgan Stanley	(438)	(12.012)	Bel Fuse Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(4.084)
26.659	Banner Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12.263)	(3.745)	Bel Fuse Inc 'B'	Barclays Bank	1.273
(2.228)	Bar Harbor Bankshares	Barclays Bank	1.047	(8.722)	Bel Fuse Inc 'B'	Goldman Sachs	(2.965)
(16.150)	Bar Harbor Bankshares	Goldman Sachs	(5.330)	(2.237)	Bel Fuse Inc 'B'	Morgan Stanley	761
(11.308)	Bar Harbor Bankshares	HSBC	(16.849)	(3.297)	Belden Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.319
(1.868)	Bar Harbor Bankshares	Morgan Stanley	878	(5.674)	Belden Inc	Barclays Bank	6.695
(30.713)	Barnes & Noble Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28.256)	(5.732)	Belden Inc	Goldman Sachs	12.725
5.701	Barnes Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.870	751	Bellerophon Therapeutics Inc	HSBC	45
7.986	Barnes Group Inc	Barclays Bank	16.451	(4.567)	BellRing Brands Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6.988)
10.610	Barnes Group Inc	Goldman Sachs	17.655	(4.682)	BellRing Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	(7.163)
18.546	Barnes Group Inc	HSBC	29.772	8.968	Benchmark Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.740
(9.594)	Barrett Business Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	863	16.194	Benchmark Electronics Inc	Barclays Bank	11.984
(5.793)	Barrett Business Services Inc	Barclays Bank	6.894	43.095	Benchmark Electronics Inc	Goldman Sachs	27.581
(4.670)	Barrett Business Services Inc	HSBC	22.323	35.263	Benchmark Electronics Inc	HSBC	33.500
(5.300)	Barrett Business Services Inc	Morgan Stanley	6.307	14.323	Benefitfocus Inc	Morgan Stanley	7.162
557	Bassett Furniture Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(512)	(429)	Bentley Systems Inc 'B'	Barclays Bank	(1.025)
2.922	Bassett Furniture Industries Inc	Goldman Sachs	(2.688)	(2.587)	Bentley Systems Inc 'B'	Goldman Sachs	(18.782)
2.956	Bassett Furniture Industries Inc	Morgan Stanley	(4.523)	(687)	Bentley Systems Inc 'B'	Morgan Stanley	(1.642)
1.382	Bausch Health Cos Inc	Morgan Stanley	1.147	(4.780)	Berkeley Lights Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25.669)
(2.420)	Baxter International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.132)	1.665	Berkeley Lights Inc	Barclays Bank	2.198
(14.976)	Baxter International Inc	Goldman Sachs	10.932	1.428	Berkeley Lights Inc	Goldman Sachs	7.668
(3.836)	Baxter International Inc	HSBC	16.763	(3.182)	Berkeley Lights Inc	HSBC	6.491
(14.992)	Baxter International Inc	Morgan Stanley	8.810	(3.837)	Berkeley Lights Inc	Morgan Stanley	(5.065)
(1.086)	BayCom Corp	Bank of America Merrill Lynch	43	(4.886)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Barclays Bank	1.417
(1.277)	BayCom Corp	Goldman Sachs	51	(8.548)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Goldman Sachs	(1.881)
(15.387)	BayCom Corp	HSBC	(11.848)	(2.241)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	HSBC	6.476
12.135	BBX Capital Inc	Barclays Bank	10.315	(4.631)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Morgan Stanley	1.343
1.924	BBX Capital Inc	HSBC	2.059	(21.633)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27.258)
5.883	BCB Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.059	(3.078)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Barclays Bank	(1.878)
23.221	BCB Bancorp Inc	Goldman Sachs	12.075	(26.594)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Goldman Sachs	(33.508)
21.676	BCB Bancorp Inc	Morgan Stanley	5.636	18.269	Berry Corp	Bank of America Merrill Lynch	913
(3.092)	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.473	20.243	Berry Corp	Barclays Bank	2.834
(9.921)	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs	17.560	6.202	Berry Corp	Goldman Sachs	310
(8.132)	Beacon Roofing Supply Inc	HSBC	23.014	9.118	Berry Corp	HSBC	2.827
(10.456)	Beacon Roofing Supply Inc	Morgan Stanley	(523)	43.463	Berry Corp	Morgan Stanley	6.085
(11.920)	Beam Global	Barclays Bank	(48.230)	(1.313)	Berry Global Group Inc	HSBC	(341)
(11.549)	Beam Therapeutics Inc	Barclays Bank	(24.210)	458	Berry Global Group Inc	HSBC	(462)
(4.130)	Beam Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(37.500)	(12.061)	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	16.041
(357)	Beam Therapeutics Inc	HSBC	371	1.180	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	(1.569)
150	Beasley Broadcast Group Inc 'A'	Goldman Sachs	9	3.147	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.179)
6.055	Beazer Homes USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.426	11.093	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs	(42.930)
2.646	Beazer Homes USA Inc	Barclays Bank	11	6.163	Best Buy Co Inc	HSBC	(40.331)
5.482	Beazer Homes USA Inc	Goldman Sachs	687	1.630	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	2.510
(402)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	275	7.769	Beyond Air Inc	Bank of America Merrill Lynch	(388)
(8.834)	Becton Dickinson and Co	Barclays Bank	15.712	13.357	Beyond Air Inc	Barclays Bank	(401)
(6.168)	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	(4.773)	4.870	Beyond Air Inc	Goldman Sachs	(244)
(3.312)	Becton Dickinson and Co	HSBC	15.699	6.161	Beyond Air Inc	Morgan Stanley	(185)
				583	Beyond Meat Inc	Bank of America Merrill Lynch	25.017
				597	Beyond Meat Inc	Barclays Bank	16.817
				160	Beyond Meat Inc	Goldman Sachs	6.866
				1.898	Beyondspring Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.272
				9.218	Beyondspring Inc	Barclays Bank	2.445
				7.659	Beyondspring Inc	Goldman Sachs	5.132
				7.756	Beyondspring Inc	HSBC	6.050
				15.938	Beyondspring Inc	Morgan Stanley	7.331

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(8.005)	BGC Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3.202)	6.970	BioMarin Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	(1.743)
(81.353)	BGC Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(32.541)	1.609	Biomea Fusion Inc	Bank of America	
(69.659)	BGC Partners Inc 'A'	HSBC	(27.864)			Merrill Lynch	2.043
(115.897)	BGC Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	(60.266)	963	Biomea Fusion Inc	Barclays Bank	(183)
(54.650)	BGSF Inc	Bank of America Merrill Lynch	42.627	972	Biomea Fusion Inc	Goldman Sachs	(229)
(17.150)	BGSF Inc	Barclays Bank	6.346	7.969	Biomea Fusion Inc	Morgan Stanley	(1.636)
(8.375)	BGSF Inc	Goldman Sachs	6.533	1.240	BioNTech SE ADR	Morgan Stanley	11.296
(4.584)	BGSF Inc	Morgan Stanley	1.696	2.041	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Bank of America	
(11.889)	Big 5 Sporting Goods Corp	Barclays Bank	(17.631)	460	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Merrill Lynch	25.778
4.227	Big Lots Inc	Barclays Bank	(11.413)	134	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Barclays Bank	4.283
990	BigCommerce Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.405	1.097	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	HSBC	(172)
885	BigCommerce Holdings Inc	Barclays Bank	478	(16.107)	BioSig Technologies Inc	Morgan Stanley	10.213
92	Biglari Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4.382	(541)	Bio-Techne Corp	Barclays Bank	(4.832)
6	Biglari Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(80)	(1.205)	Bio-Techne Corp	Bank of America	(14.326)
137	Biglari Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	6.525	(41)	Bio-Techne Corp	Merrill Lynch	8.640
56	Biglari Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(743)	(206)	Bio-Techne Corp	Barclays Bank	(1.086)
3.505	Biglari Holdings Inc 'B'	Barclays Bank	(25.481)	(1.758)	Bio-Techne Corp	HSBC	(1.154)
255	Biglari Holdings Inc 'B'	HSBC	1.061	(14.651)	Bioventus Inc	Morgan Stanley	12.605
(563)	Bill.com Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.064)	(415)	Bioxcel Therapeutics Inc	Barclays Bank	(15.091)
(1.843)	Bill.com Holdings Inc	Barclays Bank	(442)	(1.465)	Bioxcel Therapeutics Inc	Bank of America	(822)
(799)	Bill.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(8.605)	(2.342)	Bioxcel Therapeutics Inc	Merrill Lynch	(1.553)
(4.893)	Bill.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.174)	(766)	Bioxcel Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(4.637)
(2.011)	BioAtla Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.530	(7.282)	BJ's Restaurants Inc	Morgan Stanley	(812)
(2.409)	BioAtla Inc	Barclays Bank	(3.694)	(11.908)	BJ's Restaurants Inc	Barclays Bank	437
(1.700)	BioAtla Inc	Goldman Sachs	2.624	(406)	BJ's Restaurants Inc	Goldman Sachs	20.958
(6.785)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(14.588)	(1.193)	BJ's Restaurants Inc	Morgan Stanley	24
46.731	BioDelivery Sciences International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.608)	(280)	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Bank of America	3.178
118.119	BioDelivery Sciences International Inc	Barclays Bank	(1.181)	(1.908)	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Merrill Lynch	(70)
30.531	BioDelivery Sciences International Inc	Goldman Sachs	(3.664)	(5.213)	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Barclays Bank	(70)
22.460	BioDelivery Sciences International Inc	HSBC	7.861	(9.013)	Black Diamond Therapeutics Inc	HSBC	3.453
31.303	BioDelivery Sciences International Inc	Morgan Stanley	(313)	(15.221)	Black Hills Corp	Morgan Stanley	(1.303)
10.903	Biodesix Inc	Goldman Sachs	25.186	(16.860)	Black Hills Corp	Bank of America	3.312
101	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	20	(9.538)	Black Hills Corp	Bank of America	3.209
(832)	Biogen Inc	Barclays Bank	9.468	(18.552)	Black Hills Corp	Merrill Lynch	3.206
(223)	Biogen Inc	Goldman Sachs	2.881	(7.891)	Black Hills Corp	Goldman Sachs	2.478
(7.158)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	Barclays Bank	(62.896)	(16.213)	Black Knight Inc	HSBC	56.955
(3.525)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	Goldman Sachs	(55.688)	(6.999)	Blackbaud Inc	Morgan Stanley	1.796
(1.283)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	HSBC	(22.658)	(12.745)	Blackbaud Inc	Morgan Stanley	(3.567)
(5.044)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(37.373)	(8.542)	Blackbaud Inc	Bank of America	(7.139)
(4.714)	BioLife Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.964)	(1.243)	Blackbaud Inc	Merrill Lynch	(5.301)
(5.381)	BioLife Solutions Inc	Goldman Sachs	(9.786)	6.026	Blackline Inc	Goldman Sachs	(8.713)
(7.924)	BioLife Solutions Inc	HSBC	(19.097)	6.915	Blackline Inc	Morgan Stanley	(320)
(4.327)	BioLife Solutions Inc	Morgan Stanley	(7.480)	(8.670)	Blackstone Group Inc	Goldman Sachs	(2.810)
4.123	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(126)	(10.036)	Blackstone Group Inc	Morgan Stanley	415
1.128	BioMarin Pharmaceutical Inc	Barclays Bank	(282)	(40.544)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	HSBC	(35.200)
7.888	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	(3.495)	(22.607)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(14.552)
1.135	BioMarin Pharmaceutical Inc	HSBC	1.033	(8.273)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America	(15.812)
				17.820	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Merrill Lynch	(1.737)
				(3.341)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	(1.737)
				27.622	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	3.343
				(9.199)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(1.303)
						Goldman Sachs	10.699
						Morgan Stanley	(1.932)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
35.255	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	7.574	101	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs	11.311
25.103	Bloom Energy Corp 'A'	Bank of America		109	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	1.832
		Merrill Lynch	112.731	(1.119)	Boot Barn Holdings Inc	Barclays Bank	(2.754)
11.499	Bloom Energy Corp 'A'	Barclays Bank	26.678	(9.511)	Boot Barn Holdings Inc	HSBC	(48.221)
4.442	Bloom Energy Corp 'A'	Goldman Sachs	20.255	(2.862)	Boot Barn Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.620)
7.038	Bloom Energy Corp 'A'	Morgan Stanley	16.328	2.499	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America	
(21.816)	Bloomin' Brands Inc	Bank of America		12.226	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Merrill Lynch	3.439
		Merrill Lynch	(12.653)		Booz Allen Hamilton Holding Corp	Barclays Bank	(8.442)
(2.812)	Bloomin' Brands Inc	Barclays Bank	(2.165)	4.837	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Goldman Sachs	8.078
(1.991)	Bloomin' Brands Inc	Goldman Sachs	8	2.180	Booz Allen Hamilton Holding Corp	HSBC	(1.782)
(8.801)	Blucora Inc	Bank of America		31.041	BorgWarner Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(9.857)	(535)	BorgWarner Inc	Merrill Lynch	(11.175)
(27.255)	Blucora Inc	Barclays Bank	(22.077)		BorgWarner Inc	Bank of America	
(17.914)	Blucora Inc	Goldman Sachs	(20.064)	20.676	BorgWarner Inc	Merrill Lynch	193
(9.472)	Blucora Inc	HSBC	(17.523)	(14.256)	BorgWarner Inc	Barclays Bank	18.276
(6.703)	Blucora Inc	Morgan Stanley	(5.429)	6.249	BorgWarner Inc	Barclays Bank	(16.252)
(4.852)	Blue Bird Corp	Barclays Bank	388	8.808	BorgWarner Inc	Goldman Sachs	(2.250)
(6.847)	Blue Bird Corp	Goldman Sachs	7.345	8.808	BorgWarner Inc	HSBC	(14.445)
(5.947)	Blue Bird Corp	Morgan Stanley	(1.378)	27.593	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	29.292
1.565	Blue Ridge Bankshares Inc	Goldman Sachs	13	(1.639)	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(1.868)
(3.913)	Bluebird Bio Inc	Barclays Bank	(2.035)	169	Boston Beer Co Inc 'A'	Bank of America	
(3.571)	Bluebird Bio Inc	Goldman Sachs	(3.813)		Boston Beer Co Inc 'A'	Merrill Lynch	(4.214)
(4.054)	Bluebird Bio Inc	HSBC	(11.027)	58	Boston Beer Co Inc 'A'	Barclays Bank	(174)
(3.530)	Bluebird Bio Inc	Morgan Stanley	(1.836)	400	Boston Beer Co Inc 'A'	Goldman Sachs	(11.758)
17.142	Bluegreen Vacations Holding Corp	Barclays Bank	(857)	95	Boston Beer Co Inc 'A'	Morgan Stanley	551
4.135	Bluegreen Vacations Holding Corp	HSBC	9.386	(827)	Boston Omaha Corp 'A'	Bank of America	
(1.452)	BlueLinx Holdings Inc	Barclays Bank	7.667		Boston Omaha Corp 'A'	Merrill Lynch	(2.994)
(3.313)	Blueprint Medicines Corp	Bank of America		(6.973)	Boston Omaha Corp 'A'	Barclays Bank	(12.342)
		Merrill Lynch	9.303	(323)	Boston Omaha Corp 'A'	HSBC	(1.211)
(1.454)	Blueprint Medicines Corp	Barclays Bank	5.001	(12.645)	Boston Omaha Corp 'A'	Morgan Stanley	(22.382)
(6.962)	Blueprint Medicines Corp	Goldman Sachs	17.614	22.303	Boston Private Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	4.907
(10.250)	Blueprint Medicines Corp	Morgan Stanley	35.260	(1.791)	Boston Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(13.289)
(26.759)	Bluerock Residential Growth Inc (REIT)	Goldman Sachs	(5.352)	5.495	Boston Properties Inc (REIT)	HSBC	51.378
523	BM Technologies Inc	Barclays Bank	6.721	12.477	Boston Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	32.066
(568)	Boeing Co	Bank of America		(3.474)	Boston Scientific Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(10.815)		Boston Scientific Corp	Merrill Lynch	(2.884)
(2.100)	Boeing Co	Goldman Sachs	(29.089)	(10.110)	Boston Scientific Corp	Barclays Bank	2.528
(2.556)	Boeing Co	HSBC	(36.014)	(733)	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs	(608)
(4.592)	Boeing Co	Morgan Stanley	(43.991)	(26.500)	Boston Scientific Corp	HSBC	18.550
3.738	Bogota Financial Corp	Bank of America		(18.202)	Boston Scientific Corp	Morgan Stanley	4.009
		Merrill Lynch	(374)	3.103	Bottomline Technologies DE Inc	Bank of America	
7.311	Bogota Financial Corp	Morgan Stanley	219	1.404	Bottomline Technologies DE Inc	Merrill Lynch	(993)
(9.775)	Boise Cascade Co	Barclays Bank	(5.572)	14.298	Bottomline Technologies DE Inc	Barclays Bank	(716)
(501)	Boise Cascade Co	Goldman Sachs	1.468	1.572	Bottomline Technologies DE Inc	Goldman Sachs	(4.575)
(1.934)	BOK Financial Corp	Bank of America			Bottomline Technologies DE Inc	HSBC	(1.761)
		Merrill Lynch	97	26.339	Bottomline Technologies DE Inc	Morgan Stanley	(13.433)
(8.209)	BOK Financial Corp	Barclays Bank	(7.799)	20.323	Box Inc 'A'	Barclays Bank	(813)
(3.446)	BOK Financial Corp	Goldman Sachs	172	6.068	Box Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.517)
(578)	BOK Financial Corp	HSBC	(92)	29.631	Box Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.185)
2.424	BOK Financial Corp	HSBC	388	(11.032)	Boyd Gaming Corp	Bank of America	
(1.711)	BOK Financial Corp	Morgan Stanley	(1.625)		Boyd Gaming Corp	Merrill Lynch	(43.025)
7.814	BOK Financial Corp	Morgan Stanley	7.423	(24.132)	Boyd Gaming Corp	Barclays Bank	(83.980)
3.184	Bolt Biotherapeutics Inc	Bank of America		(3.393)	Boyd Gaming Corp	Goldman Sachs	(13.233)
		Merrill Lynch	(3.375)	(38.612)	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	(134.370)
5.779	Bolt Biotherapeutics Inc	Barclays Bank	(2.040)	4.311	Brady Corp 'A'	Bank of America	
7.461	Bolt Biotherapeutics Inc	HSBC	(29.580)	1.533	Brady Corp 'A'	Merrill Lynch	4.527
588	Bolt Biotherapeutics Inc	Morgan Stanley	(288)	13.799	Brady Corp 'A'	Barclays Bank	1.180
(511)	Bonanza Creek Energy Inc	Bank of America		14.205	Brady Corp 'A'	Goldman Sachs	8.728
		Merrill Lynch	(332)		Brady Corp 'A'	Morgan Stanley	10.356
(6.833)	Bonanza Creek Energy Inc	Barclays Bank	205				
(2.087)	Bonanza Creek Energy Inc	Goldman Sachs	(1.357)				
(275)	Bonanza Creek Energy Inc	HSBC	(814)				
(10.958)	Bonanza Creek Energy Inc	Morgan Stanley	329				
287	Booking Holdings Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	28.604				
419	Booking Holdings Inc	Barclays Bank	4.896				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
57.096	Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	19.413	16.337	BrightView Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.208)
39.486	Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT)	Barclays Bank	11.846	17.153	BrightView Holdings Inc	Barclays Bank	(515)
7.760	Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	2.638	22.917	BrightView Holdings Inc	Goldman Sachs	(8.708)
63.919	Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT)	HSBC	(50.650)	1.446	BrightView Holdings Inc	HSBC	(1.547)
37.455	Braemar Hotels & Resorts Inc (REIT)	Morgan Stanley	11.237	(1.249)	Brinker International Inc	Bank of America Merrill Lynch	636
(57.881)	BrainStorm Cell Therapeutics Inc	Barclays Bank	(9.261)	(2.696)	Brinker International Inc	Barclays Bank	(405)
(8.367)	BrainStorm Cell Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1.841)	(1.199)	Brinker International Inc	Morgan Stanley	(791)
83.778	Brandywine Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	36.025	1.231	Brink's Co	Bank of America Merrill Lynch	(5.244)
9.962	Brandywine Realty Trust (REIT)	Barclays Bank	(797)	12.843	Brink's Co	Goldman Sachs	(54.711)
21.169	Brandywine Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	9.103	483	Brink's Co	Morgan Stanley	(826)
3.120	Bridgebio Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	15.818	5.835	Bristol-Myers Squibb Co	Bank of America Merrill Lynch	712
(2.131)	Bridgebio Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.145)	43.733	Bristol-Myers Squibb Co	Barclays Bank	(68.661)
8.167	Bridgebio Pharma Inc	Barclays Bank	18.294	9.003	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs	2.340
2.858	Bridgebio Pharma Inc	Goldman Sachs	14.490	1.148	Bristol-Myers Squibb Co	HSBC	1.662
3.673	Bridgebio Pharma Inc	HSBC	46.757	24.317	Bristol-Myers Squibb Co	Morgan Stanley	(38.178)
353	Bridgebio Pharma Inc	Morgan Stanley	791	(8.331)	Bristow Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.831
3.118	Bridgewater Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(967)	(3.275)	Bristow Group Inc	Barclays Bank	4.127
(262)	Bridgford Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	364	(8.443)	Bristow Group Inc	Goldman Sachs	7.164
(6.472)	Bridgford Foods Corp	Barclays Bank	10.840	(3.976)	Bristow Group Inc	Morgan Stanley	5.010
(3.165)	Bridgford Foods Corp	Goldman Sachs	4.236	24.464	Brixmor Property Group Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	7.339
(299)	Bridgford Foods Corp	HSBC	(1.041)	14.167	Brixmor Property Group Inc (REIT)	Barclays Bank	8.784
(826)	Bridgford Foods Corp	Morgan Stanley	1.470	(3.666)	Brixmor Property Group Inc (REIT)	Barclays Bank	(2.273)
3.518	Briggs & Stratton Corp*	Barclays Bank	(369)	42.066	Brixmor Property Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	12.620
32.162	Briggs & Stratton Corp*	Goldman Sachs	(32)	(12.120)	Brixmor Property Group Inc (REIT)	Morgan Stanley	(7.514)
34.168	Brigham Minerals Inc 'A'	Barclays Bank	3.417	(1.052)	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34.074)
3.567	Brigham Minerals Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.961)	2.597	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	84.117
19.369	Brigham Minerals Inc 'A'	HSBC	4.261	(861)	Broadcom Inc	Barclays Bank	(11.314)
361	Bright Horizons Family Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	151	147	Broadcom Inc	Barclays Bank	1.932
2.733	Bright Horizons Family Solutions Inc	Goldman Sachs	6.793	(655)	Broadcom Inc	Goldman Sachs	(21.215)
(1.063)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Goldman Sachs	(4.196)	1.830	Broadcom Inc	Goldman Sachs	59.274
1.485	Bright Horizons Family Solutions Inc	HSBC	(1.143)	(1.856)	Broadcom Inc	HSBC	(67.243)
2.823	Bright Horizons Family Solutions Inc	Morgan Stanley	11.405	(5.263)	Broadcom Inc	Morgan Stanley	(69.156)
(1.772)	Brightcove Inc	Barclays Bank	(354)	(41.489)	Broadmark Realty Capital Inc (REIT)	Barclays Bank	4.979
(1.769)	Brightcove Inc	Goldman Sachs	(1.698)	(79.115)	Broadmark Realty Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	(11.867)
(7.803)	Brightcove Inc	HSBC	(7.803)	(2.222)	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.297
(19.118)	Brightcove Inc	Morgan Stanley	(3.824)	(7.926)	Broadridge Financial Solutions Inc	Barclays Bank	(392)
7.098	Brighthouse Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.844	(3.861)	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldman Sachs	10.167
3.581	Brighthouse Financial Inc	Barclays Bank	117	(15.527)	Broadridge Financial Solutions Inc	Morgan Stanley	88
3.385	Brighthouse Financial Inc	Goldman Sachs	(394)	(11.586)	Brookdale Senior Living Inc	Barclays Bank	1.622
13.280	Brighthouse Financial Inc	HSBC	12.577	(139.025)	Brookdale Senior Living Inc	Morgan Stanley	19.464
17.072	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	3.756	3.088	Brookfield Infrastructure Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4.200
(28.502)	Brightsphere Investment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.002	9.040	Brookfield Infrastructure Corp 'A'	Barclays Bank	19.436
(14.040)	Brightsphere Investment Group Inc	Barclays Bank	5.257	3.164	Brookfield Infrastructure Corp 'A'	Goldman Sachs	4.699
(7.160)	Brightsphere Investment Group Inc	Goldman Sachs	4.141	696	Brookfield Infrastructure Corp 'A'	HSBC	1.478
(5.609)	Brightsphere Investment Group Inc	Morgan Stanley	1.125	1.806	Brookfield Infrastructure Corp 'A'	Morgan Stanley	2.060
				(6.620)	Brookfield Property Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2.449)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(39.382)	Brookfield Property Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	(9.846)	(3.777)	Brunswick Corp	Morgan Stanley	(13.446)
(9.740)	Brookfield Property Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(6.673)	13.890	Bryn Mawr Bank Corp	Barclays Bank	8.612
(6.044)	Brookfield Property Inc 'A' (REIT)	HSBC	99	5.916	Bryn Mawr Bank Corp	Goldman Sachs	(2.189)
(16.521)	Brookfield Property Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(3.430)	(1.999)	Buckle Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.757 (16.074)
2.491	Brookfield Property Partners LP	Goldman Sachs	3.936	(10.645)	Buckle Inc	Barclays Bank	(16.074)
8.684	Brookfield Renewable Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	24.749	(3.963)	Buckle Inc	Goldman Sachs	13.395
17.913	Brookfield Renewable Corp 'A'	Barclays Bank	5.374	17.384	Builders FirstSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38.755)
3.768	Brookfield Renewable Corp 'A'	Goldman Sachs	10.739	8.278	Builders FirstSource Inc	Barclays Bank	497
30.231	Brookfield Renewable Corp 'A'	HSBC	106.413	36.872	Builders FirstSource Inc	Goldman Sachs	(79.108)
1.197	Brookfield Renewable Corp 'A'	Morgan Stanley	359	5.921	Builders FirstSource Inc	HSBC	(38.466)
(24.887)	Brookline Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	42.356	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	(173)
(32.482)	Brookline Bancorp Inc	HSBC	(6.821)	580	Bumble Inc 'A'	Goldman Sachs	(413)
(93.265)	Brookline Bancorp Inc	Morgan Stanley	(7.461)	7.286	Bunge Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.952)
1.818	Brooklyn Immuno Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(7.908)	(10.117)	Bunge Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.741
2.940	Brooklyn Immuno Therapeutics Inc	HSBC	773	10.500	Bunge Ltd	Barclays Bank	(1.245)
(980)	Brooks Automation Inc	Barclays Bank	(4.332)	(1.567)	Bunge Ltd	Barclays Bank	(31)
2.492	Brooks Automation Inc	Barclays Bank	11.015	3.509	Bunge Ltd	Goldman Sachs	(9.544)
10.894	Brooks Automation Inc	Goldman Sachs	123.102	(3.906)	Bunge Ltd	Goldman Sachs	10.624
(1.568)	Brooks Automation Inc	HSBC	(19.835)	536	Bunge Ltd	HSBC	(183)
(1.727)	Brooks Automation Inc	Morgan Stanley	(7.634)	9.579	Bunge Ltd	Morgan Stanley	(380)
3.827	Brown & Brown Inc	Barclays Bank	1.378	(4.820)	Burford Capital Ltd	Barclays Bank	(735)
42.992	Brown & Brown Inc	HSBC	(36.543)	(4.802)	Burford Capital Ltd	Morgan Stanley	(1.298)
7.270	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	2.617	3.471	BurgerFi International Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.354
4.426	Brown-Forman Corp 'A'	Morgan Stanley	5.267	(9.836)	Burlington Stores Inc	Barclays Bank	(27.147)
(3.483)	Brown-Forman Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(2.267)	(1.358)	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	17.328
(10.751)	Brown-Forman Corp 'B'	Barclays Bank	(42)	(3.255)	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	(8.984)
9.630	Brown-Forman Corp 'B'	Goldman Sachs	23.112	(11.873)	Business First Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.868)
(689)	Brown-Forman Corp 'B'	Goldman Sachs	(460)	(905)	Business First Bancshares Inc	Barclays Bank	(235)
3.337	Brown-Forman Corp 'B'	HSBC	8.509	(5.058)	Business First Bancshares Inc	Goldman Sachs	(2.074)
(6.259)	Brown-Forman Corp 'B'	HSBC	(15.151)	(6.929)	Business First Bancshares Inc	HSBC	(8.246)
8.206	Brown-Forman Corp 'B'	Morgan Stanley	6.401	(3.364)	Business First Bancshares Inc	Morgan Stanley	(875)
(5.385)	Brown-Forman Corp 'B'	Morgan Stanley	(2.693)	(1.934)	BWX Technologies Inc	Barclays Bank	(1.083)
(1.113)	BRP Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	467	(2.984)	BWX Technologies Inc	Goldman Sachs	5.670
(20.334)	BRP Group Inc 'A'	Barclays Bank	(2.440)	(9.667)	BWX Technologies Inc	Morgan Stanley	(5.414)
(4.719)	BRP Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1.982	(21.313)	Byline Bancorp Inc	Morgan Stanley	2.131
7.604	BRT Apartments Corp (REIT)	Barclays Bank	(2.205)	(718)	Byrna Technologies Inc	Barclays Bank	(9)
22.177	BRT Apartments Corp (REIT)	Goldman Sachs	(5.322)	(979)	C&F Financial Corp	Barclays Bank	773
19.067	BRT Apartments Corp (REIT)	Morgan Stanley	(5.529)	(1.023)	C&F Financial Corp	HSBC	(4.174)
13.138	Bruker Corp	Bank of America Merrill Lynch	29.155	(1.098)	C&F Financial Corp	Morgan Stanley	867
(686)	Bruker Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.585)	(473)	C3.ai Inc 'A'	Barclays Bank	(1.003)
4.171	Bruker Corp	Barclays Bank	(1.335)	4.471	C4 Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.865 (2.628)
(677)	Bruker Corp	Barclays Bank	217	8.213	C4 Therapeutics Inc	Barclays Bank	(2.628)
8.168	Bruker Corp	Goldman Sachs	18.868	539	C4 Therapeutics Inc	HSBC	1.682
(434)	Bruker Corp	Goldman Sachs	(1.003)	1.318	C4 Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(422)
10.683	Bruker Corp	HSBC	9.828	4.968	Cabaletta Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.936
7.149	Bruker Corp	Morgan Stanley	(2.221)	15.719	Cabaletta Bio Inc	Barclays Bank	1.729
3.424	Brunswick Corp	Barclays Bank	12.189	3.347	Cabaletta Bio Inc	Goldman Sachs	6.694
605	Brunswick Corp	Goldman Sachs	(2.305)	15.063	Cabaletta Bio Inc	HSBC	33.139
3.729	Brunswick Corp	HSBC	(46.948)	11.050	Cabaletta Bio Inc	Morgan Stanley	1.216
(4.961)	Brunswick Corp	HSBC	62.459	293	Cable One Inc	Bank of America Merrill Lynch	25.838
3.148	Brunswick Corp	Morgan Stanley	11.207	83	Cable One Inc	Goldman Sachs	6.198
				64	Cable One Inc	HSBC	4.677
				157	Cable One Inc	Morgan Stanley	1.339
				(9.031)	Cabot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.245)
				(18.225)	Cabot Corp	Barclays Bank	(7.655)
				(6.562)	Cabot Corp	Goldman Sachs	(2.993)
				(8.997)	Cabot Corp	HSBC	(18.151)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(13.508)	Cabot Corp	Morgan Stanley	(5.673)	36.803	Calithera Biosciences Inc	Goldman Sachs	4.416
(10.901)	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs	20.821	14.780	Calithera Biosciences Inc	HSBC	4.730
(9.761)	Cabot Oil & Gas Corp	HSBC	12.689	6.711	Calithera Biosciences Inc	Morgan Stanley	940
(8.135)	Cabot Oil & Gas Corp	Morgan Stanley	1.627	1.434	Calix Inc	Barclays Bank	1.119
1.194	CACI International Inc 'A'	Goldman Sachs	(5.612)	9.530	Calix Inc	Goldman Sachs	29.352
250	CACI International Inc 'A'	Morgan Stanley	(800)	(11.357)	Callaway Golf Co	Bank of America	
(6.783)	Cactus Inc 'A'	Bank of America			Merrill Lynch	(26.427)	
		Merrill Lynch	5.019	(9.253)	Callaway Golf Co	Barclays Bank	(19.061)
(1.748)	Cactus Inc 'A'	Goldman Sachs	1.294	(5.213)	Callaway Golf Co	Goldman Sachs	(11.038)
(17.980)	Cactus Inc 'A'	HSBC	(11.148)	(11.702)	Callaway Golf Co	Morgan Stanley	(24.106)
(15.469)	Cactus Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.486)	(12.015)	Cal-Maine Foods Inc	Barclays Bank	20.786
(7.254)	Cadence BanCorp	HSBC	(725)	(7.115)	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	18.499
(16.316)	Cadence BanCorp	Morgan Stanley	(4.405)	(852)	Cal-Maine Foods Inc	HSBC	2.164
1.256	Cadence Design Systems Inc	Bank of America		(1.999)	Cal-Maine Foods Inc	Morgan Stanley	3.458
		Merrill Lynch	6.475	(24.657)	Calyxt Inc	Barclays Bank	(5.918)
11.728	Cadence Design Systems Inc	Barclays Bank	7.088	(1.478)	Cambium Networks Corp	Goldman Sachs	(13.893)
4.011	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs	20.677	(7.422)	Cambium Networks Corp	Morgan Stanley	(23.899)
2.958	Cadence Design Systems Inc	HSBC	2.434	(7.626)	Cambridge Bancorp	Bank of America	
11.009	Cadence Design Systems Inc	Morgan Stanley	7.266	(1.605)	Cambridge Bancorp	Barclays Bank	1.348
(17.968)	Cadiz Inc	Barclays Bank	(17.429)	(8.700)	Cambridge Bancorp	Goldman Sachs	14.355
(33.709)	Cadiz Inc	HSBC	(58.991)	(11.161)	Cambridge Bancorp	HSBC	(1.451)
6.202	Caesars Entertainment Inc	Bank of America		(3.918)	Cambridge Bancorp	Morgan Stanley	3.291
		Merrill Lynch	2.652	18.702	Camden National Corp	Bank of America	
1.507	Caesars Entertainment Inc	Barclays Bank	(44)	18.687	Camden National Corp	Merrill Lynch	(3.553)
(6.047)	Caesars Entertainment Inc	Goldman Sachs	(14.685)	17.970	Camden National Corp	Barclays Bank	(4.298)
10.362	Caesarstone Ltd	Morgan Stanley	2.280	8.011	Camden National Corp	Goldman Sachs	(3.414)
(6.121)	CAI International Inc	Bank of America		17.597	Camden National Corp	HSBC	6.329
		Merrill Lynch	(1.542)	(4.791)	Camden National Corp	Morgan Stanley	(4.047)
(3.561)	CAI International Inc	Barclays Bank	(8.754)	7.017	Camden Property Trust (REIT)	Barclays Bank	(3.593)
(2.525)	CAI International Inc	Goldman Sachs	581	4.163	Camden Property Trust (REIT)	Goldman Sachs	15.999
(2.534)	CAI International Inc	HSBC	1.596	19.340	Camden Property Trust (REIT)	HSBC	8.784
(23.090)	CAI International Inc	Morgan Stanley	(56.015)	(3.576)	Camden Property Trust (REIT)	Morgan Stanley	14.505
(6.075)	CalAmp Corp	HSBC	(12.332)	(6.740)	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	(202)
(37.821)	CalAmp Corp	Morgan Stanley	378	3.862	Camping World Holdings Inc 'A'	Bank of America	
(59)	Calavo Growers Inc	Bank of America		15.846	Camping World Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	9.759
		Merrill Lynch	202	8.652	Camping World Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	72.733
(243)	Calavo Growers Inc	Barclays Bank	71	3.080	Camping World Holdings Inc 'A'	HSBC	(5.714)
(9.916)	Calavo Growers Inc	Goldman Sachs	33.913	4.292	Cannae Holdings Inc	Morgan Stanley	14.137
(862)	Calavo Growers Inc	Morgan Stanley	(87)	2.401	Cannae Holdings Inc	Bank of America	
5.023	Caledonia Mining Corp Plc	Barclays Bank	(1.356)	58.214	Cannae Holdings Inc	Merrill Lynch	(4.206)
8.255	Caledonia Mining Corp Plc	Goldman Sachs	(6.026)	(14.746)	Cantaloupe Inc	Barclays Bank	(1.849)
(1.165)	Caleres Inc	Bank of America		(20.048)	Cantaloupe Inc	Goldman Sachs	(2.282)
		Merrill Lynch	(570)	(24.028)	Cantaloupe Inc	Morgan Stanley	(44.825)
(3.228)	Caleres Inc	Barclays Bank	1.435	(3.740)	Cantaloupe Inc	Bank of America	
(19.736)	Caleres Inc	Goldman Sachs	34.192	(6.213)	Capital Bancorp Inc	Merrill Lynch	(19.170)
(4.206)	Caleres Inc	HSBC	1.052	(5.447)	Capital Bancorp Inc	Barclays Bank	(1.416)
(18.332)	Caleres Inc	Morgan Stanley	(4.787)	(3.796)	Capital Bancorp Inc	Goldman Sachs	(190)
4.179	California BanCorp	Bank of America		(5.576)	Capital Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.450)
		Merrill Lynch	1.881	40.144	Capital City Bank Group Inc	Bank of America	
10.321	California BanCorp	Barclays Bank	1.548	20.651	Capital City Bank Group Inc	Merrill Lynch	13.248
5.398	California BanCorp	Goldman Sachs	2.429	49.415	Capital City Bank Group Inc	Barclays Bank	7.228
4.610	California BanCorp	HSBC	6.131	23.551	Capital City Bank Group Inc	Goldman Sachs	16.256
3.512	California BanCorp	Morgan Stanley	527	64.701	Capital City Bank Group Inc	HSBC	30.852
(16.379)	California Resources Corp	Bank of America			Capital City Bank Group Inc	Morgan Stanley	22.645
		Merrill Lynch	(62.568)				
3.829	California Water Service Group	Bank of America					
		Merrill Lynch	2.106				
18.141	California Water Service Group	Barclays Bank	(1.814)				
8.706	California Water Service Group	Goldman Sachs	4.788				
23.686	California Water Service Group	Morgan Stanley	(2.369)				
18.452	Calithera Biosciences Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	2.214				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
3.136	Capital One Financial Corp	Barclays Bank	(120)	(72.695)	Carnival Corp	Morgan Stanley	(120.673)
4.958	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	198	(8.829)	CarParts.com Inc	Bank of America	
(7.573)	Capital Senior Living Corp	Bank of America		(1.484)	CarParts.com Inc	Merrill Lynch	(7.063)
		Merrill Lynch	46.347	(2.080)	Carpenter Technology Corp	Barclays Bank	(608)
10.923	Capitol Federal Financial Inc	Goldman Sachs	(1.420)	(1.883)	Carpenter Technology Corp	Bank of America	
36.010	Capitol Federal Financial Inc	HSBC	1.080	(27.565)	Carpenter Technology Corp	Merrill Lynch	(6.003)
35.235	Capitol Federal Financial Inc	Morgan Stanley	(4.581)	(1.501)	Carpenter Technology Corp	Barclays Bank	(4.306)
8.545	Capri Holdings Ltd	Bank of America		14.615	Carriage Services Inc	Goldman Sachs	(73.331)
(10.094)	Capri Holdings Ltd	Merrill Lynch	(9.998)	9.367	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	(20)
18.089	Capstar Financial Holdings Inc	Barclays Bank	(35.935)	23.880	Carrier Global Corp	Goldman Sachs	6.284
		Barclays Bank	5.608	36.227	Carrier Global Corp	Bank of America	
25.388	Capstar Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	12.948	3.946	Carrier Global Corp	Merrill Lynch	18.597
5.832	Capstar Financial Holdings Inc	HSBC	15.105	69.625	Carrier Global Corp	Barclays Bank	37.014
35.287	Capstar Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	10.939	10.781	Carrols Restaurant Group Inc	Goldman Sachs	56.124
(11.178)	Capstead Mortgage Corp (REIT)	Morgan Stanley	782	25.333	Carrols Restaurant Group Inc	HSBC	2.052
(12.481)	Cara Therapeutics Inc	Bank of America		12.092	Carrols Restaurant Group Inc	Morgan Stanley	106.614
		Merrill Lynch	(2.621)	4.973	Cars.com Inc	Barclays Bank	(216)
(9.755)	Cara Therapeutics Inc	Barclays Bank	(2.244)	15.668	Cars.com Inc	Barclays Bank	4.307
(646)	Cara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(136)	(50.462)	Carter Bankshares Inc	Morgan Stanley	2.056
(4.715)	Cara Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1.084)	(1.257)	Carter's Inc	Barclays Bank	845
(7.053)	Cardiff Oncology Inc	Bank of America		(281)	Carter's Inc	HSBC	21.862
		Merrill Lynch	353	524	Carter's Inc	Morgan Stanley	27.754
(3.356)	Cardiff Oncology Inc	Barclays Bank	(1.946)	(3.839)	Carter's Inc	Bank of America	
(8.947)	Cardiff Oncology Inc	Goldman Sachs	447	5.988	Carter's Inc	Merrill Lynch	153
4.464	Cardinal Health Inc	Bank of America		(114)	Carvana Co	Barclays Bank	(397)
		Merrill Lynch	(1.696)	(2.228)	Carvana Co	Barclays Bank	(562)
18.821	Cardinal Health Inc	Barclays Bank	(10.540)	(932)	Carvana Co	Morgan Stanley	(5.541)
442	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs	(168)	(298)	Carvana Co	Morgan Stanley	9.577
8.916	Cardinal Health Inc	HSBC	(20.150)	24.707	Casa Systems Inc	Bank of America	
38.428	Cardinal Health Inc	Morgan Stanley	(21.520)	(8.378)	Casella Waste Systems Inc 'A'	Merrill Lynch	(4.392)
14.491	Cardiovascular Systems Inc	Barclays Bank	6.231	(1.173)	Casella Waste Systems Inc 'A'	Barclays Bank	(17.066)
11.475	Cardiovascular Systems Inc	Goldman Sachs	22.721	(24.610)	Casella Waste Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	(30.542)
1.499	Cardiovascular Systems Inc	HSBC	(252)	(36.772)	Casella Waste Systems Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.364)
8.799	Cardiovascular Systems Inc	Morgan Stanley	3.784	1.687	Casey's General Stores Inc	Goldman Sachs	6.918
1.019	Cardlytics Inc	Bank of America		(4.107)	Casey's General Stores Inc	Barclays Bank	
		Merrill Lynch	16.121	3.637	Casey's General Stores Inc	Morgan Stanley	(73)
1.968	Cardlytics Inc	Barclays Bank	9.892	(32.854)	CASI Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	986
4.906	Cardlytics Inc	Goldman Sachs	70.083	33.899	Casper Sleep Inc	Barclays Bank	(10.170)
1.535	Cardlytics Inc	HSBC	14.790	30.441	Casper Sleep Inc	Goldman Sachs	(8.219)
339	Cardlytics Inc	Morgan Stanley	2.166	929	Casper Sleep Inc	HSBC	511
(748)	Cardtronics Plc 'A'	Barclays Bank	(30)	(2.641)	Cass Information Systems Inc	Bank of America	
(344)	Cardtronics Plc 'A'	Goldman Sachs	(10)	(13.859)	Cass Information Systems Inc	Merrill Lynch	(2.268)
(3.157)	CareDx Inc	Bank of America		(4.578)	Cass Information Systems Inc	Barclays Bank	(16.215)
		Merrill Lynch	(39.242)	(20.155)	Cass Information Systems Inc	Goldman Sachs	(2.523)
(6.885)	CareDx Inc	Barclays Bank	(11.980)	(25.988)	Cass Information Systems Inc	HSBC	(3.023)
(1.167)	CareDx Inc	Goldman Sachs	(14.506)	(1.140)	Cassava Sciences Inc	Morgan Stanley	(28.974)
(1.224)	CareDx Inc	HSBC	(18.431)	(1.674)	Cassava Sciences Inc	Bank of America	
(11.218)	CareDx Inc	Morgan Stanley	(19.520)	(2.656)	Cassava Sciences Inc	Merrill Lynch	(11.446)
(20.639)	Cargurus Inc	Bank of America		(4.372)	Castle Biosciences Inc	Barclays Bank	(9.441)
		Merrill Lynch	(9.781)	69.352	Castlight Health Inc 'B'	HSBC	(40.637)
(12.116)	Cargurus Inc	Goldman Sachs	(4.495)	101.833	Castlight Health Inc 'B'	Morgan Stanley	(4.897)
(1.599)	Cargurus Inc	HSBC	99			Bank of America	
(1.531)	Carlisle Cos Inc	Bank of America				Merrill Lynch	3.468
		Merrill Lynch	643			Morgan Stanley	15.275
(5.492)	Carlisle Cos Inc	Barclays Bank	8.513				
(9.588)	Carlisle Cos Inc	Goldman Sachs	4.027				
(2.606)	Carlisle Cos Inc	Morgan Stanley	4.039				
(8.215)	Carlyle Group Inc	Barclays Bank	(7.229)				
(1.002)	Carlyle Group Inc	Morgan Stanley	(882)				
(8.537)	CarMax Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	78.967				
(2.189)	CarMax Inc	Goldman Sachs	20.248				
(1.431)	CarMax Inc	Morgan Stanley	(1.874)				
(48.263)	Carnival Corp	Barclays Bank	(80.117)				
(39.616)	Carnival Corp	Goldman Sachs	(81.976)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(23.219)	Catabasis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(5.573)	13.359	CDK Global Inc	Barclays Bank	(9.485)
(2.138)	Catalent Inc	Bank of America		(38.294)	CDK Global Inc	Goldman Sachs	21.445
		Merrill Lynch	(6.008)	54.714	CDK Global Inc	Goldman Sachs	(30.640)
(10.950)	Catalent Inc	Barclays Bank	(24.857)	2.434	CDK Global Inc	HSBC	(15)
(5.470)	Catalent Inc	Goldman Sachs	(15.371)	(444)	CDK Global Inc	Morgan Stanley	315
582	Catalent Inc	Morgan Stanley	1.321	9.108	CDK Global Inc	Morgan Stanley	(6.467)
19.845	Catalyst Biosciences Inc	Bank of America		(14.157)	CDW Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.985	(9.826)	CDW Corp	Merrill Lynch	52.664
30.102	Catalyst Biosciences Inc	Barclays Bank	3.612	(1.001)	CDW Corp	Goldman Sachs	36.553
3.322	Catalyst Biosciences Inc	Goldman Sachs	332	(6.521)	CDW Corp	HSBC	6.006
27.443	Catalyst Biosciences Inc	HSBC	(6.586)	76.090	CECO Environmental Corp	Morgan Stanley	20.476
19.329	Catalyst Biosciences Inc	Morgan Stanley	2.319			Bank of America	
(50.126)	Catalyst Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	8.020	14.982	CECO Environmental Corp	Merrill Lynch	(65.437)
(21.075)	Catalyst Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(843)	24.002	CECO Environmental Corp	Barclays Bank	(5.394)
(39.743)	Catalyst Pharmaceuticals Inc	HSBC	(28.218)	5.298	CECO Environmental Corp	Goldman Sachs	(20.642)
(29.461)	Catalyst Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	4.714	12.757	Cedar Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(1.907)
(8.832)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	1.325	355	Celanese Corp	Bank of America	1.021
(154.934)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	20.141	(16.256)	Celanese Corp	Merrill Lynch	420
(20.228)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	HSBC	6.878	(4.302)	Celcuity Inc	Morgan Stanley	8.128
(49.571)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	7.436	(6.863)	Celldex Therapeutics Inc	Barclays Bank	3.054
1.826	Caterpillar Inc	Bank of America	(6.774)	(2.472)	Celldex Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(7.412)
556	Caterpillar Inc	Barclays Bank	1.129	(7.753)	CEL-SCI Corp	Barclays Bank	(1.409)
791	Caterpillar Inc	Goldman Sachs	(1.441)	(1.430)	Celsius Holdings Inc	Bank of America	(11.319)
317	Caterpillar Inc	HSBC	(485)	(12.566)	Celsius Holdings Inc	Merrill Lynch	(15.530)
1.842	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	3.739	(2.015)	Celsius Holdings Inc	Barclays Bank	(20.734)
32.108	Cathay General Bancorp	Morgan Stanley	11.451	(1.049)	Celsius Holdings Inc	Goldman Sachs	(21.883)
(20.509)	Cato Corp 'A'	Bank of America	(33.019)	9.868	Centene Corp	Morgan Stanley	(1.731)
(1.606)	Cato Corp 'A'	Barclays Bank	80	8.400	Centene Corp	Barclays Bank	(3.158)
(23.944)	Cato Corp 'A'	Goldman Sachs	(38.550)	12.179	Centene Corp	Goldman Sachs	24.860
(195)	Cavco Industries Inc	Bank of America	(2.172)	5.888	Centene Corp	HSBC	43.784
(130)	Cavco Industries Inc	Barclays Bank	(1.473)	23.842	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	(1.884)
(1.437)	Cavco Industries Inc	Goldman Sachs	(16.008)	(1.869)	CenterPoint Energy Inc	Barclays Bank	6.437
(2.772)	Cavco Industries Inc	HSBC	(31.157)	39.340	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs	(505)
(3.734)	Cavco Industries Inc	Morgan Stanley	(42.306)	(2.608)	CenterPoint Energy Inc	HSBC	31.760
8.297	CB Financial Services Inc	Barclays Bank	(1.245)	976	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	(704)
6.474	CB Financial Services Inc	Goldman Sachs	(5.762)	(2.941)	Centerspace (REIT)	Morgan Stanley	264
9.178	CB Financial Services Inc	Morgan Stanley	(1.377)	16.048	Centogene NV	Morgan Stanley	912
22.313	cbdMD Inc	Bank of America	4.239	3.344	Centogene NV	Barclays Bank	(9.950)
12.444	cbdMD Inc	Goldman Sachs	2.364	5.388	Centogene NV	Goldman Sachs	(334)
(39.138)	CBIZ Inc	Bank of America	49.423	22.444	Central Garden & Pet Co 'A'	Morgan Stanley	(3.341)
(69.772)	CBIZ Inc	Barclays Bank	32.095	13.178	Central Garden & Pet Co 'A'	Bank of America	(45.337)
(63.829)	CBIZ Inc	Goldman Sachs	84.254	32.398	Central Garden & Pet Co 'A'	Barclays Bank	(1.054)
(771)	Cboe Global Markets Inc	Morgan Stanley	(948)	5.480	Central Garden & Pet Co 'A'	Goldman Sachs	(65.444)
14.386	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America	16.029	7.727	Central Garden & Pet Co 'A'	HSBC	(19.235)
22.374	CBRE Group Inc 'A'	Barclays Bank	(21.927)	38.821	Central Pacific Financial Corp	Morgan Stanley	(618)
2.431	CBRE Group Inc 'A'	Goldman Sachs	2.674	90.586	Central Pacific Financial Corp	Bank of America	(29.892)
(20.950)	CBTX Inc	Bank of America	17.598	(7.441)	Central Valley Community Bancorp	Merrill Lynch	(4.529)
(19.609)	CBTX Inc	Barclays Bank	784	(1.634)	Central Valley Community Bancorp	Bank of America	(8.706)
(42.672)	CBTX Inc	Goldman Sachs	35.844	(4.250)	Central Valley Community Bancorp	Merrill Lynch	(33)
(4.004)	CDK Global Inc	Bank of America	2.242	(9.618)	Central Valley Community Bancorp	Barclays Bank	(4.973)
2.332	CDK Global Inc	Bank of America	(1.306)	(1.300)	Central Valley Community Bancorp	Goldman Sachs	(4.973)
(2.811)	CDK Global Inc	Barclays Bank	1.996	(7.460)	Centrus Energy Corp 'A'	HSBC	(14.619)
				(2.452)	Centrus Energy Corp 'A'	Morgan Stanley	(26)
				(920)	Centrus Energy Corp 'A'	Barclays Bank	(298)
				(13.084)	Century Aluminum Co	Goldman Sachs	245
				9.552	Century Casinos Inc	Morgan Stanley	253
				(619)	Century Communities Inc	HSBC	32.972
						Morgan Stanley	(669)
						Bank of America	
						Merrill Lynch	(2.649)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.111)	Century Communities Inc	Barclays Bank	(5.611)	(1.147)	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs	(17.526)
(17.814)	Century Communities Inc	Goldman Sachs	(76.244)	675	Charles River Laboratories International Inc	HSBC	2.828
(49.534)	Cerecor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20.309)	(2.031)	Charles River Laboratories International Inc	Morgan Stanley	(13.851)
(54.392)	Cerecor Inc	Barclays Bank	(3.264)	556	Charles River Laboratories International Inc	Morgan Stanley	129
(10.916)	Cerecor Inc	Goldman Sachs	(4.476)	1.097	Charles Schwab Corp	Bank of America Merrill Lynch	932
(11.196)	Cerecor Inc	HSBC	(1.120)	330	Charles Schwab Corp	Barclays Bank	409
(2.075)	Cerence Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24.485)	2.526	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs	2.147
1.708	Cerence Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.702	1.361	Charles Schwab Corp	HSBC	717
(573)	Cerence Inc	Goldman Sachs	(6.761)	19.431	Charles Schwab Corp	Morgan Stanley	23.359
350	Cerence Inc	Goldman Sachs	4.130	(1.493)	Chart Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.825
1.796	Cerence Inc	HSBC	10.360	(2.498)	Chart Industries Inc	Barclays Bank	8.917
3.465	Cerence Inc	Morgan Stanley	19.820	(567)	Chart Industries Inc	Barclays Bank	4.871
(1.503)	Cerence Inc	Morgan Stanley	(8.597)	(392)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.199)
4.719	Cerevel Therapeutics Holdings Inc	Barclays Bank	(6.040)	(1.323)	Charter Communications Inc 'A'	Barclays Bank	11.378
7.855	Cerevel Therapeutics Holdings Inc	Morgan Stanley	(10.054)	(375)	Charter Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	(825)
(2.602)	Ceridian HCM Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.528)	(2.026)	Charter Communications Inc 'A'	HSBC	385
(19.568)	Ceridian HCM Holding Inc	Barclays Bank	(3.131)	(3.435)	Charter Communications Inc 'A'	Morgan Stanley	29.541
(6.909)	Ceridian HCM Holding Inc	HSBC	(38.207)	(1.579)	Chase Corp	Barclays Bank	13
(6.118)	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	(979)	(9.414)	Chase Corp	Goldman Sachs	43.878
5.662	Cerner Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.909	(15.814)	Chase Corp	Morgan Stanley	5.666
5.700	Cerner Corp	Barclays Bank	7.125	22.158	Chatham Lodging Trust (REIT)	Barclays Bank	4.875
9.455	Cerner Corp	Goldman Sachs	16.546	2.498	CHC Group Ltd*	Morgan Stanley	(1.124)
4.151	Cerner Corp	HSBC	3.736	(398)	Check Point Software Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16)
20.906	Cerner Corp	Morgan Stanley	26.133	(11.260)	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	23.083
1.487	Certara Inc	Goldman Sachs	2.260	905	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	(1.855)
7.001	Certara Inc	Morgan Stanley	3.220	3.039	Checkmate Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.398
2.982	Certara Inc	Bank of America Merrill Lynch	15	4.500	Checkmate Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	315
38.468	Cerus Corp	HSBC	385	5.271	Checkmate Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	2.425
50.471	Cerus Corp	Morgan Stanley	(4.038)	1.826	Checkmate Pharmaceuticals Inc	HSBC	511
(12.216)	CEVA Inc	Barclays Bank	(3.481)	(33.647)	Checkpoint Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(8.075)
(2.205)	CEVA Inc	Goldman Sachs	(200)	2.373	Cheesecake Factory Inc	Barclays Bank	4.936
(2.255)	CEVA Inc	Morgan Stanley	(834)	13.338	Cheesecake Factory Inc	HSBC	(38.547)
(36.357)	CF Industries Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	52.354	(1.551)	Chefs' Warehouse Inc	Bank of America Merrill Lynch	279
(14.295)	CF Industries Holdings Inc	Barclays Bank	(2.001)	(8.117)	Chefs' Warehouse Inc	Barclays Bank	2.029
(8.849)	CF Industries Holdings Inc	Goldman Sachs	12.742	(6.737)	Chefs' Warehouse Inc	Goldman Sachs	1.213
(1.866)	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	(261)	455	Chegg Inc	Bank of America Merrill Lynch	209
863	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.735)	3.862	Chegg Inc	Barclays Bank	11.277
9.100	CH Robinson Worldwide Inc	Barclays Bank	(6.370)	4.989	Chegg Inc	Morgan Stanley	14.568
15.874	CH Robinson Worldwide Inc	Goldman Sachs	(27.015)	(8.417)	Chegg Inc	Morgan Stanley	(24.578)
1.713	CH Robinson Worldwide Inc	HSBC	(8.068)	(45.974)	Chembio Diagnostics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(460)
9.879	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	(6.915)	(25.567)	Chembio Diagnostics Inc	Barclays Bank	(3.068)
(31.882)	Champions Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.709	(73)	Chemed Corp	Bank of America Merrill Lynch	(880)
(2.664)	Champions Oncology Inc	Barclays Bank	1.971	(4.610)	Chemed Corp	Barclays Bank	11.295
(2.471)	Champions Oncology Inc	Goldman Sachs	1.063	(1.026)	Chemed Corp	Goldman Sachs	(12.374)
14.217	ChampionX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.834)	(14.873)	ChemoCentryx Inc	Barclays Bank	(5.057)
68.362	ChampionX Corp	Barclays Bank	80.667				
28.080	ChampionX Corp	Goldman Sachs	(9.547)				
10.026	ChampionX Corp	HSBC	24.664				
16.479	ChampionX Corp	Morgan Stanley	19.445				
(2.228)	ChannelAdvisor Corp	Barclays Bank	1.470				
(25.246)	ChannelAdvisor Corp	Goldman Sachs	3.030				
(784)	Charles River Laboratories International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.980)				
(1.362)	Charles River Laboratories International Inc	Barclays Bank	(9.289)				
441	Charles River Laboratories International Inc	Barclays Bank	6.172				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(11.014)	ChemoCentrx Inc	Morgan Stanley	(3.744)	175	Chipotle Mexican Grill Inc	Morgan Stanley	5.184
(4.768)	Chemours Co	Bank of America		(4.699)	Choice Hotels International Inc	Barclays Bank	(11.419)
		Merrill Lynch	(5.817)	(731)	Choice Hotels International Inc	Goldman Sachs	(1.784)
(8.289)	Chemours Co	Barclays Bank	(14.008)	8.866	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	20.873
(18.018)	Chemours Co	Goldman Sachs	(21.982)	1.390	ChoiceOne Financial Services Inc	Bank of America	
(4.646)	Chemours Co	Morgan Stanley	(7.852)	2.670	ChoiceOne Financial Services Inc	Merrill Lynch	(195)
(2.185)	Chemung Financial Corp	Bank of America		4.491	ChoiceOne Financial Services Inc	Barclays Bank	(1.121)
		Merrill Lynch	(5.943)	476	ChoiceOne Financial Services Inc	HSBC	943
(5.694)	Chemung Financial Corp	Morgan Stanley	(11.616)	(27.493)	ChromaDex Corp	Morgan Stanley	(200)
(1.579)	Cheniére Energy Inc	Bank of America		(2.658)	ChromaDex Corp	Barclays Bank	(9.897)
		Merrill Lynch	(1.263)	(792)	Chubb Ltd	Goldman Sachs	(2.685)
(1.952)	Cheniére Energy Inc	Barclays Bank	(410)	(3.515)	Chubb Ltd	Merrill Lynch	(2.919)
(5.472)	Cheniére Energy Inc	Goldman Sachs	(4.378)	(3.053)	Chubb Ltd	Barclays Bank	(4.716)
1.571	Cheniére Energy Inc	HSBC	5.059	(1.092)	Chubb Ltd	Goldman Sachs	(12.414)
(5.838)	Cheniére Energy Inc	Morgan Stanley	(1.226)	(886)	Chubb Ltd	HSBC	4.193
(30.414)	Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT)	Bank of America		2.060	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	(64)
		Merrill Lynch	(4.866)	(160)	Church & Dwight Co Inc	Bank of America	
(5.924)	Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(948)	1.446	Church & Dwight Co Inc	Merrill Lynch	(3.269)
(9.883)	Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT)	HSBC	692	(4.411)	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	235
(625)	Cherry Hill Mortgage Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(50)	1.364	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	(2.126)
4.308	Chesapeake Energy Corp	Bank of America		(5.388)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	9.870
		Merrill Lynch	12.105	12.912	Church & Dwight Co Inc	HSBC	(3.718)
7.059	Chesapeake Energy Corp	Barclays Bank	15.021	(3.867)	Churchill Downs Inc	Morgan Stanley	7.920
9.831	Chesapeake Energy Corp	Morgan Stanley	22.120	(419)	Churchill Downs Inc	Morgan Stanley	(18.981)
(2.045)	Chesapeake Utilities Corp	Barclays Bank	4.867	(3.430)	Churchill Downs Inc	Bank of America	
(1.084)	Chesapeake Utilities Corp	Goldman Sachs	2.027	(1.607)	Churchill Downs Inc	Merrill Lynch	(11.012)
(14.520)	Chesapeake Utilities Corp	HSBC	60.258	(3.741)	Chuy's Holdings Inc	Barclays Bank	(65)
(11.899)	Chesapeake Utilities Corp	Morgan Stanley	28.320	34.197	Cidara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(6.643)
(1.727)	Chevron Corp	Barclays Bank	3.126	47.425	Cidara Therapeutics Inc	Merrill Lynch	684
(1.632)	Chevron Corp	Goldman Sachs	11.457	74.154	Cidara Therapeutics Inc	Barclays Bank	949
1.348	Chevron Corp	Goldman Sachs	(89)	40.100	Cidara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1.483
(330)	Chevron Corp	Morgan Stanley	597	7.859	Ciena Corp	HSBC	3.981
(6.544)	Chewy Inc 'A'	Barclays Bank	(12.499)	34.803	Ciena Corp	Barclays Bank	(4.637)
(9.105)	Chewy Inc 'A'	Morgan Stanley	(17.391)	3.009	Cigna Corp	Goldman Sachs	28.190
1.553	Chicken Soup For The Soul Entertainment Inc	Barclays Bank	2.966	4.722	Cigna Corp	Barclays Bank	(7.579)
(24.316)	Chico's FAS Inc	Bank of America		76	Cigna Corp	Goldman Sachs	(23.006)
		Merrill Lynch	(5.350)	3.152	Cigna Corp	HSBC	(613)
(51.030)	Chico's FAS Inc	Goldman Sachs	(11.227)	798	Cimpress Plc	Morgan Stanley	(8.447)
(10.900)	Chico's FAS Inc	Morgan Stanley	(4.142)	606	Cimpress Plc	Bank of America	
(5.630)	Children's Place Inc	Bank of America		7.188	Cimpress Plc	Merrill Lynch	(3.503)
		Merrill Lynch	(16.665)	1.188	Cimpress Plc	Barclays Bank	1.005
(2.898)	Children's Place Inc	Barclays Bank	6.694	1.001	Cimpress Plc	Goldman Sachs	(31.555)
(4.601)	Children's Place Inc	Goldman Sachs	(13.619)	7.702	Cincinnati Financial Corp	HSBC	1.093
(157.273)	Chimera Investment Corp (REIT)	Bank of America		15.063	Cinemark Holdings Inc	Morgan Stanley	2.132
		Merrill Lynch	(83.354)	40.140	Cinemark Holdings Inc	Bank of America	6.007
(9.154)	Chimera Investment Corp (REIT)	Barclays Bank	(2.655)	6.280	Cinemark Holdings Inc	Merrill Lynch	8.887
(47.824)	Chimera Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(25.347)	927	Cinemark Holdings Inc	Barclays Bank	292
(16.819)	Chimera Investment Corp (REIT)	HSBC	(11.101)	13.015	Cinemark Holdings Inc	Goldman Sachs	3.705
(89.243)	Chimera Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(25.880)	1.343	Cintas Corp	HSBC	476
(12.698)	Chimerix Inc	Bank of America		807	Cintas Corp	Morgan Stanley	260
		Merrill Lynch	4.571	1.570	Cintas Corp	Barclays Bank	(1.343)
(5.767)	Chimerix Inc	Barclays Bank	288			Goldman Sachs	1.211
(5.699)	Chimerix Inc	Goldman Sachs	2.052			HSBC	(11.304)
1.840	Chinook Therapeutics Inc	Barclays Bank	(2.742)				
2.984	Chinook Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(656)				
4.665	Chinook Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(6.951)				
491	Chipotle Mexican Grill Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	19.188				
17	Chipotle Mexican Grill Inc	Barclays Bank	504				
1.894	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs	76.517				
103	Chipotle Mexican Grill Inc	HSBC	4.239				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
2.194	Cintas Corp	Morgan Stanley	(2.194)	4.537	Clean Energy Fuels Corp	Barclays Bank	(181)
(7.579)	CIRCOR International Inc	Bank of America Merrill Lynch	909	15.247	Clean Energy Fuels Corp	HSBC	2.813
(9.405)	CIRCOR International Inc	Barclays Bank	(2.822)	2.867	Clean Energy Fuels Corp	Morgan Stanley	(220)
(6.646)	CIRCOR International Inc	Goldman Sachs	798	(8.800)	Clean Harbors Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.424
(484)	CIRCOR International Inc	Morgan Stanley	47	3.261	Clean Harbors Inc	Bank of America Merrill Lynch	369
18.831	Cirrus Logic Inc	Barclays Bank	31.260	(13.986)	Clean Harbors Inc	Barclays Bank	7.832
4.791	Cirrus Logic Inc	Goldman Sachs	18.254	(12.831)	Clean Harbors Inc	Goldman Sachs	9.367
11.231	Cirrus Logic Inc	HSBC	36.301	3.516	Clean Harbors Inc	Goldman Sachs	(880)
2.263	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	3.757	8.377	Clean Harbors Inc	Morgan Stanley	2.070
(28.008)	Cisco Systems Inc - CDI	Goldman Sachs	1.120	(12.085)	Cleantech Inc	Barclays Bank	(8.327)
(1.142)	Cisco Systems Inc - CDI	HSBC	297	(1.560)	Clearfield Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.323)
15.637	Cisco Systems Inc - CDI	Morgan Stanley	(7.662)	(1.785)	Clearfield Inc	Barclays Bank	(2.892)
(6.512)	Cisco Systems Inc - CDI	Morgan Stanley	3.191	(1.099)	Clearfield Inc	Goldman Sachs	(2.341)
(280)	Citi Trends Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.539	(14.317)	ClearPoint Neuro Inc	Barclays Bank	(859)
(1.088)	Citi Trends Inc	Barclays Bank	7.148	5.510	Clearwater Paper Corp	Barclays Bank	(10.249)
(4.755)	Citi Trends Inc	Goldman Sachs	77.079	12.004	Clearway Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	13.565
(1.270)	Citigroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.638)	9.722	Clearway Energy Inc 'A'	Barclays Bank	3.111
(3.678)	Citigroup Inc	Barclays Bank	(2.501)	8.992	Clearway Energy Inc 'A'	HSBC	9.477
(6.960)	Citigroup Inc	Morgan Stanley	(4.733)	1.104	Clearway Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	353
(28.085)	Citizens & Northern Corp	Bank of America Merrill Lynch	17.132	1.210	Clearway Energy Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	1.295
(9.307)	Citizens & Northern Corp	Morgan Stanley	1.303	23.441	Clearway Energy Inc 'C'	Barclays Bank	3.047
9.022	Citizens Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.578)	2.386	Clearway Energy Inc 'C'	Goldman Sachs	2.553
(5.009)	Citizens Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.208	24.273	Clearway Energy Inc 'C'	HSBC	23.788
18.996	Citizens Financial Group Inc	Barclays Bank	11.018	4.790	Clearway Energy Inc 'C'	Morgan Stanley	623
(4.446)	Citizens Financial Group Inc	Barclays Bank	(2.579)	(11.554)	Clene Inc	Barclays Bank	(28.769)
46.836	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs	(39.342)	(7.746)	Clene Inc	Goldman Sachs	(21.766)
(8.180)	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs	(62)	7.451	Cleveland-Cliffs Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.038
19.407	Citizens Financial Group Inc	Morgan Stanley	11.256	(3.058)	Cleveland-Cliffs Inc	Barclays Bank	(4.770)
(944)	Citizens Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	208	35.780	Cleveland-Cliffs Inc	Barclays Bank	42.546
(4.421)	Citizens Holding Co	Barclays Bank	3.095	2.908	Cleveland-Cliffs Inc	Goldman Sachs	(2.239)
(9.485)	Citizens Holding Co	Goldman Sachs	2.087	60.325	Clipper Realty Inc (REIT)	Barclays Bank	2.413
12.191	Citizens Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.479)	30.431	Clipper Realty Inc (REIT)	Goldman Sachs	(4.565)
63.873	Citizens Inc	Barclays Bank	(15.237)	6.055	Clipper Realty Inc (REIT)	HSBC	(2.301)
11.324	Citizens Inc	Goldman Sachs	(4.303)	28.762	Clipper Realty Inc (REIT)	Morgan Stanley	1.150
8.602	Citizens Inc	HSBC	(2.683)	4.035	Clorox Co	Goldman Sachs	(15.141)
9.566	Citizens Inc	Morgan Stanley	(338)	1.231	Clorox Co	HSBC	(13.861)
(907)	Citrix Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.732	20.785	Cloudera Inc	Bank of America Merrill Lynch	19.330
(698)	Citrix Systems Inc	Barclays Bank	614	34.415	Cloudera Inc	Barclays Bank	8.604
(1.974)	Citrix Systems Inc	Goldman Sachs	3.770	32.645	Cloudera Inc	Goldman Sachs	30.360
(2.908)	Citrix Systems Inc	Morgan Stanley	2.559	9.653	Cloudera Inc	HSBC	11.004
(14.121)	City Holding Co	Morgan Stanley	(13.274)	12.961	Cloudera Inc	Morgan Stanley	3.240
(9.804)	Civeo Corp	Bank of America Merrill Lynch	10.686	1.349	Cloudflare Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	14.974
(2.449)	Civeo Corp	Goldman Sachs	2.669	3.884	Cloudflare Inc 'A'	Barclays Bank	8.068
(1.318)	Civeo Corp	Morgan Stanley	514	328	Cloudflare Inc 'A'	Goldman Sachs	3.641
20.737	Civista Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	415	3.203	Cloudflare Inc 'A'	Morgan Stanley	10.186
17.737	Civista Bancshares Inc	Barclays Bank	1.064	27.829	Clover Health Investments Corp	Barclays Bank	20.037
22.161	Civista Bancshares Inc	Goldman Sachs	443	24.234	Clover Health Investments Corp	Goldman Sachs	19.872
18.260	Civista Bancshares Inc	HSBC	16.251	14.880	Clovis Oncology Inc	Goldman Sachs	(11.011)
26.093	Civista Bancshares Inc	Morgan Stanley	1.566	1.806	Clovis Oncology Inc	Morgan Stanley	117
1.327	Clarivate Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.030	6.722	CMC Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.133
2.838	Clarivate Plc	Barclays Bank	(449)	4.915	CMC Materials Inc	Barclays Bank	1.117
(9.134)	Clarivate Plc	Barclays Bank	977	1.921	CMC Materials Inc	Goldman Sachs	5.681
4.254	Clarivate Plc	Goldman Sachs	5.715	(2.204)	CMC Materials Inc	HSBC	(2.645)
3.000	Clarivate Plc	Morgan Stanley	1.050	770	CMC Materials Inc	HSBC	875
(2.719)	Clarus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.063)	(768)	CMC Materials Inc	Morgan Stanley	(369)
(1.088)	Clarus Corp	Barclays Bank	(914)	2.478	CMC Materials Inc	Morgan Stanley	1.640
(50.082)	Clarus Corp	Morgan Stanley	(42.069)	1.275	CME Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.971
				4.753	CME Group Inc	Barclays Bank	6.892

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.531	CME Group Inc	Goldman Sachs	3.567	6.721	Cognex Corp	Bank of America	
(528)	CME Group Inc	Goldman Sachs	(636)			Merrill Lynch	35.487
719	CME Group Inc	HSBC	7.700	3.192	Cognex Corp	Barclays Bank	6.512
(1.136)	CME Group Inc	Morgan Stanley	(194)	2.000	Cognex Corp	Goldman Sachs	10.560
10.682	CMS Energy Corp	Bank of America		8.028	Cognex Corp	HSBC	24.325
		Merrill Lynch	(2.293)	11.837	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Bank of America	
6.216	CMS Energy Corp	Barclays Bank	(6.402)			Merrill Lynch	10.742
30.847	CMS Energy Corp	Goldman Sachs	(7.256)	1.929	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Barclays Bank	887
42.676	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	(43.957)	11.697	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Goldman Sachs	10.820
(12.070)	CNA Financial Corp	Bank of America		(4.184)	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	HSBC	10.251
(18.219)	CNA Financial Corp	Merrill Lynch	(6.365)	1.705	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	HSBC	(1.378)
(612)	CNA Financial Corp	Barclays Bank	(1.640)	(13.665)	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Morgan Stanley	(6.286)
(35.376)	CNA Financial Corp	Goldman Sachs	(233)	32.890	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Morgan Stanley	15.129
(1.342)	CNB Financial Corp	Morgan Stanley	(9.197)	1.509	Cognite Software Ltd	Goldman Sachs	2.927
(8.137)	CNB Financial Corp	Bank of America		7.346	Cognite Software Ltd	Morgan Stanley	8.374
(8.304)	CNB Financial Corp	Merrill Lynch	1.476	(107.211)	Cohbar Inc	Barclays Bank	6.433
(8.772)	CNB Financial Corp	Barclays Bank	1.383	5.012	Cohen & Steers Inc	Bank of America	
(57.328)	CNO Financial Group Inc	Goldman Sachs	9.134			Merrill Lynch	3.809
4.385	CNX Resources Corp	Morgan Stanley	1.491	5.174	Cohen & Steers Inc	Barclays Bank	(108)
		Barclays Bank	562	3.037	Cohen & Steers Inc	Goldman Sachs	2.308
		Merrill Lynch	(4.341)	8.948	Cohen & Steers Inc	HSBC	25.754
5.547	CNX Resources Corp	Barclays Bank	(1.609)	10.343	Cohen & Steers Inc	Morgan Stanley	1.551
8.047	CNX Resources Corp	Goldman Sachs	(7.967)	(553)	Coherent Inc	Bank of America	
3.504	CNX Resources Corp	HSBC	(491)			Merrill Lynch	(1.604)
8.957	Coastal Financial Corp	Morgan Stanley	3.852	(398)	Coherent Inc	Barclays Bank	(494)
(23.059)	Coca-Cola Co	Barclays Bank	(11.299)	403	Coherent Inc	Barclays Bank	500
(2.048)	Coca-Cola Consolidated Inc	Morgan Stanley	(76.841)	320	Coherent Inc	Goldman Sachs	254
(2.603)	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Barclays Bank	677	235	Coherent Inc	HSBC	753
(7.170)	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Goldman Sachs	6.525	(1.515)	Coherent Inc	Morgan Stanley	(1.879)
(6.534)	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Morgan Stanley	1.699	24.466	Coherus Biosciences Inc	Bank of America	
(17.831)	Coda Octopus Group Inc	Barclays Bank	(10.164)			Merrill Lynch	(23.977)
(9.400)	Coda Octopus Group Inc	Goldman Sachs	(6.956)	11.918	Coherus Biosciences Inc	Barclays Bank	(358)
(3.489)	Coda Octopus Group Inc	HSBC	(2.547)	1.857	Coherus Biosciences Inc	Goldman Sachs	(1.820)
(2.093)	Coda Octopus Group Inc	Morgan Stanley	(1.193)	1.778	Coherus Biosciences Inc	HSBC	(1.991)
20.685	Codexis Inc	Goldman Sachs	47.989	17.550	Coherus Biosciences Inc	Morgan Stanley	(527)
7.932	Codexis Inc	HSBC	23.955	(2.329)	Cohu Inc	Bank of America	
6.597	Codexis Inc	Morgan Stanley	5.607			Merrill Lynch	(1.689)
(14.359)	Co-Diagnostics Inc	Barclays Bank	(574)	(1.781)	Cohu Inc	Barclays Bank	(614)
(354)	Co-Diagnostics Inc	Goldman Sachs	120	(4.033)	Cohu Inc	Goldman Sachs	(3.219)
(2.954)	Codiak Biosciences Inc	Barclays Bank	(6.322)	(21.579)	Cohu Inc	Morgan Stanley	(4.236)
(1.865)	Codiak Biosciences Inc	Goldman Sachs	(4.475)	(6.427)	Colfax Corp	Bank of America	
(1.975)	Codiak Biosciences Inc	Morgan Stanley	(2.752)			Merrill Lynch	368
(10.901)	Codorus Valley Bancorp Inc	Bank of America		(8.289)	Colfax Corp	Barclays Bank	(1.654)
		Merrill Lynch	(4.469)	(6.479)	Colfax Corp	Goldman Sachs	(788)
(4.747)	Codorus Valley Bancorp Inc	Barclays Bank	(133)	(15.079)	Colfax Corp	Morgan Stanley	3.196
(10.661)	Codorus Valley Bancorp Inc	Goldman Sachs	(3.406)	5.806	Colfax Corp	Morgan Stanley	—
(6.145)	Codorus Valley Bancorp Inc	HSBC	(2.642)	3.781	Colgate-Palmolive Co	Bank of America	
(4.860)	Codorus Valley Bancorp Inc	Morgan Stanley	(146)			Merrill Lynch	870
(17.850)	Coeur Mining Inc	Bank of America		13.123	Colgate-Palmolive Co	Barclays Bank	(8.136)
		Merrill Lynch	(179)	24.497	Colgate-Palmolive Co	Goldman Sachs	5.634
(9.980)	Coeur Mining Inc	Barclays Bank	(1.497)	5.840	Colgate-Palmolive Co	HSBC	2.570
(9.401)	Coeur Mining Inc	HSBC	(12.221)	14.514	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	(8.999)
(36.001)	Coeur Mining Inc	Morgan Stanley	(5.400)	11.161	Collegium Pharmaceutical Inc	Bank of America	
(23.534)	Cogent Biosciences Inc	Bank of America				Merrill Lynch	7.925
		Merrill Lynch	(10.826)	16.233	Collegium Pharmaceutical Inc	Barclays Bank	(9.131)
(7.196)	Cogent Communications Holdings Inc	Bank of America		5.193	Collegium Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	5.712
		Merrill Lynch	(2.255)	7.445	Collegium Pharmaceutical Inc	HSBC	14.134
1.699	Cogent Communications Holdings Inc	Barclays Bank	1.274	15.106	Collegium Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	(5.628)
(7.705)	Cogent Communications Holdings Inc	Barclays Bank	(5.779)				
2.790	Cogent Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	530				
(1.785)	Cogent Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	(339)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
4.354	Colony Bankcorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.919	31.911	Community Bankers Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7.020)
13.125	Colony Bankcorp Inc	Barclays Bank	(4.331)	32.061	Community Bankers Trust Corp	Barclays Bank	321
14.091	Colony Bankcorp Inc	Goldman Sachs	12.682	33.776	Community Bankers Trust Corp	Goldman Sachs	(7.431)
9.497	Colony Bankcorp Inc	HSBC	17.854	51.249	Community Bankers Trust Corp	Morgan Stanley	512
13.083	Colony Bankcorp Inc	Morgan Stanley	(4.317)	(1.554)	Community Financial Corp	Goldman Sachs	1.336
40.618	Colony Capital Inc (REIT)	Barclays Bank	2.031	(5.345)	Community Financial Corp	HSBC	(6.147)
11.609	Colony Capital Inc (REIT)	Morgan Stanley	580	(2.855)	Community Financial Corp	Morgan Stanley	514
(13.527)	Colony Credit Real Estate Inc (REIT)	Goldman Sachs	(406)	(7.672)	Community Health Systems Inc	Morgan Stanley	(3.989)
(10.905)	Colony Credit Real Estate Inc (REIT)	HSBC	(4.144)	(6.828)	Community Healthcare Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	2.526
(44.318)	Colony Credit Real Estate Inc (REIT)	Morgan Stanley	(443)	15.086	Community Trust Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13.879)
(26.596)	Columbia Banking System Inc	Morgan Stanley	(7.979)	25.468	Community Trust Bancorp Inc	Barclays Bank	(11.206)
(32.997)	Columbia Financial Inc	Barclays Bank	(10.229)	15.468	Community Trust Bancorp Inc	Goldman Sachs	(14.231)
(55.664)	Columbia Financial Inc	Goldman Sachs	16.143	10.915	Community Trust Bancorp Inc	HSBC	(4.803)
(62.326)	Columbia Financial Inc	HSBC	1.247	35.972	Community Trust Bancorp Inc	Morgan Stanley	(15.828)
(76.433)	Columbia Financial Inc	Morgan Stanley	(23.694)	9.894	CommVault Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	76.184
(27.223)	Columbia Property Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	11.480	15.844	CommVault Systems Inc	Goldman Sachs	121.999
(36.370)	Columbia Property Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	18.185	4.773	CommVault Systems Inc	HSBC	48.303
(42.151)	Columbia Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	19.826	1.526	CommVault Systems Inc	Morgan Stanley	2.243
(3.608)	Columbia Property Trust Inc (REIT)	HSBC	1.624	(1.419)	Compass Minerals International Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.788
(2.884)	Columbia Property Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	1.442	(7.576)	Compass Minerals International Inc	Barclays Bank	(3.864)
(5.934)	Columbia Sportswear Co	Goldman Sachs	18.692	(3.749)	Compass Minerals International Inc	Goldman Sachs	4.724
3.400	Columbus McKinnon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10.472)	(6.331)	Compass Minerals International Inc	HSBC	(4.685)
3.867	Columbus McKinnon Corp	Barclays Bank	(6.806)	(9.524)	Compass Minerals International Inc	Morgan Stanley	(4.857)
25.979	Columbus McKinnon Corp	HSBC	(29.876)	(9.036)	Computer Programs and Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.078)
15.007	Columbus McKinnon Corp	Morgan Stanley	(26.412)	(4.845)	Computer Programs and Systems Inc	Barclays Bank	(2.229)
20.097	Comcast Corp 'A'	Barclays Bank	33.763	(22.903)	Computer Programs and Systems Inc	Goldman Sachs	(5.268)
51.674	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	109.445	(2.220)	Computer Programs and Systems Inc	HSBC	(4.684)
33.172	Comcast Corp 'A'	Morgan Stanley	53.775	(15.662)	Computer Programs and Systems Inc	Morgan Stanley	(7.205)
(2.830)	Comerica Inc	Goldman Sachs	3.283	862	CompX International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.052)
13.358	Comerica Inc	Morgan Stanley	16.564	5.581	CompX International Inc	Barclays Bank	502
(960)	Comerica Inc	Morgan Stanley	(1.190)	2.748	CompX International Inc	Goldman Sachs	(6.540)
2.142	Comfort Systems USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(236)	4.049	CompX International Inc	Morgan Stanley	364
1.501	Comfort Systems USA Inc	Barclays Bank	3.182	80.718	comScore Inc	Barclays Bank	(3.229)
1.019	Comfort Systems USA Inc	Goldman Sachs	(112)	10.055	comScore Inc	Goldman Sachs	3.519
5.727	Comfort Systems USA Inc	HSBC	(19.357)	(5.870)	Comstock Mining Inc	Morgan Stanley	(1.644)
9.752	Comfort Systems USA Inc	Morgan Stanley	20.674	(28.141)	Comstock Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	14.071
(3.428)	Commerce Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.582	(14.604)	Comstock Resources Inc	Barclays Bank	2.045
(9.871)	Commerce Bancshares Inc	Barclays Bank	(3.660)	(1.213)	Comtech Telecommunications Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.722)
(12.087)	Commerce Bancshares Inc	Goldman Sachs	4.713	(14.462)	Comtech Telecommunications Corp	Barclays Bank	(24.441)
(3.705)	Commerce Bancshares Inc	HSBC	6.632	(13.840)	Comtech Telecommunications Corp	Goldman Sachs	(19.653)
(2.629)	Commerce Bancshares Inc	Morgan Stanley	684	33.730	Conagra Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.629
(15.725)	Commercial Metals Co	Bank of America Merrill Lynch	22.801	17.169	Conagra Brands Inc	Barclays Bank	(2.232)
1.785	Commercial Metals Co	Bank of America Merrill Lynch	(2.588)				
47.221	Commercial Metals Co	Barclays Bank	472				
28.056	Commercial Metals Co	HSBC	(26.653)				
17.784	Commercial Metals Co	Morgan Stanley	178				
(12.533)	Commercial Vehicle Group Inc	HSBC	20.679				
(6.471)	CommScope Holding Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.295)				
(9.271)	CommScope Holding Co Inc	Barclays Bank	(13.536)				
(23.405)	CommScope Holding Co Inc	Goldman Sachs	(44.470)				
(5.919)	CommScope Holding Co Inc	Morgan Stanley	(8.642)				
(1.555)	Community Bank System Inc	Morgan Stanley	(482)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
32.560	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs	11.265	(14.417)	Construction Partners Inc	Bank of America	
6.408	Conagra Brands Inc	HSBC	(961)		'A'	Merrill Lynch	(8.085)
77.371	Conagra Brands Inc	Morgan Stanley	(10.058)	(21.140)	Construction Partners Inc	Barclays Bank	(17.335)
(291)	Concentrix Corp	Bank of America			'A'	Goldman Sachs	(11.055)
803	Concentrix Corp	Merrill Lynch	(501)	(16.571)	Construction Partners Inc	Morgan Stanley	(16.136)
(479)	Concentrix Corp	Barclays Bank	771		'A'		
440	Concentrix Corp	Barclays Bank	(460)	(26.816)	Construction Partners Inc		
1.497	Concentrix Corp	Goldman Sachs	757		'A'		
(1.859)	Concentrix Corp	Goldman Sachs	1.437	37.629	Consumer Portfolio		
(3.892)	Concert Pharmaceuticals	Morgan Stanley	(1.785)	(6.023)	Services Inc	Morgan Stanley	4.139
	Inc	Goldman Sachs	39		Container Store Group Inc	Bank of America	
(9.925)	Concert Pharmaceuticals			(18.158)	Container Store Group Inc	Merrill Lynch	(1.807)
(15.111)	Concert Pharmaceuticals	HSBC	(2.481)	(14.743)	Container Store Group Inc	Barclays Bank	(13.074)
	Inc			(22.671)	Contango Oil & Gas Co	Goldman Sachs	(3.732)
(2.424)	Concrete Pumping Holdings	Morgan Stanley	(604)	9.446	ContextLogic Inc 'A'	Barclays Bank	(2.267)
	Inc	Bank of America		5.942	Continental Resources Inc	Bank of America	
(20.214)	Concrete Pumping Holdings	Merrill Lynch	24			Merrill Lynch	5.282
	Inc	Barclays Bank	3.639	7.546	Continental Resources Inc	Barclays Bank	4.754
(16.150)	Concrete Pumping Holdings			8.096	Continental Resources Inc	Goldman Sachs	4.939
	Inc	HSBC	(969)	21.113	Continental Resources Inc	Morgan Stanley	13.301
14.163	Conduent Inc	Bank of America	5.240	(55.459)	ContraFect Corp	Goldman Sachs	(11.092)
87.348	Conduent Inc	Merrill Lynch	32.319	(448)	Cooper Cos Inc	Barclays Bank	470
9.457	Conduent Inc	Goldman Sachs	2.648	(1.674)	Cooper Cos Inc	Morgan Stanley	1.758
25.728	Conduent Inc	HSBC	5.403	(4.702)	Cooper Tire & Rubber Co	Bank of America	
(958)	CONMED Corp	Bank of America				Merrill Lynch	2.915
		Merrill Lynch	(389)	(7.476)	Cooper Tire & Rubber Co	Barclays Bank	(3.738)
(2.938)	CONMED Corp	Barclays Bank	2.491	(4.823)	Cooper Tire & Rubber Co	Goldman Sachs	2.990
(2.439)	CONMED Corp	Goldman Sachs	1.094	(30.160)	Cooper Tire & Rubber Co	Morgan Stanley	(15.080)
(3.211)	ConnectOne Bancorp Inc	Bank of America		6.911	Cooper-Standard Holdings		
		Merrill Lynch	1.349		Inc	Morgan Stanley	2.419
(7.720)	ConnectOne Bancorp Inc	Barclays Bank	386	29.024	Copa Holdings SA 'A'	Goldman Sachs	(21.768)
(9.201)	ConnectOne Bancorp Inc	Barclays Bank	3.864	7.404	Copa Holdings SA 'A'	Morgan Stanley	8.070
(26.648)	ConnectOne Bancorp Inc	Goldman Sachs	(1.066)	16.824	Copart Inc	Barclays Bank	14.637
(7.859)	ConnectOne Bancorp Inc	HSBC	393	11.694	Copart Inc	Goldman Sachs	70.865
4.528	Conn's Inc	HSBC	2.852	4.439	Copart Inc	HSBC	26.190
926	Conn's Inc	Morgan Stanley	1.509	9.923	Copart Inc	Morgan Stanley	8.633
(17.952)	ConocoPhillips	Barclays Bank	45.957	53.890	Corbus Pharmaceuticals		
(16.804)	ConocoPhillips	Bank of America	6.049		Holdings Inc	Barclays Bank	25.867
(6.540)	ConocoPhillips	Barclays Bank	16.742	9.724	Corbus Pharmaceuticals		
(60.641)	Consolidated Communications	Barclays Bank	(6.671)	24.917	Holdings Inc	Goldman Sachs	5.640
(30.019)	Consolidated Communications	Goldman Sachs	(4.520)		Holdings Inc	HSBC	14.950
	Holdings Inc	Barclays Bank		(16.026)	Corecept Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(6.410)
(41.091)	Consolidated Communications	Barclays Bank	(8.405)	(33.508)	CoreCivic Inc (REIT)	Barclays Bank	1.005
	Holdings Inc			(40.243)	CoreCivic Inc (REIT)	Goldman Sachs	12.073
14.882	Consolidated Edison Inc	Barclays Bank	8.422	(31.037)	CoreCivic Inc (REIT)	Morgan Stanley	596
8.081	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs	(9.212)	(4.788)	CoreLogic Inc	Morgan Stanley	575
3.778	Consolidated Edison Inc	Barclays Bank	(5.629)	(242)	Core-Mark Holding Co Inc	HSBC	(787)
5.915	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs	(15.438)	(14.660)	Core-Mark Holding Co Inc	Morgan Stanley	2.199
36.902	Consolidated Edison Inc	HSBC	(42.068)	93.067	CorePoint Lodging Inc		
(27.051)	Consolidated Water Co Ltd	Barclays Bank	(20.829)		(REIT)	Goldman Sachs	14.891
(56.146)	Consolidated Water Co Ltd	Barclays Bank	8.422	80.806	CorePoint Lodging Inc		
(56.967)	Consolidated Water Co Ltd	Goldman Sachs	(43.560)		(REIT)	Morgan Stanley	24.493
(3.899)	Consolidated Water Co Ltd	Goldman Sachs	59	(1.579)	CoreSite Realty Corp	Bank of America	
1.023	Constellation Brands Inc 'A'	Morgan Stanley			(REIT)	Merrill Lynch	(7.058)
		Bank of America		1.066	CoreSite Realty Corp	Bank of America	
1.077	Constellation Brands Inc 'A'	Merrill Lynch	7.575		(REIT)	Merrill Lynch	4.765
695	Constellation Brands Inc 'A'	Barclays Bank	3.489	(117)	CoreSite Realty Corp		
(495)	Constellation Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	2.056		(REIT)	Barclays Bank	(158)
(962)	Constellation	Morgan Stanley	(1.604)	304	CoreSite Realty Corp	Barclays Bank	410
	Pharmaceuticals Inc				(REIT)		
(2.880)	Constellation	Barclays Bank	202	(1.995)	CoreSite Realty Corp	Goldman Sachs	(8.918)
	Pharmaceuticals Inc	HSBC	(144)	1.462	CoreSite Realty Corp	Goldman Sachs	6.535
				(6.131)	CoreSite Realty Corp	HSBC	(17.903)
					(REIT)		

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
3.663	CoreSite Realty Corp (REIT)	HSBC	10.696	20.696	Covenant Logistics Group	Barclays Bank	(5.795)
(4.694)	CoreSite Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	(6.337)	3.448	Covenant Logistics Group Inc	Goldman Sachs	(3.689)
2.223	CoreSite Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	3.001	20.596	Covenant Logistics Group Inc	Morgan Stanley	(5.767)
(16.361)	CorMedix Inc	Barclays Bank	(4.908)	5.018	Covetrus Inc	Bank of America	
7.465	Cornerstone Building Brands Inc	Bank of America				Merrill Lynch	4.236
15.589	Cornerstone Building Brands Inc	Barclays Bank	(7.327)	4.629	Covetrus Inc	Barclays Bank	6.666
28.366	Cornerstone Building Brands Inc	Goldman Sachs	42.549	12.282	Covetrus Inc	Goldman Sachs	18.708
10.817	Cornerstone Building Brands Inc	HSBC	19.579	(2.304)	Covetrus Inc	HSBC	(1.290)
12.293	Cornerstone Building Brands Inc	Morgan Stanley	(5.778)	713	Covetrus Inc	HSBC	932
(601)	Cornerstone OnDemand Inc	Barclays Bank	493	(5.237)	Covetrus Inc	Morgan Stanley	(7.541)
(3.819)	Cornerstone OnDemand Inc	HSBC	(7.676)	4.205	Covetrus Inc	Morgan Stanley	6.055
(18.140)	Cornerstone OnDemand Inc	Morgan Stanley	14.875	4.203	Cowen Inc 'A'	Bank of America	
(1.305)	Corning Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(9.121)
(565)	Corning Inc	Barclays Bank	215	9.134	Cowen Inc 'A'	Barclays Bank	(822)
(21.019)	Corning Inc	Goldman Sachs	11.771	3.608	Cowen Inc 'A'	Goldman Sachs	(7.829)
(9.783)	Corning Inc	HSBC	15.751	6.194	Cowen Inc 'A'	Morgan Stanley	(557)
(3.481)	Corsair Gaming Inc	Barclays Bank	70	(10.772)	CPS Technologies Corp	Barclays Bank	(5.601)
1.920	Corsair Gaming Inc	HSBC	(442)	(1.891)	CPS Technologies Corp	Goldman Sachs	(1.210)
4.600	Corteve Inc	Barclays Bank	1.610	(4.677)	CRA International Inc	Bank of America	
6.155	Corteve Inc	Goldman Sachs	(4.432)			Merrill Lynch	(2.274)
(9.164)	Cortexyme Inc	Barclays Bank	(11.822)	(4.939)	CRA International Inc	Barclays Bank	4.443
(266)	CorVel Corp	Barclays Bank	(1.612)	(2.186)	CRA International Inc	Goldman Sachs	(62)
(550)	CorVel Corp	Morgan Stanley	(3.531)	(2.284)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Barclays Bank	4.876
26.482	Corvus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	6.621	(1.588)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Goldman Sachs	(621)
(64.227)	Costamare Inc	Barclays Bank	429	(3.266)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	HSBC	5.585
(72.684)	Costamare Inc	Goldman Sachs	(28.347)	(4.399)	Crane Co	Bank of America	
(820)	CoStar Group Inc	Barclays Bank	(7.201)			Merrill Lynch	8.358
(257)	CoStar Group Inc	Goldman Sachs	(3.068)	(913)	Crane Co	Barclays Bank	630
(1.516)	CoStar Group Inc	Morgan Stanley	(14.660)	(12.815)	Crane Co	Goldman Sachs	24.348
5.583	Costco Wholesale Corp	Bank of America		(6.328)	Crane Co	HSBC	19.617
		Merrill Lynch	(31.767)	(3.393)	Crane Co	Morgan Stanley	2.341
4.870	Costco Wholesale Corp	Barclays Bank	(25.227)	34.659	Crawford & Co 'A'	Bank of America	
(5.631)	Costco Wholesale Corp	Barclays Bank	29.169			Merrill Lynch	(10.181)
3.952	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs	(22.487)	66.884	Crawford & Co 'A'	Barclays Bank	3.260
(2.265)	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs	12.888	32.638	Crawford & Co 'A'	Goldman Sachs	(8.898)
1.334	Costco Wholesale Corp	HSBC	(4.282)	39.494	Crawford & Co 'A'	HSBC	2.290
5.169	Costco Wholesale Corp	Morgan Stanley	(26.775)	21.594	Crawford & Co 'A'	Morgan Stanley	1.512
(986)	Costco Wholesale Corp	Morgan Stanley	5.584	(2.216)	Crawford & Co 'B'	Bank of America	
5.097	Coty Inc 'A'	Goldman Sachs	1.071	(10.912)	Crawford & Co 'B'	Merrill Lynch	44
6.894	Coty Inc 'A'	HSBC	(620)	(909)	Credicorp Ltd	Goldman Sachs	218
20.174	Coty Inc 'A'	Morgan Stanley	5.245	(556)	Credicorp Ltd	Merrill Lynch	6.181
(7.451)	County Bancorp Inc	Barclays Bank	(3.353)	(907)	Credicorp Ltd	Barclays Bank	(3.036)
3.981	Coupa Software Inc	Goldman Sachs	42.285	(939)	Credicorp Ltd	HSBC	(3.601)
8.167	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	(7.300)	359	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	(5.127)
1.049	Coursera Inc	Bank of America		(1.397)	Credit Acceptance Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	94	135	Credit Acceptance Corp	Merrill Lynch	6.361
(1.231)	Coursera Inc	Barclays Bank	(616)	3.243	Cree Inc	Barclays Bank	(14.738)
8.430	Coursera Inc	Goldman Sachs	759			Morgan Stanley	1.424
(3.103)	Coursera Inc	HSBC	(238)	295	Cree Inc	Bank of America	
10.500	Coursera Inc	Morgan Stanley	5.250	276	Cree Inc	Merrill Lynch	30.322
(17.248)	Cousins Properties Inc (REIT)	HSBC	(18.455)	129	Cree Inc	Barclays Bank	873
(17.592)	Cousins Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(2.814)	4.155	Cree Inc	Goldman Sachs	1.233
(54.315)	Covanta Holding Corp	Bank of America		10.637	Crinetics Pharmaceuticals Inc	HSBC	1.024
		Merrill Lynch	16.295			Morgan Stanley	12.299
(37.604)	Covanta Holding Corp	Barclays Bank	10.905	10.596	Crocs Inc	Morgan Stanley	7.765
(6.870)	Covanta Holding Corp	Goldman Sachs	2.061	17.005	Crocs Inc	Barclays Bank	(6.993)
(68.439)	Covanta Holding Corp	Morgan Stanley	19.847	10.289	Crocs Inc	HSBC	(50.845)
6.409	Covenant Logistics Group Inc	Bank of America		23.467	Cross Country Healthcare Inc	Morgan Stanley	(6.791)
		Merrill Lynch	(6.858)	8.701	Cross Country Healthcare Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(10.616)
						Morgan Stanley	174

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.358)	CrossFirst Bankshares Inc	Barclays Bank	244	10.487	Cue Biopharma Inc	Morgan Stanley	105
(60.265)	CrossFirst Bankshares Inc	Goldman Sachs	16.573	(3.346)	Cullen/Frost Bankers Inc	Goldman Sachs	12.949
(137)	CrossFirst Bankshares Inc	HSBC	(38)	(2.290)	Cullen/Frost Bankers Inc	Morgan Stanley	1.832
(33.476)	CrossFirst Bankshares Inc	Morgan Stanley	6.026	4.617	Cullinan Oncology Inc	Bank of America	
(493)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	513			Merrill Lynch	6.279
(1.405)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(47.236)	2.526	Cullinan Oncology Inc	Barclays Bank	3.082
(2.792)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	HSBC	(96.519)	5.311	Cullinan Oncology Inc	Goldman Sachs	7.223
(1.561)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(12.176)	6.642	Culp Inc	Bank of America	
1.450	Crown Castle International Corp (REIT)	Bank of America				Merrill Lynch	10.760
		Merrill Lynch	(51)	10.492	Culp Inc	Barclays Bank	5.036
438	Crown Castle International Corp (REIT)	Barclays Bank	1.428	10.042	Culp Inc	Goldman Sachs	16.268
1.464	Crown Castle International Corp (REIT)	Goldman Sachs	786	16.166	Culp Inc	HSBC	25.584
(4.435)	Crown Castle International Corp (REIT)	HSBC	(27.985)	7.146	Culp Inc	Morgan Stanley	3.430
2.310	Crown Castle International Corp (REIT)	HSBC	14.576	(284)	Cummins Inc	Barclays Bank	(497)
(5.521)	Crown Castle International Corp (REIT)	Morgan Stanley	(17.998)	(3.639)	Cummins Inc	Goldman Sachs	3.629
28.598	Crown Holdings Inc	Barclays Bank	(214.199)	(2.314)	Cummins Inc	Morgan Stanley	(4.050)
2.549	Crown Holdings Inc	Goldman Sachs	(20.749)	2.447	Cumulus Media Inc 'A'	Bank of America	
(3.398)	CryoLife Inc	Barclays Bank	3.670			Merrill Lynch	2.496
(3.052)	CryoLife Inc	Goldman Sachs	732	15.269	Cumulus Media Inc 'A'	Barclays Bank	458
(4.528)	CryoLife Inc	Morgan Stanley	4.890	14.969	Cumulus Media Inc 'A'	HSBC	4.790
(1.966)	CryoPort Inc	Bank of America		7.071	Cumulus Media Inc 'A'	Morgan Stanley	212
		Merrill Lynch	(12.032)	5.797	CuriosityStream Inc	Barclays Bank	2.145
(5.776)	CryoPort Inc	Barclays Bank	(20.967)	12.163	CuriosityStream Inc	Goldman Sachs	25.299
10.928	CSG Systems International Inc	Bank of America		12.015	CuriosityStream Inc	Morgan Stanley	4.446
		Merrill Lynch	(9.507)	(8.625)	Curis Inc	Barclays Bank	(2.760)
16.905	CSG Systems International Inc	Barclays Bank	(13.355)	2.712	Curo Group Holdings Corp	Bank of America	
1.620	CSG Systems International Inc	Goldman Sachs	(1.409)			Merrill Lynch	4.041
41.815	CSG Systems International Inc	Morgan Stanley	(28.791)	4.339	Curo Group Holdings Corp	Barclays Bank	2.994
(2.469)	CSW Industrials Inc	Bank of America		3.789	Curo Group Holdings Corp	HSBC	3.107
		Merrill Lynch	15.061	3.670	Curo Group Holdings Corp	Morgan Stanley	2.532
(9.851)	CSW Industrials Inc	Barclays Bank	15.860	(675)	Curtiss-Wright Corp	Bank of America	
(2.713)	CSW Industrials Inc	Goldman Sachs	16.549			Merrill Lynch	551
(11.176)	CSW Industrials Inc	Morgan Stanley	17.993	(3.578)	Curtiss-Wright Corp	Barclays Bank	2.361
(660)	CSX Corp	Bank of America		12.661	Curtiss-Wright Corp	Goldman Sachs	(30.133)
		Merrill Lynch	(38)	(3.087)	Curtiss-Wright Corp	Goldman Sachs	7.347
(27.528)	CSX Corp	Barclays Bank	(4.439)	1.858	Curtiss-Wright Corp	HSBC	(7.116)
(10.584)	CSX Corp	HSBC	32.175	3.029	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	(1.999)
(6.542)	CSX Corp	Morgan Stanley	(6.950)	(275)	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	182
6.520	CTO Realty Growth Inc (REIT)	Bank of America		42.738	Cushman & Wakefield Plc	Goldman Sachs	34.618
		Merrill Lynch	3.782	25.799	Cushman & Wakefield Plc	Morgan Stanley	(2.064)
3.212	CTO Realty Growth Inc (REIT)	Barclays Bank	(2.987)	7.848	Custom Truck One Source Inc	Morgan Stanley	5.886
9.396	CTO Realty Growth Inc (REIT)	Goldman Sachs	5.450			Bank of America	
6.832	CTO Realty Growth Inc (REIT)	HSBC	10.521	(5.221)	Customers Bancorp Inc	Bank of America	
9.414	CTO Realty Growth Inc (REIT)	Morgan Stanley	(8.755)			Merrill Lynch	(14.514)
(28.241)	CTS Corp	Bank of America		(4.714)	Customers Bancorp Inc	Goldman Sachs	(13.105)
		Merrill Lynch	(39.537)	(8.372)	Cutera Inc	Morgan Stanley	(2.093)
(11.471)	CTS Corp	Goldman Sachs	(16.059)	12.475	CVR Energy Inc	Goldman Sachs	(30.938)
(1.230)	CTS Corp	HSBC	(7.343)	8.949	CVS Health Corp	Barclays Bank	(29.263)
(15.292)	CTS Corp	Morgan Stanley	2.753	2.605	CVS Health Corp	Goldman Sachs	4.897
5.314	CubeSmart (REIT)	Bank of America		8.588	CVS Health Corp	Morgan Stanley	(28.083)
		Merrill Lynch	7.333	(5.648)	CyberOptics Corp	Barclays Bank	2.598
(1.860)	CubeSmart (REIT)	Bank of America		(816)	CyberOptics Corp	HSBC	(2.187)
		Merrill Lynch	(2.567)	(7.687)	CyberOptics Corp	Morgan Stanley	3.536
10.434	CubeSmart (REIT)	Barclays Bank	8.869	(11.088)	Cyclerion Therapeutics Inc	HSBC	(5.544)
6.310	CubeSmart (REIT)	Goldman Sachs	8.708	(54.123)	Cyclerion Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(15.696)
33.060	CubeSmart (REIT)	Morgan Stanley	28.101	45.799	Cymbabay Therapeutics Inc	Bank of America	
(2.011)	CubeSmart (REIT)	Morgan Stanley	(1.709)			Merrill Lynch	(6.412)
6.359	Cue Biopharma Inc	Goldman Sachs	2.162	10.219	Cymbabay Therapeutics Inc	Barclays Bank	(1.533)
				25.603	Cymbabay Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2.656)
				8.518	Cymbabay Therapeutics Inc	HSBC	553
				13.324	Cymbabay Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1.999)
				(3.970)	CyrusOne Inc (REIT)	Barclays Bank	1.826
				2.495	CyrusOne Inc (REIT)	Barclays Bank	(1.148)
				(1.261)	Cytokinetics Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	4.716
				(2.117)	Cytokinetics Inc	Barclays Bank	1.948
				(9.915)	Cytokinetics Inc	Goldman Sachs	37.082
				(16.947)	Cytokinetics Inc	Morgan Stanley	13.915
				(8.985)	CytomX Therapeutics Inc	Barclays Bank	9.614

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(47.416)	CytomX Therapeutics Inc	Goldman Sachs	58.322	2.502	Deciphera Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	2.302
(5.451)	CytoSorbents Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.635	2.462	Deciphera Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1.920)
(46.950)	CytoSorbents Corp	Barclays Bank	11.738	2.309	Deciphera Pharmaceuticals Inc	HSBC	1.916
(14.430)	CytoSorbents Corp	Goldman Sachs	4.329	7.747	Deciphera Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	4.692
(3.901)	CytoSorbents Corp	Morgan Stanley	975	445	Deckers Outdoor Corp	Bank of America	
811	Daily Journal Corp	HSBC	14.793	8.299	Deckers Outdoor Corp	Merrill Lynch	(2.581)
69.788	Daktronics Inc	Barclays Bank	2.094	1.860	Deckers Outdoor Corp	Barclays Bank	(24.980)
41.855	Daktronics Inc	Goldman Sachs	7.115	1.743	Deckers Outdoor Corp	Goldman Sachs	(10.789)
60.104	Daktronics Inc	HSBC	21.036	1.939	Deckers Outdoor Corp	HSBC	4.034
55.929	Daktronics Inc	Morgan Stanley	1.678	57	Deere & Co	Morgan Stanley	(6.243)
15.209	Dana Inc	Barclays Bank	11.711	3.632	Deere & Co	Bank of America	(1.280)
4.730	Dana Inc	Goldman Sachs	393	513	Deere & Co	Merrill Lynch	9.765
10.163	Dana Inc	Morgan Stanley	7.219	4.153	Deere & Co	Goldman Sachs	(11.517)
(6.954)	Danaher Corp	Barclays Bank	(12.800)	4.113	Deere & Co	HSBC	(125.836)
(3.274)	Danaher Corp	Goldman Sachs	(8.852)	4.113	Deere & Co	Morgan Stanley	2.179
(1.396)	Danaher Corp	HSBC	4.034	(2.258)	Del Taco Restaurants Inc	Barclays Bank	361
(1.328)	Danaher Corp	Morgan Stanley	(4.156)	(52.721)	Del Taco Restaurants Inc	Goldman Sachs	1.054
(3.746)	Danimer Scientific Inc	Barclays Bank	(4.308)	9.641	Delek US Energy Inc	Bank of America	
3.190	Darden Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.430	3.497	Delek US Energy Inc	Merrill Lynch	(2.410)
14.659	Darden Restaurants Inc	Barclays Bank	27.412	7.846	Delek US Energy Inc	Barclays Bank	4.721
472	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs	1.987	36.832	Delek US Energy Inc	Goldman Sachs	(1.962)
142	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	266	2.067	Dell Technologies Inc 'C'	Morgan Stanley	49.723
(8.978)	DarioHealth Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.507)	12.647	Dell Technologies Inc 'C'	Bank of America	
(6.942)	DarioHealth Corp	Barclays Bank	13.120	1.531	Dell Technologies Inc 'C'	Merrill Lynch	517
677	Darling Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.978	6.021	Dell Technologies Inc 'C'	Barclays Bank	(18.971)
(1.057)	Darling Ingredients Inc	Barclays Bank	(15)	(86)	Delta Air Lines Inc	HSBC	1.552
1.015	Darling Ingredients Inc	Barclays Bank	152	(16.603)	Delta Air Lines Inc	Bank of America	
11.354	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs	19.696	(4.452)	Delta Air Lines Inc	Merrill Lynch	(133)
923	Darling Ingredients Inc	HSBC	115	(771)	Delta Air Lines Inc	Barclays Bank	(25.071)
(1.424)	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	(151)	(5.512)	Delta Air Lines Inc	Goldman Sachs	(4.140)
2.586	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	(1.789)	(3.936)	Delta Apparel Inc	HSBC	(1.735)
(22.923)	Daseke Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23.152)	(7.914)	Delta Apparel Inc	Morgan Stanley	(8.323)
(4.710)	Daseke Inc	Barclays Bank	(1.413)	(1.823)	Delta Apparel Inc	Bank of America	
(23.410)	Daseke Inc	Goldman Sachs	(23.644)	(5.897)	Delta Apparel Inc	Merrill Lynch	11.690
(1.759)	Datadog Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7.459)	(8.580)	Delta Apparel Inc	Barclays Bank	8.864
(3.057)	Datadog Inc 'A'	Goldman Sachs	(30.631)	9.698	Deluxe Corp	Goldman Sachs	5.414
(12.900)	Datadog Inc 'A'	Morgan Stanley	(16.641)	4.434	Deluxe Corp	HSBC	16.630
(1.437)	Datto Holding Corp	Barclays Bank	(144)	4.418	Deluxe Corp	Morgan Stanley	9.610
(3.632)	Datto Holding Corp	Goldman Sachs	(2.942)	3.733	Deluxe Corp	Bank of America	
(1.133)	Datto Holding Corp	Morgan Stanley	(113)	17.901	Deluxe Corp	Merrill Lynch	(6.387)
7.338	Dave & Buster's Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16.804)	(3.974)	Denali Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.185
1.570	Dave & Buster's Entertainment Inc	Barclays Bank	1.240	(7.164)	Denali Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3.711)
4.421	Dave & Buster's Entertainment Inc	Goldman Sachs	(10.124)	(479)	Denali Therapeutics Inc	HSBC	(3.240)
3.215	Dave & Buster's Entertainment Inc	HSBC	59	(5.822)	Denali Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(11.935)
(8.198)	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	35.005	20.784	Denny's Corp	Bank of America	
(12.495)	DaVita Inc	Barclays Bank	22.116	9.543	Denny's Corp	Merrill Lynch	3.533
661	DaVita Inc	Barclays Bank	(1.170)	4.733	Denny's Corp	Barclays Bank	573
(1.808)	DaVita Inc	Goldman Sachs	7.720	(9.250)	DENTSPLY SIRONA Inc	HSBC	2.272
(392)	DaVita Inc	HSBC	3.101	(5.216)	DENTSPLY SIRONA Inc	Bank of America	
1.885	DaVita Inc	HSBC	80	1.153	DENTSPLY SIRONA Inc	Merrill Lynch	18.778
(14.381)	DaVita Inc	Morgan Stanley	25.454	(555)	DermTech Inc	Barclays Bank	3.808
37.646	Dawson Geophysical Co	Morgan Stanley	2.259	(4.698)	DermTech Inc	HSBC	(977)
1.192	Decibel Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.885	5.084	Design Therapeutics Inc	Bank of America	
1.132	Decibel Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.030			Merrill Lynch	(3.175)
7.211	Decibel Therapeutics Inc	HSBC	13.412			Barclays Bank	(12.450)
2.475	Deciphera Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2)			Merrill Lynch	14.439

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(864)	Designer Brands Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.529	1.116	DigitalOcean Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.439
(4.087)	Designer Brands Inc 'A'	Barclays Bank	3.474	2.830	DigitalOcean Holdings Inc	Barclays Bank	594
(2.009)	Designer Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	5.223	7.938	DigitalOcean Holdings Inc	Goldman Sachs	45.802
35.628	Devon Energy Corp	Barclays Bank	21.733	1.162	Dillard's Inc 'A'	Goldman Sachs	(11.004)
22.430	Devon Energy Corp	Goldman Sachs	(14.131)	1.634	Dillard's Inc 'A'	Morgan Stanley	1.258
2.362	Dexcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	97.722	(3.925)	Dime Community Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(903)
(2.807)	Dexcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(123.480)	(3.427)	Dime Community Bancshares Inc	Barclays Bank	891
1.062	Dexcom Inc	Barclays Bank	14.868	(8.210)	Dime Community Bancshares Inc	Goldman Sachs	(1.888)
(1.214)	Dexcom Inc	Barclays Bank	(16.996)	(22.304)	Dime Community Bancshares Inc	Morgan Stanley	5.799
305	Dexcom Inc	Goldman Sachs	13.417	615	Dine Brands Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	256
(1.563)	Dexcom Inc	Goldman Sachs	(68.756)	6.695	Dine Brands Global Inc	Barclays Bank	5.549
593	Dexcom Inc	HSBC	19.750	12.115	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs	(44.952)
(504)	Dexcom Inc	HSBC	(13.457)	945	Dine Brands Global Inc	HSBC	1.242
37	Dexcom Inc	Morgan Stanley	518	833	Dine Brands Global Inc	Morgan Stanley	1.572
(300)	Dexcom Inc	Morgan Stanley	(4.200)	(2.650)	Diodes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.853)
(11.060)	DHI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(774)	(254)	Diodes Inc	Barclays Bank	(97)
(31.054)	DHI Group Inc	Barclays Bank	3.416	(4.658)	Diodes Inc	Goldman Sachs	(22.591)
(22.836)	DHI Group Inc	Goldman Sachs	(1.599)	(19.031)	Diodes Inc	Morgan Stanley	(7.232)
(7.065)	DHI Group Inc	HSBC	353	(5.489)	Discover Financial Services	Morgan Stanley	(13.613)
(21.654)	DHI Group Inc	Morgan Stanley	2.382	6.175	Discovery Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10.745)
(44.911)	DHT Holdings Inc	Barclays Bank	(8.533)	12.421	Discovery Inc 'A'	Barclays Bank	10.309
(13.096)	DHT Holdings Inc	Goldman Sachs	(6.679)	8.684	Discovery Inc 'A'	Goldman Sachs	2.204
(4.500)	DHT Holdings Inc	Morgan Stanley	(423)	11.092	Discovery Inc 'A'	Morgan Stanley	9.206
(2.516)	Diamond Hill Investment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.265	(35.421)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	10.410
(2.354)	Diamond Hill Investment Group Inc	Barclays Bank	(330)	(26.069)	DISH Network Corp 'A'	Barclays Bank	23.462
(2.066)	Diamondback Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	599	(6.281)	DISH Network Corp 'A'	HSBC	3.064
7.342	Diamondback Energy Inc	Barclays Bank	20.337	(24.987)	DISH Network Corp 'A'	Morgan Stanley	22.488
2.289	Diamondback Energy Inc	Goldman Sachs	(664)	5.523	Diversified Healthcare Trust (REIT)	Barclays Bank	(221)
(1.784)	Diamondback Energy Inc	Goldman Sachs	517	38.384	Diversified Healthcare Trust (REIT)	HSBC	(13.051)
853	Diamondback Energy Inc	HSBC	(2.295)	(3.201)	DMC Global Inc	HSBC	10.915
6.567	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	18.191	(4.109)	DMC Global Inc	Morgan Stanley	(2.712)
90.583	DiamondRock Hospitality Co (REIT)	HSBC	(7.247)	20	DocuSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	302
3.346	DiamondRock Hospitality Co (REIT)	Morgan Stanley	468	4.458	DocuSign Inc	Barclays Bank	27.060
(24.675)	Dicerna Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(61.441)	(3.152)	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8.920)
10.334	Dick's Sporting Goods Inc	Goldman Sachs	95.756	5.370	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	15.197
(29.758)	Diebold Nixdorf Inc	Morgan Stanley	(3.571)	(3.182)	Dolby Laboratories Inc 'A'	Barclays Bank	(1.941)
(10.426)	Digi International Inc	Barclays Bank	(1.564)	9.324	Dolby Laboratories Inc 'A'	Barclays Bank	5.688
(34.674)	Digi International Inc	Goldman Sachs	(24.965)	1.727	Dolby Laboratories Inc 'A'	Goldman Sachs	4.887
(2.070)	Digi International Inc	HSBC	(2.981)	691	Dolby Laboratories Inc 'A'	HSBC	2.839
(11.692)	Digi International Inc	Morgan Stanley	(1.754)	(8.627)	Dolby Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.262)
(9.442)	Digimarc Corp	Goldman Sachs	(40.884)	18.501	Dolby Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	11.286
7.862	Digital Media Solutions Inc 'A'	Barclays Bank	3.302	(3.903)	Dollar General Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.840
8.878	Digital Media Solutions Inc 'A'	Goldman Sachs	799	1.348	Dollar General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.672)
(635)	Digital Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2.121)	(5.588)	Dollar General Corp	Barclays Bank	(32.466)
(3.185)	Digital Realty Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	(1.083)	9.449	Dollar General Corp	Barclays Bank	40.691
(8.179)	Digital Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(27.318)	(3.751)	Dollar General Corp	Goldman Sachs	4.651
(1.184)	Digital Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(403)	375	Dollar General Corp	Goldman Sachs	(89)
(2.072)	Digital Turbine Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16.099)	4.677	Dollar General Corp	HSBC	(11.261)
(5.314)	Digital Turbine Inc	Barclays Bank	(14.348)	(14.291)	Dollar General Corp	Morgan Stanley	(83.031)
(2.153)	Digital Turbine Inc	Goldman Sachs	(16.729)	5.123	Dollar General Corp	Morgan Stanley	27.096
(3.436)	Digital Turbine Inc	HSBC	(20.994)	(7.421)	Dollar Tree Inc	Bank of America Merrill Lynch	90.165
(1.381)	Digital Turbine Inc	Morgan Stanley	(3.729)	11.880	Dollar Tree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(139.673)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.409)	Dollar Tree Inc	Barclays Bank	13.667	(16.215)	Dover Corp	Morgan Stanley	(16.377)
1.429	Dollar Tree Inc	Barclays Bank	(13.861)	6.750	Dow Inc	Bank of America	
1.032	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs	(11.370)			Merrill Lynch	(16.808)
17.922	Dollar Tree Inc	Morgan Stanley	(104.669)	1.398	Dow Inc	Barclays Bank	(1.580)
(27.039)	Dominion Energy Inc	Bank of America		(30.064)	Dow Inc	Morgan Stanley	33.972
		Merrill Lynch	41.123	(1.378)	DR Horton Inc	Bank of America	
(17.562)	Dominion Energy Inc	Barclays Bank	10.827			Merrill Lynch	(328)
(18.224)	Dominion Energy Inc	Goldman Sachs	27.883	1.947	DR Horton Inc	Barclays Bank	8.158
9.556	Dominion Energy Inc	Goldman Sachs	2.038	1.809	DR Horton Inc	Goldman Sachs	(651)
(46.104)	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	43.799	(8.502)	DR Horton Inc	Goldman Sachs	(17.531)
24.589	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	6.418	4.703	DR Horton Inc	HSBC	(43.079)
(627)	Domino's Pizza Inc	Bank of America		17.508	DR Horton Inc	Morgan Stanley	73.359
		Merrill Lynch	3.756	(826)	DR Horton Inc	Morgan Stanley	(3.461)
129	Domino's Pizza Inc	Barclays Bank	770	(9.981)	DraftKings Inc 'A'	Barclays Bank	(20.861)
(731)	Domino's Pizza Inc	Barclays Bank	(4.364)	(2.551)	Dril-Quip Inc	Bank of America	
(345)	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs	2.067			Merrill Lynch	2.883
(434)	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	(2.591)	(14.095)	Dril-Quip Inc	Barclays Bank	(17.337)
(1.003)	Domo Inc 'B'	Bank of America		(2.338)	Dril-Quip Inc	Goldman Sachs	2.642
		Merrill Lynch	(6.449)	6.311	Driven Brands Holdings Inc	Bank of America	
(576)	Domo Inc 'B'	Barclays Bank	(2.408)			Merrill Lynch	2.524
(703)	Domo Inc 'B'	Goldman Sachs	(5.918)	2.337	Driven Brands Holdings Inc	Barclays Bank	2.033
(3.670)	Domo Inc 'B'	Morgan Stanley	(13.185)	8.576	Driven Brands Holdings Inc	HSBC	12.006
(11.031)	Domtar Corp	Barclays Bank	1.875	17.162	Driven Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	14.931
1.259	Donaldson Co Inc	Bank of America		2.262	Dropbox Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.674)	(12.758)	Dropbox Inc 'A'	Bank of America	
6.842	Donaldson Co Inc	Barclays Bank	4.584			Merrill Lynch	996
(7.300)	Donaldson Co Inc	Barclays Bank	(4.891)	(22.434)	Dropbox Inc 'A'	Barclays Bank	(7.746)
11.534	Donaldson Co Inc	Goldman Sachs	(15.340)	(10.939)	Dropbox Inc 'A'	Barclays Bank	(4.487)
4.720	Donaldson Co Inc	HSBC	(15.104)	(56.253)	Dropbox Inc 'A'	HSBC	(6.929)
10.637	Donaldson Co Inc	Morgan Stanley	7.127	5.431	DSP Group Inc	Morgan Stanley	(10.066)
(831)	Donaldson Co Inc	Morgan Stanley	(557)	3.000	DSP Group Inc	Barclays Bank	923
36.445	Donegal Group Inc 'A'	Bank of America		34.966	DSP Group Inc	HSBC	5.760
		Merrill Lynch	5.102	1.671	DTE Energy Co	Morgan Stanley	5.944
33.862	Donegal Group Inc 'A'	Barclays Bank	(2.709)	204	DTE Energy Co	Bank of America	
4.331	Donegal Group Inc 'A'	Goldman Sachs	606	7.756	DTE Energy Co	Merrill Lynch	(3.730)
19.217	Donegal Group Inc 'A'	HSBC	3.843	13.258	DTE Energy Co	Barclays Bank	(853)
17.902	Donegal Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.432)	(264)	DTE Energy Co	Goldman Sachs	(9.603)
3.082	Donnelley Financial Solutions Inc	Bank of America		(2.096)	Duck Creek Technologies Inc	Morgan Stanley	(54.895)
		Merrill Lynch	2.984			Morgan Stanley	1.104
4.297	Donnelley Financial Solutions Inc	Barclays Bank	(521)	1.925	Duck Creek Technologies Inc	Barclays Bank	(1.425)
1.948	Donnelley Financial Solutions Inc	Goldman Sachs	4.987	(2.573)	Duck Creek Technologies Inc	Goldman Sachs	4.909
1.472	Donnelley Financial Solutions Inc	HSBC	(194)	(1.002)	Duck Creek Technologies Inc	Goldman Sachs	(6.561)
26.156	Donnelley Financial Solutions Inc	Morgan Stanley	6.539	(1.140)	Duck Creek Technologies Inc	HSBC	73
(5.541)	DoorDash Inc 'A'	Barclays Bank	(54.068)	(5.201)	Ducommun Inc	Bank of America	(775)
(794)	DoorDash Inc 'A'	Morgan Stanley	(7.797)	(6.890)	Ducommun Inc	Bank of America	
(51.256)	Dorian LPG Ltd	Barclays Bank	36.355	(2.049)	Ducommun Inc	Merrill Lynch	5.149
(33.250)	Dorian LPG Ltd	Goldman Sachs	32.624	(1.993)	Ducommun Inc	Barclays Bank	(15.434)
(10.684)	Dorian LPG Ltd	Morgan Stanley	(250)	(2.106)	Duke Energy Corp	Goldman Sachs	2.029
(1.247)	Dorman Products Inc	Bank of America				Morgan Stanley	(4.464)
		Merrill Lynch	873	(22.316)	Duke Energy Corp	Bank of America	
(384)	Dorman Products Inc	Barclays Bank	(634)	(16.702)	Duke Energy Corp	Merrill Lynch	4.696
(479)	Dorman Products Inc	Goldman Sachs	335	(28.702)	Duke Energy Corp	Barclays Bank	46.640
1.393	Douglas Dynamics Inc	Bank of America		53.002	Duke Realty Corp (REIT)	HSBC	58.791
		Merrill Lynch	1.393	14.622	Duke Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	59.987
3.662	Douglas Dynamics Inc	Barclays Bank	6.628	14.026	Duke Realty Corp (REIT)	Bank of America	
14.663	Douglas Dynamics Inc	HSBC	(7.771)	(10.156)	Duluth Holdings Inc 'B'	Merrill Lynch	83.213
12.963	Douglas Dynamics Inc	Morgan Stanley	23.463	(2.118)	Duluth Holdings Inc 'B'	Barclays Bank	2.486
28.720	Douglas Emmett Inc (REIT)	Bank of America		(1.877)	Duluth Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	22.021
		Merrill Lynch	56.578	(2.394)	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Morgan Stanley	2.001
(5.657)	Douglas Emmett Inc (REIT)	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(10.508)			Merrill Lynch	(3.898)
(8.720)	Douglas Emmett Inc (REIT)	Barclays Bank	3.837			Barclays Bank	(890)
23.718	Douglas Emmett Inc (REIT)	Morgan Stanley	(10.436)			Goldman Sachs	(115)
(7.800)	Douglas Emmett Inc (REIT)	Morgan Stanley	3.432				
(4.689)	Dova Pharmaceuticals Inc	HSBC	(2.532)				
(10.476)	Dover Corp	HSBC	30.904				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
8.487	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.613)	71.110	Easterly Government Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	42.666
(627)	DuPont de Nemours Inc	Bank of America		(22.199)	Eastern Bankshares Inc	Goldman Sachs	(14.651)
		Merrill Lynch	659	(14.594)	Eastern Co	Bank of America	
(12.001)	DuPont de Nemours Inc	Barclays Bank	7.181			Merrill Lynch	(5.197)
(3.240)	DuPont de Nemours Inc	Goldman Sachs	(118)	(11.685)	Eastern Co	Barclays Bank	1.402
(2.496)	DuPont de Nemours Inc	HSBC	(159)	(14.491)	Eastern Co	Goldman Sachs	(5.752)
(1.142)	DuPont de Nemours Inc	Morgan Stanley	765	(2.590)	Eastern Co	HSBC	(1.735)
(52.906)	Durect Corp	Bank of America		(1.315)	Eastern Co	Morgan Stanley	158
		Merrill Lynch	5.291	(5.725)	EastGroup Properties Inc (REIT)	Bank of America	
(33.312)	Durect Corp	Barclays Bank	—	(16.480)	EastGroup Properties Inc (REIT)	Merrill Lynch	(26.908)
(94.579)	Durect Corp	Goldman Sachs	9.458				
(6.125)	DXC Technology Co	Bank of America		(9.066)	EastGroup Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(77.456)
		Merrill Lynch	(6.272)				
(665)	DXC Technology Co	Barclays Bank	(392)	(8.500)	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	770
(5.396)	DXC Technology Co	Goldman Sachs	(6.259)			Bank of America	
(1.672)	DXC Technology Co	Morgan Stanley	(1.714)	(14.748)	Eastman Chemical Co	Merrill Lynch	38.165
7.214	DXC Technology Co	Morgan Stanley	4.256	(5.579)	Eastman Chemical Co	Barclays Bank	12.683
16.957	DXP Enterprises Inc	Morgan Stanley	5.087	(18.703)	Eastman Kodak Co	Goldman Sachs	25.050
6.700	Dyadic International Inc	Bank of America		(2.225)	Eaton Corp Plc	Barclays Bank	(11.374)
		Merrill Lynch	1.809	(2.834)	Eaton Corp Plc	Barclays Bank	(3.582)
7.549	Dyadic International Inc	Barclays Bank	226	470	Eaton Corp Plc	Goldman Sachs	6.178
7.962	Dyadic International Inc	Morgan Stanley	239	(1.812)	Eaton Corp Plc	Goldman Sachs	191
(8.113)	Dycom Industries Inc	Bank of America		1.726	Eaton Corp Plc	Morgan Stanley	(2.917)
		Merrill Lynch	148.143	8.588	eBay Inc	Morgan Stanley	2.779
(1.771)	Dycom Industries Inc	Barclays Bank	5.126			Bank of America	
(24.526)	Dynatrace Inc	Bank of America		3.887	eBay Inc	Merrill Lynch	(6.956)
		Merrill Lynch	(123.149)	(12.254)	eBay Inc	Barclays Bank	(350)
(2.419)	Dynatrace Inc	Barclays Bank	(2.179)	10.817	eBay Inc	Barclays Bank	1.103
(5.402)	Dynatrace Inc	Goldman Sachs	(19.904)	(4.177)	eBay Inc	Morgan Stanley	(974)
(2.033)	Dynatrace Inc	HSBC	(12.950)	(1.001)	Ebix Inc	Morgan Stanley	376
(29.386)	Dynatrace Inc	Morgan Stanley	(30.855)			Bank of America	
(10.553)	Dynavax Technologies Corp	Goldman Sachs	(4.643)	(10.395)	Ebix Inc	Merrill Lynch	691
1.421	Dyne Therapeutics Inc	Bank of America		(7.352)	Ebix Inc	Barclays Bank	3.430
		Merrill Lynch	1.606	(6.573)	Ebix Inc	Goldman Sachs	4.341
4.703	Dyne Therapeutics Inc	Goldman Sachs	5.314	(10.398)	Ebix Inc	HSBC	12.817
1.338	Dyne Therapeutics Inc	HSBC	1.445	14.209	Echo Global Logistics Inc	Morgan Stanley	3.431
(22.748)	Dynex Capital Inc (REIT)	HSBC	7.279	28.959	Echo Global Logistics Inc	Goldman Sachs	(20.319)
(29.239)	Dynex Capital Inc (REIT)	Morgan Stanley	292	37.423	Echo Global Logistics Inc	HSBC	(45.466)
1.313	DZS Inc	Bank of America		(9.738)	EchoStar Corp 'A'	Morgan Stanley	1.559
		Merrill Lynch	670			Bank of America	
2.695	DZS Inc	Barclays Bank	943	(1.181)	EchoStar Corp 'A'	Merrill Lynch	1.071
2.889	DZS Inc	Goldman Sachs	1.473	(7.097)	EchoStar Corp 'A'	Barclays Bank	(1.016)
6.805	DZS Inc	Morgan Stanley	2.382	3.061	Ecolab Inc	Goldman Sachs	781
(7.385)	E2open Parent Holdings Inc	Barclays Bank	7.754			Bank of America	
(13.603)	Eagle Bancorp Inc	Morgan Stanley	(11.154)	259	Ecolab Inc	Merrill Lynch	(20.080)
9.119	Eagle Bancorp Montana Inc	Bank of America		3.454	Ecolab Inc	Barclays Bank	(57)
		Merrill Lynch	18.214	2.642	Ecolab Inc	Goldman Sachs	(22.658)
7.399	Eagle Bancorp Montana Inc	Barclays Bank	(1.110)	5.741	Ecolab Inc	HSBC	(26.103)
10.370	Eagle Bancorp Montana Inc	Goldman Sachs	20.844	(5.976)	Edgewell Personal Care Co	Morgan Stanley	(1.263)
5.908	Eagle Bancorp Montana Inc	HSBC	12.612			Bank of America	
14.987	Eagle Bancorp Montana Inc	Morgan Stanley	(2.248)	(3.061)	Edgewell Personal Care Co	Merrill Lynch	(8.486)
(1.903)	Eagle Materials Inc	Bank of America		(3.498)	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs	(4.347)
		Merrill Lynch	(2.448)	(11.304)	Edgewell Personal Care Co	HSBC	(3.008)
(5.820)	Eagle Materials Inc	Barclays Bank	3.085	(619)	Edgewise Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1.583
(19.485)	Eagle Materials Inc	Morgan Stanley	(32.137)	(8.154)	Edison International	Barclays Bank	(260)
(12.946)	Eagle Pharmaceuticals Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	27.834	(9.963)	Edison International	Merrill Lynch	15.332
(1.159)	Eagle Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	2.341	(15.684)	Edison International	Barclays Bank	23.064
(1.215)	Eagle Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	2.612	(2.501)	Edison International	Goldman Sachs	29.800
(6.762)	Eargo Inc	Barclays Bank	(5.545)	(752)	Editas Medicine Inc	Morgan Stanley	6.253
(8.859)	Earthstone Energy Inc 'A'	Barclays Bank	(3.366)			Bank of America	
(9.283)	Earthstone Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.528)	1.174	Editas Medicine Inc	Merrill Lynch	(632)
4.678	East West Bancorp Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(15.344)	(1.869)	Editas Medicine Inc	Merrill Lynch	986
54.479	Easterly Government Properties Inc (REIT)	Bank of America		2.830	Editas Medicine Inc	Barclays Bank	(1.420)
		Merrill Lynch	32.687	65	Editas Medicine Inc	Goldman Sachs	2.377
6.368	Easterly Government Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	318	717	Editas Medicine Inc	HSBC	173
						Morgan Stanley	545

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
16.492	Edwards Lifesciences Corp	Morgan Stanley	7.421	(23.590)	eMagin Corp	Goldman Sachs	(40.575)
3.118	eGain Corp	Barclays Bank	(1.621)	29.031	EMCOR Group Inc	Bank of America	
5.016	eGain Corp	Goldman Sachs	652			Merrill Lynch	26.418
4.113	eGain Corp	Morgan Stanley	(2.139)	14.239	EMCOR Group Inc	Barclays Bank	45.422
983	eHealth Inc	Bank of America		9.453	EMCOR Group Inc	Goldman Sachs	8.602
		Merrill Lynch	2.418	24.341	EMCOR Group Inc	HSBC	42.597
3.662	eHealth Inc	Barclays Bank	(476)	6.125	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	19.539
5.735	eHealth Inc	Goldman Sachs	14.108	(11.608)	EMCORE Corp	Bank of America	
(450)	eHealth Inc	Morgan Stanley	59			Merrill Lynch	(18.689)
726	eHealth Inc	Morgan Stanley	(94)	(4.996)	EMCORE Corp	Barclays Bank	(3.098)
5.946	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(2.022)	(28.067)	EMCORE Corp	Goldman Sachs	(45.188)
12.336	El Pollo Loco Holdings Inc	Bank of America		35.290	Emerald Holding Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.759)			Merrill Lynch	9.175
41.061	El Pollo Loco Holdings Inc	Barclays Bank	5.431	(1.257)	Emergent BioSolutions Inc	Bank of America	
5.412	El Pollo Loco Holdings Inc	Goldman Sachs	(4.979)	(4.758)	Emergent BioSolutions Inc	Barclays Bank	(17.562)
11.790	El Pollo Loco Holdings Inc	HSBC	(11.433)	(363)	Emergent BioSolutions Inc	Goldman Sachs	(131)
23.328	El Pollo Loco Holdings Inc	Morgan Stanley	3.033	(1.389)	Emergent BioSolutions Inc	Morgan Stanley	(5.251)
98	Elah Holdings Inc	Bank of America		1.271	Emerson Electric Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	392			Merrill Lynch	216
87	Elah Holdings Inc	Morgan Stanley	(87)	9.900	Emerson Electric Co	Barclays Bank	16.632
1.705	Elanco Animal Health Inc	Barclays Bank	(44)	4.313	Emerson Electric Co	Goldman Sachs	733
8.436	Elanco Animal Health Inc	Goldman Sachs	5.609	10.729	Emerson Electric Co	Morgan Stanley	18.025
(685)	Elanco Animal Health Inc	HSBC	(1.364)	31.909	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America	
1.234	Elanco Animal Health Inc	Morgan Stanley	247			Merrill Lynch	11.488
(3.043)	Elanco Animal Health Inc	Morgan Stanley	(609)	35.862	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	1.793
(1.622)	Elastic NV	Bank of America		50.989	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	18.356
		Merrill Lynch	(15.571)	2.129	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	HSBC	64
(2.204)	Elastic NV	Barclays Bank	(2.160)	28.007	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	1.401
(7.455)	Elastic NV	Goldman Sachs	(71.568)	3.054	Employers Holdings Inc	Bank of America	
(1.769)	Elastic NV	HSBC	(25.880)			Merrill Lynch	(764)
(8.896)	Elastic NV	Morgan Stanley	(8.718)	9.333	Employers Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.333)
(6.079)	Electromed Inc	Bank of America		5.789	Employers Holdings Inc	Morgan Stanley	868
		Merrill Lynch	(1.884)	1.575	Enanta Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
(13.741)	Electromed Inc	Barclays Bank	(8.107)			Merrill Lynch	(1.339)
(25.392)	Electromed Inc	Goldman Sachs	(7.872)	451	Enanta Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(383)
(3.329)	Electromed Inc	HSBC	566	13.095	Enanta Pharmaceuticals Inc	HSBC	13.357
1.310	Electronic Arts Inc	Bank of America		6.164	Enanta Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(2.466)
		Merrill Lynch	7.074	(2.382)	Enbridge Inc	Bank of America	
10.031	Eledon Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2.107			Merrill Lynch	715
(2.536)	Element Solutions Inc	Bank of America		2.321	Encompass Health Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	398			Merrill Lynch	(1.576)
(8.320)	Element Solutions Inc	Barclays Bank	(3.994)	622	Encompass Health Corp	Barclays Bank	(193)
(34.752)	Element Solutions Inc	Goldman Sachs	(25.021)	(265)	Encompass Health Corp	Barclays Bank	225
(71.452)	Element Solutions Inc	Morgan Stanley	(32.579)	769	Encompass Health Corp	HSBC	(673)
10.287	Elevate Credit Inc	Goldman Sachs	514	(3.135)	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	2.665
4.545	Elevate Credit Inc	HSBC	1.091	4.104	Encore Capital Group Inc	Bank of America	
13.541	Elevate Credit Inc	Morgan Stanley	(2.437)			Merrill Lynch	14.200
(6.049)	elf Beauty Inc	Bank of America		1.682	Encore Capital Group Inc	Barclays Bank	3.835
		Merrill Lynch	7.682	6.501	Encore Capital Group Inc	Goldman Sachs	22.493
(8.464)	elf Beauty Inc	Barclays Bank	9.734	1.762	Encore Capital Group Inc	HSBC	7.665
(8.916)	elf Beauty Inc	Goldman Sachs	11.323	503	Encore Capital Group Inc	Morgan Stanley	1.147
(1.291)	elf Beauty Inc	Morgan Stanley	242	(3.325)	Encore Wire Corp	Bank of America	
(1.434)	Eli Lilly & Co	Barclays Bank	41			Merrill Lynch	(181)
(614)	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs	(244)	(13.261)	Encore Wire Corp	Barclays Bank	(14.414)
(1.814)	Eli Lilly & Co	HSBC	(9.034)	(13.507)	Encore Wire Corp	Goldman Sachs	4.227
(7.889)	Eli Lilly & Co	Morgan Stanley	10.098	(4.109)	Encore Wire Corp	Morgan Stanley	(687)
(14.803)	Ellington Residential Mortgage REIT (REIT)	Bank of America		14.732	Endeavor Group Holdings Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.072)			Merrill Lynch	(21.131)
(4.664)	Ellington Residential Mortgage REIT (REIT)	Barclays Bank	466	6.462	Endeavor Group Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	5.299
(17.193)	Ellington Residential Mortgage REIT (REIT)	Goldman Sachs	(2.407)	(6.373)	Endo International Plc	HSBC	(3.760)
(27.062)	Ellington Residential Mortgage REIT (REIT)	Morgan Stanley	2.706	(1.618)	Energizer Holdings Inc	Bank of America	
(6.350)	Eloxx Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(635)			Merrill Lynch	2.443
(19.449)	Eloxx Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(3.695)	(2.172)	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs	2.096
(6.669)	Eloxx Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(667)				
(23.327)	eMagin Corp	Barclays Bank	(38.956)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(6.255)	Energizer Holdings Inc	HSBC	28.085	52.424	Entravision		
(10.660)	Energous Corp	Bank of America			Communications Corp 'A'	Morgan Stanley	3.145
		Merrill Lynch	(1.706)	(44.864)	Envela Corp	Bank of America	
(40.544)	Energous Corp	Barclays Bank	(7.298)			Merrill Lynch	11.216
19.253	Energy Fuels Inc	Morgan Stanley	11.167	(15.392)	Envela Corp	Barclays Bank	(2.309)
18.345	Energy Recovery Inc	Barclays Bank	16.180	(14.311)	Envela Corp	Goldman Sachs	3.578
(6.754)	Enerpac Tool Group Corp	Barclays Bank	(135)	6.401	Envista Holdings Corp	Bank of America	
(46.010)	Enerpac Tool Group Corp	Morgan Stanley	(920)			Merrill Lynch	(9.089)
(18.052)	EnerSys	Bank of America		11.566	Envista Holdings Corp	Barclays Bank	(6.014)
		Merrill Lynch	(55.858)	8.795	Envista Holdings Corp	Goldman Sachs	(12.489)
(8.884)	EnerSys	Barclays Bank	(7.551)	8.950	Envista Holdings Corp	Morgan Stanley	(4.654)
(18.456)	EnerSys	Goldman Sachs	(56.893)	(57.198)	Enzo Biochem Inc	Barclays Bank	(572)
(490)	EnerSys	HSBC	(2.724)	(7.486)	Enzo Biochem Inc	HSBC	(1.198)
(9.221)	EnerSys	Morgan Stanley	(7.838)	(21.006)	Enzo Biochem Inc	Morgan Stanley	(210)
(3.023)	Eneti Inc	Barclays Bank	3.869	1.437	EOG Resources Inc	Bank of America	
(1.801)	Eneti Inc	Goldman Sachs	378			Merrill Lynch	(2.677)
(1.535)	Eneti Inc	HSBC	(384)	6.793	EOG Resources Inc	Barclays Bank	2.773
42.560	EnLink Midstream LLC	Morgan Stanley	(3.405)	4.479	EOG Resources Inc	Goldman Sachs	(21.320)
72.315	Ennis Inc	Bank of America		7.526	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	1.505
		Merrill Lynch	(50.621)	(1.504)	EPAM Systems Inc	Bank of America	
8.950	Enochian Biosciences Inc	Barclays Bank	2.327			Merrill Lynch	(44.909)
53.424	Enochian Biosciences Inc	Goldman Sachs	21.904	(2.719)	EPAM Systems Inc	Barclays Bank	18.544
34.578	Enochian Biosciences Inc	HSBC	12.794	(2.951)	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs	(88.116)
18.956	Enochian Biosciences Inc	Morgan Stanley	4.929	(4.544)	EPAM Systems Inc	Morgan Stanley	30.990
(7.701)	Enova International Inc	Goldman Sachs	(15.864)	3.014	Epizyme Inc	Goldman Sachs	(2.351)
3.261	Enphase Energy Inc	Barclays Bank	7.109	21.378	Epizyme Inc	Morgan Stanley	(6.413)
344	Enphase Energy Inc	Goldman Sachs	8.472	14.985	ePlus Inc	Barclays Bank	(6.144)
1.124	Enphase Energy Inc	Morgan Stanley	2.450	2.269	ePlus Inc	Goldman Sachs	(12.956)
(2.612)	EnPro Industries Inc	Bank of America		14.622	ePlus Inc	Morgan Stanley	(5.995)
		Merrill Lynch	7.470	(5.072)	EPR Properties (REIT)	Bank of America	
(10.493)	EnPro Industries Inc	Barclays Bank	(6.296)			Merrill Lynch	(6.188)
(1.735)	EnPro Industries Inc	Goldman Sachs	4.962	(11.272)	EPR Properties (REIT)	Barclays Bank	(13.639)
(9.114)	Ensign Group Inc	Bank of America		14.514	EPR Properties (REIT)	Barclays Bank	17.562
		Merrill Lynch	(9.934)	(3.936)	EPR Properties (REIT)	Goldman Sachs	(5.196)
(1.716)	Ensign Group Inc	Goldman Sachs	(1.870)	4.376	EPR Properties (REIT)	Morgan Stanley	5.295
(955)	Ensign Group Inc	HSBC	735	(24.921)	EQT Corp	Barclays Bank	12.959
(15.216)	Ensign Group Inc	Morgan Stanley	(29.823)	9.563	EQT Corp	Goldman Sachs	(21.517)
(1.402)	Enstar Group Ltd	Goldman Sachs	(9.169)	(6.244)	EQT Corp	Morgan Stanley	3.247
(4.379)	Enstar Group Ltd	Morgan Stanley	(46.505)	(1.887)	Equifax Inc	Barclays Bank	4.642
(7.111)	Entegris Inc	Bank of America		(299)	Equifax Inc	Goldman Sachs	(140)
		Merrill Lynch	(50.488)	1.245	Equifax Inc	Morgan Stanley	(3.063)
(920)	Entegris Inc	Barclays Bank	(1.168)	(4.783)	Equifax Inc	Morgan Stanley	11.766
(3.748)	Entegris Inc	Goldman Sachs	(26.611)	(17.837)	Equillum Inc	Goldman Sachs	(14.983)
(3.628)	Entegris Inc	Morgan Stanley	(4.361)	849	Equinix Inc (REIT)	Bank of America	
(1.639)	Entergy Corp	HSBC	6.310			Merrill Lynch	18.415
(16.293)	Entergy Corp	Morgan Stanley	25.091	1.006	Equinix Inc (REIT)	Barclays Bank	13.501
12.732	Enterprise Bancorp Inc	Bank of America		1.020	Equinix Inc (REIT)	Goldman Sachs	22.124
		Merrill Lynch	3.056	2.162	Equinix Inc (REIT)	HSBC	36.149
3.532	Enterprise Bancorp Inc	Barclays Bank	1.589	103	Equinix Inc (REIT)	Morgan Stanley	1.382
13.164	Enterprise Bancorp Inc	Goldman Sachs	3.159	505	Equitable Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.061)
3.493	Enterprise Bancorp Inc	HSBC	(3.214)	10.797	Equitable Holdings Inc	HSBC	(27.856)
19.575	Enterprise Bancorp Inc	Morgan Stanley	8.809	23.896	Equitable Holdings Inc	Morgan Stanley	(23.896)
(33.317)	Enterprise Financial Services Corp	Bank of America		(12.420)	Equitrans Midstream Corp	HSBC	1.987
		Merrill Lynch	1.570	20.993	Equitrans Midstream Corp	Morgan Stanley	(4.618)
(32.566)	Enterprise Financial Services Corp	Barclays Bank	(8.142)	(14.343)	Equity Bancshares Inc 'A'	Morgan Stanley	(18.933)
(9.977)	Enterprise Financial Services Corp	Goldman Sachs	3.292	(46.205)	Equity Commonwealth (REIT)	Bank of America	
(14.155)	Enterprise Financial Services Corp	HSBC	3.963			Merrill Lynch	(7.855)
(30.671)	Enterprise Financial Services Corp	Morgan Stanley	(5.593)	(10.452)	Equity Commonwealth (REIT)	Barclays Bank	3.345
39.492	Entravision	Bank of America		(40.188)	Equity Commonwealth (REIT)	Goldman Sachs	(6.832)
		Merrill Lynch	10.773	(26.616)	Equity Commonwealth (REIT)	HSBC	(5.057)
17.267	Entravision	Barclays Bank	1.036	(37.012)	Equity Commonwealth (REIT)		
				(8.176)	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	11.844
14.243	Entravision	Goldman Sachs	6.103	3.320	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	Bank of America	
58.818	Entravision	HSBC	42.349			Merrill Lynch	(11.926)
						Barclays Bank	(664)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(929)	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	186	(1.244)	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(684)
8.984	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(1.797)	(9.961)	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	(4.482)
(6.050)	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	949	(16.644)	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(7.490)
10.880	Equity Residential (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	37.862	(7.341)	Essential Utilities Inc	Goldman Sachs	(8.426)
409	Equity Residential (REIT)	Barclays Bank	519	(15.308)	Essential Utilities Inc	HSBC	(15.920)
(8.664)	Equity Residential (REIT)	Barclays Bank	(11.003)	(11.907)	Essential Utilities Inc	Morgan Stanley	(3.572)
3.269	Equity Residential (REIT)	Goldman Sachs	11.376	(379)	Essex Property Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	(96)
11.385	Equity Residential (REIT)	HSBC	32.447	(58)	Essex Property Trust Inc (REIT)	HSBC	(228)
38.909	Equity Residential (REIT)	Morgan Stanley	49.414	525	Essex Property Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	1.538
(5.039)	Equity Residential (REIT)	Morgan Stanley	(6.400)	(1.097)	Essex Property Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(3.214)
(1.222)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2.823	(589)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Goldman Sachs	(5.819)
902	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2.084)	962	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Morgan Stanley	3.906
(4.080)	Erie Indemnity Co 'A'	Barclays Bank	(17.993)	20.378	Ethan Allen Interiors Inc	Goldman Sachs	(21.397)
1.548	Erie Indemnity Co 'A'	Barclays Bank	5.100	368	Ethan Allen Interiors Inc	Morgan Stanley	423
651	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	1.518	(23.644)	Eton Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	42.323
1.995	Erie Indemnity Co 'A'	HSBC	11.403	972	Etsy Inc	Barclays Bank	(437)
2.322	Erie Indemnity Co 'A'	Morgan Stanley	4.887	(2.609)	Etsy Inc	Barclays Bank	1.174
43.006	Eros STX Global Corp	Goldman Sachs	1.720	1.103	Etsy Inc	Goldman Sachs	(496)
71.796	Eros STX Global Corp	HSBC	6.462	(2.755)	Etsy Inc	Morgan Stanley	1.240
21.108	Eros STX Global Corp	Morgan Stanley	(1.055)	2.612	Euronet Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.661
25.192	Esc Inc*	Barclays Bank	6.741	352	Euronet Worldwide Inc	Barclays Bank	496
63.725	Esc Inc*	Goldman Sachs	(31.863)	9.225	Euronet Worldwide Inc	Goldman Sachs	48.247
41.059	Esc Inc*	Morgan Stanley	10.987	2.947	Euronet Worldwide Inc	HSBC	31.268
(13.745)	Escalade Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.034)	2.659	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	3.749
(5.486)	Escalade Inc	Barclays Bank	(3.017)	16.397	Evans Bancorp Inc	Barclays Bank	(492)
(8.717)	Escalade Inc	Goldman Sachs	(6.363)	6.693	Evans Bancorp Inc	Goldman Sachs	6.760
(15.527)	Escalade Inc	Morgan Stanley	(8.540)	2.047	Evans Bancorp Inc	Morgan Stanley	(61)
2.621	ESCO Technologies Inc	Barclays Bank	367	5.197	Evelo Biosciences Inc	Morgan Stanley	6.029
21.454	ESCO Technologies Inc	Morgan Stanley	3.004	(5.149)	Eventbrite Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2.266
(40.015)	Escrow New York (REIT)*	Bank of America Merrill Lynch	(776.291)	(5.353)	Eventbrite Inc 'A'	Barclays Bank	2.141
(39.940)	Escrow New York (REIT)*	Goldman Sachs	(774.796)	(5.422)	Eventbrite Inc 'A'	Goldman Sachs	2.386
(21.172)	Escrow New York (REIT)*	Morgan Stanley	(410.737)	2.592	Everbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	814
1.280	Esperion Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.229)	2.521	Everbridge Inc	Barclays Bank	2.471
5.523	Esperion Therapeutics Inc	Barclays Bank	(1.988)	3.992	Everbridge Inc	Goldman Sachs	4.303
2.161	Esperion Therapeutics Inc	HSBC	(4.841)	3.762	Everbridge Inc	Morgan Stanley	3.480
3.436	Esperion Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1.237)	4.986	Evercore Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.986)
782	Esports Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	810	898	Evercore Inc 'A'	HSBC	1.868
4.250	Esports Technologies Inc	Goldman Sachs	924	(3.528)	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	42.865
8.979	Esquire Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.710	(1.610)	Everest Re Group Ltd	Barclays Bank	5.812
11.569	Esquire Financial Holdings Inc	Barclays Bank	1.388	(2.030)	Everest Re Group Ltd	Goldman Sachs	24.665
6.010	Esquire Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	5.830	(517)	Everest Re Group Ltd	HSBC	6.643
4.342	Esquire Financial Holdings Inc	HSBC	6.491	(1.697)	Everest Re Group Ltd	Morgan Stanley	6.126
6.702	Esquire Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	804	231	Everest Re Group Ltd	Morgan Stanley	7
6.408	ESSA Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	597	(20.570)	Evergny Inc	HSBC	42.168
3.412	ESSA Bancorp Inc	Barclays Bank	444	(21.493)	Evergny Inc	Morgan Stanley	13.756
6.045	ESSA Bancorp Inc	Goldman Sachs	665	(9.025)	Everi Holdings Inc	HSBC	(24.187)
16.405	ESSA Bancorp Inc	HSBC	6.234	(7.608)	Everi Holdings Inc	Morgan Stanley	(9.662)
11.010	ESSA Bancorp Inc	Morgan Stanley	1.431	4.993	EverQuote Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	10.735
8.929	Essent Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.962)	2.769	EverQuote Inc 'A'	Barclays Bank	5.704
13.924	Essent Group Ltd	Barclays Bank	4.050	569	EverQuote Inc 'A'	Goldman Sachs	1.102
38.321	Essent Group Ltd	Goldman Sachs	3.380	4.268	EverQuote Inc 'A'	HSBC	2.219
18.974	Essent Group Ltd	HSBC	(2.687)	892	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	(2.560)
4.275	Essent Group Ltd	Morgan Stanley	1.497	(8.158)	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	18.205
				18.170	Eversource Energy	Barclays Bank	(38.339)
				7.519	Eversource Energy	Goldman Sachs	(21.580)
				12.131	Eversource Energy	HSBC	(51.678)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
36.772	Eversource Energy	Morgan Stanley	(77.589)	(975)	eXp World Holdings Inc	Morgan Stanley	(597)
(13.732)	EVERTEC Inc	Bank of America		285	Expedia Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(137)			Merrill Lynch	2.138
(6.091)	EVERTEC Inc	Barclays Bank	(122)	4.829	Expedia Group Inc	Barclays Bank	26.163
(4.192)	EVERTEC Inc	Goldman Sachs	(42)	3.644	Expedia Group Inc	Goldman Sachs	25.710
(22.598)	EVERTEC Inc	HSBC	(13.785)	1.375	Expedia Group Inc	Morgan Stanley	4.384
(36.203)	EVERTEC Inc	Morgan Stanley	(724)	1.332	Expeditors International of Washington Inc	Bank of America	
(6.851)	EVI Industries Inc	Barclays Bank	2.946			Merrill Lynch	6.700
(11.566)	Evo Payments Inc 'A'	Bank of America		6.753	Expeditors International of Washington Inc	Barclays Bank	9.985
		Merrill Lynch	(7.402)				
(11.393)	Evo Payments Inc 'A'	Barclays Bank	(1.937)	4.523	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs	22.751
(27.225)	Evo Payments Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.628)				
(125.347)	Evoform Biosciences Inc	Barclays Bank	(4.412)	10.503	Expeditors International of Washington Inc	HSBC	59.237
(22.333)	Evoform Biosciences Inc	Goldman Sachs	9.380				
(4.478)	Evolent Health Inc 'A'	Barclays Bank	(403)	22.658	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	37.670
(1.982)	Evolent Health Inc 'A'	Morgan Stanley	(178)				
(7.167)	Evolus Inc	Barclays Bank	(9.604)	(1.107)	Exponent Inc	Bank of America	
(1.546)	Evolus Inc	Goldman Sachs	(2.891)			Merrill Lynch	2.546
24.419	Evolution Petroleum Corp	Bank of America		(5.400)	Exponent Inc	Barclays Bank	4.806
		Merrill Lynch	(2.198)	(25.059)	Exponent Inc	Goldman Sachs	57.636
84.837	Evolution Petroleum Corp	Goldman Sachs	(7.635)	(3.085)	Exponent Inc	Morgan Stanley	2.746
74.590	Evolution Petroleum Corp	Morgan Stanley	(2.984)	20.275	Express Inc	Morgan Stanley	11.354
7.910	Evoqua Water Technologies Corp	Goldman Sachs	16.532	7.137	Exterran Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(2.926)
1.665	Evoqua Water Technologies Corp	HSBC	2.531	22.300	Exterran Corp	Barclays Bank	(2.676)
				7.905	Exterran Corp	Goldman Sachs	(3.241)
16.617	Evoqua Water Technologies Corp	Morgan Stanley	14.789	18.718	Exterran Corp	Morgan Stanley	(2.246)
		Goldman Sachs	1.286	1.351	Extra Space Storage Inc (REIT)	Bank of America	
2.010	EW Scripps Co 'A'	Morgan Stanley	(15.053)			Merrill Lynch	5.674
26.408	EW Scripps Co 'A'	Bank of America		3.910	Extra Space Storage Inc (REIT)	Barclays Bank	4.461
(1.033)	Exact Sciences Corp	Merrill Lynch	(16.383)				
		Barclays Bank	(1.112)	930	Extra Space Storage Inc (REIT)	Goldman Sachs	2.123
(1.059)	Exact Sciences Corp	HSBC	(3.028)	9.409	Extraction Oil & Gas Inc	Barclays Bank	(7.904)
(259)	Exact Sciences Corp	Morgan Stanley	(4.728)	4.268	Extraction Oil & Gas Inc	HSBC	11.737
(4.503)	Exact Sciences Corp	Bank of America		(17.727)	Extreme Networks Inc	Bank of America	
11.257	Exagen Inc	Merrill Lynch	19.137			Merrill Lynch	(2.937)
		Barclays Bank	8.676	(22.900)	Extreme Networks Inc	Morgan Stanley	(229)
5.389	Exagen Inc	Goldman Sachs	15.215	(3.989)	Exxon Mobil Corp	Bank of America	
8.950	Exagen Inc	HSBC	(2.650)			Merrill Lynch	4.453
8.117	Exagen Inc	Morgan Stanley	3.059	(19.153)	Exxon Mobil Corp	Barclays Bank	23.750
1.900	Exagen Inc	Bank of America		(9.904)	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs	7.275
(9.857)	Exelixis Inc	Merrill Lynch	26.515	(17.458)	Exxon Mobil Corp	HSBC	73.498
		Barclays Bank	3.611	(39.968)	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	49.560
(3.196)	Exelixis Inc	Goldman Sachs	10.187	(6.882)	EyePoint Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(4.817)
(3.787)	Exelixis Inc	HSBC	11.959				
(4.983)	Exelixis Inc	Bank of America		(1.386)	EyePoint Pharmaceuticals Inc	HSBC	(1.331)
7.422	Exelon Corp	Merrill Lynch	223	(2.330)	EyePoint Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.631)
		HSBC	(1.792)				
(2.987)	Exelon Corp	Morgan Stanley	19.261	32.795	EZCORP Inc 'A'	Bank of America	
(21.166)	Exelon Corp	Bank of America				Merrill Lynch	3.607
66.965	Exicure Inc	Merrill Lynch	14.063	93.020	EZCORP Inc 'A'	Barclays Bank	5.581
		Barclays Bank	190	65.680	EZCORP Inc 'A'	Goldman Sachs	7.225
19.006	Exicure Inc	HSBC	(1.884)	64.016	EZCORP Inc 'A'	HSBC	51.853
26.919	Exicure Inc	Bank of America		54.992	EZCORP Inc 'A'	Morgan Stanley	3.300
(9.665)	ExlService Holdings Inc	Merrill Lynch	(45.136)	758	F5 Networks Inc	Bank of America	
		Barclays Bank	(1.662)			Merrill Lynch	3.573
(3.391)	ExlService Holdings Inc	Goldman Sachs	(7.995)	(549)	F5 Networks Inc	Barclays Bank	49
(1.712)	ExlService Holdings Inc	HSBC	(36.376)	1.361	F5 Networks Inc	Goldman Sachs	6.506
(9.209)	ExlService Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.221)	(14.291)	Fabrinet	Barclays Bank	(50.055)
(6.914)	ExlService Holdings Inc	Bank of America		(6.504)	Fabrinet	HSBC	(44.032)
(1.772)	ExOne Co	Merrill Lynch	(3.473)	(21.098)	Fabrinet	Morgan Stanley	(74.826)
		Barclays Bank	(11.157)	(228)	Facebook Inc 'A'	Bank of America	
(9.702)	ExOne Co	Bank of America				Merrill Lynch	(3.610)
(1.902)	eXp World Holdings Inc	Merrill Lynch	(10.347)	(12.547)	Facebook Inc 'A'	Barclays Bank	(31.567)
		Barclays Bank	(39.410)	(416)	Facebook Inc 'A'	Goldman Sachs	(6.461)
(9.683)	eXp World Holdings Inc	Barclays Bank	23.093	(308)	Facebook Inc 'A'	HSBC	722
5.674	eXp World Holdings Inc	Goldman Sachs	(8.960)	(1.358)	Facebook Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.568)
(1.647)	eXp World Holdings Inc	HSBC	11.628				
1.814	eXp World Holdings Inc						

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
2.207	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs	10.185	5.073	Federal Realty Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	6.899
246	FactSet Research Systems Inc	HSBC	1.132	(1.278)	Federal Realty Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1.738)
325	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	744	2.775	Federal Realty Investment Trust (REIT)	Barclays Bank	3.302
(544)	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8.633)	227	Federal Realty Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	309
(1.236)	Fair Isaac Corp	Barclays Bank	(7.120)	(4.039)	Federal Realty Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(5.493)
(1.353)	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs	(21.472)	(373)	Federal Realty Investment Trust (REIT)	HSBC	705
(80)	Fair Isaac Corp	HSBC	(1.053)	(1.080)	Federal Realty Investment Trust (REIT)	Morgan Stanley	(1.285)
(1.440)	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	(8.294)	4.345	Federal Signal Corp	Bank of America Merrill Lynch	130
26.588	Falcon Minerals Corp	Barclays Bank	(3.722)	49.537	Federal Signal Corp	Barclays Bank	42.602
42.993	Falcon Minerals Corp	HSBC	(8.169)	1.131	Federal Signal Corp	Goldman Sachs	34
65.599	Falcon Minerals Corp	Morgan Stanley	(9.184)	10.445	Federal Signal Corp	HSBC	(5.954)
(2.063)	Farfetch Ltd 'A'	Barclays Bank	(10.294)	23.711	Federal Signal Corp	Morgan Stanley	20.391
(3.786)	Farfetch Ltd 'A'	Morgan Stanley	(18.892)	(4.567)	Federated Hermes Inc	Bank of America Merrill Lynch	381
(2.282)	Farmer Bros Co	Goldman Sachs	90	(18.017)	Federated Hermes Inc	Barclays Bank	3.485
(11.384)	Farmer Bros Co	Morgan Stanley	5.464	(9.869)	Federated Hermes Inc	Goldman Sachs	589
4.511	Farmers & Merchants Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	722	(15.573)	Federated Hermes Inc	HSBC	23.827
2.943	Farmers & Merchants Bancorp Inc	Barclays Bank	(59)	(25.512)	Federated Hermes Inc	Morgan Stanley	5.868
6.481	Farmers & Merchants Bancorp Inc	Goldman Sachs	1.037	(516)	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.864)
3.602	Farmers & Merchants Bancorp Inc	HSBC	—	(2.948)	FedEx Corp	Goldman Sachs	(16.361)
9.253	Farmers & Merchants Bancorp Inc	Morgan Stanley	(185)	(3.108)	FedEx Corp	Morgan Stanley	(9.231)
68.337	Farmers National Banc Corp	Bank of America Merrill Lynch	17.084	5.719	FedNat Holding Co	Barclays Bank	1.487
24.465	Farmers National Banc Corp	Barclays Bank	(3.670)	9.122	FedNat Holding Co	Goldman Sachs	3.649
87.275	Farmers National Banc Corp	Goldman Sachs	21.819	5.152	FedNat Holding Co	HSBC	412
39.923	Farmers National Banc Corp	Morgan Stanley	(5.988)	47.681	FedNat Holding Co	Morgan Stanley	12.397
(28.127)	Farmland Partners Inc (REIT)	Morgan Stanley	7.313	18.344	Fennec Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	19.261
2.207	FARO Technologies Inc	Barclays Bank	1.170	40.865	Fennec Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	26.562
3.489	FARO Technologies Inc	Goldman Sachs	8.862	(6.092)	FibroGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.970)
4.146	FARO Technologies Inc	HSBC	24.959	(1.807)	FibroGen Inc	Barclays Bank	(885)
(18.067)	Fastenal Co	Bank of America Merrill Lynch	11.382	(1.351)	FibroGen Inc	Goldman Sachs	(1.324)
(28.285)	Fastenal Co	Barclays Bank	(5.630)	(6.914)	FibroGen Inc	Morgan Stanley	(3.388)
(47.577)	Fastenal Co	Goldman Sachs	15.103	(110)	Fidelity D&D Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	36
(921)	Fastenal Co	HSBC	654	(24)	Fidelity D&D Bancorp Inc	Barclays Bank	(3)
(28.416)	Fastenal Co	Morgan Stanley	(5.399)	(1.224)	Fidelity D&D Bancorp Inc	Morgan Stanley	(159)
(3.543)	Fastly Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7.128)	(2.484)	Fidelity National Financial Inc	Morgan Stanley	149
(2.279)	Fastly Inc 'A'	Barclays Bank	412	4.480	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	134
(581)	Fastly Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.847)	423	Fidelity National Information Services Inc	Barclays Bank	(871)
(5.234)	Fate Therapeutics Inc	Barclays Bank	(13.451)	3.634	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs	109
(9.413)	Fate Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2.448)	19.128	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	(39.404)
(714)	Fate Therapeutics Inc	HSBC	(635)	(4.643)	Fiesta Restaurant Group Inc	Morgan Stanley	2.925
521	Fathom Holdings Inc	Barclays Bank	880	(115.489)	Fifth Third Bancorp	Goldman Sachs	87.772
1.126	Fathom Holdings Inc	Goldman Sachs	4.572	(43.612)	Fifth Third Bancorp	Morgan Stanley	(11.775)
779	Fathom Holdings Inc	Morgan Stanley	1.317	18.569	Finance Of America Cos Inc 'A'	Barclays Bank	(11.698)
(8.121)	FB Financial Corp	HSBC	(812)	4.918	Finance Of America Cos Inc 'A'	Goldman Sachs	360
(36.282)	FB Financial Corp	Morgan Stanley	13.787	16.313	Finance Of America Cos Inc 'A'	HSBC	(9.614)
1.728	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(4.355)	2.070	Finance Of America Cos Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.304)
15.887	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Barclays Bank	(3.019)	(11.677)	Financial Institutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.707
4.661	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Goldman Sachs	(11.746)	(3.267)	Financial Institutions Inc	Barclays Bank	33
4.342	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Morgan Stanley	(825)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(18.754)	Financial Institutions Inc	Goldman Sachs	12.378	56.820	First Community		
(9.697)	Financial Institutions Inc	Morgan Stanley	97		Bankshares Inc	HSBC	53.979
8.136	FireEye Inc	Bank of America		36.624	First Community		
		Merrill Lynch	14.401		Bankshares Inc	Morgan Stanley	5.127
(22.770)	FireEye Inc	Bank of America		5.703	First Community Corp	Barclays Bank	1.312
		Merrill Lynch	(14.475)	7.187	First Community Corp	Goldman Sachs	359
14.332	FireEye Inc	Barclays Bank	573	28.129	First Community Corp	Morgan Stanley	6.470
12.020	FireEye Inc	Goldman Sachs	21.275	(4.539)	First Financial Bancorp	Barclays Bank	(318)
(10.625)	FireEye Inc	Goldman Sachs	(17.282)	(3.194)	First Financial Bancorp	Goldman Sachs	958
(17.752)	FireEye Inc	HSBC	(6.687)	(698)	First Financial Bancorp	Morgan Stanley	(362)
(39.633)	FireEye Inc	Morgan Stanley	(1.721)	(21.812)	First Financial Bankshares		
3.525	First American Financial	Bank of America			Inc	Goldman Sachs	21.594
	Corp	Merrill Lynch	(8.284)	(37.705)	First Financial Bankshares		
10.952	First American Financial				Inc	HSBC	(22.623)
	Corp	Barclays Bank	(14.347)	(38.571)	First Financial Bankshares		
5.388	First American Financial				Inc	Morgan Stanley	(28.157)
	Corp	Goldman Sachs	(12.662)	67.193	First Financial Corp	Bank of America	
3.182	First American Financial					Merrill Lynch	7.391
	Corp	HSBC	(6.046)	10.085	First Financial Corp	Barclays Bank	2.219
15.295	First American Financial			42.396	First Financial Northwest	Bank of America	
	Corp	Morgan Stanley	(20.036)		Inc	Merrill Lynch	16.110
7.275	First Bancorp Inc	Bank of America		35.612	First Financial Northwest		
		Merrill Lynch	12.950		Inc	Goldman Sachs	13.533
10.177	First Bancorp Inc	Barclays Bank	7.836	(37.569)	First Foundation Inc	Morgan Stanley	(6.762)
8.226	First Bancorp Inc	Goldman Sachs	14.642	(2.148)	First Guaranty Bancshares	Bank of America	
8.604	First Bancorp Inc	HSBC	15.573		Inc	Merrill Lynch	(1.998)
14.137	First Bancorp Inc	Morgan Stanley	10.885	(2.205)	First Guaranty Bancshares		
(3.662)	First Bancshares Inc	Bank of America			Inc	Morgan Stanley	(728)
		Merrill Lynch	1.904	13.356	First Hawaiian Inc	Bank of America	
(7.374)	First Bancshares Inc	Barclays Bank	(1.401)			Merrill Lynch	(7.078)
(7.742)	First Bancshares Inc	Goldman Sachs	4.026	14.112	First Hawaiian Inc	Barclays Bank	1.598
(8.549)	First Bancshares Inc	HSBC	(1.111)	13.250	First Hawaiian Inc	Goldman Sachs	(7.023)
(44.596)	First Bancshares Inc	Morgan Stanley	(8.473)	6.918	First Hawaiian Inc	HSBC	(346)
40.599	First Bank	Bank of America		68.969	First Hawaiian Inc	Morgan Stanley	6.937
		Merrill Lynch	(2.030)	(27.326)	First Horizon Corp	Bank of America	
17.854	First Bank	Barclays Bank	(179)			Merrill Lynch	3.006
11.783	First Bank	Goldman Sachs	(589)	4.817	First Horizon Corp	Bank of America	
(4.598)	First Busey Corp	Goldman Sachs	(6.253)			Merrill Lynch	(530)
(40.880)	First Busey Corp	HSBC	(60.911)	45.959	First Horizon Corp	Goldman Sachs	(5.055)
(41.429)	First Busey Corp	Morgan Stanley	(30.243)	(1.274)	First Horizon Corp	Goldman Sachs	(420)
19.341	First Business Financial	Bank of America		14.579	First Horizon Corp	HSBC	1.021
	Services Inc	Merrill Lynch	1.934	(5.676)	First Industrial Realty Trust		
18.719	First Business Financial				Inc (REIT)	Barclays Bank	3.179
	Services Inc	Barclays Bank	(11.044)	83.412	First Industrial Realty Trust		
16.754	First Business Financial				Inc (REIT)	Goldman Sachs	110.938
	Services Inc	Goldman Sachs	1.675	(2.633)	First Industrial Realty Trust		
14.209	First Business Financial				Inc (REIT)	Goldman Sachs	(3.502)
	Services Inc	HSBC	9.094	4.009	First Industrial Realty Trust		
6.181	First Business Financial				Inc (REIT)	Morgan Stanley	(2.245)
	Services Inc	Morgan Stanley	(3.647)	(2.948)	First Internet Bancorp	Bank of America	
(1.621)	First Capital Inc	Bank of America				Merrill Lynch	4.245
		Merrill Lynch	(567)	(2.303)	First Internet Bancorp	Barclays Bank	1.313
(14.032)	First Choice Bancorp	Bank of America		(972)	First Internet Bancorp	Goldman Sachs	1.400
		Merrill Lynch	1.684	(8.763)	First Internet Bancorp	Morgan Stanley	4.995
(5.169)	First Choice Bancorp	Barclays Bank	(310)	2.621	First Interstate BancSystem	Bank of America	
(1.725)	First Choice Bancorp	Goldman Sachs	207		Inc 'A'	Merrill Lynch	(1.048)
(3.316)	First Choice Bancorp	Morgan Stanley	(199)	65.074	First Interstate BancSystem		
269	First Citizens BancShares	Bank of America			Inc 'A'	Barclays Bank	48.805
	Inc 'A'	Merrill Lynch	3.661	21.516	First Interstate BancSystem		
300	First Citizens BancShares				Inc 'A'	Goldman Sachs	(8.606)
	Inc 'A'	Barclays Bank	(1.238)	32.929	First Interstate BancSystem		
633	First Citizens BancShares				Inc 'A'	HSBC	10.700
	Inc 'A'	Goldman Sachs	(731)	25.897	First Interstate BancSystem		
697	First Citizens BancShares				Inc 'A'	Morgan Stanley	19.423
	Inc 'A'	Morgan Stanley	3.212	(53.908)	First Merchants Corp	Bank of America	
646	First Community	Bank of America				Merrill Lynch	54.986
	Bankshares Inc	Merrill Lynch	(459)	(80.500)	First Merchants Corp	Barclays Bank	19.320
19.579	First Community			(17.539)	First Merchants Corp	HSBC	9.120
	Bankshares Inc	Barclays Bank	2.741	(19.500)	First Merchants Corp	Morgan Stanley	4.680
15.800	First Community			(38.797)	First Mid Bancshares Inc	Bank of America	
	Bankshares Inc	Goldman Sachs	(11.218)			Merrill Lynch	(14.355)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(29.242)	First Mid Bancshares Inc	Goldman Sachs	(10.820)	(1.704)	Five9 Inc	Goldman Sachs	(22.885)
(2.689)	First Mid Bancshares Inc	HSBC	(2.366)	9.053	Five9 Inc	Morgan Stanley	42.368
(13.824)	First Mid Bancshares Inc	Morgan Stanley	(1.659)	(2.146)	FleetCor Technologies Inc	Bank of America	
(16.991)	First Midwest Bancorp Inc	HSBC	3.398			Merrill Lynch	(4.755)
(30.927)	First Midwest Bancorp Inc	Morgan Stanley	3.711	(2.417)	FleetCor Technologies Inc	Barclays Bank	(5.474)
58.552	First Northwest Bancorp	Bank of America		(346)	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs	(820)
		Merrill Lynch	28.690	(357)	FleetCor Technologies Inc	HSBC	3.124
1.596	First Northwest Bancorp	Barclays Bank	32	(10.852)	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	(14.791)
1.569	First Northwest Bancorp	Goldman Sachs	769	980	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	1.392
1.178	First Northwest Bancorp	HSBC	1.107	12.869	Flex Ltd	Bank of America	
1.593	First Northwest Bancorp	Morgan Stanley	32			Merrill Lynch	9.910
(6.283)	First of Long Island Corp	Bank of America		128.935	Flex Ltd	Barclays Bank	21.919
		Merrill Lynch	6.911	61.224	Flex Ltd	Goldman Sachs	47.142
(13.419)	First of Long Island Corp	Barclays Bank	805	29.757	Flex Ltd	Morgan Stanley	5.059
(7.356)	First of Long Island Corp	Goldman Sachs	8.092	2.055	Flexion Therapeutics Inc	Bank of America	
(27.209)	First of Long Island Corp	HSBC	4.353			Merrill Lynch	288
(15.207)	First of Long Island Corp	Morgan Stanley	912	28.204	Flexion Therapeutics Inc	Barclays Bank	(475)
9.415	First Republic Bank	Barclays Bank	9.227	1.094	Flexion Therapeutics Inc	Goldman Sachs	153
1.689	First Republic Bank	HSBC	4.729	6.216	Flexion Therapeutics Inc	HSBC	8.578
(2.200)	First Republic Bank	Morgan Stanley	(2.156)	21.130	Flexion Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(211)
7.099	First Savings Financial Group Inc	Bank of America		(5.158)	Flexsteel Industries Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	6.815			Merrill Lynch	(7.170)
848	First Savings Financial Group Inc	Barclays Bank	(356)	(11.802)	Flexsteel Industries Inc	Barclays Bank	1.652
2.139	First Savings Financial Group Inc	Goldman Sachs	2.053	(3.768)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	Bank of America	
322	First Savings Financial Group Inc	HSBC	493	(4.463)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	10.513
741	First Savings Financial Group Inc	Morgan Stanley	(311)	(1.695)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(2.098)
(3.942)	First Solar Inc	Barclays Bank	(2.878)	(4.084)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	4.729
3.488	First Solar Inc	Barclays Bank	2.546	(15.461)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	HSBC	47.849
(168)	First Solar Inc	Goldman Sachs	(766)	(76.369)	Flotek Industries Inc	Morgan Stanley	(4.453)
5.911	First Solar Inc	Goldman Sachs	16.785			Bank of America	
(775)	First Solar Inc	Morgan Stanley	(566)	(11.910)	Flotek Industries Inc	Merrill Lynch	(21.383)
6.462	First United Corp	Bank of America		(55.703)	Flotek Industries Inc	Goldman Sachs	(3.335)
		Merrill Lynch	(5.622)	(72.024)	Flotek Industries Inc	HSBC	(27.294)
4.382	First United Corp	Barclays Bank	(2.366)	4.585	Flowers Foods Inc	Morgan Stanley	(720)
20.049	First United Corp	Goldman Sachs	(17.443)	4.755	Flowserve Corp	HSBC	(3.072)
19.967	First United Corp	Morgan Stanley	(10.782)			Bank of America	
7.049	First Western Financial Inc	Bank of America		7.520	Flowserve Corp	Merrill Lynch	(5.231)
		Merrill Lynch	7.190	15.136	Flowserve Corp	Barclays Bank	226
3.066	First Western Financial Inc	Barclays Bank	184	3.095	Flowserve Corp	Goldman Sachs	(16.650)
6.322	First Western Financial Inc	Goldman Sachs	6.448	2.998	Flowserve Corp	HSBC	(650)
13.280	First Western Financial Inc	HSBC	16.202	6.249	Fluent Inc	Morgan Stanley	90
363	First Western Financial Inc	Morgan Stanley	22			Bank of America	
8.995	FirstCash Inc	Morgan Stanley	2.069	6.845	Fluent Inc	Merrill Lynch	(312)
(23.365)	FirstEnergy Corp	HSBC	(6.075)	28.405	Fluent Inc	Barclays Bank	137
(30.670)	FirstEnergy Corp	Morgan Stanley	307	12.948	Fluent Inc	Goldman Sachs	(1.420)
9.038	Fiserv Inc	Bank of America		(16.332)	Fluidigm Corp	Morgan Stanley	259
		Merrill Lynch	21.510	2.137	Fluor Corp	Goldman Sachs	(7.513)
9.124	Fiserv Inc	Barclays Bank	(6.022)	9.991	Fluor Corp	Barclays Bank	299
(17.098)	Fiserv Inc	Barclays Bank	11.285	40.150	Flushing Financial Corp	Goldman Sachs	(11.390)
6.392	Fiserv Inc	Goldman Sachs	15.213	4.271	FMC Corp	Goldman Sachs	(20.878)
285	Fiserv Inc	HSBC	(271)	(562)	FMC Corp	Barclays Bank	(214)
7.632	Fiserv Inc	Morgan Stanley	(5.037)	3.581	FMC Corp	Barclays Bank	28
(2.677)	Fiserv Inc	Morgan Stanley	1.767	(12.165)	FNB Corp	Goldman Sachs	(6.195)
(5.973)	Fisker Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.898)	(66.189)	FNB Corp	Merrill Lynch	2.920
(4.271)	Fisker Inc	Goldman Sachs	(2.084)	(48.473)	FNB Corp	Barclays Bank	(1.986)
(4.237)	Five Below Inc	Bank of America		(57.783)	FNB Corp	Goldman Sachs	11.634
		Merrill Lynch	(1.737)	(27.171)	FNB Corp	HSBC	1.734
10.687	Five Star Senior Living Inc	Bank of America		(5.482)	FNCB Bancorp Inc	Morgan Stanley	(816)
		Merrill Lynch	(2.779)	(410)	FNCB Bancorp Inc	Goldman Sachs	219
21.349	Five Star Senior Living Inc	Barclays Bank	(2.562)	(11.032)	FNCB Bancorp Inc	HSBC	(131)
3.577	Five Star Senior Living Inc	Goldman Sachs	(930)	(12.294)	Focus Financial Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	1.986
3.471	Five Star Senior Living Inc	Morgan Stanley	(417)			Bank of America	
1.050	Five9 Inc	Barclays Bank	4.914			Merrill Lynch	(44.627)
(162)	Five9 Inc	Barclays Bank	(758)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(5.375)	Focus Financial Partners Inc 'A'	Barclays Bank	(8.196)	26.083	Fortitude Gold Corp	Morgan Stanley	24.779
(9.854)	Focus Financial Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(30.866)	3.559	Fortive Corp	Bank of America	
(4.681)	Focus Financial Partners Inc 'A'	HSBC	(17.086)	15.898	Fortive Corp	Merrill Lynch	6.904
(18.971)	Focus Financial Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	(28.475)	442	Fortive Corp	Barclays Bank	8.903
3.477	Foghorn Therapeutics Inc	Bank of America		(83.042)	Fortress Biotech Inc	Morgan Stanley	248
2.519	Foghorn Therapeutics Inc	Merrill Lynch	2.643	(10.340)	Fortune Brands Home & Security Inc	Barclays Bank	(18.269)
5.332	Foghorn Therapeutics Inc	Barclays Bank	756	(8.280)	Fortune Brands Home & Security Inc	Barclays Bank	11.581
20.792	Foghorn Therapeutics Inc	Goldman Sachs	4.052	(374)	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldman Sachs	26.331
4.838	Foghorn Therapeutics Inc	HSBC	11.966	(3.496)	Forward Air Corp	Morgan Stanley	419
10.340	FONAR Corp	Morgan Stanley	1.451	3.041	Fossil Group Inc	Bank of America	(6.398)
5.625	FONAR Corp	Goldman Sachs	(8.375)	4.069	Fossil Group Inc	Merrill Lynch	(678)
(438)	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	(675)	2.611	Fossil Group Inc	Barclays Bank	8.667
(24.968)	Foot Locker Inc	Bank of America		72.565	Four Corners Property Trust Inc (REIT)	HSBC	6.789
541	Foot Locker Inc	Merrill Lynch	1.108	2.224	Four Corners Property Trust Inc (REIT)	Bank of America	37.008
(3.756)	Foot Locker Inc	Barclays Bank	(43.444)	28.212	Four Corners Property Trust Inc (REIT)	Merrill Lynch	
685	Foot Locker Inc	Barclays Bank	(55)	3.586	Fox Corp 'A'	Barclays Bank	166
(10.049)	Foot Locker Inc	Goldman Sachs	9.503	16.026	Fox Corp 'A'	Morgan Stanley	(1.411)
(4.158)	Ford Motor Co	HSBC	1.251	572	Fox Corp 'A'	Bank of America	(338)
52.955	Ford Motor Co	Morgan Stanley	(17.485)	15.520	Fox Corp 'A'	Merrill Lynch	7.126
(13.200)	Ford Motor Co	Bank of America		(17.042)	Fox Factory Holding Corp	HSBC	120
16.198	Ford Motor Co	Merrill Lynch	(6.611)	2.127	Fox Factory Holding Corp	Morgan Stanley	(1.397)
12.502	Forestar Group Inc	Barclays Bank	77.844	(1.263)	Fox Factory Holding Corp	Bank of America	1.534
6.783	Forestar Group Inc	Goldman Sachs	7.844	(921)	Fox Factory Holding Corp	Merrill Lynch	3.524
6.181	Forestar Group Inc	Morgan Stanley	(19.404)	1.135	Fox Factory Holding Corp	Bank of America	
5.068	Forestar Group Inc	Bank of America	23.811	(1.073)	Fox Factory Holding Corp	Merrill Lynch	(3.241)
4.930	Forian Inc	Merrill Lynch	(1.500)	561	Fox Factory Holding Corp	Goldman Sachs	2.570
1.564	Forian Inc	Barclays Bank	678	(839)	Fox Factory Holding Corp	Goldman Sachs	(1.132)
1.206	Forma Therapeutics Holdings Inc	Goldman Sachs	(742)	500	Fox Factory Holding Corp	HSBC	687
2.876	Forma Therapeutics Holdings Inc	Morgan Stanley	397	3.019	Franchise Group Inc	HSBC	910
(15.927)	FormFactor Inc	Bank of America		3.641	Franchise Group Inc	Morgan Stanley	(1.544)
(3.248)	FormFactor Inc	Merrill Lynch	(21.274)	4.875	Franchise Group Inc	Bank of America	920
(1.974)	FormFactor Inc	Barclays Bank	(715)	4.616	Franklin Covey Co	Merrill Lynch	453
(6.977)	FormFactor Inc	Goldman Sachs	(588)	240	Franklin Covey Co	Barclays Bank	(692)
10.013	Forrester Research Inc	Morgan Stanley	(1.868)	16.992	Franklin Covey Co	Goldman Sachs	731
20.583	Forrester Research Inc	Barclays Bank	(11.141)	11.500	Franklin Covey Co	HSBC	3.647
707	Forrester Research Inc	Goldman Sachs	(55.368)	22.982	Franklin Covey Co	Bank of America	
2.121	Forrester Research Inc	HSBC	(820)	20.563	Franklin Electric Co Inc	Merrill Lynch	139
1.442	Forte Biosciences Inc	Morgan Stanley	(2.588)	28.560	Franklin Electric Co Inc	Goldman Sachs	9.855
651	Forte Biosciences Inc	Bank of America		7.079	Franklin Electric Co Inc	HSBC	5.060
1.982	Forte Biosciences Inc	Merrill Lynch	5.581	17.011	Franklin Electric Co Inc	Morgan Stanley	4.826
637	Forte Biosciences Inc	Barclays Bank	(1.282)	19.502	Franklin Electric Co Inc	Bank of America	(25.498)
(8)	Forterra Inc	Goldman Sachs	7.670	5.898	Franklin Financial Services Corp	Barclays Bank	49.123
(3.369)	Forterra Inc	HSBC	2.414	2.896	Franklin Financial Services Corp	Goldman Sachs	(8.778)
(6.696)	Forterra Inc	Bank of America		4.526	Franklin Financial Services Corp	HSBC	(28.068)
(8.066)	Forterra Inc	Merrill Lynch	1	4.215	Franklin Financial Services Corp	Morgan Stanley	33.543
(7.925)	Fortinet Inc	Barclays Bank	(34)	1.126	Franklin Financial Services Corp	Bank of America	(1.475)
(8.897)	Fortinet Inc	Goldman Sachs	603	(3.593)	Franklin Resources Inc	Merrill Lynch	
(1.522)	Fortinet Inc	HSBC	(81)	41.245	Franklin Street Properties Corp (REIT)	Barclays Bank	(825)
(1.831)	Fortinet Inc	Bank of America	(112.535)				
(6.250)	Fortinet Inc	Barclays Bank	(48.666)				
7.866	Fortitude Gold Corp	Goldman Sachs	(14.241)				
12.045	Fortitude Gold Corp	HSBC	(25.358)				
675	Fortitude Gold Corp	Morgan Stanley	(34.188)				
		Bank of America	7.111				
		Merrill Lynch	11.443				
		Barclays Bank	610				
		Goldman Sachs					

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
37.250	Franklin Street Properties Corp (REIT)	HSBC	(3.353)	(8.820)	FuelCell Energy Inc	Barclays Bank	(11.642)
24.541	Franklin Street Properties Corp (REIT)	Morgan Stanley	(491)	(21.474)	FuelCell Energy Inc	Goldman Sachs	(40.156)
30.371	Frank's International NV	Morgan Stanley	(3.645)	(1.886)	Fulgent Genetics Inc	Barclays Bank	(5.790)
(17.791)	Freeport-McMoRan Inc	Bank of America		(4.119)	Full House Resorts Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	25.975			Merrill Lynch	(8.197)
(2.703)	Freeport-McMoRan Inc	Barclays Bank	(3.696)	(3.251)	Full House Resorts Inc	Barclays Bank	(1.495)
(10.923)	Freeport-McMoRan Inc	Goldman Sachs	8.830	(32.910)	Full House Resorts Inc	Goldman Sachs	(65.491)
4.023	Freeport-McMoRan Inc	HSBC	8.183	(2.783)	Full House Resorts Inc	Morgan Stanley	(1.280)
(3.987)	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	(4.585)	77.966	Fulton Financial Corp	HSBC	(10.915)
4.948	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	5.690	72.903	Fulton Financial Corp	Morgan Stanley	1.458
(11.542)	FreightCar America Inc	Bank of America		(4.316)	Funko Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(9.580)			Merrill Lynch	(3.971)
(13.437)	Frequency Therapeutics Inc	Barclays Bank	(9.943)	(8.718)	Funko Inc 'A'	Barclays Bank	(15.431)
(4.416)	Frequency Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(309)	(27.920)	FutureFuel Corp	Bank of America	
(620)	Fresh Del Monte Produce Inc	Barclays Bank	800			Merrill Lynch	112.244
(19.395)	Fresh Del Monte Produce Inc	HSBC	9.698	(29.832)	FutureFuel Corp	Barclays Bank	19.689
(28.308)	Fresh Del Monte Produce Inc	Morgan Stanley	36.517	(28.056)	FutureFuel Corp	Goldman Sachs	142.827
(283)	Freshpet Inc	Bank of America		(3.528)	FutureFuel Corp	Morgan Stanley	1.698
		Merrill Lynch	(2.224)	(11.711)	FVCBankcorp Inc	Barclays Bank	1.054
5.708	Freshpet Inc	Bank of America		(1.603)	FVCBankcorp Inc	Goldman Sachs	497
		Merrill Lynch	19.223	(27.591)	FVCBankcorp Inc	HSBC	(276)
(1.437)	Freshpet Inc	Barclays Bank	(2.500)	5.546	G1 Therapeutics Inc	Barclays Bank	(333)
1.616	Freshpet Inc	Barclays Bank	2.812	5.382	Gaia Inc	Bank of America	
1.846	Freshpet Inc	Goldman Sachs	2.392			Merrill Lynch	861
(425)	Freshpet Inc	Goldman Sachs	(3.341)	3.667	Gaia Inc	Barclays Bank	2.017
(1.027)	Freshpet Inc	HSBC	(5.227)	18.746	Gaia Inc	Goldman Sachs	2.999
1.321	Freshpet Inc	HSBC	8.723	8.268	Gaia Inc	HSBC	4.630
(170)	Freshpet Inc	Morgan Stanley	(296)	7.973	Galera Therapeutics Inc	Bank of America	
2.888	Freshpet Inc	Morgan Stanley	5.025			Merrill Lynch	4.943
(10.382)	frontdoor Inc	Bank of America		11.512	Galera Therapeutics Inc	Goldman Sachs	7.137
		Merrill Lynch	(20.133)	13.030	Galera Therapeutics Inc	HSBC	27.363
10.541	frontdoor Inc	Barclays Bank	7.062	4.627	Galera Therapeutics Inc	Morgan Stanley	972
(10.286)	frontdoor Inc	Barclays Bank	(6.871)	(10.204)	GAMCO Investors Inc 'A'	Bank of America	
4.464	frontdoor Inc	Goldman Sachs	12.097			Merrill Lynch	543
(6.705)	frontdoor Inc	Goldman Sachs	(18.171)	(5.727)	GAMCO Investors Inc 'A'	Barclays Bank	15.577
(3.884)	frontdoor Inc	HSBC	(3.962)	(2.552)	GAMCO Investors Inc 'A'	Goldman Sachs	179
2.348	frontdoor Inc	Morgan Stanley	1.573	(3.352)	GAMCO Investors Inc 'A'	HSBC	(9.821)
(9.796)	frontdoor Inc	Morgan Stanley	(6.064)	(4.884)	GameStop Corp 'A'	Barclays Bank	(205.079)
(38.371)	Frontline Ltd	Barclays Bank	14.581	(21.888)	Gaming and Leisure Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(1.313)
(6.386)	Frontline Ltd	Morgan Stanley	(171)				
354	FRP Holdings Inc	Barclays Bank	471	3.221	Gaming and Leisure Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	193
2.991	FRP Holdings Inc	Goldman Sachs	3.228	(5.789)	GAN Ltd	Barclays Bank	(7.526)
1.134	FRP Holdings Inc	Morgan Stanley	541	(4.524)	GAN Ltd	Goldman Sachs	(4.841)
6.887	FS Bancorp Inc	Bank of America		(5.731)	Gannett Co Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	7.300			Merrill Lynch	344
7.349	FS Bancorp Inc	Barclays Bank	4.997	(10.284)	Gap Inc	Bank of America	
7.399	FS Bancorp Inc	HSBC	11.690			Merrill Lynch	29.618
7.218	FS Bancorp Inc	Morgan Stanley	4.908	(9.968)	Gap Inc	Barclays Bank	(6.679)
532	F-star Therapeutics Inc'	Goldman Sachs	213	(12.705)	Gap Inc	Goldman Sachs	36.590
532	F-star Therapeutics Inc'	Goldman Sachs	213	(5.388)	Gap Inc	Morgan Stanley	(3.610)
31.630	FTC Solar Inc	Goldman Sachs	80.024	10.910	Gap Inc	Morgan Stanley	7.310
5.919	FTC Solar Inc	HSBC	167	(4.937)	Garmin Ltd	Barclays Bank	(11.109)
7.834	FTC Solar Inc	Morgan Stanley	10.733	(657)	Garmin Ltd	Morgan Stanley	(1.478)
1.860	FTI Consulting Inc	Bank of America		465	Gartner Inc	Barclays Bank	(405)
		Merrill Lynch	968	135	Gartner Inc	Goldman Sachs	732
1.134	FTI Consulting Inc	Barclays Bank	265	756	Gartner Inc	HSBC	514
(2.483)	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	(1.341)	5.546	Gartner Inc	Morgan Stanley	(4.825)
987	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	(88)	43.067	Gates Industrial Corp Plc	Barclays Bank	32.301
4.964	FTS International Inc 'A'	Bank of America		5.412	Gates Industrial Corp Plc	Goldman Sachs	4.005
		Merrill Lynch	(7.496)	25.698	Gates Industrial Corp Plc	HSBC	14.134
673	FTS International Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.016)	25.310	Gates Industrial Corp Plc	Morgan Stanley	18.983
1.513	FTS International Inc 'A'	HSBC	(2.950)	(17.699)	Gatos Silver Inc	Barclays Bank	(13.746)
(28.952)	FuelCell Energy Inc	Bank of America		(7.344)	Gatos Silver Inc	Goldman Sachs	(18.093)
		Merrill Lynch	(54.140)	(3.230)	Gatos Silver Inc	Morgan Stanley	(3.080)
				(3.342)	GATX Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	3.342
				5.280	GATX Corp	Morgan Stanley	(2.165)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(28.166)	GCP Applied Technologies Inc	Morgan Stanley	21.969	(15.236)	Gentex Corp	Goldman Sachs	(11.884)
7.432	Gemini Therapeutics Inc	Bank of America		(17.291)	Gentex Corp	HSBC	(6.571)
		Merrill Lynch	9.290	(17.986)	Gentex Corp	Morgan Stanley	(19.964)
6.914	Gemini Therapeutics Inc	Barclays Bank	9.403	3.155	Gentherm Inc	Bank of America	
8.372	Gemini Therapeutics Inc	Goldman Sachs	10.465	7.412	Gentherm Inc	Merrill Lynch	4.733
3.048	Gemini Therapeutics Inc	HSBC	4.633	5.722	Gentherm Inc	Barclays Bank	12.230
2.663	Gemini Therapeutics Inc	Morgan Stanley	3.622	1.215	Gentherm Inc	Goldman Sachs	1.348
(60.317)	Genasys Inc	Bank of America		669	Gentherm Inc	HSBC	1.042
		Merrill Lynch	19.905	1.736	Genuine Parts Co	Morgan Stanley	1.104
(16.015)	Genasys Inc	Barclays Bank	9.449			Bank of America	
(11.002)	Genasys Inc	Goldman Sachs	3.631	13.103	Genuine Parts Co	Merrill Lynch	(2.135)
(18.950)	Genasys Inc	HSBC	3.032	4.470	Genuine Parts Co	Barclays Bank	(2.278)
(5.637)	Genasys Inc	Morgan Stanley	3.326	2.919	Genuine Parts Co	Goldman Sachs	(4.156)
(8.808)	Genco Shipping & Trading Ltd	Barclays Bank	9.160	22.243	Genuine Parts Co	HSBC	(7.239)
(23.626)	Genco Shipping & Trading Ltd	Goldman Sachs	(9.687)	(45.132)	Genworth Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.477)
(13.601)	Genco Shipping & Trading Ltd	Morgan Stanley	14.145	(20.985)	GEO Group Inc (REIT)	Barclays Bank	(1.354)
23.474	Gencor Industries Inc	Bank of America		(2.812)	GEO Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	8.394
		Merrill Lynch	(13.145)	(10.122)	Geospace Technologies Corp	Bank of America	3.206
11.115	Gencor Industries Inc	Barclays Bank	3.668			Merrill Lynch	(1.316)
17.670	Gencor Industries Inc	Goldman Sachs	(9.895)	(10.773)	Geospace Technologies Corp	Barclays Bank	970
10.157	Gencor Industries Inc	HSBC	11.477	(16.314)	Geospace Technologies Corp	Goldman Sachs	(2.121)
16.747	Gencor Industries Inc	Morgan Stanley	5.527	(7.864)	Geospace Technologies Corp	Goldman Sachs	(2.121)
1.311	Generac Holdings Inc	Bank of America		(10.271)	German American Bancorp Inc	Morgan Stanley	708
		Merrill Lynch	45.166	(14.357)	German American Bancorp Inc	Barclays Bank	(13.660)
606	Generac Holdings Inc	Barclays Bank	10.956	(16.622)	German American Bancorp Inc	Goldman Sachs	(9.619)
1.240	Generac Holdings Inc	Goldman Sachs	43.115	(50.731)	German American Bancorp Inc	HSBC	(499)
366	Generac Holdings Inc	HSBC	8.605			Morgan Stanley	(67.472)
5.574	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	100.778	(193.284)	Geron Corp	Barclays Bank	—
(21.679)	General Electric Co	Bank of America		14.626	Getty Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	17.405
		Merrill Lynch	(19.728)	7.683	Getty Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	4.917
(28.402)	General Electric Co	Barclays Bank	(24.994)	198	Gibraltar Industries Inc	Bank of America	
(80.273)	General Electric Co	Goldman Sachs	(73.048)			Merrill Lynch	196
(10.263)	General Electric Co	HSBC	(7.287)	1.013	Gibraltar Industries Inc	Barclays Bank	142
(174.539)	General Electric Co	Morgan Stanley	(153.594)	388	Gibraltar Industries Inc	Goldman Sachs	384
(7.369)	General Mills Inc	Bank of America		391	Gibraltar Industries Inc	HSBC	(813)
		Merrill Lynch	(516)	10.185	Gibraltar Industries Inc	Morgan Stanley	1.426
(11.091)	General Mills Inc	Goldman Sachs	(776)	(12.247)	G-III Apparel Group Ltd	Barclays Bank	(11.022)
8.604	General Mills Inc	Goldman Sachs	340	(4.923)	G-III Apparel Group Ltd	Goldman Sachs	3.184
450	General Mills Inc	HSBC	225			Bank of America	
1.329	General Mills Inc	Morgan Stanley	(253)	3.271	Gilead Sciences Inc	Merrill Lynch	(9.682)
(26.940)	General Motors Co	Bank of America		35.195	Gilead Sciences Inc	Barclays Bank	(46.457)
		Merrill Lynch	(88.094)	1.482	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs	(4.387)
(4.503)	General Motors Co	Barclays Bank	(12.203)	241	Gilead Sciences Inc	HSBC	(648)
1.843	General Motors Co	HSBC	8.470	38.348	Gilead Sciences Inc	Morgan Stanley	(48.422)
(8.568)	General Motors Co	Morgan Stanley	(23.219)	5.613	Glacier Bancorp Inc	Bank of America	
(3.467)	Generation Bio Co	Bank of America				Merrill Lynch	(9.464)
		Merrill Lynch	(11.857)	32.310	Glacier Bancorp Inc	Barclays Bank	(11.632)
(777)	Generation Bio Co	Barclays Bank	(3.100)	312	Glacier Bancorp Inc	Goldman Sachs	(1.017)
(5.726)	Generation Bio Co	Goldman Sachs	(19.583)	2.898	Glacier Bancorp Inc	HSBC	(7.622)
892	Genesco Inc	Bank of America		3.692	Glacier Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.329)
		Merrill Lynch	(2.337)	(10.663)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Bank of America	
1.365	Genesco Inc	Morgan Stanley	683	(68.052)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Merrill Lynch	(8.881)
(38.152)	Genie Energy Ltd 'B'	Bank of America		(13.987)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Barclays Bank	(58.560)
		Merrill Lynch	20.221	(25.813)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Goldman Sachs	(743)
(5.009)	Genie Energy Ltd 'B'	Barclays Bank	2.304			Morgan Stanley	(16.409)
(18.827)	Genie Energy Ltd 'B'	Goldman Sachs	9.978	23.225	Gladstone Land Corp (REIT)	Bank of America	
(7.176)	Genie Energy Ltd 'B'	HSBC	(359)	14.766	Gladstone Land Corp (REIT)	Merrill Lynch	(32.283)
(13.576)	Genie Energy Ltd 'B'	Morgan Stanley	6.245			Goldman Sachs	(20.525)
44.754	Genpact Ltd	Goldman Sachs	62.656				
5.628	Genprex Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	1.745				
5.618	Genprex Inc	Barclays Bank	674				
4.965	Genprex Inc	Goldman Sachs	1.539				
9.969	Genprex Inc	HSBC	3.550				
4.642	Genprex Inc	Morgan Stanley	557				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
5.961	Gladstone Land Corp (REIT)	Morgan Stanley	(8.107)	(1.464)	GoHealth Inc 'A'	Goldman Sachs	(234)
(26.140)	Glatfelter Corp	Barclays Bank	(2.353)	9.387	GoHealth Inc 'A'	HSBC	(20)
(48.054)	Glatfelter Corp	Goldman Sachs	(24.988)	(35.612)	Golar LNG Ltd	Bank of America	
(42.175)	Glatfelter Corp	HSBC	16.448	(11.441)	Golar LNG Ltd	Merrill Lynch	(27.777)
(20.803)	Glatfelter Corp	Morgan Stanley	(1.872)	36.930	Gold Resource Corp	Goldman Sachs	(8.924)
(1.212)	Glaukos Corp	Barclays Bank	2.872	29.666	Gold Resource Corp	Bank of America	
626	Glaukos Corp	Barclays Bank	(1.484)	48.144	Gold Resource Corp	Merrill Lynch	(2.216)
387	Glaukos Corp	Goldman Sachs	(66)	37.463	Gold Resource Corp	Barclays Bank	(890)
998	Glaukos Corp	HSBC	(2.824)	91.293	Gold Resource Corp	Goldman Sachs	(2.889)
5.962	Global Blood Therapeutics Inc	Barclays Bank	7.154	(11.534)	Golden Entertainment Inc	HSBC	1.873
(639)	Global Blood Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1.355)	(5.569)	Golden Entertainment Inc	Morgan Stanley	(2.739)
(2.088)	Global Blood Therapeutics Inc	HSBC	(2.004)	16.858	Golden Entertainment Inc	Bank of America	(19.904)
(572)	Global Blood Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(686)	990	Golden Nugget Online Gaming Inc	Merrill Lynch	(7.232)
3.321	Global Indemnity Group LLC 'A'	Barclays Bank	2.258	(666)	Golden Nugget Online Gaming Inc	Barclays Bank	7.418
10.817	Global Indemnity Group LLC 'A'	Goldman Sachs	33.857	(1.926)	Goldman Sachs Group Inc	HSBC	1.000
4.415	Global Indemnity Group LLC 'A'	HSBC	12.804	(665)	Goldman Sachs Group Inc	Bank of America	(1.882)
6.738	Global Indemnity Group LLC 'A'	Morgan Stanley	4.582	(3.863)	Goldman Sachs Group Inc	Merrill Lynch	(4.210)
5.076	Global Medical Inc (REIT)	Bank of America	508	8.387	Goodrich Petroleum Corp	Barclays Bank	(1.091)
11.690	Global Medical Inc (REIT)	Barclays Bank	(1.754)	3.294	Goodrich Petroleum Corp	Morgan Stanley	(3.606)
12.824	Global Medical Inc (REIT)	Goldman Sachs	1.282	13.631	Goodrich Petroleum Corp	Merrill Lynch	(1.416)
37.124	Global Medical Inc (REIT)	HSBC	10.395	(4.419)	GoodRx Holdings Inc 'A'	Bank of America	(2.999)
2.726	Global Medical Inc (REIT)	Morgan Stanley	(409)	(8.439)	GoodRx Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	(13.018)
(4.021)	Global Payments Inc	Bank of America	12.465	(1.447)	GoodRx Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(36.553)
719	Global Payments Inc	Merrill Lynch	(2.229)	(3.668)	GoodRx Holdings Inc 'A'	HSBC	566
(532)	Global Payments Inc	Barclays Bank	819	12.454	Goodyear Tire & Rubber Co	Morgan Stanley	(17.093)
2.640	Global Payments Inc	Barclays Bank	(4.066)	48.395	Goodyear Tire & Rubber Co	Bank of America	9.772
(4.874)	Global Payments Inc	Goldman Sachs	15.109	9.415	Goodyear Tire & Rubber Co	Merrill Lynch	33.876
2.111	Global Payments Inc	Goldman Sachs	(6.544)	10.262	Goodyear Tire & Rubber Co	Barclays Bank	(572)
(7.319)	Global Payments Inc	Morgan Stanley	11.271	50.392	Goodyear Tire & Rubber Co	Goldman Sachs	(7.267)
1.683	Global Payments Inc	Morgan Stanley	(2.592)	924	Goosehead Insurance Inc 'A'	HSBC	7.267
13.858	Global Water Resources Inc	Barclays Bank	277	(8.268)	Goosehead Insurance Inc 'A'	Bank of America	6.893
26.230	Global Water Resources Inc	Goldman Sachs	6.820	896	Goosehead Insurance Inc 'A'	Barclays Bank	(43.002)
27.655	Global Water Resources Inc	Morgan Stanley	553	(4.529)	Goosehead Insurance Inc 'A'	Barclays Bank	5.197
812	Globant SA	Goldman Sachs	4.295	(4.529)	Goosehead Insurance Inc 'A'	Barclays Bank	5.197
1.151	Globant SA	HSBC	5.030	863	Goosehead Insurance Inc 'A'	Goldman Sachs	(33.786)
971	Globant SA	Morgan Stanley	544	1.492	Goosehead Insurance Inc 'A'	Goldman Sachs	6.438
(5.916)	Globe Life Inc	Bank of America	2.176	4.065)	Goosehead Insurance Inc 'A'	HSBC	(8.594)
(30.442)	Globe Life Inc	Barclays Bank	(5.501)	2.607	Goosehead Insurance Inc 'A'	Morgan Stanley	(23.577)
(2.466)	Globe Life Inc	Goldman Sachs	(231)	(7.641)	GoPro Inc 'A'	Morgan Stanley	15.121
(3.008)	Globe Life Inc	HSBC	246	(7.975)	GoPro Inc 'A'	Barclays Bank	(4.967)
(16.021)	Globe Life Inc	Morgan Stanley	(1.787)	(39.831)	Gorman-Rupp Co	Goldman Sachs	(10.607)
1.546	Globus Medical Inc 'A'	Goldman Sachs	526	(15.822)	Gorman-Rupp Co	Bank of America	(25.890)
2.776	Globus Medical Inc 'A'	HSBC	2.804	(32.647)	Gorman-Rupp Co	Merrill Lynch	(16.455)
17.927	Globus Medical Inc 'A'	Morgan Stanley	17.031	(7.703)	Gorman-Rupp Co	Barclays Bank	(21.221)
(8.222)	GlycoMimetics Inc	Bank of America	(987)	(12.186)	Gorman-Rupp Co	HSBC	(3.929)
(52.340)	GlycoMimetics Inc	Merrill Lynch	(20.413)	16.955	Gossamer Bio Inc	Morgan Stanley	(12.673)
(4.050)	GMS Inc	HSBC	(203)	8.457	Gossamer Bio Inc	Bank of America	(4.578)
2.567	GoDaddy Inc 'A'	Morgan Stanley	(539)	10.265	Gossamer Bio Inc	Merrill Lynch	(4.651)
13.309	GoDaddy Inc 'A'	Barclays Bank	12.777	5.239	Gossamer Bio Inc	Barclays Bank	(2.772)
6.040	GoDaddy Inc 'A'	Morgan Stanley	5.798	23.236	Gossamer Bio Inc	Goldman Sachs	(2.462)
(13.522)	Gogo Inc	Bank of America	(19.472)	(35.394)	GP Strategies Corp	HSBC	2.462
(23.888)	Gogo Inc	Merrill Lynch	(36.310)			Morgan Stanley	(12.780)
(10.939)	GoHealth Inc 'A'	Bank of America	(1.750)			Bank of America	(43.889)
		Merrill Lynch				Merrill Lynch	

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
2.604	Graco Inc	Barclays Bank	2.083	(2.398)	Green Dot Corp 'A'	Goldman Sachs	(336)
367	Graco Inc	Goldman Sachs	(257)	(4.208)	Green Dot Corp 'A'	HSBC	8.963
15.668	Graco Inc	HSBC	(39.953)	(3.898)	Green Dot Corp 'A'	Morgan Stanley	(1.793)
16.935	Graco Inc	Morgan Stanley	13.548	12.261	Green Plains Inc	Goldman Sachs	57.259
(38.367)	GrafTech International Ltd	Bank of America		5.709	Green Plains Inc	Morgan Stanley	11.304
		Merrill Lynch	8.125	(11.895)	Greenbrier Cos Inc	Bank of America	
(31.826)	GrafTech International Ltd	Barclays Bank	10.856			Merrill Lynch	20.103
(47.334)	GrafTech International Ltd	Goldman Sachs	27.927	(21.410)	Greenbrier Cos Inc	Barclays Bank	66.157
(10.086)	GrafTech International Ltd	HSBC	(7.968)	(2.184)	Greenbrier Cos Inc	Goldman Sachs	3.691
(19.252)	GrafTech International Ltd	Morgan Stanley	6.207	(2.397)	Greene County Bancorp Inc	Bank of America	
4.053	Graham Corp	Goldman Sachs	(2.027)			Merrill Lynch	(5.681)
(632)	Graham Holdings Co 'B'	Bank of America		(2.148)	Greene County Bancorp Inc	Barclays Bank	(3.716)
		Merrill Lynch	(1.858)	(2.856)	Greene County Bancorp Inc	Goldman Sachs	(6.769)
675	Graham Holdings Co 'B'	Barclays Bank	(4.455)	(2.486)	Greene County Bancorp Inc	HSBC	(7.508)
(263)	Graham Holdings Co 'B'	Goldman Sachs	(773)	(915)	Greene County Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.583)
(374)	Graham Holdings Co 'B'	HSBC	2.061	(6.593)	Greenhill & Co Inc	Bank of America	
842	Graham Holdings Co 'B'	Morgan Stanley	(5.557)			Merrill Lynch	2.967
(322)	Graham Holdings Co 'B'	Morgan Stanley	2.125	(3.964)	Greenhill & Co Inc	Goldman Sachs	1.784
1.685	Grand Canyon Education Inc	Barclays Bank	(940)	(1.634)	Greenhill & Co Inc	HSBC	(2.059)
1.189	Grand Canyon Education Inc	HSBC	91	(12.830)	Greenhill & Co Inc	Morgan Stanley	(128)
(847)	Grand Canyon Education Inc	Morgan Stanley	25	(3.547)	Greenlane Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(1.206)
3.079	Grand Canyon Education Inc	Morgan Stanley	(33)	47.474	Greenlight Capital Re Ltd 'A'	Barclays Bank	(4.747)
14.366	Granite Construction Inc	Bank of America		36.326	Greenlight Capital Re Ltd 'A'	Goldman Sachs	(8.718)
		Merrill Lynch	7.305	5.303	GreenSky Inc 'A'	Bank of America	
21.764	Granite Construction Inc	Barclays Bank	12.851	(3.402)	GreenSky Inc 'A'	Merrill Lynch	(530)
3.901	Granite Construction Inc	Goldman Sachs	1.756	(58.854)	GreenSky Inc 'A'	Barclays Bank	(1.177)
19.123	Granite Construction Inc	HSBC	15.930	960	Greif Inc 'A'	Bank of America	
2.310	Granite Construction Inc	Morgan Stanley	(832)	4.941	Greif Inc 'A'	Merrill Lynch	(2.861)
2.046	Graphic Packaging Holding Co	Bank of America		10.221	Greif Inc 'A'	Barclays Bank	(6.967)
		Merrill Lynch	(551)	9.885	Greif Inc 'A'	Goldman Sachs	(30.459)
4.261	Graphic Packaging Holding Co	Barclays Bank	(1.236)	(10.339)	Greif Inc 'B'	Morgan Stanley	(13.938)
59.018	Graphic Packaging Holding Co	HSBC	(100.921)	(6.195)	Greif Inc 'B'	Bank of America	
49.501	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	(14.356)	(9.256)	Greif Inc 'B'	Merrill Lynch	20.368
(9.475)	Gray Television Inc	Bank of America		(1.747)	Greif Inc 'B'	Barclays Bank	2.044
		Merrill Lynch	(13.320)	(174)	Greif Inc 'B'	Goldman Sachs	18.234
(35.898)	Gray Television Inc	Barclays Bank	(25.847)	10.200	Grid Dynamics Holdings Inc	HSBC	4.175
(43.127)	Gray Television Inc	Goldman Sachs	(64.027)	34.278	Griffon Corp	Morgan Stanley	57
(26.251)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Bank of America		12.409	Griffon Corp	Barclays Bank	(6.120)
		Merrill Lynch	2.100	651	Griffon Corp	Bank of America	
(28.384)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Barclays Bank	(2.555)	(18.081)	Gritstone bio Inc	Merrill Lynch	(18.853)
(78.543)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Goldman Sachs	6.080	(9.672)	Grocery Outlet Holding Corp	Barclays Bank	(993)
(25.444)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	HSBC	(18.829)	(8.491)	Grocery Outlet Holding Corp	Morgan Stanley	(52)
(24.263)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Morgan Stanley	(2.184)	(3.233)	Grocery Outlet Holding Corp	Bank of America	
(25.944)	Great Southern Bancorp Inc	Bank of America		(4.169)	Grocery Outlet Holding Corp	Merrill Lynch	(7.413)
		Merrill Lynch	26.463	(6.553)	Grocery Outlet Holding Corp	Bank of America	
(11.697)	Great Southern Bancorp Inc	Barclays Bank	(2.105)			Merrill Lynch	8.995
(23.362)	Great Southern Bancorp Inc	Goldman Sachs	23.829	2.536	Group 1 Automotive Inc	Barclays Bank	(12.426)
(9.374)	Great Southern Bancorp Inc	HSBC	2.906	1.904	Group 1 Automotive Inc	Goldman Sachs	(21.153)
(4.367)	Great Southern Bancorp Inc	Morgan Stanley	(786)	1.806	Group 1 Automotive Inc	Morgan Stanley	(8.849)
(4.691)	Great Western Bancorp Inc	Bank of America		(2.903)	Groupon Inc	Morgan Stanley	(1.306)
		Merrill Lynch	2.486	(9.597)	GrowGeneration Corp	Bank of America	
(7.985)	Great Western Bancorp Inc	Morgan Stanley	958	(5.734)	GrowGeneration Corp	Merrill Lynch	(50.192)
2.222	Green Brick Partners Inc	Bank of America		(3.924)	Grubhub Inc	Barclays Bank	(43.234)
		Merrill Lynch	733	(6.053)	Grubhub Inc	Bank of America	
1.932	Green Brick Partners Inc	Barclays Bank	1.700	(2.082)	Grubhub Inc	Merrill Lynch	(10.241)
2.729	Green Brick Partners Inc	Goldman Sachs	901	(4.802)	Grubhub Inc	Barclays Bank	(10.169)
32.140	Green Brick Partners Inc	Morgan Stanley	28.283			Goldman Sachs	(5.434)
(1.330)	Green Dot Corp 'A'	Barclays Bank	(612)			HSBC	22.761

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(14.674)	Grubhub Inc	Morgan Stanley	(24.652)	26.217	Hallmark Financial Services Inc	Morgan Stanley	(3.670)
(34.014)	GSI Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.726)	(4.150)	Halozyme Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.191
(21.599)	GSI Technology Inc	Barclays Bank	4.752	(20.236)	Halozyme Therapeutics Inc	Barclays Bank	10.725
(36.279)	GSI Technology Inc	Goldman Sachs	(12.043)	(6.264)	Halozyme Therapeutics Inc	Goldman Sachs	6.327
(5.803)	GSI Technology Inc	Morgan Stanley	881	(5.658)	Halozyme Therapeutics Inc	HSBC	26.536
3.720	GT Biopharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.596	(7.142)	Halozyme Therapeutics Inc	Morgan Stanley	3.785
(13.097)	GTT Communications Inc	Barclays Bank	131	533	Hamilton Beach Brands Holding Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7)
27.917	GTX Corp'	Bank of America Merrill Lynch	28.615	2.733	Hamilton Beach Brands Holding Co 'A'	Goldman Sachs	4.420
7.571	GTX Corp'	Goldman Sachs	7.760	1.360	Hamilton Beach Brands Holding Co 'A'	HSBC	1.362
59	GTX Corp'	Morgan Stanley	60	5.985	Hamilton Beach Brands Holding Co 'A'	Morgan Stanley	5.247
(23.654)	GT Technology Holdings Inc	Barclays Bank	5.914	3.972	Hamilton Lane Inc 'A'	Goldman Sachs	(755)
(4.708)	GT Technology Holdings Inc	Goldman Sachs	989	24.453	Hamilton Lane Inc 'A'	HSBC	14.916
(15.497)	GT Technology Holdings Inc	Morgan Stanley	3.874	(20.086)	Hancock Whitney Corp	Bank of America Merrill Lynch	15.466
(13.811)	Guaranty Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	19.197	(24.203)	Hancock Whitney Corp	HSBC	(11.133)
(4.194)	Guaranty Bancshares Inc	HSBC	5.662	(21.747)	Hancock Whitney Corp	Morgan Stanley	1.740
(10.747)	Guaranty Bancshares Inc	Morgan Stanley	2.902	(56.375)	Hanesbrands Inc	Barclays Bank	(22.550)
(8.657)	Guardant Health Inc	Barclays Bank	(5.194)	(31.285)	Hanesbrands Inc	Goldman Sachs	10.637
(552)	Guardant Health Inc	Goldman Sachs	(6.331)	10.949	Hanesbrands Inc	Goldman Sachs	(3.723)
(4.479)	Guardant Health Inc	Morgan Stanley	(2.687)	(31.192)	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	(12.477)
1.490	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.073)	12.053	Hanger Inc	Bank of America Merrill Lynch	816
3.765	Guess? Inc	Barclays Bank	6.062	12.262	Hanger Inc	Barclays Bank	(4.285)
3.220	Guess? Inc	HSBC	3.059	14.742	Hanger Inc	Goldman Sachs	1.786
5.022	Guess? Inc	Morgan Stanley	8.085	33.434	Hanger Inc	Morgan Stanley	(14.042)
725	Guidewire Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.125	1.018	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	2.382
30.177	Guidewire Software Inc	Barclays Bank	17.804	(13.150)	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT)	Barclays Bank	170
4.681	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs	25.682	(4.270)	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	(7.660)
4.687	Guidewire Software Inc	HSBC	3.726	3.173	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	7.425
5.803	Guidewire Software Inc	Morgan Stanley	3.424	(8.894)	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT)	Morgan Stanley	(2.381)
(39.677)	Guild Holdings Co 'A'	Barclays Bank	(19.045)	3.729	Hanover Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.858)
(32.922)	Gulf Island Fabrication Inc	Goldman Sachs	(16.132)	6.114	Hanover Insurance Group Inc	Barclays Bank	(2.996)
(16.100)	Gulf Island Fabrication Inc	Morgan Stanley	(483)	3.955	Hanover Insurance Group Inc	Goldman Sachs	(12.577)
(22.096)	GWG Holdings Inc	Morgan Stanley	—	(4.783)	Hanover Insurance Group Inc	Goldman Sachs	15.210
4.896	H&E Equipment Services Inc	Goldman Sachs	(6.805)	4.181	Hanover Insurance Group Inc	HSBC	(2.885)
3.817	H&R Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	(534)	(3.601)	Hanover Insurance Group Inc	HSBC	2.485
21.875	H&R Block Inc	Barclays Bank	9.188	10.571	Hanover Insurance Group Inc	Morgan Stanley	(5.180)
14.520	H&R Block Inc	HSBC	10.964	(1.881)	Hanover Insurance Group Inc	Morgan Stanley	922
21.974	H&R Block Inc	Morgan Stanley	9.229	(35.024)	HarborOne Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.977
(12.587)	Hackett Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.314)	(29.870)	HarborOne Bancorp Inc	Barclays Bank	(8.961)
(34.889)	Hackett Group Inc	Barclays Bank	(13.607)	(97.518)	HarborOne Bancorp Inc	Goldman Sachs	8.289
(19.054)	Hackett Group Inc	Goldman Sachs	(14.100)	(25.161)	HarborOne Bancorp Inc	HSBC	(21.387)
1.120	Haemonetics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(166)	(60.488)	HarborOne Bancorp Inc	Morgan Stanley	(18.146)
3.871	Haemonetics Corp	Barclays Bank	2.903				
5.625	Haemonetics Corp	Goldman Sachs	(2.405)				
4.354	Haemonetics Corp	Morgan Stanley	3.425				
(16.355)	Hain Celestial Group Inc	Morgan Stanley	(2.780)				
13.548	Hallador Energy Co	Goldman Sachs	2.439				
5.621	Hallador Energy Co	Morgan Stanley	1.349				
(5.103)	Halliburton Co	Goldman Sachs	6.787				
6.074	Halliburton Co	Goldman Sachs	(8.078)				
(29.030)	Halliburton Co	HSBC	8.419				
(14.213)	Halliburton Co	Morgan Stanley	853				
41.234	Halliburton Co	Morgan Stanley	(2.485)				
9.453	Hallmark Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.985				
2.733	Hallmark Financial Services Inc	Goldman Sachs	574				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(10.402)	Harley-Davidson Inc	Bank of America Merrill Lynch	36.303	(6.376)	HCA Healthcare Inc	Barclays Bank	(55.280)
11.927	Harley-Davidson Inc	Barclays Bank	11.211	(4.592)	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs	(24.292)
1.676	Harley-Davidson Inc	Goldman Sachs	1.350	1.233	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs	3.486
12.039	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	11.317	1.403	HCA Healthcare Inc	HSBC	9.567
3.076	Harmonic Inc	Bank of America Merrill Lynch	92	(962)	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	(8.341)
83.321	Harmonic Inc	Barclays Bank	1.666	2.807	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	7.692
28.082	Harmonic Inc	Goldman Sachs	842	(1.792)	HCI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(169)
4.623	Harmonic Inc	Morgan Stanley	92	(4.336)	Health Catalyst Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28.271)
8.396	Harmony Biosciences Holdings Inc	Barclays Bank	(5.793)	(5.820)	Health Catalyst Inc	Barclays Bank	(9.836)
6.905	Harmony Biosciences Holdings Inc	Goldman Sachs	14.431	(3.698)	Health Catalyst Inc	Morgan Stanley	(6.250)
4.161	Harmony Biosciences Holdings Inc	HSBC	21.471	(251)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(88)
3.478	Harmony Biosciences Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.400)	5.007	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1.752
5.058	Harpoon Therapeutics Inc	Morgan Stanley	8.700	688	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	(172)
(7.587)	Harrow Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.062	(37.327)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(13.064)
(26.362)	Harrow Health Inc	Barclays Bank	21.880	7.799	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	2.730
(21.358)	Harrow Health Inc	Goldman Sachs	2.990	(20.512)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	HSBC	26.666
(12.067)	Harsco Corp	HSBC	(10.740)	(69.485)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	17.372
(8.689)	Harsco Corp	Morgan Stanley	434	(4.224)	Healthcare Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)
1.626	Hartford Financial Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.301)	(9.262)	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs	2.502
13.164	Hartford Financial Services Group Inc	Barclays Bank	1.448	(16.037)	Healthcare Services Group Inc	Morgan Stanley	6.037
1.771	Hartford Financial Services Group Inc	HSBC	(956)	6.460	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	(3.359)
(12.137)	Hartford Financial Services Group Inc	Morgan Stanley	(1.335)	17.612	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	HSBC	(17.260)
(14.106)	Harvard Bioscience Inc	Barclays Bank	3.809	(765)	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	398
(66.304)	Harvard Bioscience Inc	Goldman Sachs	23.206	14.410	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(6.780)
4.961	Hasbro Inc	Barclays Bank	9.178	(2.787)	HealthEquity Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18.366)
871	Hasbro Inc	HSBC	(2.979)	(6.124)	HealthEquity Inc	Barclays Bank	(33.009)
1.391	Haverty Furniture Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(849)	(19.418)	HealthEquity Inc	Goldman Sachs	(126.644)
13.926	Haverty Furniture Cos Inc	Morgan Stanley	27.573	(6.657)	HealthEquity Inc	Morgan Stanley	(28.206)
(35.601)	Hawaiian Electric Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	46.993	20.415	Healthpeak Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	(1.429)
(8.555)	Hawaiian Electric Industries Inc	Barclays Bank	5.989	27.655	Healthpeak Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	1.659
(7.066)	Hawaiian Electric Industries Inc	Goldman Sachs	9.327	28.976	Healthpeak Properties Inc (REIT)	HSBC	(3.767)
(6.333)	Hawaiian Electric Industries Inc	HSBC	14.566	14.873	Healthpeak Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(1.041)
(16.496)	Hawaiian Electric Industries Inc	Morgan Stanley	11.547	11.803	HealthStream Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.249
50.682	Hawaiian Holdings Inc	Morgan Stanley	23.314	21.751	HealthStream Inc	Barclays Bank	(9.353)
11.772	Hawkins Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.007	37.966	HealthStream Inc	Goldman Sachs	13.668
42.004	Hawkins Inc	Barclays Bank	36.964	(74.252)	Heartland Express Inc	Barclays Bank	6.683
4.959	Hawkins Inc	Goldman Sachs	5.058	(33.735)	Heartland Express Inc	Goldman Sachs	18.892
(1.869)	Hawthorn Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.626)	15.018	Heartland Financial USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.410)
(2.646)	Hawthorn Bancshares Inc	Barclays Bank	(1.985)	23.432	Heartland Financial USA Inc	Barclays Bank	(3.983)
(3.359)	Hawthorn Bancshares Inc	Goldman Sachs	(2.922)	27.384	Heartland Financial USA Inc	Goldman Sachs	(15.335)
(5.161)	Hawthorn Bancshares Inc	Morgan Stanley	(3.871)	30.315	Heartland Financial USA Inc	HSBC	7.579
(13.118)	Haynes International Inc	Goldman Sachs	(31.221)	24.195	Heartland Financial USA Inc	Morgan Stanley	(4.113)
(15.567)	Haynes International Inc	HSBC	(28.176)	(14.343)	Hecla Mining Co	Goldman Sachs	(2.725)
16.541	HB Fuller Co	Barclays Bank	29.774	(42.077)	Hecla Mining Co	Morgan Stanley	(5.470)
8.510	HB Fuller Co	Goldman Sachs	255	1.201	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	8.011
36.794	HBT Financial Inc	Barclays Bank	2.576				
25.792	HBT Financial Inc	Goldman Sachs	(11.864)				
13.473	HBT Financial Inc	HSBC	—				
58.872	HBT Financial Inc	Morgan Stanley	4.121				
(80.083)	HC2 Holdings Inc	Barclays Bank	9.610				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(358)	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.388)	31.817	Heritage Insurance Holdings Inc	HSBC	(21.680)
2.796	HEICO Corp	Barclays Bank	14.959	39.001	Heritage Insurance Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.020)
10.882	HEICO Corp	Morgan Stanley	58.219	(7.270)	Heritage-Crystal Clean Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.052
2.832	HEICO Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	29.651	(11.087)	Heritage-Crystal Clean Inc	Barclays Bank	17.961
6.176	HEICO Corp 'A'	Morgan Stanley	42.306	(27.378)	Heritage-Crystal Clean Inc	Goldman Sachs	26.557
4.590	Heidrick & Struggles International Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.793	(5.462)	Heritage-Crystal Clean Inc	HSBC	7.701
5.900	Heidrick & Struggles International Inc	Barclays Bank	7.257	(12.661)	Heritage-Crystal Clean Inc	Morgan Stanley	20.511
6.728	Heidrick & Struggles International Inc	Goldman Sachs	2.826	22.021	Herman Miller Inc	Barclays Bank	36.335
4.486	Heidrick & Struggles International Inc	HSBC	5.697	8.925	Heron Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.499)
25.316	Heidrick & Struggles International Inc	Morgan Stanley	26.997	30.392	Heron Therapeutics Inc	Barclays Bank	(6.990)
(679)	Helen of Troy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.661	13.547	Heron Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3.793)
(2.620)	Helen of Troy Ltd	Barclays Bank	19.100	10.308	Heron Therapeutics Inc	HSBC	(44.221)
(1.852)	Helen of Troy Ltd	Goldman Sachs	18.084	(39.125)	Hersha Hospitality Trust (REIT)	Goldman Sachs	9.390
(2.990)	Helios Technologies Inc	HSBC	11.541	(9.279)	Hersha Hospitality Trust (REIT)	HSBC	1.485
(14.367)	Helios Technologies Inc	Morgan Stanley	8.382	(22.043)	Hersha Hospitality Trust (REIT)	Morgan Stanley	(7.715)
30.039	Helix Energy Solutions Group Inc	Goldman Sachs	(1.802)	376	Hershey Co	Bank of America Merrill Lynch	211
18.307	Helix Energy Solutions Group Inc	HSBC	6.957	5.891	Hershey Co	Barclays Bank	(6.186)
8.562	Helix Energy Solutions Group Inc	Morgan Stanley	1.284	7.538	Hershey Co	Goldman Sachs	4.221
(4.352)	Helmerich & Payne Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.706	(1.764)	Hershey Co	Goldman Sachs	397
1.138	Helmerich & Payne Inc	Bank of America Merrill Lynch	84	13.710	Hershey Co	Morgan Stanley	(14.396)
(2.990)	Helmerich & Payne Inc	Barclays Bank	1.136	142	Heska Corp	Barclays Bank	(995)
21.156	Helmerich & Payne Inc	Barclays Bank	(8.039)	8.155	Heska Corp	Morgan Stanley	(57.167)
(3.232)	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	7.951	686	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.784)
14.849	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	(36.529)	16.753	Hess Corp	Barclays Bank	(6.198)
(2.373)	Helmerich & Payne Inc	Morgan Stanley	902	14.584	Hess Corp	Goldman Sachs	(37.918)
15.314	Hemisphere Media Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.504)	1.570	Hess Corp	Morgan Stanley	(581)
12.056	Hemisphere Media Group Inc	Barclays Bank	(8.560)	(8.495)	Hess Midstream LP 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(12.743)
38.170	Hemisphere Media Group Inc	Goldman Sachs	(18.703)	(17.991)	Hess Midstream LP 'A'	Goldman Sachs	(26.987)
48.086	Hemisphere Media Group Inc	Morgan Stanley	(34.141)	130.853	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	(75.528)
15.672	Hennessy Advisors Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.097	79.694	Hewlett Packard Enterprise Co	Barclays Bank	(27.736)
835	Hennessy Advisors Inc	Morgan Stanley	(42)	14.210	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs	(3.974)
12.929	Henry Schein Inc	Goldman Sachs	(57.663)	78.193	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	(30.091)
15.400	Herbalife Nutrition Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38.962	(2.860)	Hexcel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21.193)
12.839	Herbalife Nutrition Ltd	Barclays Bank	6.933	(3.825)	Hexcel Corp	Barclays Bank	(19.546)
5.989	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs	15.152	(5.786)	Hexcel Corp	Goldman Sachs	(40.579)
12.860	Herbalife Nutrition Ltd	Morgan Stanley	6.944	(2.798)	Hexcel Corp	Morgan Stanley	(14.298)
(2.189)	Herc Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18.782)	5.001	HF Enterprises Inc	Barclays Bank	250
(507)	Herc Holdings Inc	Barclays Bank	(4.578)	(38.020)	HF Foods Group Inc	Barclays Bank	6.844
144.906	Heritage Commerce Corp	Morgan Stanley	12.317	(12.848)	HF Foods Group Inc	Morgan Stanley	2.313
(12.333)	Heritage Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(123)	9.535	Hibbett Sports Inc	Morgan Stanley	58.163
(17.816)	Heritage Financial Corp	Barclays Bank	(3.741)	4.565	HighPeak Energy Inc	Barclays Bank	2.088
(18.652)	Heritage Financial Corp	Goldman Sachs	(187)	2.811	HighPeak Energy Inc	HSBC	1.604
(14.019)	Heritage Financial Corp	HSBC	(8.692)	2.569	HighPeak Energy Inc	Morgan Stanley	(194)
(14.574)	Heritage Financial Corp	Morgan Stanley	(3.061)	(610)	Highwoods Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	(8)
48.387	Heritage Insurance Holdings Inc	Barclays Bank	(8.710)	(912)	Highwoods Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(187)
47.208	Heritage Insurance Holdings Inc	Goldman Sachs	(14.162)	(1.778)	Highwoods Properties Inc (REIT)	HSBC	(199)
				(16.375)	Highwoods Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(9.825)
				(145.151)	Hill International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24.676)
				(41.500)	Hill International Inc	Morgan Stanley	2.905

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
4.355	Hillenbrand Inc	Bank of America		(4.959)	Honeywell International Inc	Barclays Bank	(29.308)
		Merrill Lynch	(2.961)	(2.240)	Honeywell International Inc	Goldman Sachs	(10.419)
14.531	Hillenbrand Inc	Barclays Bank	(8.864)	744	Honeywell International Inc	HSBC	(22)
26.122	Hillenbrand Inc	Goldman Sachs	(17.763)	(5.880)	Honeywell International Inc	HSBC	176
13.223	Hillenbrand Inc	HSBC	(13.752)	18.850	Honeywell International Inc	Morgan Stanley	111.403
7.950	Hillenbrand Inc	Morgan Stanley	(4.850)	2.376	Hooker Furniture Corp	Barclays Bank	(2.084)
444	Hill-Rom Holdings Inc	Bank of America		18.446	Hooker Furniture Corp	Morgan Stanley	(26.009)
		Merrill Lynch	111	3.317	Hookipa Pharma Inc	Barclays Bank	—
(358)	Hill-Rom Holdings Inc	Bank of America		1.720	Hookipa Pharma Inc	Goldman Sachs	(2.391)
		Merrill Lynch	(90)	4.687	Hookipa Pharma Inc	Morgan Stanley	—
5.171	Hill-Rom Holdings Inc	Barclays Bank	2.534	(60.950)	Hope Bancorp Inc	Goldman Sachs	28.037
7.089	Hill-Rom Holdings Inc	Goldman Sachs	1.772	(32.760)	Hope Bancorp Inc	HSBC	328
1.077	Hill-Rom Holdings Inc	HSBC	2.165	(104.908)	Hope Bancorp Inc	Morgan Stanley	9.442
5.306	Hill-Rom Holdings Inc	Morgan Stanley	2.600	(2.976)	Horace Mann Educators Corp	Bank of America	
(2.618)	Hilltop Holdings Inc	Bank of America			Horace Mann Educators Corp	Merrill Lynch	(518)
		Merrill Lynch	(1.981)	(535)	Horace Mann Educators Corp	Barclays Bank	(402)
(20.401)	Hilltop Holdings Inc	Barclays Bank	(19.345)	(1.073)	Horace Mann Educators Corp	Goldman Sachs	(592)
(33.091)	Hilltop Holdings Inc	HSBC	(49.967)	(1.947)	Horace Mann Educators Corp	HSBC	273
(8.806)	Hilltop Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.549)	(9.680)	Horizon Bancorp Inc	Barclays Bank	(678)
28.672	Hilton Grand Vacations Inc	Barclays Bank	(18.063)	(93.883)	Horizon Bancorp Inc	Goldman Sachs	(2.816)
(2.278)	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	1.435	(38.317)	Horizon Bancorp Inc	HSBC	(18.775)
(2.322)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Bank of America		(91.119)	Horizon Bancorp Inc	Morgan Stanley	(6.378)
		Merrill Lynch	(8.266)	(25.409)	Horizon Global Corp	Bank of America	
(1.191)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Barclays Bank	(2.001)	(5.454)	Horizon Therapeutics Plc	Merrill Lynch	(48.023)
(20.864)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(74.275)	(2.661)	Horizon Therapeutics Plc	Barclays Bank	19.416
(6.313)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	(10.606)	(10.343)	Horizon Therapeutics Plc	HSBC	(14.423)
1.758	Hingham Institution For Savings The	Goldman Sachs	(9.933)	(5.348)	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	36.821
1.380	Hingham Institution For Savings The	Morgan Stanley	(483)	(24.371)	Hormel Foods Corp	Bank of America	
3	Histogen Inc	Bank of America		(30.502)	Hormel Foods Corp	Merrill Lynch	(10.643)
		Merrill Lynch	—	(14.289)	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	Barclays Bank	17.547
27.326	HNI Corp	Barclays Bank	17.215	(18.088)	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	(61.374)
7.697	HNI Corp	Goldman Sachs	3.002	(1.644)	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	Bank of America	
2.618	HNI Corp	HSBC	2.024	17.040	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	Merrill Lynch	3.001
929	HNI Corp	Morgan Stanley	585	(15.015)	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	Barclays Bank	(2.894)
7.594	HollyFrontier Corp	Bank of America		(12.736)	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	(288)
		Merrill Lynch	(31.895)	12.695	Hostess Brands Inc	Bank of America	
5.191	HollyFrontier Corp	Barclays Bank	(8.980)	35.533	Hostess Brands Inc	Merrill Lynch	2.856
5.333	HollyFrontier Corp	Goldman Sachs	(22.399)	2.002	Hostess Brands Inc	Barclays Bank	1.421
11.304	HollyFrontier Corp	HSBC	(30.069)	82.076	Hostess Brands Inc	Goldman Sachs	450
(1.468)	HollyFrontier Corp	HSBC	3.171	159.016	Hostess Brands Inc	HSBC	11.491
9.721	HollyFrontier Corp	Morgan Stanley	(16.817)	(13.291)	Houghton Mifflin Harcourt Co	Morgan Stanley	6.217
3.013	Hologic Inc	Goldman Sachs	1.265	(10.980)	Houghton Mifflin Harcourt Co	Bank of America	
4.818	Hologic Inc	Morgan Stanley	1.542	(26.610)	Houghton Mifflin Harcourt Co	Merrill Lynch	(6.513)
(7.336)	Home Bancorp Inc	Barclays Bank	4.695	(5.400)	Houlihan Lokey Inc	Goldman Sachs	(3.888)
(11.776)	Home Bancorp Inc	Goldman Sachs	(8.361)	33.122	Houlihan Lokey Inc	Goldman Sachs	23.848
(3.588)	Home Bancorp Inc	HSBC	(215)	(4.376)	Houlihan Lokey Inc	HSBC	(35.314)
(7.651)	Home Bancorp Inc	Morgan Stanley	4.897	832	Houlihan Lokey Inc	HSBC	6.714
(60.871)	Home BancShares Inc	Barclays Bank	4.261	(1.732)	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	(831)
(66.122)	Home BancShares Inc	Goldman Sachs	38.351	21.872	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	10.499
(1.102)	Home Depot Inc	Barclays Bank	477	(25)	Hovnanian Enterprises Inc 'A'	Bank of America	
3.534	Home Depot Inc	Morgan Stanley	14.383	(3.743)	Hovnanian Enterprises Inc 'A'	Merrill Lynch	(501)
(23.715)	Home Point Capital Inc	Goldman Sachs	(711)			Barclays Bank	(63.631)
10.320	HomeTrust Bancshares Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(7.430)				
19.708	HomeTrust Bancshares Inc	Barclays Bank	2.168				
1.345	HomeTrust Bancshares Inc	Goldman Sachs	(968)				
4.970	Homology Medicines Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	1.143				
33.885	Homology Medicines Inc	Barclays Bank	21.009				
6.909	Homology Medicines Inc	Goldman Sachs	1.589				
3.012	Homology Medicines Inc	Morgan Stanley	1.867				
2.180	Honeywell International Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	9.679				
4.804	Honeywell International Inc	Barclays Bank	28.392				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(49.244)	Howard Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.447	3.073	Huntington Ingalls Industries Inc	Morgan Stanley	799
(7.473)	Howard Hughes Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16.245)	(1.213)	Huntington Ingalls Industries Inc	Morgan Stanley	(315)
(4.125)	Howard Hughes Corp	Barclays Bank	(1.650)	(24.468)	Huntsman Corp	HSBC	65.330
(2.983)	Howard Hughes Corp	Goldman Sachs	(6.473)	(42.846)	Huntsman Corp	Morgan Stanley	1.714
(2.131)	Howard Hughes Corp	HSBC	(5.865)	5.498	Hurco Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.014)
(12.153)	Howard Hughes Corp	Morgan Stanley	(11.224)	5.577	Hurco Cos Inc	Barclays Bank	(1.840)
(9.718)	Howmet Aerospace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17.201)	6.095	Hurco Cos Inc	Goldman Sachs	(4.449)
11.707	Howmet Aerospace Inc	Bank of America Merrill Lynch	20.597	4.059	Hurco Cos Inc	HSBC	528
(10.715)	Howmet Aerospace Inc	Barclays Bank	(15.430)	8.633	Hurco Cos Inc	Morgan Stanley	(2.849)
4.227	Howmet Aerospace Inc	Barclays Bank	6.087	(10.075)	Huron Consulting Group Inc	Barclays Bank	6.851
(7.290)	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs	(12.903)	(4.938)	Huron Consulting Group Inc	Goldman Sachs	4.000
14.182	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs	27.271	(3.890)	Huron Consulting Group Inc	Morgan Stanley	2.645
(14.393)	Howmet Aerospace Inc	HSBC	(41.740)	(93.904)	Huttig Building Products Inc	Morgan Stanley	46.013
833	Howmet Aerospace Inc	HSBC	1.424	(303)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	125
(46.929)	Howmet Aerospace Inc	Morgan Stanley	(67.578)	4.592	Hyatt Hotels Corp 'A'	Barclays Bank	3.511
31.356	Howmet Aerospace Inc	Morgan Stanley	45.153	2.328	Hyatt Hotels Corp 'A'	Goldman Sachs	605
(23.870)	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	87.655	1.922	Hyatt Hotels Corp 'A'	HSBC	1.419
18.472	HP Inc	Barclays Bank	(56.894)	16.481	Hyatt Hotels Corp 'A'	Morgan Stanley	18.235
10.697	HP Inc	Goldman Sachs	(40.756)	(13.332)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Morgan Stanley	(15.732)
(6.234)	HP Inc	Goldman Sachs	19.587	1.629	Hydrofarm Holdings Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.015
21.941	HP Inc	HSBC	(132.085)	1.114	Hydrofarm Holdings Group Inc	Goldman Sachs	5.481
(9.896)	HP Inc	Morgan Stanley	30.480	2.335	Hydrofarm Holdings Group Inc	HSBC	654
3.110	Hub Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(14.399)	778	Hydrofarm Holdings Group Inc	Morgan Stanley	6.667
2.377	Hub Group Inc 'A'	Barclays Bank	(713)	(5.270)	HyreCar Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.411
2.015	Hub Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(9.329)	(4.915)	HyreCar Inc	Barclays Bank	2.478
17.689	Hub Group Inc 'A'	HSBC	(63.680)	(175)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Bank of America Merrill Lynch	(261)
46.934	Hub Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(14.080)	(1.247)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Barclays Bank	823
(648)	Hubbell Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.452	(200)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Goldman Sachs	286
(516)	Hubbell Inc	Barclays Bank	(882)	(97)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	HSBC	(213)
(3.576)	Hubbell Inc	Goldman Sachs	7.486	(7.109)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Morgan Stanley	4.022
(347)	Hubbell Inc	HSBC	2.377	(11.228)	I3 Verticals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8.833)
1.713	Hubbell Inc	Morgan Stanley	2.929	(12.775)	I3 Verticals Inc 'A'	Barclays Bank	4.195
(409)	Hubbell Inc	Morgan Stanley	(161)	(7.433)	I3 Verticals Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.504)
1.415	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.267	(4.525)	I3 Verticals Inc 'A'	Morgan Stanley	(220)
606	HubSpot Inc	Barclays Bank	(1.557)	8.055	IAA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.075)
922	HubSpot Inc	Goldman Sachs	10.377	12.630	IAA Inc	Barclays Bank	(19.324)
862	HubSpot Inc	HSBC	15.473	45.039	IAA Inc	Goldman Sachs	(24.264)
1.196	HubSpot Inc	Morgan Stanley	(2.914)	4.080	IAA Inc	HSBC	(2.176)
20.183	Hudson Pacific Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	—	4.081	IAA Inc	Morgan Stanley	(6.244)
(34.903)	Hudson Pacific Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	—	(675)	IAC Via InterActive Corp	Bank of America Merrill Lynch	44.017
18.943	Hudson Pacific Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	41.864	(4.519)	IAC Via InterActive Corp	Barclays Bank	420.990
(1.022)	Hudson Pacific Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	—	(345)	IAC Via InterActive Corp	Goldman Sachs	22.497
(657)	Humana Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.383	(9.398)	IAC Via InterActive Corp	Morgan Stanley	875.518
604	Humana Inc	Goldman Sachs	(7.707)	1.280	IBEX Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.715)
(1.212)	Humana Inc	HSBC	22.572	3.706	IBEX Holdings Ltd	Barclays Bank	(1.668)
1.468	Huntington Bancshares Inc	HSBC	159	6.222	IBEX Holdings Ltd	Goldman Sachs	(8.337)
99	Huntington Ingalls Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62)	488	IBEX Holdings Ltd	Morgan Stanley	(220)
(1.396)	Huntington Ingalls Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(553)	(82.022)	iBio Inc	Barclays Bank	3.281
2.775	Huntington Ingalls Industries Inc	Barclays Bank	722	(14.103)	iBio Inc	Goldman Sachs	(1.269)
482	Huntington Ingalls Industries Inc	Goldman Sachs	451	(6.042)	iCAD Inc	Goldman Sachs	(6.405)
(926)	Huntington Ingalls Industries Inc	Goldman Sachs	583	(9.977)	iCAD Inc	HSBC	(9.279)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.315)	iCAD Inc	Morgan Stanley	302	5.810	IMAX Corp	HSBC	5.322
1.372	ICF International Inc	Goldman Sachs	(7.176)	15.476	IMAX Corp	Morgan Stanley	(2.745)
8.734	ICF International Inc	Morgan Stanley	(22.883)	(8.841)	Immersion Corp	Morgan Stanley	(2.980)
10.340	Ichor Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	66.486	(8.803)	Immunic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.905)
550	Ichor Holdings Ltd	Barclays Bank	1.601	(1.232)	Immunic Inc	Barclays Bank	(517)
21.824	Ichor Holdings Ltd	Goldman Sachs	140.328	(4.227)	Immunic Inc	Goldman Sachs	(1.395)
(1.553)	ICU Medical Inc	Goldman Sachs	(12.207)	(2.209)	ImmunityBio Inc	Barclays Bank	(4.087)
(1.817)	ICU Medical Inc	HSBC	(14.663)	(28.094)	ImmunoGen Inc	HSBC	9.271
(1.612)	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	(5.755)	(13.956)	ImmunoGen Inc	Morgan Stanley	3.070
12.383	IDACORP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35.292)	(7.404)	Immunovant Inc	Barclays Bank	3.258
16.564	IDACORP Inc	Goldman Sachs	(47.207)	(2.660)	Immunovant Inc	Goldman Sachs	904
12.743	IDACORP Inc	Morgan Stanley	(33.387)	1.584	Impel Neuropharma Inc	HSBC	(281)
(5.235)	Ideaya Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.124)	(1.044)	Impinj Inc	Barclays Bank	(793)
(2.674)	Ideaya Biosciences Inc	Barclays Bank	—	(4.271)	Impinj Inc	HSBC	(25.156)
(4.416)	Ideaya Biosciences Inc	Goldman Sachs	(1.281)	(2.280)	Inari Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.129)
(12.958)	Identiv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13.476)	(4.912)	Inari Medical Inc	Barclays Bank	786
(13.759)	Identiv Inc	Barclays Bank	16.373	(5.741)	Inari Medical Inc	Goldman Sachs	(30.542)
(17.725)	Identiv Inc	Goldman Sachs	(18.434)	(223)	Inari Medical Inc	HSBC	535
(20.786)	Idera Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.494)	(1.199)	Inari Medical Inc	Morgan Stanley	192
(35.875)	Idera Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(2.870)	(1.680)	Incyte Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.537)
(2.615)	IDEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(255)	(8.654)	Incyte Corp	Goldman Sachs	(13.067)
(4.860)	IDEX Corp	Barclays Bank	(9.234)	(14.508)	Independence Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	6.238
2.970	IDEX Corp	Barclays Bank	3.203	(12.405)	Independence Holding Co	Morgan Stanley	24.562
(10.369)	IDEX Corp	Goldman Sachs	5.639	(53.656)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(46.144)
817	IDEX Corp	Goldman Sachs	302	(35.380)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(30.427)
1.039	IDEX Corp	HSBC	213	(56.687)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	HSBC	(41.382)
(8.388)	IDEX Corp	Morgan Stanley	(13.144)	(63.153)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(20.209)
2.419	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	83.431	108.439	Independent Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29.279)
4.189	IDEXX Laboratories Inc	Barclays Bank	35.187	43.625	Independent Bank Corp	Barclays Bank	(1.309)
529	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	12.185	38.339	Independent Bank Corp	Goldman Sachs	(10.352)
39	IDEXX Laboratories Inc	HSBC	1.207	11.478	Independent Bank Corp	HSBC	(344)
2.032	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	9.839	56.195	Independent Bank Corp	Morgan Stanley	(1.686)
20.166	IDT Corp 'B'	Morgan Stanley	(8.268)	(5.516)	Independent Bank Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17.431)
(12.040)	IES Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30.220)	(2.983)	Independent Bank Group Inc	Barclays Bank	(7.666)
(5.974)	IES Holdings Inc	Morgan Stanley	(8.304)	(16.155)	Independent Bank Group Inc	Goldman Sachs	(51.050)
1.163	IGM Biosciences Inc	Goldman Sachs	7.641	(5.830)	Indus Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(10.844)
395	IGM Biosciences Inc	HSBC	3.551	(10.086)	Indus Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(18.012)
626	IGM Biosciences Inc	Morgan Stanley	4.088	(1.052)	Indus Realty Trust Inc (REIT)	HSBC	(3.177)
5.468	iHeartMedia Inc 'A'	HSBC	1.695	(1.673)	Indus Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(786)
13.192	iHeartMedia Inc 'A'	Morgan Stanley	9.762	(26.917)	Industrial Logistics Properties Trust (REIT)	Morgan Stanley	3.499
4.237	IHS Markit Ltd	HSBC	(10.126)	(9.715)	Infinera Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.669)
13.509	IHS Markit Ltd	Morgan Stanley	2.432	(11.597)	Infinera Corp	Barclays Bank	(2.953)
(2.195)	II-VI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.341)	(6.407)	Infinera Corp	Goldman Sachs	(141)
(2.818)	II-VI Inc	Barclays Bank	(2.959)	(22.672)	Infinera Corp	Morgan Stanley	(5.441)
2.679	II-VI Inc	Goldman Sachs	6.812	23.571	Infinity Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.371
(1.445)	II-VI Inc	HSBC	(7.745)	14.720	Infinity Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	4.563
(6.449)	II-VI Inc	Morgan Stanley	(6.771)	11.972	Infinity Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	5.268
5.658	Illinois Tool Works Inc	Barclays Bank	(1.754)	26.123	Infinity Pharmaceuticals Inc	HSBC	10.972
(6.715)	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs	1.557	3.761	Information Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.392
823	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs	(158)				
(715)	Illumina Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18.704)				
(951)	Illumina Inc	Morgan Stanley	(5.373)				
2.770	IMARA Inc	Goldman Sachs	(2.161)				
1.673	IMARA Inc	HSBC	535				
1.586	IMARA Inc	Morgan Stanley	(301)				
1.730	IMAX Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.280				
6.552	IMAX Corp	Barclays Bank	(1.179)				
5.994	IMAX Corp	Goldman Sachs	4.436				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
23.372	Information Services Group Inc	Barclays Bank	(4.674)	11.394	Insmed Inc	Morgan Stanley	2.777
10.811	Information Services Group Inc	Goldman Sachs	4.000	3.192	Insperty Inc	Bank of America	
28.124	Information Services Group Inc	HSBC	25.593	11.252	Insperty Inc	Merrill Lynch	5.187
38.116	Information Services Group Inc	Morgan Stanley	(7.623)	923	Insperty Inc	Barclays Bank	7.426
(12.245)	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	Barclays Bank	9.306	7.522	Insperty Inc	Goldman Sachs	3.055
2.114	InfuSystem Holdings Inc	Barclays Bank	(4.693)	2.812	Insperty Inc	HSBC	29.764
2.178	InfuSystem Holdings Inc	Morgan Stanley	(4.835)	(1.932)	Inspire Medical Systems Inc	Morgan Stanley	1.856
31	Ingersoll Rand Inc	Bank of America		386	Inspire Medical Systems Inc	Bank of America	
28.857	Ingersoll Rand Inc	Merrill Lynch	27	(579)	Inspire Medical Systems Inc	Merrill Lynch	(49.981)
4.037	Ingersoll Rand Inc	Barclays Bank	1.443	177	Inspire Medical Systems Inc	Bank of America	
(11.352)	Ingersoll Rand Inc	HSBC	3.584	139	Inspire Medical Systems Inc	Morgan Stanley	1.725
(1.529)	Ingevity Corp	Morgan Stanley	(568)	(6.787)	Inspired Entertainment Inc	Bank of America	
(18.246)	Ingevity Corp	Bank of America		(5.753)	Inspired Entertainment Inc	Merrill Lynch	(20.497)
(13.848)	Ingevity Corp	Merrill Lynch	10.856	(5.955)	Installed Building Products Inc	Morgan Stanley	(6.041)
(662)	Ingevity Corp	Barclays Bank	63.314	(9.519)	Installed Building Products Inc	Bank of America	
(332)	Ingevity Corp	Goldman Sachs	98.321		Installed Building Products Inc	Merrill Lynch	13.697
(3.020)	Ingles Markets Inc 'A'	HSBC	2.919	(2.758)	Installed Building Products Inc	Barclays Bank	(32.079)
(12.055)	Ingles Markets Inc 'A'	Morgan Stanley	1.152	(1.048)	Insteel Industries Inc	Morgan Stanley	(1.780)
(5.443)	Ingles Markets Inc 'A'	Bank of America		(1.048)	Insteel Industries Inc	Bank of America	
4.190	Ingredion Inc	Merrill Lynch	(1.087)	(14.016)	Insteel Industries Inc	Merrill Lynch	3.815
2.628	Ingredion Inc	Barclays Bank	(4.460)	(19.282)	Insteel Industries Inc	Goldman Sachs	41.663
(5.014)	Inhibrx Inc	Goldman Sachs	(1.959)	(4.368)	Insteel Industries Inc	HSBC	102.966
(6.107)	Inmune Bio Inc	Barclays Bank	(4.609)	227	Insulet Corp	Morgan Stanley	7.557
(10.580)	Innodata Inc	Bank of America	(2.891)	920	Insulet Corp	Bank of America	
(13.471)	Innodata Inc	Merrill Lynch	(12.861)	318	Insulet Corp	Merrill Lynch	9.361
(3.851)	Innodata Inc	Barclays Bank	(4.275)	2.518	Insulet Corp	Barclays Bank	11.868
7.919	Innospec Inc	Bank of America		(1.028)	Integer Holdings Corp	Goldman Sachs	44.952
718	Innospec Inc	Merrill Lynch	6.289	768	Integer Holdings Corp	HSBC	13.649
6.658	Innospec Inc	Barclays Bank	337	3.679	Integer Holdings Corp	Morgan Stanley	(13.261)
3.759	Innospec Inc	Goldman Sachs	5.659	4.240	Integer Holdings Corp	Barclays Bank	(6.329)
17.867	Innospec Inc	HSBC	2.843	3.260	Integra LifeSciences Holdings Corp	Goldman Sachs	(1.920)
(75.605)	Innoviva Inc	Morgan Stanley	6.409	(3.656)	Integra LifeSciences Holdings Corp	HSBC	(5.629)
(39.282)	Innoviva Inc	Bank of America		3.726	Integra LifeSciences Holdings Corp	Morgan Stanley	(10.218)
(23.956)	Innoviva Inc	Merrill Lynch	(42.532)	13.336	Intel Corp	Morgan Stanley	3.875
(2.637)	Innoviva Inc	Barclays Bank	3.535	30.253	Intel Corp	Bank of America	
1.704	Inogen Inc	Goldman Sachs	(10.872)	13.759	Intel Corp	Merrill Lynch	5.260
7.051	Inogen Inc	Morgan Stanley	237	43.913	Intel Corp	Barclays Bank	2.676
(2.720)	Inotiv Inc	Barclays Bank	(1.977)	(13.911)	Intellia Therapeutics Inc	Goldman Sachs	38.642
(8.526)	Inotiv Inc	Morgan Stanley	(8.179)	(9.582)	Intellia Therapeutics Inc	HSBC	7.075
4.191	Inovalon Holdings Inc 'A'	Bank of America		(1.876)	Intellia Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(11.419)
37.096	Inovalon Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	(10.554)	(8.246)	Intellicheck Inc	Bank of America	
8.672	Inovio Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	9.720	(56.390)	Intellicheck Inc	Merrill Lynch	2.391
5.613	Inovio Pharmaceuticals Inc	HSBC	6.748	(2.099)	Intelligent Systems Corp	Barclays Bank	16.917
11.033	Inovio Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	22.629	(10.595)	Intelligent Systems Corp	Bank of America	
2.463	Inovio Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	6.504	(5.080)	Inter Parfums Inc	Merrill Lynch	6.150
6.403	Inozyme Pharma Inc	Goldman Sachs	2.189	(5.772)	Inter Parfums Inc	Barclays Bank	30.831
5.796	Inozyme Pharma Inc	HSBC	2.167	(4.525)	Inter Parfums Inc	Bank of America	
7.461	Inozyme Pharma Inc	Barclays Bank	(5.699)	(7.511)	Inter Parfums Inc	Merrill Lynch	(7.163)
(12.290)	Inseego Corp	Goldman Sachs	2.666	(14.163)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Barclays Bank	(13.218)
(16.812)	Inseego Corp	Morgan Stanley	(6.640)	2.196	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(6.380)
(3.223)	Inseego Corp	Bank of America		9.951	Interactive Brokers Group Inc 'A'	HSBC	(31.171)
3.402	Insight Enterprises Inc	Merrill Lynch	(10.601)	8.688	Insmed Inc	Morgan Stanley	(32.433)
13.578	Insight Enterprises Inc	Barclays Bank	(8.574)			Barclays Bank	834
8.688	Insmed Inc	Goldman Sachs	(1.205)			Goldman Sachs	(13.931)
		Merrill Lynch	11.839				
		Barclays Bank	(10.601)				
		Goldman Sachs	(8.574)				
		HSBC	(1.205)				
		Bank of America	11.839				
		Merrill Lynch	(10.601)				
		Barclays Bank	(8.574)				
		Goldman Sachs	(1.205)				
		HSBC	11.839				
		Bank of America	(10.601)				
		Merrill Lynch	(8.574)				
		Barclays Bank	(1.205)				
		Goldman Sachs	11.839				
		HSBC	(10.601)				
		Bank of America	(8.574)				
		Merrill Lynch	(1.205)				
		Barclays Bank	11.839				
		Goldman Sachs	(10.601)				
		HSBC	(8.574)				
		Bank of America	(1.205)				
		Merrill Lynch	11.839				
		Barclays Bank	(10.601)				
		Goldman Sachs	(8.574)				
		HSBC	(1.205)				
		Bank of America	11.839				
		Merrill Lynch	(10.601)				
		Barclays Bank	(8.574)				
		Goldman Sachs	(1.205)				
		HSBC	11.839				
		Bank of America	(10.601)				
		Merrill Lynch	(8.574)				
		Barclays Bank	(1.205)				
		Goldman Sachs	11.839				
		HSBC	(10.601)				
		Bank of America	(8.574)				
		Merrill Lynch	(1.205)				
		Barclays Bank	11.839				
		Goldman Sachs	(10.601)				
		HSBC	(8.574)				
		Bank of America	(1.205)				
		Merrill Lynch	11.839				
		Barclays Bank	(10.601)				
		Goldman Sachs	(8.574)				
		HSBC	(1.205)				
		Bank of America	11.839				
		Merrill Lynch	(10.601)				
		Barclays Bank	(8.574)				
		Goldman Sachs	(1.205)				
		HSBC	11.839				
		Bank of America	(10.601)				
		Merrill Lynch	(8.574)				
		Barclays Bank	(1.205)				
		Goldman Sachs	11.839				
		HSBC	(10.601)				
		Bank of America	(8.574)				
		Merrill Lynch	(1.205)				
		Barclays Bank	11.839				
		Goldman Sachs	(10.601)				
		HSBC	(8.574)				
		Bank of America	(1.205)				
		Merrill Lynch	11.839				
		Barclays Bank	(10.601)				
		Goldman Sachs	(8.574)				
		HSBC	(1.205)				
		Bank of America	11.839				
		Merrill Lynch	(10.601)				
		Barclays Bank	(8.574)				
		Goldman Sachs	(1.205)				
		HSBC	11.839				
		Bank of America	(10.601)				
		Merrill Lynch	(8.574)				
		Barclays Bank	(1.205)				
		Goldman Sachs	11.839				
		HSBC	(10.601)				
		Bank of America	(8.574)				
		Merrill Lynch	(1.205)				
		Barclays Bank	11.839				
		Goldman Sachs	(10.601)				
		HSBC	(8.574)				
		Bank of America	(1.205)				
		Merrill Lynch	11.839				
		Barclays Bank	(10.601)				
		Goldman Sachs	(8.574)				
		HSBC	(1.205)				
		Bank of America	11.839				
		Merrill Lynch	(10.601)				
		Barclays Bank	(8.574)				
		Goldman Sachs	(1.205)				
		HSBC	11.839				
		Bank of America	(10.601)				
		Merrill Lynch	(8.574)				
		Barclays Bank	(1.205)				
		Goldman Sachs	11.839				
		HSBC	(10.601)				
		Bank of America	(8.574)				
		Merrill Lynch	(1.205)				
		Barclays Bank	11.839				
		Goldman Sachs	(10.601)				
		HSBC	(8.574)				
		Bank of America	(1.205)				
		Merrill Lynch	11.839				
		Barclays Bank	(10.601)				
		Goldman Sachs	(8.574)				
		HSBC	(1.205)				
		Bank of America	11.839				
		Merrill Lynch	(10.601)				
		Barclays Bank	(8.574)				
		Goldman Sachs	(1.205)				
		HSBC	11.839				
		Bank of America	(10.601)				
		Merrill Lynch	(8.574)				
		Barclays Bank	(1.205)				
		Goldman Sachs	11.839				
		HSBC	(10.601)				
		Bank of America	(8.574)				
		Merrill Lynch	(1.205)				
		Barclays Bank	11.839				
		Goldman Sachs	(10.601)				
		HSBC	(8.574)				
		Bank of America	(1.205)				
		Merrill Lynch	11.839				
		Barclays Bank	(10.601)				
		Goldman Sachs	(8.574)				
		HSBC	(1.205)				
		Bank of America	11.839				
		Merrill Lynch	(10.601)				
		Barclays Bank	(8.574)				
		Goldman Sachs	(1.205)				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
3.770	Interactive Brokers Group Inc 'A'	HSBC	(1.939)	21.134	Interpublic Group of Cos Inc	Morgan Stanley	7.608
4.101	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Morgan Stanley	1.558	21.788	Intersect ENT Inc	Barclays Bank	(9.805)
(5.723)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(1.889)	13.264	Intersect ENT Inc	Morgan Stanley	(5.969)
(3.221)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	2.029	(11.764)	Intevac Inc	Bank of America	
(2.926)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(966)	(30.794)	Intevac Inc	Merrill Lynch	(13.999)
2.492	Intercontinental Exchange Inc	Bank of America	374	(900)	Intevac Inc	Goldman Sachs	(36.645)
2.001	Intercontinental Exchange Inc	Barclays Bank	(180)	(449)	Intra-Cellular Therapies Inc	HSBC	(1.089)
5.247	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs	2.151	(3.114)	Intra-Cellular Therapies Inc	Bank of America	50
5.505	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	(495)	(664)	Intra-Cellular Therapies Inc	Merrill Lynch	(10.712)
(455)	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	41	(808)	Intrepid Potash Inc	Morgan Stanley	210
(1.254)	InterDigital Inc	Bank of America	(11.371)	(10.158)	Intrepid Potash Inc	Bank of America	
(3.083)	InterDigital Inc	Merrill Lynch	(20.364)	(1.431)	Intrepid Potash Inc	Merrill Lynch	(1.624)
(6.308)	InterDigital Inc	Barclays Bank	(57.087)	(1.624)	Intrepid Potash Inc	Barclays Bank	(17.472)
(5.233)	International Bancshares Corp	Morgan Stanley	18.525	(28.802)	Intrepid Potash Inc	Goldman Sachs	(2.876)
(1.257)	International Bancshares Corp	Bank of America	4.450	(4.660)	IntriCon Corp	HSBC	(1.153)
(25.873)	International Bancshares Corp	Merrill Lynch	68.563	(9.706)	IntriCon Corp	Goldman Sachs	51.556
(43.889)	International Bancshares Corp	HSBC	47.839	2.715	IntriCon Corp	HSBC	(5.592)
(11.821)	International Business Machines Corp	Morgan Stanley	11.585	1.089	Intuit Inc	Morgan Stanley	25.041
(28.342)	International Business Machines Corp	Bank of America	38.829	1.151	Intuit Inc	Bank of America	53.404
(5.987)	International Flavors & Fragrances Inc	Merrill Lynch	9.717	338	Intuit Inc	Merrill Lynch	(1.437)
(8.998)	International Flavors & Fragrances Inc	Barclays Bank	473	8.264	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs	22.640
(701)	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	589	(1.761)	Intuitive Surgical Inc	HSBC	15.734
(3.099)	International Flavors & Fragrances Inc	Bank of America	26.527	(1.660)	Intuitive Surgical Inc	Morgan Stanley	(9.878)
17.831	International Game Technology Plc	Merrill Lynch	91.795	(282)	Intuitive Surgical Inc	Bank of America	(44.669)
53.360	International Game Technology Plc	HSBC	69.873	(2.161)	Invacare Corp	Merrill Lynch	(12.052)
(4.059)	International Game Technology Plc	Morgan Stanley	(3.087)	15.475	Invacare Corp	Barclays Bank	(2.084)
12.456	International Game Technology Plc	Goldman Sachs	32.566	8.829	Invacare Corp	HSBC	(15.689)
41.482	International Game Technology Plc	HSBC	17.108	11.712	Invacare Corp	Merrill Lynch	(4.333)
27.834	International Money Express Inc	Morgan Stanley	12.143	12.980	Invacare Corp	Barclays Bank	(88)
23.436	International Money Express Inc	Goldman Sachs	17.108	4.531	Invacare Corp	Goldman Sachs	(3.279)
(14.653)	International Paper Co	Barclays Bank	5.933	22.994	Invacare Corp	HSBC	130
(4.564)	International Paper Co	Goldman Sachs	4.056	79.825	Invesco Ltd	Morgan Stanley	(45)
(4.056)	International Paper Co	Morgan Stanley	3.627	(15.000)	Invesco Ltd	Barclays Bank	35.181
(3.227)	International Paper Co	Barclays Bank	7.676	(88.431)	Invesco Mortgage Capital Inc (REIT)	Morgan Stanley	122.132
(8.529)	International Seaways Inc	HSBC	(2.488)	(62.815)	Invesco Mortgage Capital Inc (REIT)	Bank of America	1.923
(15.548)	International Seaways Inc	Goldman Sachs	1.875	4.312	Investar Holding Corp	Merrill Lynch	9.727
(8.150)	International Seaways Inc	HSBC	1.875	10.705	Investar Holding Corp	Barclays Bank	4.406
(1.641)	Interpublic Group of Cos Inc	Bank of America	(1.021)	10.254	Investar Holding Corp	Bank of America	
(17.875)	Interpublic Group of Cos Inc	Merrill Lynch	(2.463)	29.732	Investar Holding Corp	Merrill Lynch	172
(12.797)	Interpublic Group of Cos Inc	Barclays Bank	(12.292)	12.707	Investors Bancorp Inc	Barclays Bank	(1.499)
(11.370)	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs	(3.648)	108.035	Investors Bancorp Inc	Goldman Sachs	410
		Morgan Stanley		17.659	Investors Bancorp Inc	HSBC	21.407
				27.330	Investors Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.779)
				74.329	Investors Bancorp Inc	Bank of America	(28.089)
				1.187	Investors Title Co	Merrill Lynch	706
				863	Investors Title Co	Barclays Bank	(7.106)
				4.942	Investors Title Co	Goldman Sachs	18.582
				1.483	Investors Title Co	Bank of America	(6.896)
				933	Invitae Corp	Merrill Lynch	(1.001)
				1.178	Invitae Corp	Barclays Bank	(1.001)
				8.824	Invitae Corp	Goldman Sachs	(28.713)
				(3.915)	Invitae Corp	HSBC	(11.375)
				4.240	Invitae Corp	Morgan Stanley	(1.082)
				2.594	Invitation Homes Inc (REIT)	Bank of America	1.732
				22.078	Invitation Homes Inc (REIT)	Barclays Bank	4.765
				41.490	Invitation Homes Inc (REIT)	Goldman Sachs	(5.755)
						Goldman Sachs	6.233
							2.853
							4.857
							45.639

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
40.863	Invitation Homes Inc (REIT)	HSBC	44.950	(25.788)	IVERIC bio Inc	Goldman Sachs	(2.063)
73.501	Invitation Homes Inc (REIT)	Morgan Stanley	16.170	(32.795)	IZEA Worldwide Inc	Barclays Bank	(1.312)
(2.612)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America		4.531	J & J Snack Foods Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	423			Merrill Lynch	28.772
(2.937)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(5.795)	4.102	J & J Snack Foods Corp	Barclays Bank	12.675
(3.265)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(5.559)	506	J & J Snack Foods Corp	HSBC	4.468
(4.853)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(3.324)	5.188	J & J Snack Foods Corp	Morgan Stanley	16.031
(4.383)	Iovance Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	34.713	6.659	J M Smucker Co	Bank of America	
(12.545)	Iovance Biotherapeutics Inc	Morgan Stanley	(10.036)			Merrill Lynch	(1.465)
(3.255)	IPG Photonics Corp	Bank of America		8.481	J M Smucker Co	Barclays Bank	(19.676)
		Merrill Lynch	(41.892)	2.702	J M Smucker Co	HSBC	(14.050)
(3.502)	IPG Photonics Corp	Barclays Bank	(6.023)	7.895	J M Smucker Co	Morgan Stanley	(18.316)
2.721	IPG Photonics Corp	Barclays Bank	4.680	827	J2 Global Inc	Bank of America	
(384)	IPG Photonics Corp	Goldman Sachs	(4.942)			Merrill Lynch	(546)
(1.753)	IPG Photonics Corp	HSBC	(38.145)	1.164	J2 Global Inc	Barclays Bank	(3.573)
(2.055)	IPG Photonics Corp	Morgan Stanley	(3.535)	1.143	J2 Global Inc	Goldman Sachs	(754)
204	IPG Photonics Corp	Morgan Stanley	351	(388)	J2 Global Inc	HSBC	(1.870)
(3.121)	IQVIA Holdings Inc	Barclays Bank	7.553	(6.463)	J2 Global Inc	Morgan Stanley	19.841
(2.924)	IQVIA Holdings Inc	HSBC	(25.351)	9.137	J2 Global Inc	Morgan Stanley	(28.051)
(3.696)	IQVIA Holdings Inc	Morgan Stanley	8.945	12.999	Jabil Inc	Barclays Bank	14.299
8.225	iRadimed Corp	Bank of America		954	Jabil Inc	HSBC	3.215
		Merrill Lynch	(9.212)	14.200	Jabil Inc	Morgan Stanley	15.620
6.382	iRadimed Corp	Barclays Bank	(2.042)	847	Jack Henry & Associates Inc	Barclays Bank	(2.253)
4.019	iRadimed Corp	Goldman Sachs	(4.501)	(461)	Jack Henry & Associates Inc	Barclays Bank	1.226
2.129	iRadimed Corp	HSBC	(405)	3.268	Jack Henry & Associates Inc	HSBC	(15.392)
6.682	iRadimed Corp	Morgan Stanley	(2.138)	(2.934)	Jack Henry & Associates Inc	HSBC	13.819
(309)	iRhythm Technologies Inc	Bank of America		1.696	Jack in the Box Inc	Barclays Bank	(3.138)
		Merrill Lynch	(396)	3.433	Jack in the Box Inc	Goldman Sachs	(8.651)
(2.802)	iRhythm Technologies Inc	Barclays Bank	(2.746)	(3.401)	Jacobs Engineering Group Inc	Goldman Sachs	(10.135)
(1.387)	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs	(1.775)	(153)	Jacobs Engineering Group Inc	HSBC	43
(1.731)	iRhythm Technologies Inc	Morgan Stanley	(1.696)	(19.601)	Jacobs Engineering Group Inc	Morgan Stanley	(47.630)
(434)	Iridium Communications Inc	Bank of America		(10.766)	James River Group Holdings Ltd	HSBC	861
		Merrill Lynch	(586)	(24.662)	James River Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(46.118)
(6.506)	Iridium Communications Inc	Barclays Bank	(5.725)	(630)	Jamf Holding Corp	Bank of America	
(802)	Iridium Communications Inc	Goldman Sachs	(1.083)			Merrill Lynch	(3.629)
(13.740)	Iridium Communications Inc	Morgan Stanley	(12.091)	(16.444)	Jamf Holding Corp	Barclays Bank	(53.772)
1.381	iRobot Corp	Bank of America		(3.875)	Jamf Holding Corp	Goldman Sachs	(22.320)
		Merrill Lynch	1.270	(1.133)	Jamf Holding Corp	HSBC	(4.305)
7.955	iRobot Corp	Barclays Bank	33.729	(3.408)	Jamf Holding Corp	Morgan Stanley	(8.254)
3.727	iRobot Corp	Goldman Sachs	2.601	(1.679)	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America	
5.035	iRobot Corp	HSBC	7.452	(407)	Jazz Pharmaceuticals Plc	Merrill Lynch	(915)
1.101	iRobot Corp	Morgan Stanley	4.668	(634)	Jazz Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	338
939	Iron Mountain Inc (REIT)	Bank of America		(8.274)	Jazz Pharmaceuticals Plc	HSBC	(1.287)
		Merrill Lynch	(9)	(6.253)	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	6.867
7.054	Iron Mountain Inc (REIT)	Barclays Bank	(652)	(6.958)	JB Hunt Transport Services Inc	Bank of America	10.025
4.656	Iron Mountain Inc (REIT)	Morgan Stanley	(698)	(8.433)	JB Hunt Transport Services Inc	Barclays Bank	(1.272)
(14.065)	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	373	(3.463)	JB Hunt Transport Services Inc	Goldman Sachs	27.765
(7.152)	iTeos Therapeutics Inc	Goldman Sachs	31.469	(6.114)	JB Hunt Transport Services Inc	HSBC	30.924
(44.244)	Iteris Inc	Bank of America		(6.248)	JBG SMITH Properties (REIT)	Morgan Stanley	(2.752)
		Merrill Lynch	11.061	(11.974)	JBG SMITH Properties (REIT)	Barclays Bank	973
(9.336)	Iteris Inc	Goldman Sachs	2.334	778	JBG SMITH Properties (REIT)	Barclays Bank	2.634
(17.355)	Iteris Inc	Morgan Stanley	(5.554)			Morgan Stanley	303
8.904	Itron Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	54.849				
5.195	Itron Inc	Barclays Bank	18.032				
1.828	Itron Inc	Goldman Sachs	6.875				
1.002	Itron Inc	HSBC	10.271				
3.741	Itron Inc	Morgan Stanley	13.554				
5.701	ITT Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	815				
(2.386)	ITT Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	5.082				
13.520	ITT Inc	Barclays Bank	6.010				
(649)	ITT Inc	Barclays Bank	(545)				
2.704	ITT Inc	Goldman Sachs	3.550				
3.892	ITT Inc	Morgan Stanley	1.757				
(11.726)	ITT Inc	Morgan Stanley	(9.850)				
(29.110)	IVERIC bio Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(2.329)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(3.798)	JBG SMITH Properties (REIT)	Morgan Stanley	836	7.797	Johnson Outdoors Inc 'A'	HSBC	(87.872)
22.857	Jefferies Financial Group Inc	Bank of America		962	Johnson Outdoors Inc 'A' Joint Corp	Morgan Stanley	(2.992)
		Merrill Lynch	(2.743)	(3.453)		Barclays Bank	(44.578)
97.928	Jefferies Financial Group Inc	Barclays Bank	(12.731)	(4.496)	Joint Corp	Morgan Stanley	(53.523)
9.070	Jefferies Financial Group Inc	HSBC	(10.612)	(1.417)	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	2.813
15.056	Jefferies Financial Group Inc	Morgan Stanley	(1.957)	(212)	Jones Lang LaSalle Inc	HSBC	1.545
6.836	JELD-WEN Holding Inc	Bank of America		(3.848)	Jones Lang LaSalle Inc	Morgan Stanley	26.166
		Merrill Lynch	(2.460)	(12.987)	Jounce Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3.377)
16.321	JELD-WEN Holding Inc	Barclays Bank	8.813	(7.468)	JPMorgan Chase & Co	Bank of America	
22.920	JELD-WEN Holding Inc	Goldman Sachs	(3.719)			Merrill Lynch	3.211
11.866	JELD-WEN Holding Inc	HSBC	(15.489)	(2.860)	JPMorgan Chase & Co	Barclays Bank	(2.002)
1.567	JELD-WEN Holding Inc	Morgan Stanley	846	(752)	JPMorgan Chase & Co	HSBC	(2.271)
6.918	JetBlue Airways Corp	Bank of America		(17.417)	JPMorgan Chase & Co	Morgan Stanley	(12.192)
		Merrill Lynch	4.670	(15.144)	Juniper Networks Inc	Bank of America	
3.139	JetBlue Airways Corp	Barclays Bank	7	(74.804)	Juniper Networks Inc	Merrill Lynch	4.187
5.114	JetBlue Airways Corp	Goldman Sachs	1.798	(42.739)	Juniper Networks Inc	Barclays Bank	38.150
1.981	JetBlue Airways Corp	HSBC	(143)	(15.305)	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs	8.120
1.163	JetBlue Airways Corp	Morgan Stanley	(134)	(14.267)	Juniper Networks Inc	HSBC	(836)
1.674	JFrog Ltd	Goldman Sachs	8.537	(151)	Kadant Inc	Morgan Stanley	6.230
(3.128)	JOANN Inc	Bank of America		(3.463)	Kadant Inc	Goldman Sachs	720
		Merrill Lynch	(4.348)	(12.929)	Kadant Inc	HSBC	48.378
(1.927)	JOANN Inc	Barclays Bank	(501)	(8.266)	Kadmon Holdings Inc	Morgan Stanley	3.103
(1.239)	JOANN Inc	Morgan Stanley	(322)		Kadmon Holdings Inc	Bank of America	
7.203	John B Sanfilippo & Son Inc	Bank of America		(10.406)	Kadmon Holdings Inc	Merrill Lynch	(1.571)
		Merrill Lynch	17.863	(4.360)	Kadmon Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.977)
1.381	John B Sanfilippo & Son Inc	Barclays Bank	1.989	(25.532)	Kadmon Holdings Inc	HSBC	(1.003)
6.773	John B Sanfilippo & Son Inc	Goldman Sachs	16.797	1.510	Kaiser Aluminum Corp	Morgan Stanley	(2.298)
211	John B Sanfilippo & Son Inc	HSBC	452		Kaiser Aluminum Corp	Bank of America	
6.749	John B Sanfilippo & Son Inc	Morgan Stanley	9.719	371	Kaiser Aluminum Corp	Merrill Lynch	(5.844)
6.400	John Bean Technologies Corp	Bank of America		1.066	Kaiser Aluminum Corp	Barclays Bank	1.554
		Merrill Lynch	21.888	281	Kaiser Aluminum Corp	Goldman Sachs	(4.125)
4.714	John Bean Technologies Corp	Barclays Bank	43.086	332	Kaiser Aluminum Corp	HSBC	(1.347)
2.065	John Bean Technologies Corp	Goldman Sachs	7.062	20.634	Kala Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	1.391
7.394	John Bean Technologies Corp	HSBC	26.101	26.394	Kala Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
7.164	John Bean Technologies Corp	Morgan Stanley	65.479	26.102	Kala Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	5.778
(2.013)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America		3.958	Kala Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	14.517
		Merrill Lynch	(880)	(4.454)	Kaleido Biosciences Inc	Goldman Sachs	7.309
(5.282)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Barclays Bank	213	(3.531)	KalVista Pharmaceuticals Inc	HSBC	1.544
407	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldman Sachs	537		KalVista Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(34)
(1.505)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.521)	(1.775)	KalVista Pharmaceuticals Inc	Bank of America	(777)
(8.925)	John Wiley & Sons Inc 'A'	HSBC	(13.685)	(9.900)	KalVista Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	
3.917	John Wiley & Sons Inc 'A'	Morgan Stanley	(705)	(5.033)	Kaman Corp	Barclays Bank	(4.242)
(6.092)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Morgan Stanley	1.097	(2.086)	Kaman Corp	Goldman Sachs	(2.178)
4.281	Johnson & Johnson	Bank of America		(3.890)	Kaman Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.435)	(9.041)	Kaman Corp	Merrill Lynch	(151)
7.562	Johnson & Johnson	Barclays Bank	(9.831)	(38.053)	Kansas City Southern	Barclays Bank	(3.797)
1.106	Johnson & Johnson	Goldman Sachs	(1.261)	(946)	Kansas City Southern	Goldman Sachs	(117)
2.089	Johnson & Johnson	HSBC	(2.131)	(2.103)	Kansas City Southern	HSBC	6.871
14.546	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	(12.604)	(3.237)	KAR Auction Services Inc	Morgan Stanley	(69.256)
(3.999)	Johnson Controls International Plc	Barclays Bank	(2.460)	11.206	KAR Auction Services Inc	Barclays Bank	(4.588)
(1.184)	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs	(520)	12.010	KAR Auction Services Inc	Goldman Sachs	(1.346)
(1.297)	Johnson Controls International Plc	HSBC	(58)	14.276	KAR Auction Services Inc	Morgan Stanley	(15.699)
(78.728)	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	(141.710)	722	Karat Packaging Inc	Barclays Bank	(13.335)
1.252	Johnson Outdoors Inc 'A'	Bank of America		8.410	Karat Packaging Inc	Goldman Sachs	(4.083)
		Merrill Lynch	(23.062)	3.500	Karat Packaging Inc	Morgan Stanley	(16.988)
2.495	Johnson Outdoors Inc 'A'	Barclays Bank	(7.759)	569	Karat Packaging Inc	Bank of America	
1.116	Johnson Outdoors Inc 'A'	Goldman Sachs	(20.557)	5.625	Karuna Therapeutics Inc	Merrill Lynch	1.177
				(1.412)	Karuna Therapeutics Inc	Barclays Bank	8.141
				(1.664)	Karuna Therapeutics Inc	Goldman Sachs	4.459
				(1.477)	Karyopharm Therapeutics Inc	HSBC	385
				21.103	Karyopharm Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1.527
						Barclays Bank	10.527
						Goldman Sachs	459
						Morgan Stanley	13.088
						Bank of America	
						Merrill Lynch	3.799

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
30.674	Karyopharm Therapeutics Inc	Barclays Bank	307	(35.894)	KeyCorp	HSBC	(2.872)
44.863	Karyopharm Therapeutics Inc	Goldman Sachs	6.194	(43.064)	KeyCorp	Morgan Stanley	—
16.848	Karyopharm Therapeutics Inc	HSBC	18.364	(993)	Keysight Technologies Inc	Barclays Bank	(1.536)
15.581	Karyopharm Therapeutics Inc	Morgan Stanley	156	(6.967)	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs	(12.106)
3.775	KB Home	Bank of America		(1.162)	Keysight Technologies Inc	Morgan Stanley	(1.836)
13.953	KB Home	Merrill Lynch	3.435	9.669	Kezar Life Sciences Inc	Bank of America	
24.880	KB Home	Barclays Bank	45.068	18.006	Kezar Life Sciences Inc	Merrill Lynch	2.321
2.145	KB Home	Goldman Sachs	22.225	4.209	Kezar Life Sciences Inc	Barclays Bank	2.161
36.474	KB Home	HSBC	(8.987)	7.981	Kezar Life Sciences Inc	Goldman Sachs	1.010
(432)	KBR Inc	Morgan Stanley	117.811	1.814	Kezar Life Sciences Inc	HSBC	3.991
(7.507)	KBR Inc	Bank of America	61	10.640	Kforce Inc	Morgan Stanley	218
(8.179)	KBR Inc	Merrill Lynch	2.477	8.074	Kforce Inc	Barclays Bank	22.450
5.742	KBR Inc	Barclays Bank	5.556	23.612	Kforce Inc	Goldman Sachs	18.005
(3.193)	KBR Inc	Goldman Sachs	(9.130)	10.455	Kforce Inc	HSBC	83.350
(26.249)	KBR Inc	HSBC	575	1.622	Kilroy Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	22.060
(20.026)	Kearny Financial Corp	Morgan Stanley	8.662	16.393	Kilroy Realty Corp (REIT)	Bank of America	
(148.133)	Kearny Financial Corp	Bank of America	6.969	26.041	Kilroy Realty Corp (REIT)	Merrill Lynch	5.855
(128.208)	Kearny Financial Corp	Merrill Lynch	(7.407)	(16.861)	Kimball Electronics Inc	HSBC	45.736
(7.614)	Kearny Financial Corp	Barclays Bank	47.269	(2.195)	Kimball Electronics Inc	Morgan Stanley	(20.312)
28.710	Kellogg Co	Goldman Sachs	(209)	(6.722)	Kimball Electronics Inc	Bank of America	
20.462	Kellogg Co	Morgan Stanley	(23.829)	21.560	Kimball International Inc 'B'	Merrill Lynch	(2.529)
22.946	Kellogg Co	Bank of America	(12.482)	31.085	Kimball International Inc 'B'	Barclays Bank	(329)
9.792	Kellogg Co	Merrill Lynch	(19.045)	81.333	Kimball International Inc 'B'	Goldman Sachs	(2.632)
41.491	Kellogg Co	Barclays Bank	(26.634)	(248)	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	(929)
3.697	Kelly Services Inc 'A'	Goldman Sachs	(25.309)	(5.405)	Kimberly-Clark Corp	Bank of America	
46.296	Kelly Services Inc 'A'	HSBC	17.130	(19.043)	Kimberly-Clark Corp	Merrill Lynch	744
24.298	Kelly Services Inc 'A'	Morgan Stanley	5.103	(10.386)	Kimberly-Clark Corp	Barclays Bank	8.053
1.579	Kemper Corp	Merrill Lynch	(765)	(23.848)	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs	57.129
5.567	Kemper Corp	Barclays Bank	819	(6.678)	Kimco Realty Corp (REIT)	HSBC	63.450
1.578	Kemper Corp	Goldman Sachs	(4.024)	1.389	Kimco Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	35.758
487	Kemper Corp	HSBC	(1.578)	51.537	Kindred Biosciences Inc	Barclays Bank	(4.541)
3.541	Kemper Corp	Morgan Stanley	(226)	24.391	Kinder Morgan Inc	Bank of America	
(16.439)	Kennametal Inc	Barclays Bank	20.384	64.240	Kinder Morgan Inc	Merrill Lynch	(23.707)
27.503	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs	(3.025)	(1.576)	Kinder Morgan Inc	Barclays Bank	(11.952)
98.232	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Morgan Stanley	13.826	22.829	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs	(29.550)
47.199	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Merrill Lynch	(7.552)	(46.762)	Kinder Morgan Inc	HSBC	(5)
49.020	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Barclays Bank	(5.247)	28.137	Kinder Morgan Inc	HSBC	2.055
(2.736)	Keros Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(9.959)	(10.349)	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	(4.209)
(1.072)	Keros Therapeutics Inc	HSBC	(4.384)	(18.075)	Kindred Biosciences Inc	Morgan Stanley	(13.787)
(5.862)	Keros Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(19.690)	10.050	Kiniksa Pharmaceuticals Ltd 'A'	Morgan Stanley	4.472
(16.659)	Keurig Dr Pepper Inc	Barclays Bank	(16.492)	3.271	Kiniksa Pharmaceuticals Ltd 'A'	Goldman Sachs	(905)
(36.199)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs	(3.620)	(5.458)	Kinsale Capital Group Inc	Bank of America	
(6.231)	Keurig Dr Pepper Inc	Merrill Lynch	(6.169)	(1.091)	Kinsale Capital Group Inc	Merrill Lynch	(39.680)
(1.842)	Keurig Dr Pepper Inc	Barclays Bank	(1.068)	10.542	Kinsale Capital Group Inc	Barclays Bank	(2.782)
(4.994)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs	(499)	(2.309)	Kinsale Capital Group Inc	Barclays Bank	26.882
518	Key Energy Services Inc	Bank of America		92	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs	(15.068)
14.799	Key Tronic Corp	Merrill Lynch	865	(291)	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs	669
(22.485)	KeyCorp	Barclays Bank	(2.664)	(774)	Kinsale Capital Group Inc	HSBC	(1.699)
(63.070)	KeyCorp	Goldman Sachs	10.793	1.739	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	(1.895)
(42.728)	KeyCorp	Merrill Lynch	—	(796)	Kirby Corp	Morgan Stanley	4.434
		Barclays Bank	20.509	(9.566)	Kirby Corp	Barclays Bank	1.146
		Goldman Sachs		(3.108)	Kirby Corp	Goldman Sachs	44.291
				(10.498)	Kirby Corp	HSBC	5.781
				(6.639)	Kirkland's Inc	Morgan Stanley	15.117
				14.619	Kite Realty Group Trust (REIT)	Barclays Bank	11.950
				(3.512)	KKR & Co Inc	Morgan Stanley	—
				(11.144)	KKR & Co Inc	HSBC	4.917
						Morgan Stanley	(4.123)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
26.826	KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	21.729	(34.269)	Kraft Heinz Co	Bank of America	29.597
24.782	KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	8.922	(6.962)	Kraton Corp	Bank of America Merrill Lynch	11.418
11.580	KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	9.380	(486)	Kraton Corp	Barclays Bank	185
15.174	KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT)	HSBC	3.794	(1.713)	Kraton Corp	Goldman Sachs	2.809
32.147	KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	11.573	(1.687)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(439)
922	KLA Corp	Bank of America Merrill Lynch	17.675	(7.406)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Barclays Bank	(3.999)
(110)	KLA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10)	(4.957)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Goldman Sachs	(1.289)
319	KLA Corp	Barclays Bank	(211)	(20.612)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Morgan Stanley	(11.130)
(82)	KLA Corp	Barclays Bank	20	(28.619)	Kroger Co	Bank of America Merrill Lynch	11.734
742	KLA Corp	Morgan Stanley	(490)	(27.512)	Kroger Co	Barclays Bank	(10.455)
(9.098)	KLX Energy Services Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.729	(54.129)	Kroger Co	Goldman Sachs	22.193
6.145	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Barclays Bank	(4.424)	(20.992)	Kroger Co	Morgan Stanley	(7.977)
12.988	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Goldman Sachs	(15.066)	5.000	Kronos Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.550)
8.296	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.973)	31.860	Kronos Worldwide Inc	Barclays Bank	(23.895)
(9.573)	Knoll Inc	HSBC	(9.094)	25.755	Kronos Worldwide Inc	Goldman Sachs	(28.588)
(19.391)	Knoll Inc	Morgan Stanley	(11.635)	54.214	Kronos Worldwide Inc	HSBC	(56.925)
9.697	Knowles Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.333	69.454	Kronos Worldwide Inc	Morgan Stanley	(52.091)
128.086	Knowles Corp	Barclays Bank	32.022	(259)	Krystal Biotech Inc	Bank of America Merrill Lynch	427
29.074	Knowles Corp	Goldman Sachs	15.991	(2.632)	Krystal Biotech Inc	Barclays Bank	1.237
27.409	Knowles Corp	HSBC	22.749	(4.743)	Krystal Biotech Inc	Goldman Sachs	7.826
47.130	Knowles Corp	Morgan Stanley	11.783	(3.959)	Krystal Biotech Inc	Morgan Stanley	1.861
(3.171)	Kodiak Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.108	(927)	Kura Oncology Inc	Goldman Sachs	2.494
(2.896)	Kodiak Sciences Inc	Barclays Bank	(6.428)	(11.956)	Kura Oncology Inc	Morgan Stanley	2.272
(1.927)	Kodiak Sciences Inc	Goldman Sachs	1.888	(3.058)	Kura Sushi USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(22.874)
(681)	Kodiak Sciences Inc	HSBC	3.262	(7.287)	Kura Sushi USA Inc 'A'	Barclays Bank	(10.931)
(3.678)	Kodiak Sciences Inc	Morgan Stanley	(7.731)	5.357	KVH Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(214)
2.764	Kohl's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(722)	30.118	KVH Industries Inc	Barclays Bank	(1.506)
1.391	Kohl's Corp	Barclays Bank	(264)	13.245	KVH Industries Inc	Morgan Stanley	(662)
16.555	Kohl's Corp	HSBC	(50.576)	(2.412)	Kymera Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.342)
16.807	Kohl's Corp	Morgan Stanley	(3.193)	(873)	Kymera Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3.845)
(557)	Kontoor Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	919	(2.276)	Kymera Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(6.167)
(259)	Kontoor Brands Inc	Barclays Bank	(34)	23.258	L B Foster Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.628)
(270)	Kontoor Brands Inc	Goldman Sachs	446	8.413	L B Foster Co 'A'	Barclays Bank	(252)
(554)	Kontoor Brands Inc	Morgan Stanley	(72)	14.739	L B Foster Co 'A'	Goldman Sachs	(1.032)
(28.747)	Kopin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(32.620)	6.384	L B Foster Co 'A'	HSBC	7.852
(2.768)	Kopin Corp	Goldman Sachs	(3.764)	11.886	L B Foster Co 'A'	Morgan Stanley	(357)
(3.084)	Koppers Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.449	704	L Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(429)
(3.704)	Koppers Holdings Inc	Barclays Bank	(3.445)	11.324	L Brands Inc	Barclays Bank	41.446
(7.480)	Koppers Holdings Inc	Goldman Sachs	3.516	(354)	L Brands Inc	Goldman Sachs	216
(13.730)	Koppers Holdings Inc	Morgan Stanley	(12.769)	(1.405)	L3Harris Technologies Inc	Barclays Bank	(2.487)
(2.366)	Korn Ferry	Bank of America Merrill Lynch	3.860	269	L3Harris Technologies Inc	Barclays Bank	911
(2.626)	Korn Ferry	Barclays Bank	236	(3.894)	L3Harris Technologies Inc	Goldman Sachs	156
(565)	Korn Ferry	Goldman Sachs	1.175	(5.485)	L3Harris Technologies Inc	HSBC	(5.704)
(3.440)	Korn Ferry	Morgan Stanley	310	(2.235)	L3Harris Technologies Inc	Morgan Stanley	(3.956)
(32.307)	Kosmos Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	969	12.321	La Jolla Pharmaceutical Co	Bank of America Merrill Lynch	6.777
(38.910)	Kosmos Energy Ltd	Barclays Bank	3.502	5.352	La Jolla Pharmaceutical Co	Barclays Bank	2.676
(92.581)	Kosmos Energy Ltd	Goldman Sachs	2.777	3.764	La Jolla Pharmaceutical Co	HSBC	2.033
(30.574)	Kraft Heinz Co	Barclays Bank	28.187	9.238	La Jolla Pharmaceutical Co	Morgan Stanley	4.619
(31.407)	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs	6.595	(390)	Laboratory Corp of America Holdings	Barclays Bank	(1.252)
(32.708)	Kraft Heinz Co	HSBC	983	(2.731)	Laboratory Corp of America Holdings	Goldman Sachs	(19.527)
				(18.426)	Ladder Capital Corp (REIT)	HSBC	(2.395)
				(23.084)	Ladder Capital Corp (REIT)	Morgan Stanley	(3.924)
				(4.307)	Laird Superfood Inc	Barclays Bank	3.101

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
4.015	Lakeland Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	(1.741)	Laredo Petroleum Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.899)
67.962	Lakeland Bancorp Inc	Barclays Bank	13.592	(762)	Laredo Petroleum Inc	Barclays Bank	(2.652)
66.810	Lakeland Bancorp Inc	Goldman Sachs	—	(3.126)	Laredo Petroleum Inc	Goldman Sachs	(7.766)
47.061	Lakeland Bancorp Inc	HSBC	24.472	(800)	Laredo Petroleum Inc	Morgan Stanley	(795)
109.647	Lakeland Bancorp Inc	Morgan Stanley	21.929	5.044	Larimar Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26.985)
4.861	Lakeland Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.347)	1.764	Larimar Therapeutics Inc	Barclays Bank	(11.995)
15.113	Lakeland Financial Corp	Barclays Bank	(2.871)	980	Larimar Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(5.243)
14.381	Lakeland Financial Corp	Morgan Stanley	(2.732)	3.791	Larimar Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(25.779)
(5.542)	Lakeland Industries Inc	Barclays Bank	493	(6.641)	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.575)
3.033	Lam Research Corp	Barclays Bank	46.132	(554)	Las Vegas Sands Corp	Barclays Bank	(6)
1.048	Lam Research Corp	HSBC	66.443	(22.982)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	(22.752)
3.124	Lam Research Corp	Morgan Stanley	47.516	26.160	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	25.898
1.056	Lamar Advertising Co 'A' (REIT)	Goldman Sachs	2.270	16.079	Las Vegas Sands Corp	HSBC	13.537
2.217	Lamar Advertising Co 'A' (REIT)	HSBC	2.062	(6.951)	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	(70)
1.344	Lamar Advertising Co 'A' (REIT)	Morgan Stanley	1.129	7.747	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	77
(1.436)	Lamb Weston Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.535)	29.728	Lattice Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	169.542
1.721	Lamb Weston Holdings Inc	Barclays Bank	3.545	9.255	Lattice Semiconductor Corp	Barclays Bank	11.689
657	Lamb Weston Holdings Inc	Goldman Sachs	3.160	5.038	Lattice Semiconductor Corp	Goldman Sachs	29.220
3.887	Lamb Weston Holdings Inc	HSBC	13.954	7.120	Lattice Semiconductor Corp	HSBC	26.210
(3.588)	Lamb Weston Holdings Inc	HSBC	(12.881)	1.905	Lattice Semiconductor Corp	Morgan Stanley	3.162
(5.421)	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	(11.137)	(12.400)	Laureate Education Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(372)
(3.960)	Lancaster Colony Corp	Barclays Bank	(1.861)	(9.365)	Laureate Education Inc 'A'	Barclays Bank	(3.278)
35.603	Landec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14.953)	(33.616)	Laureate Education Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.008)
12.620	Landec Corp	Barclays Bank	757	(17.775)	Laureate Education Inc 'A'	HSBC	(8.355)
60.758	Landec Corp	Goldman Sachs	(25.518)	(21.104)	Laureate Education Inc 'A'	Morgan Stanley	(7.386)
9.253	Landec Corp	HSBC	(463)	563	Lawson Products Inc	Morgan Stanley	(839)
(8.748)	Landmark Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.398	(9.465)	La-Z-Boy Inc	Bank of America Merrill Lynch	19.498
(2.728)	Landmark Bancorp Inc	Barclays Bank	1.610	(35.810)	La-Z-Boy Inc	Barclays Bank	20.770
(2.210)	Landmark Bancorp Inc	Goldman Sachs	2.122	1.457	Lazydays Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(510)
10.965	Landos Biopharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.566)	5.011	Lazydays Holdings Inc	Barclays Bank	(3.007)
1.888	Landos Biopharma Inc	Barclays Bank	680	2.343	Lazydays Holdings Inc	Goldman Sachs	(820)
6.753	Landos Biopharma Inc	Goldman Sachs	(4.660)	1.708	Lazydays Holdings Inc	HSBC	(1.196)
1.152	Landos Biopharma Inc	HSBC	472	796	Lazydays Holdings Inc	Morgan Stanley	(478)
5.231	Landos Biopharma Inc	Morgan Stanley	1.883	1.114	LCI Industries	Bank of America Merrill Lynch	7.341
2.928	Lands' End Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.622	4.053	LCI Industries	Barclays Bank	27.074
4.332	Lands' End Inc	Barclays Bank	6.108	5.763	LCI Industries	HSBC	110.246
3.477	Lands' End Inc	Goldman Sachs	6.676	13.425	LCI Industries	Morgan Stanley	89.679
2.508	Lands' End Inc	HSBC	8.427	(2.204)	LCNB Corp	Barclays Bank	1.168
14.923	Lands' End Inc	Morgan Stanley	21.041	(5.399)	LCNB Corp	Goldman Sachs	1.890
5.301	Landsea Homes Corp	Bank of America Merrill Lynch	(689)	(23.819)	LCNB Corp	HSBC	(3.096)
16.490	Landsea Homes Corp	Barclays Bank	165	(2.101)	Lear Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17.564)
5.729	Landsea Homes Corp	Goldman Sachs	(745)	(1.192)	Lear Corp	Barclays Bank	(7.545)
16.031	Landsea Homes Corp	HSBC	(6.252)	(1.677)	Lear Corp	Goldman Sachs	(14.019)
5.018	Landsea Homes Corp	Morgan Stanley	50	(243)	Lear Corp	HSBC	(663)
15.103	Landstar System Inc	Bank of America Merrill Lynch	(60.684)	(6.716)	Lear Corp	Morgan Stanley	(42.512)
8.017	Landstar System Inc	Goldman Sachs	(25.958)	(5.957)	Lee Enterprises Inc	Goldman Sachs	(11.557)
1.198	Landstar System Inc	Morgan Stanley	2.791	(6.308)	Legacy Housing Corp	Bank of America Merrill Lynch	189
(19.676)	Lannett Co Inc	Barclays Bank	6.887	(7.441)	Legacy Housing Corp	Barclays Bank	(1.265)
(11.742)	Lannett Co Inc	Morgan Stanley	4.110	(4.067)	Legacy Housing Corp	Goldman Sachs	122
2.137	Lantern Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.120	(6.737)	Leggett & Platt Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.670
3.761	Lantern Pharma Inc	Barclays Bank	1.617	(13.038)	Leggett & Platt Inc	Barclays Bank	(6.910)
2.557	Lantern Pharma Inc	HSBC	2.803	8.371	Leggett & Platt Inc	Barclays Bank	3.906
3.869	Lantern Pharma Inc	Morgan Stanley	1.664	(11.197)	Leggett & Platt Inc	Goldman Sachs	11.085
(18.059)	Lantheus Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(58.511)	6.448	Leggett & Platt Inc	Goldman Sachs	(2.024)
(4.090)	Lantheus Holdings Inc	Barclays Bank	(12.270)	2.690	Leggett & Platt Inc	HSBC	77
(40.175)	Lantheus Holdings Inc	Morgan Stanley	(120.525)	(2.363)	Leidos Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	460
				(6.784)	Leidos Holdings Inc	Barclays Bank	(592)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(2.773)	Leidos Holdings Inc	Goldman Sachs	1.747	(4.344)	Liberty Broadband Corp 'A'	HSBC	(4.822)
(6.711)	Leidos Holdings Inc	HSBC	11.610	(2.786)	Liberty Broadband Corp 'A'	Morgan Stanley	2.256
(16.426)	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	3.407	8.811	Liberty Global Plc 'A'	Bank of America	
6.257	LeMaitre Vascular Inc	Goldman Sachs	14.078			Merrill Lynch	(6.961)
(3.010)	Lemonade Inc	Bank of America		2.101	Liberty Global Plc 'A'	Barclays Bank	21
		Merrill Lynch	(50.655)	1.923	Liberty Global Plc 'A'	Goldman Sachs	(1.519)
(372)	Lemonade Inc	Barclays Bank	(3.582)	(19.655)	Liberty Global Plc 'A'	Goldman Sachs	13.922
(1.943)	Lemonade Inc	Goldman Sachs	(34.955)	6.246	Liberty Global Plc 'A'	HSBC	(2.811)
6.817	LendingClub Corp	Barclays Bank	9.407	25.647	Liberty Global Plc 'A'	Morgan Stanley	256
(1.669)	LendingTree Inc	Bank of America		(3.052)	Liberty Global Plc 'A'	Morgan Stanley	(31)
		Merrill Lynch	(15.436)	(3.272)	Liberty Latin America Ltd 'A'	Barclays Bank	(1.178)
(2.572)	LendingTree Inc	Barclays Bank	(16.915)	(5.789)	Liberty Latin America Ltd 'A'	Goldman Sachs	(1.100)
(879)	LendingTree Inc	Goldman Sachs	(17.703)	(27.392)	Liberty Latin America Ltd 'A'	Morgan Stanley	(9.861)
(430)	LendingTree Inc	Morgan Stanley	(1.707)	(739)	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A'	Bank of America	
6.939	Lennar Corp 'A'	Barclays Bank	27.617	(15.158)	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A'	Merrill Lynch	(392)
13.412	Lennar Corp 'A'	HSBC	(102.045)			Goldman Sachs	(8.034)
1.756	Lennar Corp 'A'	Morgan Stanley	6.989	(8.369)	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A'	HSBC	(8.034)
(2.081)	Lennar Corp 'B'	Bank of America				Morgan Stanley	2.433
		Merrill Lynch	(2.601)	(20.274)	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A'		
1.282	Lennox International Inc	Barclays Bank	9.205	(52.310)	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Morgan Stanley	5.231
1.763	Lennox International Inc	Goldman Sachs	2.821	13.909	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Bank of America	
5.179	Lennox International Inc	Morgan Stanley	37.185	5.752	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Merrill Lynch	8.485
(22.250)	LENSAR Inc	Bank of America		5.518	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Barclays Bank	(1.553)
		Merrill Lynch	(5.785)	3.398	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Goldman Sachs	3.366
(586)	LENSAR Inc	Barclays Bank	(152)	8.059	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	HSBC	4.689
(1.462)	LENSAR Inc	Goldman Sachs	(380)	2.587	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Morgan Stanley	(2.176)
(7.457)	LENSAR Inc	HSBC	(8.203)	(6.934)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Barclays Bank	(880)
(10.755)	LENSAR Inc	Morgan Stanley	(2.796)	5.556	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Morgan Stanley	2.358
14.205	Leslie's Inc	Barclays Bank	11.790	674	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Morgan Stanley	(1.889)
2.922	Leslie's Inc	Goldman Sachs	6.691	(5.310)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Barclays Bank	856
11.255	Level One Bancorp Inc	Bank of America				Morgan Stanley	(6.744)
		Merrill Lynch	3.939	3.467	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Morgan Stanley	4.403
11.581	Level One Bancorp Inc	Barclays Bank	1.158	9.135	Liberty Oilfield Services Inc 'A'	Barclays Bank	4.750
2.835	Level One Bancorp Inc	Goldman Sachs	992	7.031	Liberty Oilfield Services Inc 'A'	Goldman Sachs	2.039
18.805	Level One Bancorp Inc	HSBC	3.009	(5.453)	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	HSBC	(327)
15.239	Level One Bancorp Inc	Morgan Stanley	1.524	(45.733)	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(10.976)
1.709	Levi Strauss & Co 'A'	Bank of America		2.554	Life Storage Inc (REIT)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(936)	8.563	Life Storage Inc (REIT)	Merrill Lynch	7.202
6.237	Levi Strauss & Co 'A'	Barclays Bank	(3.707)	11.567	Life Storage Inc (REIT)	Goldman Sachs	24.148
8.734	Levi Strauss & Co 'A'	Goldman Sachs	1.341	(4.653)	Life Storage Inc (REIT)	Morgan Stanley	21.977
10.413	Levi Strauss & Co 'A'	Morgan Stanley	(3.661)	(3.446)	LifeMD Inc	Morgan Stanley	(8.841)
(3.374)	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(540)	(2.930)	LifeMD Inc	Merrill Lynch	(17.747)
(7.355)	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(1.618)	(23.705)	Lifetime Brands Inc	Barclays Bank	(4.747)
(6.000)	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.320)	(4.210)	Lifetime Brands Inc	Goldman Sachs	54.047
(163)	Lexington Realty Trust (REIT)	Bank of America		(2.300)	Lifetime Brands Inc	HSBC	2.105
		Merrill Lynch	(52)	21.994	Lifevantage Corp	Morgan Stanley	1.955
(2.428)	Lexington Realty Trust (REIT)	Barclays Bank	(583)			Bank of America	
(57.169)	Lexington Realty Trust (REIT)	HSBC	11.434	32.756	Lifevantage Corp	Merrill Lynch	(3.739)
(258.347)	Lexington Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	(62.003)	19.275	Lifevantage Corp	Barclays Bank	(5.569)
668	LGI Homes Inc	Bank of America		18.203	Lifevantage Corp	HSBC	9.252
		Merrill Lynch	5.582	(3.194)	Ligand Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(3.095)
1.073	LGI Homes Inc	Goldman Sachs	5.054			Barclays Bank	12.489
172	LGI Homes Inc	HSBC	2.211				
3.154	LGI Homes Inc	Morgan Stanley	42.327				
2.006	LHC Group Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	18.315				
3.952	LHC Group Inc	Barclays Bank	(2.198)				
3.549	LHC Group Inc	Goldman Sachs	27.056				
890	LHC Group Inc	HSBC	(3.527)				
3.645	LHC Group Inc	Morgan Stanley	(1.216)				
(174)	Liberty Broadband Corp	Barclays Bank	118				
(8.934)	Liberty Broadband Corp	Morgan Stanley	6.075				
(6.874)	Liberty Broadband Corp 'A'	Bank of America					
		Merrill Lynch	(21.859)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
83.532	Limelight Networks Inc	Goldman Sachs	6.683	1.450	Lithia Motors Inc 'A'	Bank of America	
4.624	Limestone Bancorp Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(20.445)
		Merrill Lynch	139	2.297	Lithia Motors Inc 'A'	Barclays Bank	10.107
140	Limestone Bancorp Inc	Barclays Bank	(25)	(490)	Lithia Motors Inc 'A'	Barclays Bank	250
5.667	Limestone Bancorp Inc	Goldman Sachs	170	1.208	Lithia Motors Inc 'A'	Goldman Sachs	(17.033)
2.141	Limestone Bancorp Inc	HSBC	343	(195)	Lithia Motors Inc 'A'	Goldman Sachs	1.418
1.823	Limestone Bancorp Inc	Morgan Stanley	(328)	1.332	Lithia Motors Inc 'A'	HSBC	(20.289)
(19.090)	Limoneira Co	Bank of America		4.047	Lithia Motors Inc 'A'	Morgan Stanley	17.807
		Merrill Lynch	1.145	(229)	Lithia Motors Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.008)
(22.503)	Limoneira Co	Barclays Bank	(900)	(970)	Littelfuse Inc	Barclays Bank	(3.841)
(32.348)	Limoneira Co	Goldman Sachs	1.941	(2.817)	Littelfuse Inc	HSBC	(19.691)
(10.711)	Limoneira Co	HSBC	(214)	(8.102)	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	(32.084)
(16.433)	Limoneira Co	Morgan Stanley	(657)	3.427	LivaNova Plc	Barclays Bank	3.290
17.702	Lincoln Educational Services Corp	Bank of America		10.756	Live Nation Entertainment Inc	Barclays Bank	(17.317)
		Merrill Lynch	7.258				
10.070	Lincoln Educational Services Corp	Goldman Sachs	4.129	(1.321)	Live Nation Entertainment Inc	Goldman Sachs	(7.384)
33.957	Lincoln Educational Services Corp	HSBC	17.318	(3.612)	Live Oak Bancshares Inc	Bank of America	
13.660	Lincoln Educational Services Corp	Morgan Stanley	1.776	(1.746)	Live Oak Bancshares Inc	Merrill Lynch	795
(13.468)	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America		(3.694)	Live Oak Bancshares Inc	Barclays Bank	(821)
		Merrill Lynch	34.478	(15.257)	Livent Corp	Morgan Stanley	(1.736)
278	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America		(5.411)	Livent Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(119)	(1.325)	Livent Corp	Merrill Lynch	(35.396)
(1.629)	Lincoln Electric Holdings Inc	HSBC	10.295	8.782	LivePerson Inc	Barclays Bank	(5.790)
(1.114)	Lincoln Electric Holdings Inc	Morgan Stanley	45			Goldman Sachs	(3.074)
2.026	Lincoln National Corp	Bank of America		(10.553)	LivePerson Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	11			Merrill Lynch	(17.919)
(7.225)	Lincoln National Corp	Barclays Bank	(3.685)	4.709	LivePerson Inc	Barclays Bank	4.944
3.006	Lincoln National Corp	Barclays Bank	4.335	(4.969)	LivePerson Inc	Barclays Bank	(5.217)
(7.373)	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	2.802	3.288	LivePerson Inc	Goldman Sachs	11.146
1.803	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	25	1.201	LivePerson Inc	HSBC	5.717
(15.595)	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Bank of America		290	LivePerson Inc	Morgan Stanley	305
		Merrill Lynch	(9.045)	2.596	LiveRamp Holdings Inc	Bank of America	
(63.015)	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Barclays Bank	(32.138)	8.011	LiveRamp Holdings Inc	Merrill Lynch	9.423
(16.242)	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Goldman Sachs	(9.420)	2.001	LiveRamp Holdings Inc	Barclays Bank	22.031
2.945	Linde Plc	Bank of America		689	LiveRamp Holdings Inc	Goldman Sachs	7.264
		Merrill Lynch	(2.024)	6.208	LiveRamp Holdings Inc	HSBC	2.405
1.016	Linde Plc	Barclays Bank	(199)	20.858	LiveXLive Media Inc	Morgan Stanley	17.072
12.899	Linde Plc	Goldman Sachs	(1.300)	4.899	LiveXLive Media Inc	Goldman Sachs	20.858
1.296	Linde Plc	Morgan Stanley	(868)	16.498	LKQ Corp	Morgan Stanley	2.156
(592)	Lindsay Corp	HSBC	989	14.231	LKQ Corp	Barclays Bank	11.714
(78.765)	Lineage Cell Therapeutics Inc	Bank of America		(4.907)	Loews Corp	Morgan Stanley	10.104
		Merrill Lynch	(3.151)	(5.498)	Loews Corp	Barclays Bank	(573)
(1.824)	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Bank of America		(13.747)	Loews Corp	Goldman Sachs	385
		Merrill Lynch	(201)	(7.522)	Loews Corp	HSBC	687
(14.353)	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Barclays Bank	(12.565)	6.705	LogicBio Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1.504
7.065	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Goldman Sachs	20.065	14.856	LogicBio Therapeutics Inc	Bank of America	
(1.171)	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	HSBC	(1.052)	15.004	LogicBio Therapeutics Inc	Merrill Lynch	(2.347)
9.019	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Barclays Bank	6.584	4.968	LogicBio Therapeutics Inc	Barclays Bank	2.823
33.236	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Goldman Sachs	88.740	(4.532)	Loral Space & Communications Inc	HSBC	(4.351)
3.250	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	HSBC	12.448	(2.665)	Loral Space & Communications Inc	Morgan Stanley	944
4.961	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Morgan Stanley	3.622	(11.917)	Loral Space & Communications Inc	Bank of America	
(15.536)	Liquidia Corp	Bank of America		(1.652)	Loral Space & Communications Inc	Merrill Lynch	4
		Merrill Lynch	(4.195)	(8.187)	Loral Space & Communications Inc	Barclays Bank	2.177
(11.499)	Liquidia Corp	Barclays Bank	1.150	1.020	Lordstown Motors Corp 'A'	Goldman Sachs	(1.907)
(52.159)	Liquidia Corp	Goldman Sachs	(14.083)	1.199	Lordstown Motors Corp 'A'	HSBC	1.635
(7.523)	Liquidia Corp	Morgan Stanley	752	5.284	Lordstown Motors Corp 'A'	Morgan Stanley	8.924
(4.270)	Liquidity Services Inc	Bank of America		27.079	Louisiana-Pacific Corp	Barclays Bank	235
		Merrill Lynch	18.062			Goldman Sachs	1.799
(13.613)	Liquidity Services Inc	HSBC	12.116	7.848	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	1.215
				(1.645)	Louisiana-Pacific Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	70.405
						Barclays Bank	14.539
						Goldman Sachs	214

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.434)	Lovesac Co	Bank of America		21.240	Lyft Inc 'A'	Morgan Stanley	82.244
		Merrill Lynch	(9.034)	11.466	LyondellBasell Industries NV 'A'	Barclays Bank	11.695
(376)	Lovesac Co	Barclays Bank	(2.399)	2.108	Lyra Therapeutics Inc	Barclays Bank	84
3.842	Lowe's Cos Inc	Bank of America		7.143	Lyra Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3.071)
		Merrill Lynch	3.446	7.636	Lyra Therapeutics Inc	Morgan Stanley	305
9.307	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs	6.095	(1.799)	M&T Bank Corp	Barclays Bank	1.601
3.302	Lowe's Cos Inc	HSBC	(12.332)	(1.923)	M&T Bank Corp	Morgan Stanley	1.711
(464)	LPL Financial Holdings Inc	Bank of America		(12.581)	M/I Homes Inc	HSBC	30.194
		Merrill Lynch	413	(6.852)	M/I Homes Inc	Morgan Stanley	(26.654)
(3.371)	LPL Financial Holdings Inc	Barclays Bank	1.504	111.921	Macatawa Bank Corp	Bank of America	
(8.518)	LPL Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	7.581		Macatawa Bank Corp	Merrill Lynch	(24.623)
(751)	LPL Financial Holdings Inc	HSBC	3.289	44.390	Macatawa Bank Corp	Barclays Bank	(1.776)
(9.198)	LPL Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	2.859	77.234	Macatawa Bank Corp	Goldman Sachs	(16.991)
(9.887)	LSB Industries Inc	Morgan Stanley	2.373	99.029	Macatawa Bank Corp	HSBC	1.981
(36.320)	LSI Industries Inc	Bank of America		129.352	Macatawa Bank Corp	Morgan Stanley	(5.174)
		Merrill Lynch	(41.042)	8.689	Macerich Co (REIT)	Barclays Bank	8.168
(5.891)	LSI Industries Inc	Barclays Bank	(6.303)	27.846	Macerich Co (REIT)	Goldman Sachs	44.554
(12.963)	LSI Industries Inc	Goldman Sachs	(14.648)	3.613	Macerich Co (REIT)	HSBC	6.214
(1.036)	LTC Properties Inc (REIT)	Bank of America		18.522	Macerich Co (REIT)	Morgan Stanley	17.411
		Merrill Lynch	539	(1.186)	Mack-Cali Realty Corp (REIT)	Bank of America	
(29.724)	LTC Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	6.442	(35.948)	Mack-Cali Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	6.111
(8.629)	LTC Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	4.487	(307)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Bank of America	
(38.588)	LTC Properties Inc (REIT)	HSBC	65.214	(14.063)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Merrill Lynch	(2.603)
(91.117)	LTC Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	24.602	(21.171)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Barclays Bank	(54.846)
(667)	Lululemon Athletica Inc	Barclays Bank	3.178	874	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs	(179.530)
(143)	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	818	(15.488)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	HSBC	3.261
2.180	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	10.769	(22.549)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	HSBC	(94.477)
(5.762)	Lumber Liquidators Holdings Inc	Bank of America		(24.244)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	(87.941)
		Merrill Lynch	3.745	(11.235)	Macquarie Infrastructure Corp	Bank of America	
(1.262)	Lumber Liquidators Holdings Inc	Barclays Bank	(1.615)	(11.875)	Macquarie Infrastructure Corp	Merrill Lynch	6.119
(14.699)	Lumber Liquidators Holdings Inc	Goldman Sachs	9.554	(11.875)	Macquarie Infrastructure Corp	Barclays Bank	1.573
(56.924)	Lumen Technologies Inc	Bank of America		(28.362)	Macquarie Infrastructure Corp	Goldman Sachs	3.325
		Merrill Lynch	30.872	(26.590)	Macquarie Infrastructure Corp	HSBC	(9.620)
(14.643)	Lumen Technologies Inc	Barclays Bank	7.013	1.876	MacroGenics Inc	Morgan Stanley	3.722
(4.450)	Lumen Technologies Inc	Goldman Sachs	3.160	2.720	Madison Square Garden Entertainment Corp	Barclays Bank	4.090
(12.579)	Lumen Technologies Inc	Morgan Stanley	6.415	3.754	Madison Square Garden Entertainment Corp	Goldman Sachs	12.914
(601)	Lumentum Holdings Inc	Barclays Bank	(316)	(1.265)	Madison Square Garden Sports Corp	Bank of America	
307	Lumentum Holdings Inc	Barclays Bank	335	(3.259)	Madison Square Garden Sports Corp	Merrill Lynch	(2.606)
(199)	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs	21	(8.268)	Madison Square Garden Sports Corp	Barclays Bank	21.998
1.568	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs	14.410	(2.915)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	52.382
(201)	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	(212)	(2.831)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Bank of America	63.255
1.246	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	1.358	(1.644)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	37.879
(8.357)	Luminex Corp	Barclays Bank	(1.588)	(372)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	35.675
(1.800)	Lumos Pharma Inc	Bank of America		11.225	Magenta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	4.977
		Merrill Lynch	(522)	1.781	Magnite Inc	Barclays Bank	8.756
(10.324)	Lumos Pharma Inc	Barclays Bank	4.439	(2.178)	Magnite Inc	Barclays Bank	(1.140)
(400)	Lumos Pharma Inc	Goldman Sachs	(116)	1.812	Magnite Inc	Goldman Sachs	1.394
(36.842)	Luna Innovations Inc	Bank of America		2.334	Magnite Inc	HSBC	7.484
		Merrill Lynch	51.839				2.661
(34.860)	Luna Innovations Inc	Barclays Bank	2.597				
(52.708)	Luna Innovations Inc	Goldman Sachs	85.387				
(47.066)	Luna Innovations Inc	HSBC	35.770				
(10.999)	Luna Innovations Inc	Morgan Stanley	990				
48.599	Luther Burbank Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	(6.804)				
10.292	Luther Burbank Corp	Barclays Bank	103				
21.960	Luther Burbank Corp	Goldman Sachs	(3.074)				
6.309	Luther Burbank Corp	HSBC	1.956				
20.468	Luther Burbank Corp	Morgan Stanley	205				
(2.154)	Luxfer Holdings Plc	Barclays Bank	(431)				
(25.638)	Luxfer Holdings Plc	Goldman Sachs	(14.870)				
(14.599)	Luxfer Holdings Plc	HSBC	(6.132)				
(15.921)	Luxfer Holdings Plc	Morgan Stanley	(3.184)				
(2.471)	Lydall Inc	Morgan Stanley	(692)				
1.165	Lyft Inc 'A'	Bank of America					
		Merrill Lynch	8.598				
2.874	Lyft Inc 'A'	Barclays Bank	10.863				
5.604	Lyft Inc 'A'	HSBC	44.440				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.180	Magnite Inc	Morgan Stanley	(755)	1.918	Marcus & Millichap Inc	Bank of America	
14.954	Magnolia Oil & Gas Corp 'A'	Barclays Bank	11.515			Merrill Lynch	4.411
48.829	Magnolia Oil & Gas Corp 'A'	Goldman Sachs	3.906	78.873	Marcus & Millichap Inc	Barclays Bank	69.408
(14.964)	Magnolia Oil & Gas Corp 'A'	Morgan Stanley	(11.522)	506	Marcus & Millichap Inc	Goldman Sachs	1.164
(2.575)	MainStreet Bancshares Inc	Bank of America		9.916	Marcus & Millichap Inc	HSBC	16.659
		Merrill Lynch	(541)	34.634	Marcus & Millichap Inc	Morgan Stanley	30.478
(2.824)	MainStreet Bancshares Inc	Barclays Bank	(565)	15.644	Marcus Corp	Bank of America	
(2.036)	MainStreet Bancshares Inc	Goldman Sachs	(428)			Merrill Lynch	20.797
(25.082)	MainStreet Bancshares Inc	Morgan Stanley	(5.016)	10.556	Marcus Corp	Barclays Bank	12.878
758	Malibu Boats Inc 'A'	Barclays Bank	1.327	5.739	Marcus Corp	Goldman Sachs	4.220
359	Malibu Boats Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.878)	28.515	Marcus Corp	Morgan Stanley	34.788
2.089	Malibu Boats Inc 'A'	HSBC	(9.526)	(7)	Marine Products Corp	Bank of America	
8.756	Malibu Boats Inc 'A'	Morgan Stanley	15.323			Merrill Lynch	4
(2.387)	Malvern Bancorp Inc	Barclays Bank	406	(15.891)	Marine Products Corp	Barclays Bank	(159)
(1.994)	Malvern Bancorp Inc	Goldman Sachs	(1.356)	(10.660)	Marine Products Corp	Goldman Sachs	6.183
(10.216)	Malvern Bancorp Inc	HSBC	(204)	(7.932)	Marine Products Corp	HSBC	2.618
6.199	Mammoth Energy Services Inc	Bank of America		(8.372)	Marine Products Corp	Morgan Stanley	(84)
		Merrill Lynch	4.091	6.860	MarineMax Inc	Barclays Bank	1.166
2.872	Mammoth Energy Services Inc	Barclays Bank	115	535	MarineMax Inc	Goldman Sachs	(129)
14.243	Mammoth Energy Services Inc	HSBC	2.136	17.370	MarineMax Inc	Morgan Stanley	2.953
5.697	Mammoth Energy Services Inc	Morgan Stanley	228	(7.909)	Marinus Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
587	Manhattan Associates Inc	Bank of America		(4.804)	Marinus Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	2.354
		Merrill Lynch	2.231	(7.625)	Marinus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(13.649)
889	Manhattan Associates Inc	Barclays Bank	2.080	1.495	Markel Corp	Barclays Bank	(6.742)
1.124	Manhattan Associates Inc	Goldman Sachs	4.271	580	Markel Corp	HSBC	5.609
4.372	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	10.230	793	Markel Corp	Morgan Stanley	(3.577)
19.882	Manitowoc Co Inc	Bank of America		18.550	Marker Therapeutics Inc	HSBC	12.429
		Merrill Lynch	9.543	16.257	Marker Therapeutics Inc	Morgan Stanley	3.414
16.543	Manitowoc Co Inc	Barclays Bank	29.116	(44)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America	
2.535	Manitowoc Co Inc	Goldman Sachs	1.217			Merrill Lynch	(504)
23.714	Manitowoc Co Inc	HSBC	(13.754)	(359)	MarketAxess Holdings Inc	Barclays Bank	(3.249)
1.078	Manitowoc Co Inc	Morgan Stanley	1.897	1.010	MarketAxess Holdings Inc	Barclays Bank	10.241
24.789	MannKind Corp	Bank of America		(386)	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs	(752)
		Merrill Lynch	4.710	1.511	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs	17.301
37.451	MannKind Corp	Barclays Bank	6.800	(162)	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.643)
4.347	MannKind Corp	Goldman Sachs	826	(670)	Marlin Business Services Corp	Bank of America	
9.059	ManpowerGroup Inc	Barclays Bank	(14.313)	(21.881)	Marlin Business Services Corp	Merrill Lynch	(34)
864	ManpowerGroup Inc	HSBC	(2.030)			Morgan Stanley	4.814
2.366	ManTech International Corp 'A'	Goldman Sachs	3.525	(12.231)	Marriott International Inc 'A'	Barclays Bank	(20.160)
890	ManTech International Corp 'A'	HSBC	3.204	(3.389)	Marriott International Inc 'A'	Goldman Sachs	(12.607)
6.299	ManTech International Corp 'A'	Morgan Stanley	4.913	(1.779)	Marriott International Inc 'A'	HSBC	(4.995)
		Bank of America		(3.440)	Marriott International Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.814)
(620)	Marathon Digital Holdings Inc	Merrill Lynch	(1.494)	5.062	Marriott Vacations Worldwide Corp	Bank of America	
(2.305)	Marathon Digital Holdings Inc	Barclays Bank	(3.734)	10.644	Marriott Vacations Worldwide Corp	Merrill Lynch	(9.162)
(34.291)	Marathon Oil Corp	Barclays Bank	(4.801)	(3.827)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Barclays Bank	(6.067)
(4.856)	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs	680	1.220	Marriott Vacations Worldwide Corp	Barclays Bank	2.181
2.757	Marathon Oil Corp	HSBC	353	1.122	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs	(2.208)
(4.875)	Marathon Oil Corp	Morgan Stanley	(683)	1.122	Marriott Vacations Worldwide Corp	HSBC	740
(16.723)	Marathon Petroleum Corp	Bank of America		1.442	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	(822)
		Merrill Lynch	(4.682)	(690)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	393
(17.639)	Marathon Petroleum Corp	Barclays Bank	(18.874)	40.867	Marrone Bio Innovations Inc	Bank of America	
(18.012)	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs	(5.043)	40.569	Marrone Bio Innovations Inc	Merrill Lynch	(4.087)
(11.793)	Marathon Petroleum Corp	Morgan Stanley	(12.619)	25.611	Marrone Bio Innovations Inc	Barclays Bank	(406)
4.904	Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A'	Bank of America		24.228	Marrone Bio Innovations Inc	Goldman Sachs	(2.561)
(4.618)	Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	(4.217)	18.636	Marrone Bio Innovations Inc	HSBC	(3.392)
6.163	Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	3.971	3.488	Marrone Bio Innovations Inc	Morgan Stanley	(186)
28.841	Marchex Inc 'B'	HSBC	10.600	4.746	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America	
		Bank of America		(8.245)	Marsh & McLennan Cos Inc	Merrill Lynch	13.464
		Merrill Lynch	865			Barclays Bank	9.112
60.103	Marchex Inc 'B'	Goldman Sachs	1.803			Barclays Bank	(15.830)
47.945	Marchex Inc 'B'	Morgan Stanley	3.836			Barclays Bank	

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
12.998	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs	50.172	(15.876)	Mattel Inc	Bank of America	
(87)	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs	(336)			Merrill Lynch	(5.795)
5.839	Marsh & McLennan Cos Inc	HSBC	3.270	(9.092)	Mattel Inc	Barclays Bank	(10.729)
(5.920)	Marsh & McLennan Cos Inc	HSBC	(3.315)	47.095	Mattel Inc	Goldman Sachs	17.190
854	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	1.640	(18.258)	Mattel Inc	HSBC	9.129
(776)	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	(1.490)	5.252	Matthews International Corp		
13.429	Marten Transport Ltd	Bank of America		'A'	HSBC	(11.554)	
		Merrill Lynch	(9.132)	22.428	Matthews International Corp		
40.481	Marten Transport Ltd	Barclays Bank	12.549	'A'	Morgan Stanley	(1.570)	
7.645	Marten Transport Ltd	Goldman Sachs	(5.199)	(55.499)	Maui Land & Pineapple Co	Bank of America	
8.388	Marten Transport Ltd	HSBC	(6.165)	Inc	Merrill Lynch	7.770	
24.937	Marten Transport Ltd	Morgan Stanley	7.730	(4.632)	Maxar Technologies Inc	Bank of America	
2.866	Martin Marietta Materials	Bank of America		(2.961)	Maxar Technologies Inc	Merrill Lynch	(4.678)
	Inc	Merrill Lynch	(35.538)	(3.077)	Maxar Technologies Inc	Barclays Bank	(1.866)
2.514	Martin Marietta Materials	Barclays Bank	(7.065)	(601)	Maxar Technologies Inc	Goldman Sachs	(3.548)
	Inc			26.176	Maximus Inc	Morgan Stanley	(685)
3.058	Martin Marietta Materials	Goldman Sachs	(37.919)		Bank of America		
1.780	Martin Marietta Materials			(1.352)	Merrill Lynch	53.661	
	Inc	Morgan Stanley	(5.002)		Bank of America		
(10.761)	Marvell Technology Inc	Barclays Bank	(7.317)	22.607	Maximus Inc	Merrill Lynch	(2.772)
(7.212)	Marvell Technology Inc	Morgan Stanley	(4.904)	(803)	Maximus Inc	Barclays Bank	42.501
4.308	Masco Corp	Bank of America		539	Maximus Inc	Barclays Bank	(1.510)
		Merrill Lynch	(15.078)	(801)	Maximus Inc	Goldman Sachs	1.105
(1.390)	Masco Corp	Bank of America		5.812	Maximus Inc	Goldman Sachs	(1.642)
		Merrill Lynch	758	(3.133)	Maximus Inc	HSBC	15.111
4.912	Masco Corp	Barclays Bank	(1.670)	45.730	Maximus Inc	Morgan Stanley	(5.890)
25.425	Masco Corp	Morgan Stanley	(8.645)	(19.168)	MaxLinear Inc	Morgan Stanley	85.972
375	Masimo Corp	Bank of America		(769)	MaxLinear Inc	Barclays Bank	(37.186)
		Merrill Lynch	960	4.931	Mayville Engineering Co Inc	Goldman Sachs	(3.237)
2.558	Masimo Corp	Barclays Bank	(6.676)		Bank of America		
359	Masimo Corp	HSBC	(460)	1.445	Merrill Lynch	9.911	
231	Masimo Corp	Morgan Stanley	(603)	14.840	Goldman Sachs	2.904	
(7.072)	Masonite International Corp	Morgan Stanley	(495)	Mayville Engineering Co Inc	HSBC	18.847	
649	MasTec Inc	Bank of America		12.815	Mayville Engineering Co Inc	Morgan Stanley	8.842
		Merrill Lynch	(4)	(2.938)	MBIA Inc	Bank of America	
15.638	MasTec Inc	Morgan Stanley	5.317	(4.979)	MBIA Inc	Merrill Lynch	(2.615)
6.213	Mastech Digital Inc	Bank of America		(14.483)	MBIA Inc	Barclays Bank	(1.095)
		Merrill Lynch	(4.598)	(101.872)	MBIA Inc	Goldman Sachs	(12.890)
3.208	Mastech Digital Inc	Barclays Bank	(289)	(5.929)	McAfee Corp 'A'	Morgan Stanley	(22.970)
934	Mastech Digital Inc	Goldman Sachs	(691)	(1.262)	McAfee Corp 'A'	Barclays Bank	783
3.555	Mastech Digital Inc	HSBC	569	(3.521)	McAfee Corp 'A'	Goldman Sachs	(1.855)
2.427	Mastech Digital Inc	Morgan Stanley	(218)	2.521	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	(6)
(1.700)	Mastercard Inc 'A'	Barclays Bank	20.060		Bank of America		
2.628	Mastercard Inc 'A'	Barclays Bank	(17.089)	8.429	Merrill Lynch	(202)	
4.274	Mastercard Inc 'A'	Goldman Sachs	(11.625)	8.254	McCormick & Co Inc	Barclays Bank	(9.308)
4.019	Mastercard Inc 'A'	Morgan Stanley	(47.424)	8.221	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs	(660)
(6.208)	MasterCraft Boat Holdings			40.764	McCormick & Co Inc	HSBC	(13.318)
	Inc	HSBC	6.208	727	McDonald's Corp	Morgan Stanley	(40.549)
(4.489)	MasterCraft Boat Holdings				Bank of America		
	Inc	Morgan Stanley	5.117	(4.285)	McDonald's Corp	Merrill Lynch	1.607
(8.942)	Matador Resources Co	Barclays Bank	(9.836)		Bank of America		
(2.604)	Matador Resources Co	Goldman Sachs	(52)	7.198	Merrill Lynch	(9.470)	
1.837	Match Group Inc	Bank of America		1.713	Barclays Bank	14.252	
		Merrill Lynch	2.981	(6.029)	McDonald's Corp	Goldman Sachs	3.786
(2.434)	Match Group Inc	Barclays Bank	9.541	(725)	McDonald's Corp	Goldman Sachs	(13.324)
(1.465)	Match Group Inc	Goldman Sachs	(4.966)	3.629	McDonald's Corp	HSBC	842
(590)	Match Group Inc	Morgan Stanley	2.313	(1.735)	McDonald's Corp	Morgan Stanley	7.185
3.655	Materion Corp	Bank of America		6.427	McGrath RentCorp	Morgan Stanley	(3.435)
		Merrill Lynch	914		Bank of America		
6.068	Materion Corp	Barclays Bank	6.189	2.257	McGrath RentCorp	Merrill Lynch	4.820
10.899	Materion Corp	Goldman Sachs	2.725	9.828	McGrath RentCorp	HSBC	7.313
9.890	Materion Corp	Morgan Stanley	10.088	580	McKesson Corp	Morgan Stanley	(7.076)
6.168	Matrix Service Co	Barclays Bank	(2.035)		Bank of America		
23.220	Matrix Service Co	Goldman Sachs	(27.632)	15.417	McKesson Corp	Merrill Lynch	(251)
3.786	Matrix Service Co	HSBC	(9.238)	4.369	McKesson Corp	Barclays Bank	(110.941)
22.684	Matrix Service Co	Morgan Stanley	(7.486)	7.134	McKesson Corp	Goldman Sachs	(30.452)
(23.212)	Matson Inc	HSBC	(6.267)	4.537	MDC Holdings Inc	Morgan Stanley	(47.766)
(4.017)	Matson Inc	Morgan Stanley	(402)		Bank of America		
					Merrill Lynch	(227)	

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
23.796	MDC Holdings Inc	Barclays Bank	43.547	(10.844)	Merck & Co Inc	Barclays Bank	30.514
21.034	MDC Holdings Inc	HSBC	(87.291)	(30.717)	Merck & Co Inc	Goldman Sachs	117.270
42.536	MDC Holdings Inc	Morgan Stanley	77.841	11.172	Merck & Co Inc	Goldman Sachs	(44.465)
2.809	MDU Resources Group Inc	Bank of America		(29.065)	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	59.577
		Merrill Lynch	(895)	(3.113)	Mercury General Corp	Barclays Bank	2.677
14.626	MDU Resources Group Inc	Barclays Bank	(6.143)	(604)	Mercury General Corp	Goldman Sachs	1.921
6.906	MDU Resources Group Inc	HSBC	(304)	(3.483)	Mercury General Corp	HSBC	9.509
(17.565)	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	7.377	(11.911)	Mercury General Corp	Morgan Stanley	5.193
14.739	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	(6.190)	5.597	Mercury Systems Inc	Bank of America	
2.800	Medallia Inc	Barclays Bank	(616)			Merrill Lynch	17.742
1.586	Medallia Inc	Goldman Sachs	2.522	4.964	Mercury Systems Inc	Barclays Bank	8.162
(4.063)	Medallia Inc	Goldman Sachs	(2.192)	11.031	Mercury Systems Inc	HSBC	19.525
526	Medallia Inc	HSBC	342	1.819	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	3.807
5.754	Medallia Inc	Morgan Stanley	(1.568)	(1.287)	Meredith Corp	Barclays Bank	2.947
(6.843)	Medallia Inc	Morgan Stanley	1.505	(9.903)	Meredith Corp	Morgan Stanley	22.678
1.716	Media Gen Inc CVR ^{*,††}	Bank of America		(15.196)	Meridian Bancorp Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	—			Merrill Lynch	(5.440)
1.127	Media Gen Inc CVR ^{*,††}	Morgan Stanley	—	(54.468)	Meridian Bancorp Inc	Barclays Bank	(37.583)
(4.591)	MediaAlpha Inc 'A'	Bank of America		(43.676)	Meridian Bancorp Inc	Goldman Sachs	(13.672)
		Merrill Lynch	(20.393)	(1.869)	Meridian Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.290)
(2.083)	MediaAlpha Inc 'A'	Goldman Sachs	(10.852)	(2.935)	Meridian Bioscience Inc	Bank of America	
(35.122)	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Bank of America				Merrill Lynch	(4.432)
		Merrill Lynch	(5.620)	(10.222)	Meridian Bioscience Inc	Barclays Bank	(8.178)
13.223	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Bank of America		(4.141)	Meridian Bioscience Inc	Goldman Sachs	(6.253)
		Merrill Lynch	2.116	6.234	Meridian Corp	Bank of America	
(7.777)	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	1.089	15.620	Meridian Corp	Barclays Bank	(156)
18.341	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	(2.568)	800	Meridian Corp	Goldman Sachs	480
(7.367)	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(1.179)	13.804	Meridian Corp	HSBC	14.218
(17.711)	Medical Properties Trust Inc (REIT)	HSBC	5.845	8.803	Meridian Corp	Morgan Stanley	(88)
17.624	Medical Properties Trust Inc (REIT)	HSBC	(5.816)	(3.990)	Merit Medical Systems Inc	Bank of America	
(21.586)	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	3.022	(11.394)	Merit Medical Systems Inc	Merrill Lynch	(3.830)
1.234	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(7)	(1.229)	Merit Medical Systems Inc	Barclays Bank	32.587
13.624	MediciNova Inc	HSBC	3.270	(6.732)	Merit Medical Systems Inc	Goldman Sachs	(1.180)
(2.146)	Medfast Inc	HSBC	(80.282)	4.929	Merit Medical Systems Inc	Morgan Stanley	19.254
(750)	MEDNAX Inc	Bank of America			Meritage Homes Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(188)	8.030	Meritage Homes Corp	Merrill Lynch	(20.653)
(20.994)	MEDNAX Inc	Barclays Bank	(3.359)	8.200	Meritage Homes Corp	Barclays Bank	13.892
567	Medpace Holdings Inc	Bank of America		5.649	Meritage Homes Corp	Goldman Sachs	(34.358)
		Merrill Lynch	(202)	(3.816)	Meritage Homes Corp	HSBC	(59.201)
461	Medpace Holdings Inc	Barclays Bank	(433)	7.291	Meritage Homes Corp	Morgan Stanley	(6.602)
3.549	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs	16.787	(36.487)	Meritor Inc	Morgan Stanley	12.613
(292)	Medpace Holdings Inc	HSBC	(2.406)	8.890	Meritor Inc	Bank of America	
(3.013)	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	2.833	3.893	Meritor Inc	Merrill Lynch	(9.122)
3.959	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.721)	(5.081)	Mersana Therapeutics Inc	Barclays Bank	7.023
(9.143)	Medtronic Plc	Barclays Bank	13.806	(4.069)	Mersana Therapeutics Inc	Goldman Sachs	946
(1.356)	Medtronic Plc	Goldman Sachs	(1.311)	(2.611)	Mersana Therapeutics Inc	Bank of America	(1.016)
(3.611)	Medtronic Plc	Morgan Stanley	5.453	(6.018)	Mersana Therapeutics Inc	Barclays Bank	(122)
(5.978)	MEI Pharma Inc	Bank of America		(7.359)	Mersana Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(522)
		Merrill Lynch	(1.136)	(6.149)	Mesa Air Group Inc	HSBC	3.611
(7.597)	MEI Pharma Inc	Barclays Bank	(684)	(15.002)	Mesa Air Group Inc	Morgan Stanley	(55)
(59.295)	MEI Pharma Inc	Goldman Sachs	(11.266)	3.918	Mesa Laboratories Inc	Barclays Bank	4.981
2.806	MeiraGTx Holdings Plc	Barclays Bank	(393)			Morgan Stanley	12.152
889	MercadoLibre Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	704	1.240	Mesa Laboratories Inc	Merrill Lynch	1.567
860	MercadoLibre Inc	Goldman Sachs	(7.932)	910	Mesa Laboratories Inc	Goldman Sachs	417
173	MercadoLibre Inc	HSBC	(3.399)	(16.681)	Meta Financial Group Inc	HSBC	(2.054)
837	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	(7.248)			Bank of America	
72.156	Mercantile Bank Corp	Bank of America		(12.597)	Meta Financial Group Inc	Merrill Lynch	(47.207)
		Merrill Lynch	(10.102)	(50.484)	Meta Financial Group Inc	Barclays Bank	(24.312)
20.957	Merchants Bancorp	HSBC	16.975	32.456	Metacrine Inc	Morgan Stanley	(97.434)
27.769	Merchants Bancorp	Morgan Stanley	16.106	11.710	Metacrine Inc	Bank of America	
(43.568)	Merck & Co Inc	Bank of America		15.698	Metacrine Inc	Merrill Lynch	15.254
		Merrill Lynch	104.992	4.975	Metacrine Inc	Barclays Bank	586
				10.351	Metacrine Inc	Goldman Sachs	7.378
				9.131	Methode Electronics Inc	HSBC	2.587
						Morgan Stanley	518
						Barclays Bank	9.040

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
29.765	Methode Electronics Inc	Goldman Sachs	38.397	(1.783)	Microsoft Corp	Barclays Bank	1.961
8.143	Methode Electronics Inc	HSBC	19.380	4.981	Microsoft Corp	Barclays Bank	(2.731)
20.145	Methode Electronics Inc	Morgan Stanley	19.944	(11.075)	Microsoft Corp	Goldman Sachs	(49.838)
14.560	MetLife Inc	Bank of America		842	Microsoft Corp	Goldman Sachs	2.364
		Merrill Lynch	(1.095)	4.614	Microsoft Corp	Morgan Stanley	(5.075)
29.193	MetLife Inc	Barclays Bank	2.419	(156)	MicroStrategy Inc 'A'	Bank of America	
11.810	MetLife Inc	Goldman Sachs	(4.015)			Merrill Lynch	3.019
44.025	MetLife Inc	HSBC	(48.868)	(576)	MicroStrategy Inc 'A'	Barclays Bank	1.412
61.068	MetLife Inc	Morgan Stanley	(611)	(37)	MicroStrategy Inc 'A'	Goldman Sachs	716
(30.930)	Metrocity Bankshares Inc	Barclays Bank	(1.856)	8.539	Mid Penn Bancorp Inc	Bank of America	
(23.793)	Metrocity Bankshares Inc	Goldman Sachs	(12.610)			Merrill Lynch	—
(10.537)	Metrocity Bankshares Inc	HSBC	(7.481)	14.154	Mid Penn Bancorp Inc	Barclays Bank	(1.982)
(1.057)	Metropolitan Bank Holding Corp			3.743	Mid Penn Bancorp Inc	Goldman Sachs	—
		Barclays Bank	(465)	7.785	Mid Penn Bancorp Inc	HSBC	2.111
(3.742)	Metropolitan Bank Holding Corp	Goldman Sachs	674	17.763	Mid Penn Bancorp Inc	Morgan Stanley	(2.487)
(1.943)	Metropolitan Bank Holding Corp			(8.772)	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	(30.489)
(1.544)	Metropolitan Bank Holding Corp	HSBC	(2.740)	(6.660)	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	HSBC	(8.791)
100	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	(679)	(18.480)	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	Morgan Stanley	(24.394)
290	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America	4.194	16	Middleby Corp	Bank of America	
1.411	Mettler-Toledo International Inc	Merrill Lynch	1.925	3.972	Middleby Corp	Merrill Lynch	(118)
		Barclays Bank	66.200	(1.228)	Middlefield Banc Corp	Morgan Stanley	5.521
(97.876)	MFA Financial Inc (REIT)	HSBC	(979)	(402)	Middlefield Banc Corp	Bank of America	(381)
		Bank of America	3.891	(2.301)	Middlesex Water Co	Barclays Bank	(125)
(77.825)	MFA Financial Inc (REIT)	Merrill Lynch	(4.658)	(24.288)	Middlesex Water Co	Bank of America	(12.287)
(465.790)	MFA Financial Inc (REIT)	Barclays Bank	(1.255)	22.494	Midland States Bancorp Inc	Morgan Stanley	(123.869)
(2.562)	MGE Energy Inc	Goldman Sachs	9.763	8.713	Midland States Bancorp Inc	Bank of America	(9.672)
(14.572)	MGE Energy Inc	Bank of America	(13.618)	13.156	Midland States Bancorp Inc	Merrill Lynch	2.265
(25.694)	MGE Energy Inc	HSBC	27.753	15.056	Midland States Bancorp Inc	Barclays Bank	(5.657)
(41.423)	MGE Energy Inc	Morgan Stanley	(907)	7.555	Midland States Bancorp Inc	Goldman Sachs	(8.431)
(2.451)	MGIC Investment Corp	Bank of America		400	Midwest Holding Inc	HSBC	1.964
		Merrill Lynch	8.256	1.084	Midwest Holding Inc	Bank of America	(644)
9.713	MGM Growth Properties LLC 'A' (REIT)	Bank of America	(1.253)	974	Midwest Holding Inc	Merrill Lynch	(1.062)
11.393	MGM Growth Properties LLC 'A' (REIT)	Merrill Lynch	8.580	1.012	Midwest Holding Inc	Barclays Bank	(1.568)
10.094	MGM Growth Properties LLC 'A' (REIT)	Barclays Bank	20.550	11.908	MidWestOne Financial Group Inc	Goldman Sachs	(992)
17.125	MGM Growth Properties LLC 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(519)	28.737	MidWestOne Financial Group Inc	Bank of America	(1.786)
4.720	MGM Growth Properties LLC 'A' (REIT)	HSBC	70.475	37.494	MidWestOne Financial Group Inc	Merrill Lynch	(10.058)
17.225	MGM Resorts International	Bank of America	27.082	14.191	MidWestOne Financial Group Inc	Barclays Bank	(5.624)
23.966	MGM Resorts International	Merrill Lynch	13.205	33.239	MidWestOne Financial Group Inc	Goldman Sachs	5.534
3.205	MGM Resorts International	Barclays Bank	1.674	(67.596)	Milestone Scientific Inc	HSBC	(11.634)
491	MGM Resorts International	Goldman Sachs	45.365	(20.990)	Milestone Scientific Inc	Barclays Bank	3.380
51.551	MGM Resorts International	HSBC	(3.271)	(10.406)	Millendo Therapeutics Inc	Goldman Sachs	2.309
(1.565)	MGP Ingredients Inc	Morgan Stanley	(62.736)	(31.808)	Millendo Therapeutics Inc	Bank of America	(1.249)
(10.456)	MGP Ingredients Inc	Goldman Sachs	(1.213)	(39.946)	Millendo Therapeutics Inc	Merrill Lynch	(1.590)
(589)	MGP Ingredients Inc	HSBC	(65.433)	(32.935)	Millendo Therapeutics Inc	Barclays Bank	(4.794)
(5.093)	Microchip Technology Inc	Bank of America	(24.635)	(28.951)	Millendo Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3.623)
		Merrill Lynch	(23.462)	(3.442)	Miller Industries Inc	HSBC	(1.448)
(8.644)	Microchip Technology Inc	Barclays Bank	(90.924)	(25.103)	Miller Industries Inc	Morgan Stanley	
(1.747)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	(63.583)	(21.501)	Miller Industries Inc	Bank of America	1.318
(6.666)	Microchip Technology Inc	HSBC	(578)	(3.096)	Miller Industries Inc	Merrill Lynch	(11.262)
(22.310)	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	1.445	15.254	Mimecast Ltd	Barclays Bank	9.040
(466)	Micron Technology Inc	Barclays Bank	(22.208)	15.739	Mimecast Ltd	Goldman Sachs	(334)
1.165	Micron Technology Inc	HSBC	(16.359)	1.993	MiMedx Group Inc	Morgan Stanley	(2.630)
(6.750)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	(22.469)	3.401	MiMedx Group Inc	Goldman Sachs	(5.521)
(13.193)	Micron Technology Inc	Bank of America	(3.143)	2.574	MiMedx Group Inc	Barclays Bank	1.634
(4.993)	Microsoft Corp	Merrill Lynch				Goldman Sachs	5.136
2.032	Microsoft Corp	Bank of America				HSBC	3.166

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
3.750	MiMedx Group Inc	Morgan Stanley	3.075	2.595	Monarch Casino & Resort Inc	Barclays Bank	(727)
(413)	Minerals Technologies Inc	Barclays Bank	(1.166)	1.849	Monarch Casino & Resort Inc	Goldman Sachs	(92)
(8.422)	Minerals Technologies Inc	HSBC	(43.121)	333	Monarch Casino & Resort Inc	HSBC	103
(34.192)	Minerals Technologies Inc	Morgan Stanley	(76.590)	(9.634)	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10.810)
(34.690)	Minerva Neurosciences Inc	HSBC	(22.895)	(36.704)	Mondelez International Inc 'A'	Barclays Bank	5.505
(9.178)	Minerva Neurosciences Inc	Morgan Stanley	734	(34.327)	Mondelez International Inc 'A'	Goldman Sachs	(36.387)
51.209	Miragen Therapeutics Inc*	Goldman Sachs	(51)	(18.801)	Mondelez International Inc 'A'	HSBC	(25.288)
1.884	Miragen Therapeutics Inc*	Morgan Stanley	—	(14.746)	Mondelez International Inc 'A'	Morgan Stanley	2.212
(331)	Mirati Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.337)	(27.151)	MoneyGram International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61.361)
1.361	Mirati Therapeutics Inc	Barclays Bank	10.031	(8.387)	MoneyGram International Inc	Barclays Bank	(7.968)
(1.676)	Mirati Therapeutics Inc	Barclays Bank	(8.751)	90	MongoDB Inc	Barclays Bank	465
(274)	Mirati Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(726)	(463)	MongoDB Inc	Goldman Sachs	(2.091)
1.041	Mirati Therapeutics Inc	Goldman Sachs	2.281	(18.376)	Monmouth Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(177)
(2.635)	Mirati Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(18.344)	(31.765)	Monmouth Real Estate Investment Corp (REIT)	Barclays Bank	8.577
20.836	Mirum Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(1.250)	(79.746)	Monmouth Real Estate Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(6.278)
2.730	Mirum Pharmaceuticals Inc	HSBC	(3.221)	(6.051)	Monmouth Real Estate Investment Corp (REIT)	HSBC	1.694
3.399	Mirum Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(204)	(56.661)	Monmouth Real Estate Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	15.298
(8.510)	Misonix Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.617	288	Monolithic Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.876
(7.551)	Misonix Inc	HSBC	755	1.033	Monolithic Power Systems Inc	HSBC	21.962
(41.075)	Misonix Inc	Morgan Stanley	32.449	865	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	11.435
3.818	Mission Produce Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.902	(16.029)	Monro Inc	Barclays Bank	12.022
28.782	Mission Produce Inc	Barclays Bank	(9.498)	(5.819)	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18.467)
46.192	Mission Produce Inc	Goldman Sachs	35.106	2.898	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	8.462
14.489	Mission Produce Inc	Morgan Stanley	(4.781)	(24.784)	Monster Beverage Corp	Barclays Bank	(21.003)
35.814	Mistras Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	18.074	Monster Beverage Corp	Barclays Bank	18.797
7.157	Mistras Group Inc	Barclays Bank	573	(13.677)	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs	(38.484)
3.615	Mistras Group Inc	HSBC	1.157	17.712	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs	51.719
37.123	Mistras Group Inc	Morgan Stanley	2.970	(7.348)	Monster Beverage Corp	HSBC	(19.619)
17.608	Mitek Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.037	(33.607)	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	(33.696)
2.460	Mitek Systems Inc	Barclays Bank	(295)	5.966	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	6.205
1.807	Mitek Systems Inc	Goldman Sachs	1.030	16.922	Montauk Renewables Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.276
2.813	Mitek Systems Inc	HSBC	4.641	25.773	Montauk Renewables Inc	Barclays Bank	(2.577)
3.194	Mitek Systems Inc	Morgan Stanley	(383)	19.513	Montauk Renewables Inc	Goldman Sachs	8.391
(4.514)	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	(7.448)	12.389	Montauk Renewables Inc	HSBC	8.177
2.670	Model N Inc	Bank of America Merrill Lynch	274	6.303	Montauk Renewables Inc	Morgan Stanley	(630)
3.563	Model N Inc	Barclays Bank	6.805	(803)	Montrose Environmental Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.780)
867	Model N Inc	Goldman Sachs	818	(2.240)	Montrose Environmental Group Inc	Barclays Bank	(1.203)
2.795	Model N Inc	HSBC	(1.202)	3.521	Moody's Corp	Barclays Bank	12.218
8.693	Model N Inc	Morgan Stanley	16.604	(1.003)	Moody's Corp	Barclays Bank	(3.480)
331	Moderna Inc	Goldman Sachs	9.092	(741)	Moody's Corp	Goldman Sachs	(4.194)
(786)	Moderna Inc	Goldman Sachs	443	2.667	Moody's Corp	Morgan Stanley	9.254
302	Moderna Inc	Morgan Stanley	6.294	(908)	Moody's Corp	Morgan Stanley	(3.151)
4.613	Modine Manufacturing Co	Barclays Bank	2.698	7.958	Moog Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	10.425
40.060	Modine Manufacturing Co	Goldman Sachs	25.238	10.835	Moog Inc 'A'	Barclays Bank	41.715
(6.010)	ModivCare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17.008)	3.279	Moog Inc 'A'	Goldman Sachs	4.295
(775)	ModivCare Inc	Barclays Bank	612	2.525	Moog Inc 'A'	HSBC	3.485
(1.760)	ModivCare Inc	Goldman Sachs	(4.981)				
(453)	ModivCare Inc	Morgan Stanley	358				
3.987	Moelis & Co 'A'	Barclays Bank	2.113				
4.483	Moelis & Co 'A'	HSBC	4.304				
(1.204)	Mohawk Industries Inc	HSBC	19.023				
(3.259)	Mohawk Industries Inc	Morgan Stanley	(7.822)				
(5.994)	Molecular Templates Inc	Barclays Bank	(60)				
(6.051)	Molecular Templates Inc	Goldman Sachs	(3.933)				
(2.483)	Molecular Templates Inc	HSBC	(1.068)				
(6.799)	Molecular Templates Inc	Morgan Stanley	(68)				
(1.474)	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	3.891				
2.667	Molson Coors Beverage Co 'B'	Goldman Sachs	(398)				
9.586	Molson Coors Beverage Co 'B'	HSBC	(11.887)				
25.080	Molson Coors Beverage Co 'B'	Morgan Stanley	11.854				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
17.900	Moog Inc 'A'	Morgan Stanley	68.915	(109)	MSCI Inc	HSBC	955
(171)	Morgan Group Holding Co	Bank of America		(4.735)	MSCI Inc	Morgan Stanley	(20.268)
		Merrill Lynch	74	(65.183)	MSG Networks Inc 'A'	Bank of America	
(47)	Morgan Group Holding Co	Barclays Bank	114			Merrill Lynch	(25.421)
(9)	Morgan Group Holding Co	Goldman Sachs	4	(24.335)	MSG Networks Inc 'A'	Barclays Bank	9.004
(69)	Morgan Group Holding Co	HSBC	82	(13.058)	MSG Networks Inc 'A'	Goldman Sachs	(5.093)
(50)	Morgan Group Holding Co	Morgan Stanley	122	(6.794)	Mueller Industries Inc	Barclays Bank	(68)
2.749	Morgan Stanley	Bank of America		(13.144)	Mueller Industries Inc	Goldman Sachs	7.886
		Merrill Lynch	7.862	(42.189)	Mueller Industries Inc	HSBC	23.626
(2.348)	Morgan Stanley	Bank of America		(60.772)	Mueller Industries Inc	Morgan Stanley	(608)
		Merrill Lynch	(4.600)	(48.544)	Mueller Water Products Inc		
40.309	Morgan Stanley	Barclays Bank	50.789		'A'	HSBC	14.563
(1.411)	Morgan Stanley	Barclays Bank	(1.778)	(61.315)	Mueller Water Products Inc		
10.606	Morgan Stanley	Goldman Sachs	30.333		'A'	Morgan Stanley	(4.292)
33.655	Morgan Stanley	HSBC	150.774	(3.654)	Multiplan Corp	Bank of America	
(2.325)	Morgan Stanley	HSBC	(8.247)			Merrill Lynch	93
3.907	Morningstar Inc	Bank of America		(55.466)	Multiplan Corp	Barclays Bank	(6.983)
		Merrill Lynch	(27.583)	31.696	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs	7.924
1.454	Morningstar Inc	Goldman Sachs	(10.265)	6.591	Murphy Oil Corp	HSBC	6.362
(2.675)	Morphic Holding Inc	Bank of America		504	Murphy USA Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.517)			Merrill Lynch	(4.899)
(3.986)	Morphic Holding Inc	Barclays Bank	(16.861)	(5.969)	Murphy USA Inc	Bank of America	
(3.997)	Morphic Holding Inc	Goldman Sachs	(11.232)			Merrill Lynch	36.866
5.648	Mosaic Co	Morgan Stanley	2.485	(5.466)	Murphy USA Inc	Barclays Bank	3.308
(10.375)	Mosaic Co	Morgan Stanley	(4.565)	1.808	Murphy USA Inc	Barclays Bank	(1.175)
6.586	Motorcar Parts of America Inc	Morgan Stanley	6.784	(2.976)	Murphy USA Inc	Goldman Sachs	16.184
		Bank of America		8.859	Murphy USA Inc	Goldman Sachs	(86.109)
1.814	Motorola Solutions Inc	Bank of America		9.728	Murphy USA Inc	HSBC	(80.840)
		Merrill Lynch	8.453	(1.048)	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	(230)
3.688	Motorola Solutions Inc	Barclays Bank	9.109	36.387	Mustang Bio Inc	Barclays Bank	5.094
3.067	Motorola Solutions Inc	HSBC	15.029	23.540	Mustang Bio Inc	Goldman Sachs	11.535
2.992	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	7.390	11.480	Mustang Bio Inc	HSBC	5.693
(8.962)	Motorsport Games Inc 'A'	Bank of America		5.910	Mustang Bio Inc	Morgan Stanley	827
		Merrill Lynch	19.985	(11.408)	MVB Financial Corp	Goldman Sachs	24.071
(4.792)	Motorsport Games Inc 'A'	Goldman Sachs	10.686	(5.108)	MVB Financial Corp	Morgan Stanley	(8.020)
(5.764)	Movado Group Inc	Morgan Stanley	12.450	(32.667)	Myers Industries Inc	Bank of America	
(3.626)	MP Materials Corp	Barclays Bank	(1.235)			Merrill Lynch	(5.880)
(2.567)	MP Materials Corp	Morgan Stanley	(5.591)	(5.278)	Myers Industries Inc	Goldman Sachs	(950)
(4.245)	Mr Cooper Group Inc	Goldman Sachs	(3.014)	(6.738)	Myers Industries Inc	HSBC	(2.224)
21.303	MRC Global Inc	Bank of America		(17.203)	Myers Industries Inc	Morgan Stanley	(3.957)
		Merrill Lynch	(28.120)	4.557	MYR Group Inc	Bank of America	
4.967	MRC Global Inc	Barclays Bank	(993)			Merrill Lynch	21.053
23.765	MRC Global Inc	Goldman Sachs	(31.370)	8.857	MYR Group Inc	Goldman Sachs	40.919
35.527	MRC Global Inc	HSBC	(28.066)	4.342	MYR Group Inc	Morgan Stanley	14.242
3.110	MRC Global Inc	Morgan Stanley	(622)	3.433	Myriad Genetics Inc	Bank of America	
(579)	MSA Safety Inc	Goldman Sachs	(321)			Merrill Lynch	4.633
443	MSA Safety Inc	HSBC	718	2.716	Myriad Genetics Inc	Barclays Bank	(421)
(198)	MSA Safety Inc	HSBC	(11)	4.336	Myriad Genetics Inc	Goldman Sachs	3.076
1.595	MSA Safety Inc	Morgan Stanley	5.248	738	Myriad Genetics Inc	HSBC	(144)
(612)	MSA Safety Inc	Morgan Stanley	(2.013)	(7.072)	Myriad Genetics Inc	Morgan Stanley	(1.768)
(797)	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Bank of America		8.494	Myriad Genetics Inc	Morgan Stanley	2.124
		Merrill Lynch	805	(5.599)	Nabors Industries Ltd	Barclays Bank	32.530
4.601	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Bank of America		(3.639)	NACCO Industries Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.449			Merrill Lynch	1.638
(22.674)	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Barclays Bank	2.721	(11.948)	NACCO Industries Inc 'A'	Barclays Bank	—
(1.031)	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Goldman Sachs	1.041	2.111	NanoString Technologies Inc	Goldman Sachs	13.278
2.011	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.031)	10.092	NanoString Technologies Inc	Morgan Stanley	47.735
1.065	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	HSBC	(168)	(14.413)	NantHealth Inc	Barclays Bank	(1.874)
(283)	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Morgan Stanley	34	(7.500)	Napco Security Technologies Inc	Bank of America	
2.086	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Morgan Stanley	(250)	(14.349)	Napco Security Technologies Inc	Merrill Lynch	8.325
(330)	MSCI Inc	Bank of America		(9.555)	Napco Security Technologies Inc	Barclays Bank	19.691
		Merrill Lynch	(3.982)	(17.755)	Napco Security Technologies Inc	Goldman Sachs	9.732
(1.196)	MSCI Inc	Barclays Bank	(6.315)	(4.159)	Napco Security Technologies Inc	HSBC	16.157
(222)	MSCI Inc	Goldman Sachs	(2.742)			Morgan Stanley	6.821

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(5.981)	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22.190)	19.398	National Storage Affiliates Trust (REIT)	Barclays Bank	16.100
(6.742)	Nasdaq Inc	Barclays Bank	(15.119)	12.714	National Storage Affiliates Trust (REIT)	Morgan Stanley	10.553
(9.201)	Nasdaq Inc	Goldman Sachs	(34.136)	13.805	National Vision Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.220)
(1.126)	Nasdaq Inc	Morgan Stanley	(2.715)	6.516	National Vision Holdings Inc	Barclays Bank	8.536
(3.014)	Natera Inc	Barclays Bank	(23.268)	24.207	National Vision Holdings Inc	Goldman Sachs	(7.129)
7.088	Natera Inc	Barclays Bank	54.719	10.140	National Vision Holdings Inc	HSBC	(8.142)
(674)	Natera Inc	Goldman Sachs	(1.570)	3.471	National Vision Holdings Inc	Morgan Stanley	4.547
8.227	Natera Inc	Goldman Sachs	23.135	(572)	National Western Life Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5.485
525	Natera Inc	HSBC	1.864	(2.895)	National Western Life Group Inc 'A'	Barclays Bank	5.153
(294)	Natera Inc	Morgan Stanley	(2.270)	(2.628)	National Western Life Group Inc 'A'	Goldman Sachs	6.341
270	Natera Inc	Morgan Stanley	668	(692)	National Western Life Group Inc 'A'	Morgan Stanley	238
2.168	Nathan's Famous Inc	Morgan Stanley	477	687	Natural Gas Services Group Inc	Goldman Sachs	(199)
5.079	National Bank Holdings Corp 'A'	Goldman Sachs	(9.142)	39.208	Natural Gas Services Group Inc	Morgan Stanley	(9.018)
10.583	National Bank Holdings Corp 'A'	HSBC	(14.816)	(18.536)	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.369)
22.005	National Bank Holdings Corp 'A'	Morgan Stanley	(18.484)	(11.553)	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Barclays Bank	(2.708)
(11.221)	National Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.954	(10.562)	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Goldman Sachs	2.723
(13.068)	National Bankshares Inc	Barclays Bank	(3.790)	(8.090)	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Morgan Stanley	(2.346)
(7.061)	National Bankshares Inc	Goldman Sachs	11.298	5.323	Natural Health Trends Corp	Morgan Stanley	(1.065)
(12.807)	National Bankshares Inc	Morgan Stanley	(3.714)	19.911	Nature's Sunshine Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	24.094
(6.574)	National Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29.057)	20.720	Nature's Sunshine Products Inc	Barclays Bank	9.738
(2.697)	National Beverage Corp	Barclays Bank	(10.276)	10.524	Nature's Sunshine Products Inc	Goldman Sachs	10.572
15.063	National CineMedia Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.573	1.012	Nature's Sunshine Products Inc	HSBC	101
26.676	National CineMedia Inc	Barclays Bank	1.654	19.046	Nature's Sunshine Products Inc	Morgan Stanley	7.552
30.368	National CineMedia Inc	Goldman Sachs	11.236	4.246	Natus Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.189)
15.765	National CineMedia Inc	Morgan Stanley	205	38.838	Natus Medical Inc	Goldman Sachs	(10.875)
9.089	National Energy Services Reunited Corp	Goldman Sachs	(7.544)	12.226	Natus Medical Inc	HSBC	(7.336)
20.866	National Energy Services Reunited Corp	Morgan Stanley	(10.224)	3.339	Nautilus Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.536
(11.315)	National Fuel Gas Co	Bank of America Merrill Lynch	2.037	3.967	Nautilus Inc	Morgan Stanley	3.570
(9.511)	National Fuel Gas Co	Barclays Bank	5.421	(20.609)	Navient Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18.239)
(6.144)	National Fuel Gas Co	Goldman Sachs	961	(72.682)	Navient Corp	Barclays Bank	(55.965)
(6.167)	National Fuel Gas Co	HSBC	6.105	(7.505)	Navient Corp	Goldman Sachs	(6.642)
(26.893)	National Fuel Gas Co	Morgan Stanley	15.329	(30.037)	Navient Corp	HSBC	(30.638)
(22.432)	National Health Investors Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	20.638	(23.210)	Navient Corp	Morgan Stanley	(17.872)
(11.483)	National Health Investors Inc (REIT)	Barclays Bank	9.769	21.284	Navigator Holdings Ltd	Barclays Bank	(10.429)
(8.291)	National Health Investors Inc (REIT)	Goldman Sachs	5.703	7.527	Navigator Holdings Ltd	Goldman Sachs	(4.290)
(12.129)	National Health Investors Inc (REIT)	HSBC	54.944	7.820	Navigator Holdings Ltd	HSBC	(6.256)
(25.152)	National Health Investors Inc (REIT)	Morgan Stanley	21.631	(5.907)	Navistar International Corp	Bank of America Merrill Lynch	54
(2.430)	National HealthCare Corp	Barclays Bank	2.114	1.556	Navistar International Corp	Bank of America Merrill Lynch	—
(11.408)	National HealthCare Corp	Goldman Sachs	7.187	(19.312)	Navistar International Corp	Barclays Bank	580
(7.223)	National HealthCare Corp	HSBC	(18.924)	13.859	Navistar International Corp	Barclays Bank	(416)
(6.119)	National HealthCare Corp	Morgan Stanley	5.324	(23.799)	Navistar International Corp	Goldman Sachs	—
44.531	National Instruments Corp	Morgan Stanley	33.398	12.857	Navistar International Corp	Goldman Sachs	(120)
(2.168)	National Presto Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.336	3.376	Navistar International Corp	HSBC	—
(599)	National Presto Industries Inc	Barclays Bank	1.072	(6.523)	Navistar International Corp	Morgan Stanley	196
(3.725)	National Presto Industries Inc	Goldman Sachs	21.195	2.940	Navistar International Corp	Morgan Stanley	(88)
(3.291)	National Presto Industries Inc	Morgan Stanley	5.891	(22.827)	NBT Bancorp Inc	HSBC	(2.283)
8.881	National Research Corp	Morgan Stanley	(17.496)	(17.747)	NBT Bancorp Inc	Morgan Stanley	19.522
(8.340)	National Retail Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	(5.588)				
(9.823)	National Retail Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(12.770)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.979	nCino Inc	Bank of America Merrill Lynch	21.057	(8.953)	Neurocrine Biosciences Inc	Morgan Stanley	(3.671)
1.207	nCino Inc	Goldman Sachs	12.842	(15.125)	Neuronetics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.411)
3.212	NCR Corp	Goldman Sachs	(3.420)	(2.414)	Neuronetics Inc	Barclays Bank	2.245
5.462	NCR Corp	HSBC	(3.769)	937	NeuroPace Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.134
5.215	Neenah Inc	Goldman Sachs	(17.679)	2.621	NeuroPace Inc	Barclays Bank	2.438
9.204	Neenah Inc	Morgan Stanley	(21.629)	2.807	NeuroPace Inc	Goldman Sachs	3.396
(3.186)	Nektar Therapeutics	Bank of America Merrill Lynch	731	2.074	NeuroPace Inc	Morgan Stanley	1.929
4.396	Nektar Therapeutics	Barclays Bank	623	5.799	Nevro Corp	Bank of America Merrill Lynch	37.751
(2.073)	Nektar Therapeutics	Barclays Bank	112	20.448	Nevro Corp	Barclays Bank	23.817
(18.015)	Nektar Therapeutics	Goldman Sachs	2.162	1.649	Nevro Corp	HSBC	(436)
(1.594)	Nektar Therapeutics	HSBC	2.646	5.118	Nevro Corp	Morgan Stanley	820
(7.404)	Nelnet Inc 'A'	HSBC	(2.073)	(2.260)	New Fortress Energy Inc	Morgan Stanley	5.966
(2.715)	Nelnet Inc 'A'	Morgan Stanley	54	16.064	New Jersey Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.088
3.757	Nemauro Medical Inc	Barclays Bank	2.292	73.744	New Jersey Resources Corp	Goldman Sachs	9.587
810	NEOGAMES SA	Bank of America Merrill Lynch	13.349	7.059	New Jersey Resources Corp	HSBC	(5.012)
1.617	NEOGAMES SA	Goldman Sachs	26.648	2.050	New Jersey Resources Corp	Morgan Stanley	(1.169)
5.507	Neogen Corp	Barclays Bank	(2.038)	3.354	New Relic Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.684
2.196	Neogen Corp	Goldman Sachs	2.240	(4.595)	New Relic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.335)
3.505	Neogen Corp	Morgan Stanley	(1.297)	3.253	New Relic Inc	Barclays Bank	3.546
(1.076)	NeoGenomics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.658)	(2.278)	New Relic Inc	Barclays Bank	(2.483)
3.759	NeoGenomics Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.998	1.578	New Relic Inc	Goldman Sachs	6.438
14.508	NeoGenomics Inc	Barclays Bank	27.914	(5.068)	New Relic Inc	Goldman Sachs	(19.681)
(1.162)	NeoGenomics Inc	Barclays Bank	(2.370)	(853)	New Relic Inc	HSBC	(237)
8.908	NeoGenomics Inc	Goldman Sachs	28.298	(55.519)	New Residential Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(7.773)
(922)	NeoGenomics Inc	HSBC	(4.095)	3.797	New Residential Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	532
24.146	NeoGenomics Inc	Morgan Stanley	34.385	(24.940)	New Residential Investment Corp (REIT)	HSBC	(4.988)
(6.324)	Neoleukin Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.375	16.592	New Residential Investment Corp (REIT)	HSBC	4.335
(7.958)	Neoleukin Therapeutics Inc	Barclays Bank	716	(54.330)	New Residential Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(12.496)
(11.281)	Neoleukin Therapeutics Inc	Goldman Sachs	6.159	(65.602)	New Senior Investment Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	10.496
(3.007)	Neoleukin Therapeutics Inc	HSBC	2.135	(42.667)	New Senior Investment Group Inc (REIT)	HSBC	3.413
(2.605)	Neoleukin Therapeutics Inc	Morgan Stanley	234	(26.700)	New Senior Investment Group Inc (REIT)	Morgan Stanley	4.539
(10.219)	NeoPhotonics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.095)	60.837	New York Community Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.427
(15.091)	NeoPhotonics Corp	Barclays Bank	604	145.606	New York Community Bancorp Inc	Barclays Bank	19.989
(13.340)	NeoPhotonics Corp	Goldman Sachs	(6.272)	67.000	New York Community Bancorp Inc	Goldman Sachs	(8.710)
(12.485)	NeoPhotonics Corp	HSBC	(13.359)	3.996	New York Community Bancorp Inc	HSBC	839
(32.318)	NeoPhotonics Corp	Morgan Stanley	1.293	218.628	New York Community Bancorp Inc	Morgan Stanley	32.299
(10.008)	NetApp Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.709	(122.463)	New York Mortgage Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(7.348)
(10.789)	NetApp Inc	Barclays Bank	17.478	(101.001)	New York Mortgage Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	(1.010)
(12.929)	NetApp Inc	Goldman Sachs	13.834	(131.605)	New York Mortgage Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(1.316)
19.212	NetApp Inc	Morgan Stanley	(31.123)	(1.249)	New York Times Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(287)
(4.669)	NetApp Inc	Morgan Stanley	7.564	3.348	New York Times Co 'A'	Barclays Bank	1.540
(149)	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.067)	(3.324)	New York Times Co 'A'	Barclays Bank	887
(2.210)	Netflix Inc	Barclays Bank	199	(3.400)	New York Times Co 'A'	Goldman Sachs	(782)
(2.338)	Netflix Inc	Goldman Sachs	(33.830)	4.528	New York Times Co 'A'	HSBC	(8.739)
(751)	Netflix Inc	HSBC	(12.106)				
(1.340)	Netflix Inc	Morgan Stanley	121				
5.035	NETGEAR Inc	Goldman Sachs	7.250				
7.181	NETGEAR Inc	Morgan Stanley	6.822				
(4.138)	NetScout Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.704)				
(715)	NetScout Systems Inc	Barclays Bank	(1.051)				
(15.683)	NetScout Systems Inc	Goldman Sachs	(25.406)				
(25.950)	NetScout Systems Inc	HSBC	(71.103)				
(14.832)	NetScout Systems Inc	Morgan Stanley	(21.803)				
(3.971)	NETSTREIT Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(3.653)				
(25.165)	NETSTREIT Corp (REIT)	Goldman Sachs	(23.152)				
(37.849)	NeuBase Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.327)				
(14.766)	NeuBase Therapeutics Inc	Barclays Bank	(2.363)				
(1.280)	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs	(4.019)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.653)	New York Times Co 'A'	HSBC	3.190	11.120	NI Holdings Inc	Barclays Bank	(3.336)
14.352	New York Times Co 'A'	Morgan Stanley	6.602	17.241	NI Holdings Inc	Goldman Sachs	(7.069)
(3.116)	New York Times Co 'A'	Morgan Stanley	(1.433)	16.681	NI Holdings Inc	HSBC	6.506
8.757	NewAge Inc	Barclays Bank	1.138	6.252	NI Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.876)
13.236	NewAge Inc	Goldman Sachs	3.971	19.538	Nicholas Financial Inc	Bank of America	
7.732	NewAge Inc	HSBC	3.093			Merrill Lynch	2.931
13.125	NewAge Inc	Morgan Stanley	1.706	(4.589)	Nicolet Bankshares Inc	HSBC	1.010
(4.654)	Newell Brands Inc	HSBC	2.699	(1.858)	Nicolet Bankshares Inc	Morgan Stanley	(1.301)
(14.944)	Newell Brands Inc	Morgan Stanley	(6.575)	(6.618)	Nielsen Holdings Plc	Bank of America	
54.532	Newmark Group Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	417
		Merrill Lynch	(16.905)	(11.120)	Nielsen Holdings Plc	HSBC	9.674
21.096	Newmark Group Inc 'A'	Barclays Bank	(1.055)	(16.219)	Nielsen Holdings Plc	Morgan Stanley	2.863
40.818	Newmark Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(12.654)	618	NIKE Inc 'B'	Bank of America	
17.302	Newmark Group Inc 'A'	HSBC	3.114			Merrill Lynch	2.237
5.307	Newmark Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(265)	6.543	NIKE Inc 'B'	Barclays Bank	15.652
270	NewMarket Corp	Barclays Bank	502	642	NIKE Inc 'B'	Goldman Sachs	32
62	NewMarket Corp	Goldman Sachs	(707)	2.167	NIKE Inc 'B'	HSBC	130
1.027	NewMarket Corp	HSBC	(7.939)	5.320	NiSource Inc	Barclays Bank	(319)
458	NewMarket Corp	Morgan Stanley	852	(3.686)	NiSource Inc	Morgan Stanley	221
(1.070)	NewMarket Corp	Morgan Stanley	(1.990)	657	Nkarta Inc	Bank of America	
26.790	Newmont Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(2.727)
		Merrill Lynch	(8.645)	2.212	Nkarta Inc	Barclays Bank	(3.849)
12.165	Newmont Corp	Barclays Bank	(4.445)	3.349	Nkarta Inc	Goldman Sachs	(8.737)
7.917	Newmont Corp	Goldman Sachs	(2.336)	681	Nkarta Inc	HSBC	(650)
30.440	Newpark Resources Inc	Bank of America		(39.035)	NL Industries Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.306)	(2.310)	NL Industries Inc	Merrill Lynch	15.614
14.792	Newpark Resources Inc	Barclays Bank	—	(21.055)	NL Industries Inc	Barclays Bank	832
37.884	Newpark Resources Inc	HSBC	758	(3.077)	nLight Inc	Goldman Sachs	8.422
(37.732)	News Corp 'A'	Barclays Bank	(2.743)	(4.514)	nLight Inc	Bank of America	
(3.297)	News Corp 'A'	Goldman Sachs	(793)	(432)	nLight Inc	Merrill Lynch	(6.277)
(86.428)	News Corp 'A'	Morgan Stanley	(13.119)	(9.503)	NMI Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(7.584)
(36.718)	News Corp 'B'	Morgan Stanley	(3.672)	(6.817)	NMI Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(881)
1.044	NexImmune Inc	Bank of America		(10.194)	NMI Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(4.942)
		Merrill Lynch	626	(22.692)	NN Inc	Goldman Sachs	(3.886)
968	NexImmune Inc	Barclays Bank	(407)			Morgan Stanley	(5.301)
3.020	NexImmune Inc	HSBC	91	(26.938)	NN Inc	Bank of America	
1.296	NexImmune Inc	Morgan Stanley	(544)	(12.015)	NN Inc	Merrill Lynch	9.758
16.010	NexPoint Residential Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	7.205	(8.618)	NN Inc	Barclays Bank	14.277
(3.989)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America		(14.139)	NN Inc	Goldman Sachs	5.166
		Merrill Lynch	3.033	(30.695)	Noodles & Co	HSBC	(259)
1.962	Nexstar Media Group Inc 'A'	Goldman Sachs	4.816	(7.050)	Noodles & Co	Morgan Stanley	7.494
(1.029)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(29)	(18.533)	Noodles & Co	Barclays Bank	(11.357)
494	Nexstar Media Group Inc 'A'	HSBC	1.907	16.980	Nordic American Tankers Ltd	Goldman Sachs	(7.614)
(1.116)	Nexstar Media Group Inc 'A'	HSBC	(903)			Morgan Stanley	(6.857)
6.314	Nexstar Media Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.556)	52.796	Nordic American Tankers Ltd	HSBC	2.038
8.713	NextCure Inc	Bank of America		1.724	Nordson Corp	Morgan Stanley	(4.752)
		Merrill Lynch	(1.394)	(1.585)	Nordson Corp	Bank of America	
16.172	NextCure Inc	Barclays Bank	(8.086)	(4.724)	Nordson Corp	Bank of America	
4.804	NextCure Inc	Goldman Sachs	(769)	11.381	Nordstrom Inc	Merrill Lynch	30.515
15.562	NextCure Inc	HSBC	1.712			HSBC	(20.621)
32.282	NextDecade Corp	Morgan Stanley	646	7.390	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	(90.795)
(4.559)	NextEra Energy Inc	Bank of America		10.641	Nordstrom Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.018)	3.725	Nordstrom Inc	Bank of America	
(256)	NextEra Energy Inc	Barclays Bank	207	3.290	Nordstrom Inc	Merrill Lynch	(28.102)
(17.193)	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs	(8.872)	(1.078)	Norfolk Southern Corp	Barclays Bank	(29.634)
(2.496)	NextEra Energy Inc	Morgan Stanley	2.022	(6.002)	Northeast Bank	Goldman Sachs	(101.834)
1.411	NextGen Healthcare Inc	Barclays Bank	(2.497)			HSBC	(16.568)
19.532	NextGen Healthcare Inc	Goldman Sachs	(38.087)			Morgan Stanley	(13.193)
19.549	NextGen Healthcare Inc	HSBC	(32.451)			Morgan Stanley	(453)
(68.020)	NexTier Oilfield Solutions Inc	Bank of America		(4.984)	Northeast Bank	Bank of America	
		Merrill Lynch	36.731	(1.549)	Northern Oil and Gas Inc	Merrill Lynch	(2.761)
(50.644)	NexTier Oilfield Solutions Inc	Goldman Sachs	27.348	(3.344)	Northern Oil and Gas Inc	HSBC	(9.220)
(19.021)	NGM Biopharmaceuticals Inc	Barclays Bank	7.779	(7.008)	Northern Oil and Gas Inc	Bank of America	
(1.393)	NGM Biopharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	557	364	Northern Technologies International Corp	Barclays Bank	(2.246)
8.897	NI Holdings Inc	Bank of America		1.976	Northern Technologies International Corp	Goldman Sachs	(1.973)
		Merrill Lynch	(3.648)			Goldman Sachs	(10.162)
						Merrill Lynch	(80)
						Goldman Sachs	(435)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
7.337	Northern Technologies International Corp	Morgan Stanley	(3.815)	(11.608)	NRG Energy Inc	HSBC	38.423
1.965	Northern Trust Corp	Barclays Bank	1.041	(44.364)	NRG Energy Inc	Morgan Stanley	71.426
568	Northern Trust Corp	Goldman Sachs	324	4.253	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Bank of America	
(700)	Northern Trust Corp	Morgan Stanley	(371)			Merrill Lynch	1.395
(143.894)	Northfield Bancorp Inc	Bank of America		5.737	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Barclays Bank	(2.123)
		Merrill Lynch	28.779	2.311	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	1.156
(12.257)	Northfield Bancorp Inc	Goldman Sachs	2.451	(3.791)	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	HSBC	(3.981)
(13.691)	Northfield Bancorp Inc	Morgan Stanley	—	1.093	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	HSBC	1.148
25.641	Northrim BanCorp Inc	Barclays Bank	(18.974)	(2.604)	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	963
16.932	Northrim BanCorp Inc	Goldman Sachs	(36.573)	8.795	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.254)
8.995	Northrim BanCorp Inc	HSBC	(180)	(4.536)	Nucor Corp	Bank of America	
(18.836)	Northwest Natural Holding Co					Merrill Lynch	(484)
		Barclays Bank	1.643	(4.839)	Nucor Corp	Barclays Bank	(5.757)
2.012	Northwest Natural Holding Co			(7.539)	Nucor Corp	Goldman Sachs	(12.006)
		Morgan Stanley	(1.207)	(43.331)	Nucor Corp	Morgan Stanley	35.532
(6.133)	Northwest Pipe Co	Bank of America		(3.169)	Nurix Therapeutics Inc	Barclays Bank	(11.694)
		Merrill Lynch	1.901	(5.889)	Nurix Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(12.190)
(17.458)	Northwest Pipe Co	Barclays Bank	32.996	(8.111)	Nutanix Inc 'A'	Bank of America	
(18.196)	Northwest Pipe Co	Goldman Sachs	5.641			Merrill Lynch	615
(3.380)	Northwest Pipe Co	HSBC	101	(5.322)	Nutanix Inc 'A'	Barclays Bank	2.322
(4.150)	Northwest Pipe Co	Morgan Stanley	7.844	4.578	Nutanix Inc 'A'	Goldman Sachs	8.515
10.314	NorthWestern Corp	Bank of America		(20.103)	Nutanix Inc 'A'	Goldman Sachs	(16.294)
		Merrill Lynch	(4.676)	9.317	Nutanix Inc 'A'	Morgan Stanley	4.938
14.772	NorthWestern Corp	Barclays Bank	(6.073)	(2.202)	Nutanix Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.167)
7.915	NorthWestern Corp	Goldman Sachs	(5.145)	(61)	NuVasive Inc	Bank of America	
24.183	NorthWestern Corp	HSBC	(98.744)			Merrill Lynch	133
70.759	NorthWestern Corp	Morgan Stanley	(23.636)	(2.556)	NuVasive Inc	Barclays Bank	5.240
(4.236)	NortonLifeLock Inc	Bank of America		(5.522)	NuVasive Inc	Morgan Stanley	11.320
		Merrill Lynch	(4.282)	(1.064)	NV5 Global Inc	Barclays Bank	(1.181)
(23.992)	NortonLifeLock Inc	Barclays Bank	(3.839)	(4.057)	NV5 Global Inc	Goldman Sachs	(14.321)
(73.592)	NortonLifeLock Inc	Goldman Sachs	(106.500)	(4.296)	NV5 Global Inc	HSBC	(26.979)
(33.937)	NortonLifeLock Inc	HSBC	(30.990)	(6.664)	NV5 Global Inc	Morgan Stanley	(7.397)
(11.075)	NortonLifeLock Inc	Morgan Stanley	(1.772)	(1.318)	NVE Corp	Bank of America	
(23.190)	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd					Merrill Lynch	3.229
		Barclays Bank	(42.902)	(13.725)	NVE Corp	Barclays Bank	5.078
(2.497)	Norwood Financial Corp	Bank of America		(8.143)	NVE Corp	Goldman Sachs	19.950
		Merrill Lynch	(474)	(1.851)	NVE Corp	HSBC	11.291
(2.074)	Norwood Financial Corp	Barclays Bank	—	(452)	NVE Corp	Morgan Stanley	167
(2.575)	Norwood Financial Corp	Goldman Sachs	(489)	(22.899)	nVent Electric Plc	Barclays Bank	(15.342)
(1.696)	Norwood Financial Corp	HSBC	339	(12.492)	nVent Electric Plc	Goldman Sachs	(7.245)
(2.825)	Norwood Financial Corp	Morgan Stanley	—	(2.221)	nVent Electric Plc	HSBC	(1.288)
(6.588)	NOV Inc	Barclays Bank	1.120	(9.688)	nVent Electric Plc	Morgan Stanley	(6.491)
(4.074)	NOV Inc	Goldman Sachs	7.455	(1.823)	NVIDIA Corp	Bank of America	
(10.028)	NOV Inc	Morgan Stanley	1.705			Merrill Lynch	(151.601)
52.529	Novagold Resources Inc	Barclays Bank	1.576	(742)	NVIDIA Corp	Barclays Bank	(18.773)
15.190	Novagold Resources Inc	Goldman Sachs	(304)	(738)	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	(61.372)
27.414	Novagold Resources Inc	HSBC	25.769	974	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	303
31.221	Novagold Resources Inc	Morgan Stanley	937	(1.073)	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	(20.237)
(1.033)	Novanta Inc	Bank of America		(19)	NVR Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.399)	(55)	NVR Inc	Merrill Lynch	(533)
(2.473)	Novanta Inc	Barclays Bank	(4.748)	(17)	NVR Inc	Goldman Sachs	(2.506)
(748)	Novanta Inc	Goldman Sachs	(2.461)	(521)	NVR Inc	HSBC	(938)
(6.339)	Novanta Inc	Morgan Stanley	(12.171)	(4.384)	NXP Semiconductors NV	Morgan Stanley	(118.756)
599	Novavax Inc	Barclays Bank	1.018			Bank of America	
226	Novavax Inc	Goldman Sachs	1.686	(14.710)	NXP Semiconductors NV	Merrill Lynch	(41.839)
100	Novavax Inc	HSBC	(1.288)	(920)	NXP Semiconductors NV	Barclays Bank	(103.558)
114	Novavax Inc	Morgan Stanley	194	23.651	Nymox Pharmaceutical Corp	Morgan Stanley	(2.814)
(3.416)	Novocure Ltd	Barclays Bank	(64.084)			Bank of America	
(757)	Novocure Ltd	Goldman Sachs	(21.953)	21.901	Nymox Pharmaceutical Corp	Merrill Lynch	(5.440)
(2.817)	Novocure Ltd	HSBC	(61.946)			Goldman Sachs	(5.037)
(1.775)	Novocure Ltd	Morgan Stanley	(33.299)	50.506	Nymox Pharmaceutical Corp		
2.488	Novocure Ltd	Morgan Stanley	46.675			Morgan Stanley	—
29.490	NOW Inc	Bank of America		1.509	Oak Street Health Inc	Barclays Bank	(3.259)
		Merrill Lynch	(31.554)	950	Oak Street Health Inc	Goldman Sachs	2.736
22.454	NOW Inc	Barclays Bank	(1.572)	1.060	Oak Street Health Inc	Morgan Stanley	(2.290)
4.874	NOW Inc	Goldman Sachs	(5.215)	3.294	Oak Valley Bancorp	Bank of America	
8.062	NOW Inc	HSBC	(7.014)			Merrill Lynch	3.854
9.079	NOW Inc	Morgan Stanley	(636)	6.482	Oak Valley Bancorp	Barclays Bank	5.510
(17.467)	NRG Energy Inc	Barclays Bank	28.122	10.299	Oak Valley Bancorp	Goldman Sachs	12.050

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
8.159	Oak Valley Bancorp	HSBC	13.626	(33.482)	Old National Bancorp	Goldman Sachs	18.750
7.856	Oak Valley Bancorp	Morgan Stanley	6.678	(22.377)	Old National Bancorp	HSBC	4.028
1.842	Occidental Petroleum Corp	Bank of America		(125.740)	Old National Bancorp	Morgan Stanley	16.346
		Merrill Lynch	(792)	(13.637)	Old Republic International Corp	Bank of America	
(642)	Occidental Petroleum Corp	Bank of America			Old Republic International Corp	Merrill Lynch	(64)
		Merrill Lynch	263	(151.986)	Old Republic International Corp	Barclays Bank	22.798
998	Occidental Petroleum Corp	Bank of America		(17.344)	Old Republic International Corp	Goldman Sachs	(1.134)
		Merrill Lynch	(409)	(11.340)	Old Republic International Corp	HSBC	(2.608)
4.386	Occidental Petroleum Corp	Barclays Bank	2.281	(79.015)	Old Republic International Corp		
2.799	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs	2.914	16.733	Old Second Bancorp Inc	Morgan Stanley	7.326
(3.362)	Occidental Petroleum Corp	HSBC	1.849	887	Olema Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	557
2.916	Occidental Petroleum Corp	HSBC	(1.604)			Bank of America	
(1.729)	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	(692)	2.140	Olema Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	3.575
2.769	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	1.440	7.507	Olema Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	8.624
644	Ocean Bio-Chem Inc	Bank of America		(1.106)	Olin Corp	Morgan Stanley	20.494
		Merrill Lynch	811	(13.084)	Olin Corp	Barclays Bank	(1.261)
1.466	Ocean Bio-Chem Inc	Barclays Bank	1.393	(964)	Olin Corp	HSBC	(44.093)
12.690	Oceaneering International Inc	Goldman Sachs	(12.309)	6.824	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.099)
38.233	Oceaneering International Inc	Morgan Stanley	(3.059)	484	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Bank of America	59.883
27.825	OceanFirst Financial Corp	Barclays Bank	835	4.423	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Merrill Lynch	
47.671	OceanFirst Financial Corp	HSBC	(4.767)	(4.907)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Goldman Sachs	28.288
68.713	OceanFirst Financial Corp	Morgan Stanley	2.061	707	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(45.292)
(2.874)	Ocular Therapeutix Inc	Bank of America		4.226	Olympic Steel Inc	Morgan Stanley	5.009
		Merrill Lynch	(746)	5.695	Olympic Steel Inc	Bank of America	
(669)	Ocular Therapeutix Inc	Goldman Sachs	(328)	9.614	Olympic Steel Inc	Merrill Lynch	11.960
(19.987)	Ocular Therapeutix Inc	Morgan Stanley	(10.793)	5.620	Olympic Steel Inc	Goldman Sachs	27.208
1.786	Ocwen Financial Corp	Bank of America		12.071	Olympic Steel Inc	HSBC	4.215
		Merrill Lynch	536	342	Omega Flex Inc	Morgan Stanley	24.021
4.508	Ocwen Financial Corp	Barclays Bank	(5.455)	2.045	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	Morgan Stanley	(1.036)
3.363	Ocwen Financial Corp	Goldman Sachs	1.009	6.871	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	Bank of America	1.288
832	Ocwen Financial Corp	HSBC	1.681	1.136	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	Merrill Lynch	
5.496	Odonate Therapeutics Inc	Bank of America		(13.626)	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	Barclays Bank	275
		Merrill Lynch	1.704	18.474	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	Goldman Sachs	956
6.022	Odonate Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.927	20.566)	Omeros Corp	Morgan Stanley	739
7.778	Odonate Therapeutics Inc	Goldman Sachs	2.411	(20.566)	Omicell Inc	Barclays Bank	(737)
(9.043)	ODP Corp	Barclays Bank	(15.554)	16.137	Omicell Inc	Barclays Bank	31.471
(697)	ODP Corp	Morgan Stanley	(293)	3.297	Omicell Inc	Morgan Stanley	6.429
(7.784)	Office Properties Income Trust (REIT)	HSBC	(13.544)	(4.062)	Omicell Inc	Morgan Stanley	(7.921)
(26.121)	Office Properties Income Trust (REIT)	Morgan Stanley	(10.187)	6.229	Omnicom Group Inc	Barclays Bank	(5.980)
6.477	OGE Energy Corp	Goldman Sachs	4.599	6.507	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs	(5.661)
99.621	OGE Energy Corp	Morgan Stanley	58.776	13.795	Omnicom Group Inc	HSBC	(35.315)
(5.497)	Ohio Valley Banc Corp	Bank of America		7.013	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	(6.732)
		Merrill Lynch	1.429	(29.916)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(19.681)
(15.152)	Ohio Valley Banc Corp	Morgan Stanley	(7.879)	(32.664)	Oncocyte Corp	Morgan Stanley	(2.286)
(3.167)	O-I Glass Inc	HSBC	(602)	216	Oncorus Inc	Bank of America	
(64.768)	O-I Glass Inc	Morgan Stanley	(25.260)			Merrill Lynch	488
24.150	Oil States International Inc	Goldman Sachs	(9.419)	9.268	Oncorus Inc	Barclays Bank	8.805
20.759	Oil States International Inc	HSBC	(623)	11.874	Oncorus Inc	Goldman Sachs	26.835
37.405	Oil States International Inc	Morgan Stanley	748	3.206	Oncorus Inc	Morgan Stanley	3.046
(1.289)	Oil-Dri Corp of America	Barclays Bank	219	5.848	Oncternal Therapeutics Inc	Bank of America	
(8.490)	Oil-Dri Corp of America	Goldman Sachs	(5.603)			Merrill Lynch	2.281
(1.475)	Oil-Dri Corp of America	HSBC	(369)	3.627	Oncternal Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.705
(3.355)	Oil-Dri Corp of America	Morgan Stanley	570	3.484	Oncternal Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1.359
5.662	Okta Inc	Bank of America		7.969	Oncternal Therapeutics Inc	HSBC	3.388
		Merrill Lynch	(64.074)	(2.174)	Ondas Holdings Inc	Bank of America	
781	Okta Inc	Barclays Bank	(2.969)			Merrill Lynch	(3.739)
638	Okta Inc	Goldman Sachs	(3.824)				
787	Okta Inc	HSBC	(943)				
988	Okta Inc	Morgan Stanley	(12.710)				
1.009	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(4.823)				
182	Old Dominion Freight Line Inc	Barclays Bank	138				
8.511	Old Dominion Freight Line Inc						
(8.699)	Old National Bancorp	Morgan Stanley	12.193				
		Barclays Bank	(603)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(31.644)	Ondas Holdings Inc	Barclays Bank	(49.681)	(9.536)	Oracle Corp	Barclays Bank	6.103
7.592	ONE Gas Inc	Goldman Sachs	911	6.113	Oracle Corp	Barclays Bank	(3.912)
6.182	ONE Group Hospitality Inc	Bank of America		(4.159)	Oracle Corp	Goldman Sachs	1.414
		Merrill Lynch	(2.658)	9.490	Oracle Corp	Goldman Sachs	(3.227)
2.843	ONE Group Hospitality Inc	Goldman Sachs	(1.222)	(11.585)	Oracle Corp	HSBC	16.335
620	ONE Group Hospitality Inc	HSBC	893	(34.272)	Oracle Corp	Morgan Stanley	21.189
11.602	ONE Group Hospitality Inc	Morgan Stanley	3.945	28.015	OraSure Technologies Inc	Bank of America	
10.545	One Liberty Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	5.589	9.794	OraSure Technologies Inc	Merrill Lynch	4.763
5.541	OneMain Holdings Inc	Bank of America		33.563	OraSure Technologies Inc	Barclays Bank	196
		Merrill Lynch	18.106	4.856	OraSure Technologies Inc	Goldman Sachs	5.706
566	OneMain Holdings Inc	Barclays Bank	1.517	11.072	OraSure Technologies Inc	HSBC	(583)
4.948	OneMain Holdings Inc	Goldman Sachs	15.834	(19.579)	OraSure Technologies Inc	Morgan Stanley	7
10.759	OneMain Holdings Inc	HSBC	21.410	(24.163)	Orbital Energy Group Inc	Barclays Bank	(8.223)
5.232	OneMain Holdings Inc	Morgan Stanley	3.486	(133.549)	Orchid Island Capital Inc (REIT)	Barclays Bank	3.141
(2.864)	ONEOK Inc	Bank of America		(7.716)	Orchid Island Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	5.342
(944)	ONEOK Inc	Merrill Lynch	6.501	(41.453)	Orchid Island Capital Inc (REIT)	HSBC	(77)
(7.855)	ONEOK Inc	Barclays Bank	1.322	211	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	5.389
(2.354)	ONEOK Inc	Goldman Sachs	17.831	(395)	O'Reilly Automotive Inc	Barclays Bank	(371)
(3.731)	ONEOK Inc	HSBC	2.872	(965)	O'Reilly Automotive Inc	Barclays Bank	574
9.455	ONEOK Inc	Morgan Stanley	5.223	(5.114)	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs	9.146
(19.882)	OneSpan Inc	Morgan Stanley	(13.237)	1.484	Organogenesis Holdings Inc	Morgan Stanley	7.394
(4.406)	OneSpan Inc	Goldman Sachs	(25.548)	7.897	Organogenesis Holdings Inc	Bank of America	
(19.890)	OneSpan Inc	HSBC	(6.212)	3.603	Organogenesis Holdings Inc	Merrill Lynch	2.087
(4.721)	OneSpaWorld Holdings Ltd	Morgan Stanley	(8.354)	3.306	Organogenesis Holdings Inc	Goldman Sachs	6.318
(14.457)	OneSpaWorld Holdings Ltd	Barclays Bank	(1.652)	7.897	Organogenesis Holdings Inc	Morgan Stanley	2.198
(7.141)	OneSpaWorld Holdings Ltd	Goldman Sachs	(3.759)	1.861	Orgenesis Inc	Bank of America	
(3.959)	OneSpaWorld Holdings Ltd	HSBC	(5.713)	(21.634)	Orgenesis Inc	Merrill Lynch	(99)
(1.168)	OneWater Marine Inc 'A'	Morgan Stanley	(787)	(27.530)	Origenesis Inc	Barclays Bank	—
		Bank of America		6.913	Orgenesis Inc	Goldman Sachs	(211)
(7.387)	OneWater Marine Inc 'A'	Merrill Lynch	2.044	1.138	ORIC Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	—
(606)	OneWater Marine Inc 'A'	Barclays Bank	(7.134)	1.861	ORIC Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	216
(14.264)	Onto Innovation Inc	Morgan Stanley	(600)	(21.634)	Origin Bancorp Inc	Goldman Sachs	(4.001)
(7.438)	Ontrak Inc	Barclays Bank	(5.207)	(27.530)	Orion Energy Systems Inc	Morgan Stanley	(2.812)
26.528	Ooma Inc	Bank of America		(28.014)	Orion Energy Systems Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	86.216	(4.857)	Orion Energy Systems Inc	Merrill Lynch	(15.692)
17.763	Ooma Inc	Goldman Sachs	57.730	(22.172)	Orion Energy Systems Inc	Barclays Bank	(10.645)
2.363	Ooma Inc	HSBC	7.892	(51.954)	Orion Energy Systems Inc	HSBC	(4.080)
1.148	Ooma Inc	Morgan Stanley	3.880	(2.061)	Orion Engineered Carbons SA	Morgan Stanley	(8.425)
10.568	OP Bancorp	Bank of America		(537)	Ormat Technologies Inc	Barclays Bank	6.234
		Merrill Lynch	(4.610)	(1.018)	Ormat Technologies Inc	Bank of America	
23.439	OP Bancorp	Goldman Sachs	(11.720)	3.236	Ormat Technologies Inc	Merrill Lynch	(7.646)
1.350	OP Bancorp	HSBC	(1.134)	2.859	Ormat Technologies Inc	Barclays Bank	134
26.830	OP Bancorp	Morgan Stanley	(6.439)	(2.157)	Ormat Technologies Inc	Goldman Sachs	(1.603)
(1.782)	Open Lending Corp 'A'	Morgan Stanley	(3.350)	4.262	Ormat Technologies Inc	Goldman Sachs	12.006
9.084	Open Lending Corp 'A'	Morgan Stanley	17.078	23.587	Orrstown Financial Services Inc	HSBC	8.348
(45.387)	Opendoor Technologies Inc	Barclays Bank	(24.386)	1.767	Orrstown Financial Services Inc	Morgan Stanley	539
11.606	OPKO Health Inc	Bank of America		21.494	Orrstown Financial Services Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(492)	1.417	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Bank of America	(1.151)
6.120	OPKO Health Inc	Goldman Sachs	1.285	(2.931)	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Merrill Lynch	113
4.646	OPKO Health Inc	HSBC	42	4.722	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Bank of America	(882)
64.147	OPKO Health Inc	Morgan Stanley	3.849	(5.434)	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Merrill Lynch	(882)
14.702	Oportun Financial Corp	Goldman Sachs	(12.938)		Orstow Financial Services Inc	Barclays Bank	(6.021)
9.770	Oportun Financial Corp	HSBC	(18.758)		Orstow Financial Services Inc	Goldman Sachs	(6.368)
876	Oportun Financial Corp	Morgan Stanley	(1.498)		Orstow Financial Services Inc	HSBC	1.043
(8.698)	Oppenheimer Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(6.437)		Orstow Financial Services Inc	Morgan Stanley	(11.177)
(3.004)	OptimizeRx Corp	Bank of America			Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(16.252)		Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Merrill Lynch	
(2.089)	OptimizeRx Corp	Barclays Bank	(480)		Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Bank of America	
(1.868)	OptimizeRx Corp	Goldman Sachs	(10.106)		Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Merrill Lynch	
(17.093)	OptimizeRx Corp	Morgan Stanley	(3.931)		Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Bank of America	
34.703	Optinose Inc	Bank of America			Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Merrill Lynch	
		Merrill Lynch	347		Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Barclays Bank	
27.036	Optinose Inc	Goldman Sachs	270		Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Barclays Bank	
21.787	Optinose Inc	HSBC	5.229		Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Barclays Bank	
12.313	Option Care Health Inc	Morgan Stanley	(6.403)		Oracle Corp	Bank of America	
(6.822)	Oracle Corp	Bank of America			Oracle Corp	Merrill Lynch	
		Merrill Lynch	1.348				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(13.756)	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Goldman Sachs	(2.291)	3.216	Overstock.com Inc	Morgan Stanley	14.472
(7.064)	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	HSBC	507	(11.490)	Ovid therapeutics Inc	Barclays Bank	(3.217)
18.001	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Morgan Stanley	8.820	(43.277)	Ovid therapeutics Inc	Goldman Sachs	(20.773)
(3.386)	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Morgan Stanley	(1.457)	(4.076)	Ovid therapeutics Inc	HSBC	(3.179)
13.011	Orthofix Medical Inc	Bank of America		1.209	Ovintiv Inc	Bank of America	
13.928	Orthofix Medical Inc	Merrill Lynch	(5.649)	20.581	Ovintiv Inc	Merrill Lynch	(19)
2.837	Orthofix Medical Inc	Barclays Bank	(15.460)	9.790	Ovintiv Inc	Barclays Bank	12.321
(5.041)	OrthoPediatics Corp	Morgan Stanley	(353)	10.305	Ovintiv Inc	Goldman Sachs	(455)
(545)	OrthoPediatics Corp	Bank of America	(11.594)	18.625	Ovintiv Inc	HSBC	11.898
(4.169)	OrthoPediatics Corp	Merrill Lynch	(638)	(1.176)	Owens & Minor Inc	Morgan Stanley	12.706
(6.155)	OrthoPediatics Corp	Barclays Bank	(9.589)	(2.325)	Owens & Minor Inc	Barclays Bank	(15.206)
1.188	Oscar Health Inc 'A'	Morgan Stanley	(7.201)	261	Owens Corning	HSBC	(26.273)
25.568	Oscar Health Inc 'A'	Bank of America	1.333	10.687	Owens Corning	Bank of America	
3.561	Oscar Health Inc 'A'	Merrill Lynch	32.982	4.279	Owens Corning	Merrill Lynch	241
2.031	Oscar Health Inc 'A'	Barclays Bank	5.769	1.978	Oxford Industries Inc	Goldman Sachs	3.986
695	Oscar Health Inc 'A'	Goldman Sachs	2.018	4.250	Oxford Industries Inc	Morgan Stanley	2.289
(7.532)	Oshkosh Corp	HSBC	897	1.892	Oxford Industries Inc	Bank of America	218
730	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	23.491	1.892	Oxford Industries Inc	Merrill Lynch	12.028
(1.194)	Oshkosh Corp	Merrill Lynch	(185)	3.159	Oyster Point Pharma Inc	Barclays Bank	5.354
4.158	Oshkosh Corp	Barclays Bank	239	8.389	Oyster Point Pharma Inc	Barclays Bank	569
(3.953)	Oshkosh Corp	Goldman Sachs	(22.786)	5.751	Oyster Point Pharma Inc	Goldman Sachs	7.886
(1.967)	Oshkosh Corp	HSBC	20.901	11.793	Oyster Point Pharma Inc	HSBC	6.269
12.660	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	7.761	7.122	PACCAR Inc	Morgan Stanley	2.123
(6.043)	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	(2.532)	(6.852)	Pacific Biosciences of California Inc	Morgan Stanley	(1.994)
1.056	OSI Systems Inc	Bank of America	1.209	(4.746)	Pacific Biosciences of California Inc	Bank of America	
6.794	OSI Systems Inc	Merrill Lynch	834	(9.974)	Pacific Mercantile Bancorp	Merrill Lynch	(25.079)
6.255	OSI Systems Inc	Barclays Bank	6.794	(11.588)	Pacific Mercantile Bancorp	Goldman Sachs	(14.509)
473	OSI Systems Inc	Goldman Sachs	4.941	(13.526)	Pacific Premier Bancorp Inc	Barclays Bank	1.297
34.551	OSI Systems Inc	HSBC	270	(32.579)	Pacific Premier Bancorp Inc	Goldman Sachs	695
16.828	Osmotica Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	33.186	(60.661)	Pacific Premier Bancorp Inc	HSBC	(3.629)
7.816	Otis Worldwide Corp	Barclays Bank	(505)	(8.059)	Pacific Premier Bancorp Inc	Morgan Stanley	(5.722)
37.418	Otis Worldwide Corp	Goldman Sachs	(630)	(4.829)	Pacira BioSciences Inc	Bank of America	
5.412	Otis Worldwide Corp	HSBC	89	(4.527)	Pacira BioSciences Inc	Merrill Lynch	4.845
9.399	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	897	(1.053)	Pacira BioSciences Inc	Barclays Bank	26.302
(72.684)	Otonomy Inc	Bank of America	(2.332)	(8.863)	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs	979
(14.831)	Otonomy Inc	Merrill Lynch	2.907	(3.124)	Packaging Corp of America	HSBC	1.950
7.486	Otter Tail Corp	Goldman Sachs	593	(1.165)	Packaging Corp of America	Bank of America	
4.735	Outfront Media Inc (REIT)	Barclays Bank	1.198	(741)	Packaging Corp of America	Merrill Lynch	9.909
10.604	Outfront Media Inc (REIT)	Bank of America	4.025	3.320	Packaging Corp of America	Barclays Bank	3.320
32.129	Outfront Media Inc (REIT)	Merrill Lynch	4.454	(5.046)	Pactiv Evergreen Inc	Goldman Sachs	2.512
12.561	Outfront Media Inc (REIT)	Barclays Bank	9.960	(2.455)	Pactiv Evergreen Inc	Goldman Sachs	(21.514)
(4.393)	Outset Medical Inc	HSBC	5.276	(25.755)	Pactiv Evergreen Inc	Morgan Stanley	14.381
(638)	Outset Medical Inc	Morgan Stanley	(21.701)	(6.435)	PacWest Bancorp	Bank of America	
(138.038)	Overseas Shipholding Group Inc 'A'	Merrill Lynch	(1.480)	3.327	PacWest Bancorp	Merrill Lynch	(134)
(25.219)	Overseas Shipholding Group Inc 'A'	Barclays Bank	252	1.891	PacWest Bancorp	Barclays Bank	700
(11.707)	Overseas Shipholding Group Inc 'A'	Barclays Bank		4.480	PacWest Bancorp	HSBC	4.301
(9.870)	Overseas Shipholding Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.171)	5.249	PacWest Bancorp	Morgan Stanley	1.943
(4.708)	Overstock.com Inc	HSBC	395	36.233	PAE Inc	Bank of America	
2.618	Overstock.com Inc	Bank of America	(36.135)	78.524	PAE Inc	Merrill Lynch	(17.392)
3.797	Overstock.com Inc	Merrill Lynch	30.657	27.187	PAE Inc	Barclays Bank	(31.410)
526	Overstock.com Inc	Goldman Sachs	44.463	22.978	PAE Inc	Goldman Sachs	(7.163)
		HSBC	5.476	13.513	PAE Inc	HSBC	(12.035)
				3.621	PagerDuty Inc	Morgan Stanley	(5.405)
				3.177	PagerDuty Inc	Bank of America	
				10.047	PagerDuty Inc	Merrill Lynch	22.849
				3.079	PagerDuty Inc	Barclays Bank	11.469
				(1.321)	Palantir Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	48.463
						Morgan Stanley	11.115
						Bank of America	
						Merrill Lynch	(3.289)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(11.905)	Palantir Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	(29.643)	(4.779)	Parke Bancorp Inc	Barclays Bank	(621)
(3.196)	Palo Alto Networks Inc	HSBC	(70.024)	(2.929)	Parke Bancorp Inc	Goldman Sachs	(1.453)
(1.857)	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	2.358	(9.235)	Parke Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.201)
(4.280)	Palomar Holdings Inc	Bank of America		4.891	Parker Drilling Co	HSBC	367
		Merrill Lynch	(32.614)	2.560	Parker Drilling Co	Morgan Stanley	448
(1.403)	Palomar Holdings Inc	Barclays Bank	(5.037)	5.559	Parker-Hannifin Corp	Barclays Bank	12.674
(791)	Palomar Holdings Inc	HSBC	(5.418)	9.245	Parker-Hannifin Corp	Morgan Stanley	21.078
(4.690)	Palomar Holdings Inc	Morgan Stanley	(16.837)	3.824	Park-Ohio Holdings Corp	Goldman Sachs	4.551
(798)	PAM Transportation			(9.347)	Parsons Corp	HSBC	29.817
	Services Inc	Barclays Bank	383	(14.290)	Parsons Corp	Morgan Stanley	5.430
(2.802)	PAM Transportation			1.497	Partners Bancorp	Bank of America	
	Services Inc	Morgan Stanley	1.345			Merrill Lynch	(180)
10.265	Pan American Silver Corp	Bank of America		9.254	Partners Bancorp	Barclays Bank	1.851
		Merrill Lynch	51	6.937	Partners Bancorp	Goldman Sachs	(832)
46.959	Pan American Silver Corp	Goldman Sachs	235	1.400	Partners Bancorp	HSBC	350
21.553	Pan American Silver Corp	Morgan Stanley	—	16.432	Partners Bancorp	Morgan Stanley	3.286
(102.658)	Pangaea Logistics Solutions			4.386	PARTS iD Inc	Bank of America	
	Ltd	Barclays Bank	11.341			Merrill Lynch	965
(5.732)	Pangaea Logistics Solutions			1.606	PARTS iD Inc	Barclays Bank	658
	Ltd	Goldman Sachs	(1.548)	1.300	PARTS iD Inc	Goldman Sachs	592
(8.167)	Papa John's International			400	PARTS iD Inc	HSBC	124
	Inc	Barclays Bank	3.348	5.471	PARTS iD Inc	Morgan Stanley	2.243
(169)	Papa John's International			(32.222)	Party City Holdco Inc	Barclays Bank	(20.300)
	Inc	Goldman Sachs	380	10.741	Passage Bio Inc	Barclays Bank	(6.876)
8.815	Par Pacific Holdings Inc	Barclays Bank	(2.204)	4.174	Passage Bio Inc	Goldman Sachs	(4.606)
14.196	Par Pacific Holdings Inc	Goldman Sachs	8.660	1.172	Passage Bio Inc	HSBC	(3.046)
14.168	Par Pacific Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.542)	2.292	Passage Bio Inc	Morgan Stanley	(1.742)
669	PAR Technology Corp	Bank of America		(1.620)	Patrick Industries Inc	Morgan Stanley	(616)
		Merrill Lynch	5.780	10.506	Patterson Cos Inc	Bank of America	
1.962	PAR Technology Corp	Goldman Sachs	16.952			Merrill Lynch	(32.043)
1.348	Paramount Group Inc	Bank of America		6.528	Patterson Cos Inc	Barclays Bank	(9.466)
	(REIT)	Merrill Lynch	620	7.362	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs	(119)
19.288	Paramount Group Inc			4.069	Patterson Cos Inc	HSBC	(12.471)
	(REIT)	Barclays Bank	1.350	28.794	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	(41.751)
16.892	Paramount Group Inc			42.221	Patterson-UTI Energy Inc	Barclays Bank	(1.689)
	(REIT)	Goldman Sachs	7.770	52.268	Patterson-UTI Energy Inc	Goldman Sachs	(31.883)
(13.821)	Paramount Group Inc			21.634	Patterson-UTI Energy Inc	HSBC	1.082
	(REIT)	Goldman Sachs	(6.358)	35.256	Patterson-UTI Energy Inc	Morgan Stanley	(1.410)
61.268	Paramount Group Inc			(86.878)	PAVmed Inc	Barclays Bank	(46.045)
	(REIT)	HSBC	23.282	33.770	Paya Holdings Inc 'A'	Bank of America	
112.955	Paramount Group Inc					Merrill Lynch	16.885
	(REIT)	Morgan Stanley	7.907	12.510	Paya Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(3.503)
(29.496)	Paratek Pharmaceuticals			26.358	Paychex Inc	Bank of America	
	Inc	Goldman Sachs	(23.007)			Merrill Lynch	34.002
(15.672)	Paratek Pharmaceuticals			14.016	Paychex Inc	Barclays Bank	(9.612)
	Inc	Morgan Stanley	(3.761)	24.601	Paychex Inc	Goldman Sachs	31.735
(12.531)	Park Aerospace Corp	Bank of America		(62)	Paycom Software Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(12.155)			Merrill Lynch	(459)
(27.056)	Park Aerospace Corp	Barclays Bank	(11.289)	(2.665)	Paycom Software Inc	Barclays Bank	18.229
(36.926)	Park Aerospace Corp	Goldman Sachs	(35.818)	7.608	Paylocity Holding Corp	Bank of America	
(14.459)	Park Aerospace Corp	HSBC	(27.906)			Merrill Lynch	47.812
(19.328)	Park Aerospace Corp	Morgan Stanley	(9.277)	1.230	Paylocity Holding Corp	Barclays Bank	(689)
(21.646)	Park City Group Inc	Bank of America		3.877	Paylocity Holding Corp	Goldman Sachs	24.614
		Merrill Lynch	(19.048)	3.736	Paylocity Holding Corp	HSBC	12.856
(117.868)	Park City Group Inc	Barclays Bank	70.721	5.514	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	(3.088)
(10.895)	Park City Group Inc	Goldman Sachs	(9.588)	(1.973)	PayPal Holdings Inc	Bank of America	
33.600	Park Hotels & Resorts Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(30.897)
	(REIT)	Merrill Lynch	(25.872)	(1.516)	PayPal Holdings Inc	Barclays Bank	(4.321)
6.932	Park Hotels & Resorts Inc			1.198	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs	18.761
	(REIT)	Barclays Bank	694	(4.112)	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs	(64.394)
1.334	Park Hotels & Resorts Inc			4.443	PayPal Holdings Inc	HSBC	72.821
	(REIT)	Goldman Sachs	(1.027)	(208)	PayPal Holdings Inc	HSBC	(3.409)
22.834	Park Hotels & Resorts Inc			1.211	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	3.451
	(REIT)	HSBC	(29.228)	(4.826)	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	(13.754)
10.528	Park Hotels & Resorts Inc			(41.190)	Paysign Inc	Bank of America	
	(REIT)	Morgan Stanley	1.053			Merrill Lynch	(5.767)
(27.763)	Park National Corp	Morgan Stanley	(36.925)	(17.193)	Paysign Inc	Barclays Bank	688
(11.201)	Parke Bancorp Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(1.363)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(10.910)	Paysign Inc	Goldman Sachs	(1.527)	9.623	Penns Woods Bancorp Inc	Barclays Bank	3.945
(11.281)	Paysign Inc	HSBC	1.354	4.640	Penns Woods Bancorp Inc	Goldman Sachs	2.042
(15.724)	Paysign Inc	Morgan Stanley	629	12.466	Penns Woods Bancorp Inc	Morgan Stanley	5.111
4.601	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America		(3.754)	PennyMac Financial	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.426		Services Inc	Merrill Lynch	(5.555)
11.436	PBF Energy Inc 'A'	Barclays Bank	4.346	(5.562)	PennyMac Financial		
8.782	PBF Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	2.722		Services Inc	Barclays Bank	2.002
25.420	PBF Energy Inc 'A'	HSBC	(2.542)	(1.601)	PennyMac Financial		
1.690	PC Connection Inc	Barclays Bank	(135)		Services Inc	Goldman Sachs	(2.369)
1.493	PC Connection Inc	HSBC	3.479	6.803	PennyMac Financial		
31.657	PC Connection Inc	Morgan Stanley	(2.533)		Services Inc	Goldman Sachs	10.068
25.001	PCB Bancorp	Barclays Bank	—	(13.752)	PennyMac Financial		
8.960	PCB Bancorp	Goldman Sachs	(5.286)		Services Inc	Morgan Stanley	4.951
27.064	PCB Bancorp	Morgan Stanley	—	(20.072)	PennyMac Mortgage	Bank of America	
20.863	PCSB Financial Corp	Bank of America			Investment Trust (REIT)	Merrill Lynch	(9.233)
		Merrill Lynch	(626)	(8.497)	PennyMac Mortgage		
16.879	PCSB Financial Corp	Barclays Bank	(506)		Investment Trust (REIT)	Barclays Bank	(2.379)
42.748	PCSB Financial Corp	Goldman Sachs	(1.282)	(25.683)	PennyMac Mortgage		
34.188	PCSB Financial Corp	HSBC	20.855		Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(11.814)
43.565	PCSB Financial Corp	Morgan Stanley	(1.307)	15.387	Penske Automotive Group		
(5.656)	PCTEL Inc	Bank of America			Inc	Barclays Bank	2.616
		Merrill Lynch	(47)	1.329	Penske Automotive Group		
(16.173)	PCTEL Inc	Goldman Sachs	147		Inc	Goldman Sachs	(6.208)
(7.745)	PDC Energy Inc	Goldman Sachs	2.478	1.586	Penske Automotive Group		
(7.162)	PDC Energy Inc	HSBC	(9.955)		Inc	HSBC	(9.913)
(6.029)	PDC Energy Inc	Morgan Stanley	(11.093)	(15.475)	Pentair Plc	Goldman Sachs	(15.011)
(11.490)	PDF Solutions Inc	Morgan Stanley	7.239	(8.184)	Pentair Plc	HSBC	655
(337.585)	PDL BioPharma Inc'	Bank of America		(12.261)	Pentair Plc	Morgan Stanley	(11.158)
		Merrill Lynch	41.692	(468)	Penumbra Inc	Barclays Bank	(1.067)
(46.279)	PDL BioPharma Inc'	Barclays Bank	5.715	289	Penumbra Inc	HSBC	(2)
(74.293)	PDL BioPharma Inc'	Goldman Sachs	9.175	(4.238)	Peoples Bancorp Inc	Bank of America	
(98.282)	PDL BioPharma Inc'	HSBC	12.138			Merrill Lynch	3.857
(141.740)	PDL BioPharma Inc'	Morgan Stanley	17.505	(7.763)	Peoples Bancorp Inc	Barclays Bank	1.320
(9.482)	Peapack-Gladstone Financial			(34.955)	Peoples Bancorp Inc	Goldman Sachs	31.809
	Corp	Morgan Stanley	(2.560)	(27.409)	Peoples Bancorp Inc	HSBC	20.831
(15.853)	Pebblebrook Hotel Trust	Bank of America		(32.320)	Peoples Bancorp Inc	Morgan Stanley	5.494
	(REIT)	Merrill Lynch	5.379	912	Peoples Bancorp of North	Bank of America	
(25.678)	Pebblebrook Hotel Trust				Carolina Inc	Merrill Lynch	36
	(REIT)	Barclays Bank	(12.582)	177	Peoples Bancorp of North		
(14.206)	Pebblebrook Hotel Trust				Carolina Inc	Barclays Bank	39
	(REIT)	Goldman Sachs	2.324	8.166	Peoples Bancorp of North		
(2.875)	Pebblebrook Hotel Trust				Carolina Inc	Goldman Sachs	327
	(REIT)	Morgan Stanley	(1.409)	7.524	Peoples Bancorp of North		
418	Pegasystems Inc	Bank of America			Carolina Inc	HSBC	11.211
		Merrill Lynch	573	13.115	Peoples Bancorp of North		
11.300	Pegasystems Inc	Barclays Bank	(43.844)		Carolina Inc	Morgan Stanley	2.885
5.649	Pegasystems Inc	Goldman Sachs	7.739	3.102	Peoples Financial Services	Bank of America	
1.015	Pegasystems Inc	HSBC	(264)		Corp	Merrill Lynch	527
2.072	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	(8.039)	2.999	Peoples Financial Services		
(795)	Peloton Interactive Inc 'A'	Barclays Bank	(7.274)		Corp	Goldman Sachs	510
(983)	Peloton Interactive Inc 'A'	HSBC	(22.432)	8.283	PepsiCo Inc	Bank of America	
(8.597)	Peloton Interactive Inc 'A'	Morgan Stanley	(78.663)			Merrill Lynch	14.661
(6.610)	Penn National Gaming Inc	Bank of America		16.299	PepsiCo Inc	Barclays Bank	1.467
		Merrill Lynch	(7.403)	12.134	PepsiCo Inc	Goldman Sachs	22.621
1.942	Penn National Gaming Inc	Barclays Bank	3.476	4.033	PepsiCo Inc	HSBC	4.920
(1.679)	Penn National Gaming Inc	Goldman Sachs	(1.880)	29.255	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	2.633
4.440	Penn National Gaming Inc	Morgan Stanley	7.947	3.939	Perdoceo Education Corp	Bank of America	
(829)	Penn National Gaming Inc					Merrill Lynch	118
(1.486)	Penn Virginia Corp	Bank of America	(1.484)	28.897	Perdoceo Education Corp	Barclays Bank	6.068
		Merrill Lynch	89	35.062	Perdoceo Education Corp	Goldman Sachs	1.052
(1.740)	Penn Virginia Corp	Barclays Bank	(922)	4.648	Perdoceo Education Corp	HSBC	930
(2.722)	Penn Virginia Corp	Goldman Sachs	163	22.259	Perdoceo Education Corp	Morgan Stanley	4.674
(1.613)	Pennant Group Inc	Bank of America		(4.968)	Perficient Inc	Morgan Stanley	10.979
		Merrill Lynch	(2.678)	18.544	Performance Food Group	Bank of America	
(1.357)	Pennant Group Inc	Barclays Bank	(2.443)		Co	Merrill Lynch	(27.132)
(1.440)	Pennant Group Inc	Goldman Sachs	(2.390)	5.562	Performance Food Group		
(2.256)	Pennant Group Inc	HSBC	5.189		Co	Barclays Bank	2.836
(6.645)	Pennant Group Inc	Morgan Stanley	(11.961)	19.963	Performance Food Group		
2.680	Penns Woods Bancorp Inc	Bank of America			Co	Goldman Sachs	(32.141)
		Merrill Lynch	1.179				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.435	Performance Food Group Co	HSBC	(1.847)	(1.444)	Philip Morris International Inc	Goldman Sachs	1.174
6.190	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	3.157	(6.249)	Philip Morris International Inc	HSBC	1.502
(212)	PerkinElmer Inc	Barclays Bank	(98)	(28.416)	Philip Morris International Inc	Morgan Stanley	47.332
(144)	PerkinElmer Inc	Goldman Sachs	(265)	7.607	Phillips 66	Bank of America	(34.079)
(5.119)	PerkinElmer Inc	Morgan Stanley	(2.355)	8.723	Phillips 66	Barclays Bank	(11.253)
12.616	Perrigo Co Plc	Bank of America	8.616	(6.819)	Phillips 66	Barclays Bank	8.797
19.795	Perrigo Co Plc	Merrill Lynch	18.409	1.594	Phillips 66	Goldman Sachs	(7.141)
10.645	Perrigo Co Plc	Barclays Bank	18.409	3.666	Phillips 66	HSBC	(5.022)
5.053	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs	7.239	(5.128)	Phillips 66	HSBC	7.025
30.938	Perrigo Co Plc	HSBC	15.260	12.839	Phillips 66	Morgan Stanley	(16.562)
2.858	Personalis Inc	Morgan Stanley	25.163	(497)	Phillips 66	Morgan Stanley	641
11.173	Personalis Inc	Bank of America	7.374	(12.658)	Photronics Inc	Bank of America	(6.530)
2.012	Personalis Inc	Merrill Lynch	10.056	(6.289)	Photronics Inc	Merrill Lynch	189
6.460	Personalis Inc	Barclays Bank	5.191	(40.092)	Photronics Inc	Goldman Sachs	(22.140)
16.473	PET Acquisition LLC 'A'	HSBC	19.315	8.522	Phreesia Inc	Morgan Stanley	32.128
2.318	PetiQ Inc	Morgan Stanley	(31.793)	(31.171)	PHX Minerals Inc	Bank of America	1.870
736	PetiQ Inc	Bank of America	511	(17.887)	PHX Minerals Inc	Merrill Lynch	(715)
3.434	PetiQ Inc	Merrill Lynch	74	(11.531)	PHX Minerals Inc	Barclays Bank	692
6.753	PetiQ Inc	Barclays Bank	3.915	(2.276)	PHX Minerals Inc	Goldman Sachs	(455)
(3.146)	PetMed Express Inc	Goldman Sachs	675	(98.944)	Physicians Realty Trust (REIT)	Bank of America	(9.894)
(5.805)	PetMed Express Inc	Merrill Lynch	1.793	5.627	Physicians Realty Trust (REIT)	Bank of America	563
(22.167)	PetMed Express Inc	Barclays Bank	(1.683)	(11.503)	Physicians Realty Trust (REIT)	Barclays Bank	3.106
(31.569)	Pfizer Inc	Goldman Sachs	12.635	(24.736)	Physicians Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(2.474)
(14.531)	Pfizer Inc	Bank of America	43.565	(17.830)	Physicians Realty Trust (REIT)	HSBC	7.489
(12.251)	Pfizer Inc	Merrill Lynch	15.693	(23.953)	Physicians Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	6.467
3.321	Pfizer Inc	Barclays Bank	16.906	65.576	Physicians Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	(17.706)
6.543	Pfizer Inc	Goldman Sachs	16.906	(53.423)	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	9.616
7.510	Pfizer Inc	HSBC	(4.583)	(39.338)	Pieris Pharmaceuticals Inc	Bank of America	(59.794)
(32.523)	PFSweb Inc	Goldman Sachs	(7.394)	(1.921)	Pieris Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(3.054)
(7.885)	PFSweb Inc	Morgan Stanley	(8.111)	(19.870)	Pieris Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(30.202)
(78.611)	PG&E Corp	HSBC	88.693	(10.283)	Pieris Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(16.350)
(39.271)	PG&E Corp	Morgan Stanley	(7.312)	(44.255)	Pilgrim's Pride Corp	Bank of America	62.842
(25.588)	PG&E Corp	Bank of America	54.440	(15.498)	Pilgrim's Pride Corp	Merrill Lynch	10.897
(22.473)	PG&E Corp	Merrill Lynch	18.457	(61.373)	Pilgrim's Pride Corp	Barclays Bank	10.897
(11.317)	PGT Innovations Inc	Goldman Sachs	(2.019)	(6.724)	Pilgrim's Pride Corp	Goldman Sachs	81.685
(16.933)	PGT Innovations Inc	HSBC	9.888	(7.239)	Ping Identity Holding Corp	HSBC	1.927
(27.891)	PGT Innovations Inc	Morgan Stanley	(1.245)	(3.620)	Ping Identity Holding Corp	Bank of America	(7.601)
(66.474)	PGT Innovations Inc	Barclays Bank	21.505	14.983	Pinnacle Financial Partners Inc	Merrill Lynch	(7.601)
6.985	PhaseBio Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	21.505	(1.553)	Pinnacle Financial Partners Inc	Bank of America	(30.266)
29.714	PhaseBio Pharmaceuticals Inc	HSBC	88.693	(3.032)	Pinnacle Financial Partners Inc	Bank of America	3.137
27.918	PhaseBio Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(7.312)	9.320	Pinnacle Financial Partners Inc	Barclays Bank	(334)
3.047	Phathom Pharmaceuticals Inc	Bank of America	54.440	6.426	Pinnacle Financial Partners Inc	Goldman Sachs	(18.826)
889	Phathom Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	18.457	(1.069)	Pinnacle Financial Partners Inc	Morgan Stanley	707
2.466	Phathom Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(2.019)	12.869	Pinnacle West Capital Corp	Bank of America	(11.067)
590	Phathom Pharmaceuticals Inc	HSBC	9.888	11.999	Pinnacle West Capital Corp	Merrill Lynch	(11.067)
1.443	Phathom Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(808)			Barclays Bank	(22.918)
(16.028)	Phibro Animal Health Corp 'A'	Goldman Sachs	801				
(8.674)	Philip Morris International Inc	HSBC	1.404				
(22.977)	Philip Morris International Inc	Morgan Stanley	(808)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
5.716	Pinnacle West Capital Corp	Goldman Sachs	(4.916)	(1.499)	Polaris Inc	Bank of America	
16.300	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	(31.133)			Merrill Lynch	2.069
(828)	Pinterest Inc 'A'	Bank of America		(895)	Polaris Inc	Barclays Bank	302
		Merrill Lynch	(5.962)	(743)	Polaris Inc	Goldman Sachs	83
(8.294)	Pinterest Inc 'A'	Barclays Bank	(19.823)	(1.147)	Polaris Inc	Morgan Stanley	540
(2.583)	Pinterest Inc 'A'	HSBC	(18.016)	(45.801)	PolarityTE Inc	Morgan Stanley	(5.038)
(2.361)	Pinterest Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.643)	(25.197)	Ponce de Leon Federal		
(3.310)	Pioneer Bancorp Inc	Bank of America			Bank	Morgan Stanley	(64.252)
		Merrill Lynch	(66)	(429)	Pool Corp	Barclays Bank	(2.492)
(4.887)	Pioneer Bancorp Inc	Goldman Sachs	(98)	4.489	Pool Corp	Morgan Stanley	26.081
(110.439)	Pioneer Bancorp Inc	Morgan Stanley	(23.192)	(422)	Pool Corp	Morgan Stanley	(2.452)
6.941	Pioneer Natural Resources			1.668	Popular Inc	Bank of America	
	Co	Morgan Stanley	25.946			Merrill Lynch	(367)
(4.069)	Piper Sandler Cos	Morgan Stanley	(2.808)	16.291	Popular Inc	Barclays Bank	8.146
(7.775)	Pitney Bowes Inc	Bank of America		3.393	Popular Inc	Goldman Sachs	(746)
		Merrill Lynch	(3.343)	33.334	Portland General Electric	Bank of America	
(2.259)	Pitney Bowes Inc	Goldman Sachs	(971)		Co	Merrill Lynch	(44.726)
(13.476)	Pitney Bowes Inc	Morgan Stanley	(4.717)	(6.228)	Portland General Electric	Bank of America	
(12.372)	Pixelworks Inc	Bank of America			Co	Merrill Lynch	6.747
		Merrill Lynch	(1.684)	46.356	Portland General Electric		
(40.175)	Pixelworks Inc	Barclays Bank	(9.642)		Co	Barclays Bank	(51.394)
(52.229)	Pixelworks Inc	Goldman Sachs	(22.981)	(5.080)	Portland General Electric		
(13.855)	Pixelworks Inc	HSBC	(6.650)		Co	Barclays Bank	6.350
(23.426)	Pixelworks Inc	Morgan Stanley	(5.622)	30.934	Portland General Electric		
(4.694)	PJT Partners Inc 'A'	Barclays Bank	2.347		Co	Goldman Sachs	(40.944)
(5.480)	PJT Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	2.740	(1.635)	Portland General Electric		
21.530	Plains GP Holdings LP 'A'	HSBC	18.301		Co	HSBC	2.122
182	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America		461	Portland General Electric		
		Merrill Lynch	(31)		Co	HSBC	(7)
18.609	Planet Fitness Inc 'A'	Goldman Sachs	(3.164)	77.105	Portland General Electric		
1.741	Planet Fitness Inc 'A'	Morgan Stanley	540		Co	Morgan Stanley	(73.277)
(2.680)	Plantronics Inc	Bank of America		15.574	Poseida Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.557
		Merrill Lynch	(9.249)	8.035	Poseida Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3.134)
(7.513)	Plantronics Inc	Barclays Bank	(11.582)	(323)	Poshmark Inc 'A'	Barclays Bank	(1.686)
(3.609)	Plantronics Inc	Goldman Sachs	(4.130)	(11.580)	Post Holdings Inc	Bank of America	
(905)	Plantronics Inc	Morgan Stanley	(1.484)			Merrill Lynch	3.691
16.353	Playa Hotels & Resorts NV	Barclays Bank	5.396	(16.042)	Post Holdings Inc	Barclays Bank	885
6.707	PlayAGS Inc	Goldman Sachs	9.256	(22.115)	Post Holdings Inc	Goldman Sachs	30.500
32.355	PlayAGS Inc	HSBC	31.384	(13.184)	Post Holdings Inc	HSBC	7.383
26.454	Playtika Holding Corp	Bank of America		(36.913)	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	(346)
		Merrill Lynch	56.347	(50.439)	Potbelly Corp	Bank of America	
(957)	Playtika Holding Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(2.522)
		Merrill Lynch	(714)	(1.626)	Potbelly Corp	HSBC	520
7.494	Playtika Holding Corp	Barclays Bank	899	(18.477)	Potbelly Corp	Morgan Stanley	3.880
(1.864)	Playtika Holding Corp	Goldman Sachs	(267)	(11.185)	PotlatchDeltic Corp (REIT)	Morgan Stanley	(11.409)
(520)	Plexus Corp	Bank of America		(4.203)	Powell Industries Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(208)			Merrill Lynch	9.583
(222)	Plexus Corp	Barclays Bank	102	(2.550)	Powell Industries Inc	Barclays Bank	1.556
(3.619)	Plexus Corp	Goldman Sachs	(3.234)	(5.443)	Powell Industries Inc	Goldman Sachs	12.410
(13.534)	Plexus Corp	Morgan Stanley	6.120	(13.305)	Powell Industries Inc	Morgan Stanley	8.116
(13.632)	Pliant Therapeutics Inc	Barclays Bank	(21.130)	3.549	Power Integrations Inc	Bank of America	
697	Plug Power Inc	Bank of America				Merrill Lynch	6.544
		Merrill Lynch	4.015	13.167	Power Integrations Inc	Barclays Bank	27.233
2.284	Plug Power Inc	Barclays Bank	7.994	3.124	Power Integrations Inc	Goldman Sachs	18.900
10.291	Plug Power Inc	Goldman Sachs	59.276	5.785	Power Integrations Inc	HSBC	26.505
(5.195)	Plug Power Inc	HSBC	(55.223)	50.309	Power Integrations Inc	Morgan Stanley	110.680
(937)	Plug Power Inc	Morgan Stanley	(3.280)	14.470	Powerfleet Inc	Goldman Sachs	(2.749)
852	Plug Power Inc	Morgan Stanley	2.982	16.699	Powerfleet Inc	HSBC	6.680
(6.183)	Plumas Bancorp	Bank of America		5.228	PPD Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(9.398)			Merrill Lynch	209
(449)	Plumas Bancorp	Barclays Bank	(314)	9.434	PPD Inc	Barclays Bank	(48)
(2.103)	Plumas Bancorp	Morgan Stanley	(1.472)	958	PPD Inc	Goldman Sachs	38
(6.389)	PLx Pharma Inc	Barclays Bank	(11.820)	2.821	PPD Inc	HSBC	—
1.492	Plymouth Industrial Inc			(2.930)	PPD Inc	HSBC	—
	(REIT)	Goldman Sachs	(209)	5.879	PPD Inc	Morgan Stanley	—
31.080	Plymouth Industrial Inc			386	PPG Industries Inc	Bank of America	
	(REIT)	HSBC	(11.189)			Merrill Lynch	(350)
40.699	Plymouth Industrial Inc			25.103	PPG Industries Inc	Morgan Stanley	4.843
	(REIT)	Morgan Stanley	(21.977)	(33.041)	PPL Corp	HSBC	12.225
(2.305)	PMV Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	3.711	(61.083)	PPL Corp	Morgan Stanley	15.318

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(18.262)	PQ Group Holdings Inc	Barclays Bank	(7.853)	26.496	Primis Financial Corp	Barclays Bank	(5.034)
7.817	PRA Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.403	4.511	Primis Financial Corp	Goldman Sachs	(1.263)
13.861	PRA Group Inc	Barclays Bank	4.222	25.132	Primo Water Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.272)
13.048	PRA Group Inc	Goldman Sachs	7.692	408	Primo Water Corp	Barclays Bank	(98)
10.162	PRA Group Inc	HSBC	2.032	3.666	Primo Water Corp	Goldman Sachs	(623)
14.246	PRA Group Inc	Morgan Stanley	7.693	71.962	Primo Water Corp	Morgan Stanley	(17.271)
(2.262)	PRA Health Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.217	23.776	Primoris Services Corp	Goldman Sachs	(26.154)
(766)	PRA Health Sciences Inc	Barclays Bank	2.758	4.775	Primoris Services Corp	HSBC	(2.053)
(834)	PRA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	3.002	33.685	Primoris Services Corp	Morgan Stanley	12.463
(9.494)	Praxis Precision Medicines Inc	Barclays Bank	(2.089)	4.684	Principal Financial Group Inc	Barclays Bank	(560)
(22.687)	Precigen Inc	Barclays Bank	(822)	1.050	Principal Financial Group Inc	Goldman Sachs	251
10.888	Precision BioSciences Inc Preferred Bank	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	1.415	(3.449)	Principal Financial Group Inc	HSBC	4.898
(241)	Preferred Bank	Barclays Bank	118	(2.469)	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	914
(2.175)	Preferred Bank	Goldman Sachs	457	(4.456)	Priority Technology Holdings Inc	Barclays Bank	(936)
(2.123)	Preferred Bank	Morgan Stanley	(2.590)	(17.643)	ProAssurance Corp	Bank of America Merrill Lynch	15.879
759	Preformed Line Products Co	Goldman Sachs	1.016	(671)	ProAssurance Corp	Barclays Bank	289
400	Preformed Line Products Co	HSBC	955	(7.958)	ProAssurance Corp	Goldman Sachs	5.829
4.415	Preformed Line Products Co	Morgan Stanley	5.787	(17.386)	ProAssurance Corp	Morgan Stanley	7.476
(2.898)	Prelude Therapeutics Inc	Barclays Bank	3.680	(776)	Procter & Gamble Co	Bank of America Merrill Lynch	2.235
(2.215)	Prelude Therapeutics Inc	Goldman Sachs	15.549	(11.120)	Procter & Gamble Co	Barclays Bank	34.583
(13.896)	Premier Financial Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.975	(3.509)	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs	10.106
(8.104)	Premier Financial Bancorp Inc	Barclays Bank	810	(9.897)	Procter & Gamble Co	Morgan Stanley	30.780
(9.651)	Premier Financial Bancorp Inc	Goldman Sachs	4.150	3.148	Professional Holding Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(157)
27.224	Premier Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(31.852)	4.259	Professional Holding Corp 'A'	Barclays Bank	(852)
2.399	Premier Financial Corp	Barclays Bank	(312)	4.495	Professional Holding Corp 'A'	Goldman Sachs	(225)
618	Premier Financial Corp	Morgan Stanley	(80)	7.294	Professional Holding Corp 'A'	HSBC	4.012
(3.667)	Premier Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3.667	4.612	Professional Holding Corp 'A'	Morgan Stanley	(922)
(1.354)	Premier Inc 'A'	Barclays Bank	2.275	18.250	PROG Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39.820)
(8.038)	Premier Inc 'A'	Goldman Sachs	7.292	17.932	PROG Holdings Inc	Barclays Bank	(3.587)
(21.296)	Premier Inc 'A'	Morgan Stanley	35.777	9.326	PROG Holdings Inc	Goldman Sachs	(20.430)
(1.649)	Prestige Consumer Healthcare Inc	Goldman Sachs	241	680	PROG Holdings Inc	HSBC	(24)
(273)	PriceSmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	104	331	PROG Holdings Inc	Morgan Stanley	(66)
1.609	PriceSmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(611)	6.872	Progress Software Corp	Bank of America Merrill Lynch	(462)
4.958	PriceSmart Inc	Barclays Bank	9.222	4.797	Progress Software Corp	Barclays Bank	432
2.045	PriceSmart Inc	Goldman Sachs	(777)	6.123	Progress Software Corp	Goldman Sachs	1.531
18.200	PriceSmart Inc	HSBC	34.034	32.952	Progress Software Corp	HSBC	34.929
189	PriceSmart Inc	Morgan Stanley	352	15.309	Progress Software Corp	Morgan Stanley	1.378
(252)	PrimeEnergy Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	318	231	Progressive Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.728)
(589)	PrimeEnergy Resources Corp	Barclays Bank	165	3.161	Progressive Corp	Barclays Bank	5.121
(176)	PrimeEnergy Resources Corp	Goldman Sachs	222	25.732	Progressive Corp	Goldman Sachs	(192.475)
(238)	PrimeEnergy Resources Corp	HSBC	21	(2.602)	Progyny Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30.027)
(543)	PrimeEnergy Resources Corp	Morgan Stanley	152	(12.142)	Progyny Inc	Barclays Bank	(61.803)
(2.957)	Primerica Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.470)	(3.834)	Progyny Inc	Goldman Sachs	(44.245)
1.999	Primerica Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.080	678	Progyny Inc	Goldman Sachs	4.931
(2.863)	Primerica Inc	Barclays Bank	(8.245)	3.178	Prologis Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	11.600
1.010	Primerica Inc	Barclays Bank	2.453	32.574	Prologis Inc (REIT)	Barclays Bank	(9.974)
(2.164)	Primerica Inc	Goldman Sachs	(4.003)	524	Prologis Inc (REIT)	Goldman Sachs	1.913
(355)	Primerica Inc	HSBC	(131)	110	Prologis Inc (REIT)	HSBC	180
1.121	Primerica Inc	HSBC	991	32.223	Prologis Inc (REIT)	Morgan Stanley	(9.989)
(9.229)	Primerica Inc	Morgan Stanley	(26.580)	1.035	Prometheus Biosciences Inc	Barclays Bank	4.689
				4.056	Prometheus Biosciences Inc	Goldman Sachs	12.082
				1.550	Prometheus Biosciences Inc	HSBC	7.098

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
2.365	Prometheus Biosciences Inc	Morgan Stanley	10.713	17.527	Prudential Financial Inc	Morgan Stanley	11.217
11.137	ProPetro Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11.694)	(8.018)	PS Business Parks Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(8.980)
9.438	ProPetro Holding Corp	Barclays Bank	849	(8.064)	PS Business Parks Inc (REIT)	Barclays Bank	19.981
5.427	ProPetro Holding Corp	Goldman Sachs	(5.698)	(6.241)	PS Business Parks Inc (REIT)	Goldman Sachs	(6.990)
15.898	ProPetro Holding Corp	HSBC	(12.241)	(21.387)	PS Business Parks Inc (REIT)	HSBC	23.740
17.931	ProPetro Holding Corp	Morgan Stanley	1.614	(13.883)	PS Business Parks Inc (REIT)	Morgan Stanley	36.790
1.546	PROS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.822	3.170	PTC Inc	Bank of America Merrill Lynch	19.167
3.377	PROS Holdings Inc	Barclays Bank	19.587	9.831	PTC Inc	Barclays Bank	12.977
7.765	PROS Holdings Inc	Goldman Sachs	54.355	1.838	PTC Inc	Goldman Sachs	11.910
13.041	PROS Holdings Inc	Morgan Stanley	75.638	4.724	PTC Inc	HSBC	23.620
(14.426)	ProSight Global Inc	Barclays Bank	(144)	3.810	PTC Inc	Morgan Stanley	5.029
(4.587)	ProSight Global Inc	Morgan Stanley	(4)	(138)	PTC Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(175)
(4.464)	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	2.163	PTC Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.747
(9.152)	Prosperity Bancshares Inc	Barclays Bank	(3.569)	(479)	PTC Therapeutics Inc	Barclays Bank	(53)
(5.550)	Prosperity Bancshares Inc	Goldman Sachs	—	4.008	PTC Therapeutics Inc	Barclays Bank	441
(1.095)	Prosperity Bancshares Inc	HSBC	(580)	2.261	PTC Therapeutics Inc	Goldman Sachs	2.871
(11.883)	Prosperity Bancshares Inc	Morgan Stanley	(4.634)	(6.115)	PTC Therapeutics Inc	HSBC	(2.263)
(849)	Protagonist Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.279)	11.020	PTC Therapeutics Inc	HSBC	4.077
(7.082)	Protagonist Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.416	(5.782)	PTC Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(637)
(3.075)	Protagonist Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(7.506)	(8.039)	Public Service Enterprise Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.367
(10.556)	Protagonist Therapeutics Inc	HSBC	(71.992)	(10.927)	Public Service Enterprise Group Inc	Barclays Bank	14.642
(3.066)	Protagonist Therapeutics Inc	Morgan Stanley	613	(11.558)	Public Service Enterprise Group Inc	Goldman Sachs	1.965
2.510	Protara Therapeutics Inc	Barclays Bank	653	(8.973)	Public Service Enterprise Group Inc	HSBC	10.409
3.884	Protara Therapeutics Inc	HSBC	1.787	(31.351)	Public Service Enterprise Group Inc	Morgan Stanley	42.011
1.446	Protective Insurance Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	304	(2.441)	Public Storage (REIT)	Goldman Sachs	(14.402)
(51.193)	Proteostasis Therapeutics Inc*	Barclays Bank	(5.529)	(5.459)	Public Storage (REIT)	HSBC	(29.042)
(62.121)	Proteostasis Therapeutics Inc*	Morgan Stanley	(6.709)	244	Public Storage (REIT)	HSBC	627
(9.102)	Prothema Corp Plc	Morgan Stanley	(37.500)	(1.429)	Public Storage (REIT)	Morgan Stanley	(5.759)
1.000	Proto Labs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.378)	(4.948)	Pulmonx Corp	Barclays Bank	(8.758)
1.156	Proto Labs Inc	Barclays Bank	1.121	(8.670)	Pulmonx Corp	Goldman Sachs	(40.662)
954	Proto Labs Inc	Goldman Sachs	(4.512)	(1.275)	Pulse Biosciences Inc	Barclays Bank	(26)
(732)	Proto Labs Inc	HSBC	3.331	(4.227)	Pulse Biosciences Inc	HSBC	(7.313)
(462)	Proto Labs Inc	Morgan Stanley	(448)	(8.732)	Pulse Biosciences Inc	Morgan Stanley	(175)
(4.319)	Provention Bio Inc	Barclays Bank	1.598	3.421	Pulse Evolution Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.426
56.615	Provident Bancorp Inc	Barclays Bank	12.455	4.464	Pulse Evolution Group Inc	HSBC	32.989
35.672	Provident Bancorp Inc	Goldman Sachs	6.778	1.564	PulteGroup Inc	Barclays Bank	2.768
6.408	Provident Bancorp Inc	Morgan Stanley	1.410	(3.841)	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	(4.816)
(6.771)	Provident Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.979)	8.946	Puma Biotechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.539
(17.179)	Provident Financial Holdings Inc	Barclays Bank	(12.171)	24.491	Puma Biotechnology Inc	Barclays Bank	6.123
(18.189)	Provident Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(8.113)	26.263	Puma Biotechnology Inc	Goldman Sachs	7.616
(40.156)	Provident Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	14.055	(36.487)	Pure Cycle Corp	Goldman Sachs	(16.784)
(22.078)	Provident Financial Services Inc	Barclays Bank	(442)	(33.631)	Pure Cycle Corp	HSBC	(3.699)
(16.069)	Provident Financial Services Inc	Goldman Sachs	5.624	14.566	Pure Storage Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	14.712
(17.137)	Provident Financial Services Inc	Morgan Stanley	(343)	13.366	Pure Storage Inc 'A'	Barclays Bank	1.337
(3.016)	Prudential Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	494	4.954	Pure Storage Inc 'A'	Goldman Sachs	5.004
(10.167)	Prudential Bancorp Inc	Barclays Bank	1.220	3.354	Pure Storage Inc 'A'	HSBC	3.958
(14.662)	Prudential Bancorp Inc	Goldman Sachs	2.486	18.960	Pure Storage Inc 'A'	Morgan Stanley	1.896
(1.071)	Prudential Bancorp Inc	Morgan Stanley	(135)	(12.831)	Pure Storage Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.283)
				(1.690)	Purple Innovation Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.915
				(8.218)	Purple Innovation Inc	Morgan Stanley	3.123

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.499	PVH Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.633	(3.224)	Qualtrics International Inc 'A'	Morgan Stanley	(2.410)
3.028	PVH Corp	Goldman Sachs	(729)	(6.339)	Qualys Inc	Barclays Bank	18.890
1.172	PVH Corp	HSBC	(648)	1.440	Qualys Inc	Barclays Bank	(4.291)
(1.097)	PVH Corp	Morgan Stanley	(191)	(7.488)	Qualys Inc	Goldman Sachs	8.836
2.055	PVH Corp	Morgan Stanley	8.439	(1.841)	Qualys Inc	HSBC	7.511
11.281	Pzena Investment Management Inc 'A'	Goldman Sachs	4.287	(380)	Qualys Inc	Morgan Stanley	1.132
1.162	Pzena Investment Management Inc 'A'	HSBC	511	412	Qualys Inc	Morgan Stanley	(1.228)
41.741	Pzena Investment Management Inc 'A'	Morgan Stanley	13.357	836	Quanex Building Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	(192)
(9.874)	Q2 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17.378)	49.597	Quanex Building Products Corp	Barclays Bank	22.319
(18.566)	Q2 Holdings Inc	Barclays Bank	6.126	10.245	Quanex Building Products Corp	Goldman Sachs	(2.356)
(10.644)	Q2 Holdings Inc	Goldman Sachs	(17.015)	9.958	Quanex Building Products Corp	HSBC	(18.721)
(5.296)	Q2 Holdings Inc	HSBC	(5.790)	25.251	Quanex Building Products Corp	Morgan Stanley	11.363
(23.830)	Q2 Holdings Inc	Morgan Stanley	7.864	4.471	Quanta Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.394)
(4.095)	QAD Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(28.785)	(9.550)	Quanta Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.537)
(3.603)	QAD Inc 'A'	Barclays Bank	(12.574)	7.027	Quanta Services Inc	Barclays Bank	20.167
(3.917)	QAD Inc 'A'	Goldman Sachs	(29.769)	(2.002)	Quanta Services Inc	Barclays Bank	(5.746)
(2.070)	QAD Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.695)	(6.473)	Quanta Services Inc	Goldman Sachs	669
(2.028)	QCR Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.501)	(3.008)	Quanterix Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17.827)
(9.935)	QCR Holdings Inc	Barclays Bank	397	(3.456)	Quanterix Corp	Barclays Bank	(8.222)
(15.531)	QCR Holdings Inc	Goldman Sachs	(11.493)	(1.598)	Quanterix Corp	Goldman Sachs	635
(4.856)	QCR Holdings Inc	HSBC	(2.234)	(21.407)	Quantum Corp	Bank of America Merrill Lynch	30.826
(3.735)	QCR Holdings Inc	Morgan Stanley	149	(13.119)	Quantum Corp	Barclays Bank	19.810
2.602	QIAGEN NV	Bank of America Merrill Lynch	6.921	(18.472)	Quantum Corp	Goldman Sachs	26.600
3.029	QIAGEN NV	Morgan Stanley	3.726	1.274	QuantumScape Corp	Barclays Bank	(697)
(2.566)	Qorvo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29.868)	2.248	QuantumScape Corp	Goldman Sachs	(756)
(9.932)	Qorvo Inc	Barclays Bank	(37.766)	1.152	QuantumScape Corp	Morgan Stanley	(241)
(4.729)	Qorvo Inc	Goldman Sachs	(55.046)	(101)	Quest Diagnostics Inc	Goldman Sachs	34
(4.066)	Qorvo Inc	HSBC	(45.677)	(1.433)	Quidel Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.342
(10.223)	Qorvo Inc	Morgan Stanley	(41.812)	996	QuinStreet Inc	Bank of America Merrill Lynch	259
1.443	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	759	1.481	QuinStreet Inc	Barclays Bank	(252)
12.170	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	2.482	19.388	QuinStreet Inc	HSBC	5.623
2.346	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	2.722	5.795	QuinStreet Inc	Morgan Stanley	(985)
7.540	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	HSBC	2.365	(54.763)	Quotient Ltd	Barclays Bank	2.191
31.933	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	5.062	(67.240)	Quotient Ltd	Goldman Sachs	(33.620)
19.725	Quad/Graphics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.436)	(1.447)	Quotient Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(521)
30.329	Quad/Graphics Inc	Barclays Bank	(3.639)	(29.745)	Quotient Technology Inc	Barclays Bank	(13.088)
25.934	Quad/Graphics Inc	Goldman Sachs	(11.152)	(2.461)	Quotient Technology Inc	Goldman Sachs	(726)
8.654	Quad/Graphics Inc	HSBC	(235)	(5.901)	Quotient Technology Inc	Morgan Stanley	(1.607)
5.446	Quad/Graphics Inc	Morgan Stanley	(654)	1.097	Qurate Retail Inc	Goldman Sachs	(735)
(3.619)	Quaker Chemical Corp (598)	Goldman Sachs	(34.634)	599	Qurate Retail Inc	HSBC	54
835	Quaker Chemical Corp	HSBC	(6.704)	330	Qurate Retail Inc	Morgan Stanley	(507)
(4.226)	Quaker Chemical Corp	Morgan Stanley	6.396	(24.292)	Qurate Retail Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(19.919)
912	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	(32.371)	3.651	Qurate Retail Inc 'A'	Morgan Stanley	37
18.021	QUALCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.323	(17.221)	R1 RCM Inc	Barclays Bank	36.853
13.001	QUALCOMM Inc	Barclays Bank	26.356	(10.179)	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	21.783
4.330	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs	48.330	(12.601)	Rackspace Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.221)
16.250	QUALCOMM Inc	HSBC	7.859	(3.515)	Rackspace Technology Inc	Barclays Bank	2.285
(1.416)	Qualtrics International Inc 'A'	Morgan Stanley	26.488	3.836	Rackspace Technology Inc	Morgan Stanley	(2.493)
(3.257)	Qualtrics International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	180	(4.216)	Rackspace Technology Inc	Morgan Stanley	2.740
		Barclays Bank	(1.997)	2.134	Radian Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	768
				43.347	Radian Group Inc	Barclays Bank	23.407
				9.156	Radian Group Inc	Goldman Sachs	3.297
				13.369	Radian Group Inc	Morgan Stanley	7.219

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
109.412	Radiant Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52.518)	(392)	Raymond James Financial Inc	Morgan Stanley	760
26.454	Radiant Logistics Inc	Barclays Bank	(2.116)	(15.205)	Rayonier Advanced Materials Inc	Morgan Stanley	(2.889)
20.165	Radiant Logistics Inc	Goldman Sachs	(9.679)	(2.763)	Rayonier Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(631)
46.536	Radiant Logistics Inc	HSBC	27.456	(8.709)	Rayonier Inc (REIT)	Barclays Bank	(4.964)
47.942	Radiant Logistics Inc	Morgan Stanley	(3.835)	(24.124)	Rayonier Inc (REIT)	HSBC	880
78.650	Radius Global Infrastructure Inc	Morgan Stanley	7.865	(30.525)	Rayonier Inc (REIT)	Morgan Stanley	(17.399)
(6.987)	Radius Health Inc	Morgan Stanley	907	18.695	RBB Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	23.743
3.890	RadNet Inc	Barclays Bank	1.634	4.501	RBB Bancorp	Barclays Bank	3.781
2.392	RadNet Inc	Goldman Sachs	7.367	13.756	RBB Bancorp	Goldman Sachs	17.470
14.033	RadNet Inc	HSBC	51.501	9.215	RBB Bancorp	HSBC	27.737
(5.068)	Rafael Holdings Inc 'B'	Morgan Stanley	(27.671)	25.455	RBB Bancorp	Morgan Stanley	21.382
1.181	Ralph Lauren Corp	Barclays Bank	5.279	(3.073)	RBC Bearings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(791)
2.258	Ralph Lauren Corp	Goldman Sachs	(31.702)	(13.498)	RBC Bearings Inc	Barclays Bank	(101.450)
(133)	Ralph Lauren Corp	HSBC	(535)	(13.705)	RBC Bearings Inc	Goldman Sachs	(7.864)
6.031	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	26.959	(1.746)	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	(13.392)
(9.582)	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	(42.832)	(1.640)	RCI Hospitality Holdings Inc	Morgan Stanley	1.050
(3.671)	Ramaco Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.836)	843	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	73
(17.432)	Ramaco Resources Inc	Barclays Bank	(10.285)	787	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(39)
(14.906)	Ramaco Resources Inc	Goldman Sachs	(7.453)	4.804	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.131)
(10.266)	Rambus Inc	Barclays Bank	(4.321)	32.587	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.629)
(10.996)	Rambus Inc	Goldman Sachs	(8.261)	(22.029)	Reading International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(12.116)
(11.328)	Rambus Inc	Morgan Stanley	(4.305)	(33.144)	Reading International Inc 'A'	HSBC	(25.852)
(8.304)	Range Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.228	(37.211)	Ready Capital Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(25.303)
(16.459)	Range Resources Corp	Barclays Bank	7.242	(49.106)	Ready Capital Corp (REIT)	Barclays Bank	(25.535)
(29.997)	Range Resources Corp	Goldman Sachs	22.498	3.250	RealNetworks Inc	Bank of America Merrill Lynch	—
(8.796)	Range Resources Corp	Morgan Stanley	3.870	23.728	RealNetworks Inc	Barclays Bank	1.424
14.906	Ranger Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.657	13.078	RealNetworks Inc	HSBC	(523)
4.130	Ranger Energy Services Inc	Goldman Sachs	6.278	21.510	Realogy Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21.080)
10.017	Ranger Energy Services Inc	Morgan Stanley	801	12.392	Realogy Holdings Corp	Barclays Bank	(13.755)
7.218	Ranpak Holdings Corp	Barclays Bank	(17.540)	5.659	Realogy Holdings Corp	Goldman Sachs	(5.546)
5.429	Ranpak Holdings Corp	Morgan Stanley	(13.192)	14.370	Realogy Holdings Corp	HSBC	4.024
6.602	Rapid7 Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.245	4.386	Realogy Holdings Corp	Morgan Stanley	(4.868)
(1.164)	Rapid7 Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.653)	5.853	RealReal Inc	Barclays Bank	9.014
2.390	Rapid7 Inc	Barclays Bank	4.971	4.892	RealReal Inc	Goldman Sachs	14.285
(8.231)	Rapid7 Inc	Barclays Bank	(17.120)	(44.985)	Realty Income Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(134.955)
4.838	Rapid7 Inc	Goldman Sachs	20.559	(9.991)	Realty Income Corp (REIT)	Barclays Bank	(2.598)
(2.653)	Rapid7 Inc	Goldman Sachs	(12.841)	(1.529)	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Barclays Bank	(28.164)
1.162	Rapid7 Inc	HSBC	8.413	(780)	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Goldman Sachs	(44.983)
(421)	Rapid7 Inc	HSBC	(3.048)	(1.164)	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	HSBC	(67.721)
17.794	Rapid7 Inc	Morgan Stanley	37.011	(1.529)	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Morgan Stanley	(28.164)
(1.971)	RAPT Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.582	(31.919)	Recro Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.661
(3.479)	RAPT Therapeutics Inc	Barclays Bank	(4.244)	(41.295)	Recro Pharma Inc	Barclays Bank	413
(4.383)	RAPT Therapeutics Inc	Goldman Sachs	5.742	(45.995)	Recro Pharma Inc	Goldman Sachs	11.039
(30)	RAPT Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(37)	(3.123)	Recro Pharma Inc	HSBC	1.093
(58.574)	Rattler Midstream LP	Barclays Bank	(586)	(7.345)	Recro Pharma Inc	Morgan Stanley	73
(3.765)	Raven Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.078)	(9.321)	Red River Bancshares Inc	Barclays Bank	4.567
(1.350)	Raven Industries Inc	Barclays Bank	(1.283)	(8.129)	Red River Bancshares Inc	Goldman Sachs	6.991
(805)	Raven Industries Inc	Goldman Sachs	(1.513)	(3.874)	Red River Bancshares Inc	HSBC	(2.363)
(6.258)	Raven Industries Inc	HSBC	(15.332)	(6.299)	Red River Bancshares Inc	Morgan Stanley	3.087
(16.515)	Raven Industries Inc	Morgan Stanley	(15.689)	3.343	Red Robin Gourmet Burgers Inc	Barclays Bank	(1.137)
146	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(194)	11.309	Red Rock Resorts Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	36.528
4.011	Raymond James Financial Inc	Barclays Bank	(7.781)				
(1.196)	Raymond James Financial Inc	Barclays Bank	2.320				
1.233	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	(1.640)				
(416)	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	(122)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(2.526)	Red Rock Resorts Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8.159)	7.666	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	(631)
(12.457)	Red Rock Resorts Inc 'A'	Barclays Bank	(27.405)	(2.780)	Reliant Bancorp Inc	Bank of America	
(795)	Red Rock Resorts Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.568)			Merrill Lynch	973
(3.853)	Red Rock Resorts Inc 'A'	HSBC	(20.652)	(32.623)	Reliant Bancorp Inc	Goldman Sachs	11.418
(17.606)	Red Rock Resorts Inc 'A'	Morgan Stanley	(38.734)	(3.720)	Relmada Therapeutics Inc	Bank of America	
(18.712)	Red Violet Inc	Barclays Bank	12.911			Merrill Lynch	1.339
(821)	Red Violet Inc	Goldman Sachs	(1.617)	(5.345)	Relmada Therapeutics Inc	Barclays Bank	18.921
(2.028)	Red Violet Inc	HSBC	(7.037)	6.296	RenaissanceRe Holdings Ltd		
(3.195)	Redfin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(23.706)	(3.560)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Barclays Bank	(315)
(9.133)	Redfin Corp	Barclays Bank	(53.063)			Goldman Sachs	4.877
(16.858)	Redfin Corp	Goldman Sachs	(115.530)	(4.217)	RenaissanceRe Holdings Ltd		
(2.297)	Redfin Corp	HSBC	(13.153)			HSBC	35.591
(30.202)	Redwood Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(6.342)	306	RenaissanceRe Holdings Ltd		109
(8.668)	Regal Beloit Corp	Morgan Stanley	(27.564)	(6.674)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Morgan Stanley	334
(2.318)	Regency Centers Corp (REIT)	Barclays Bank	(2.040)	1.034	RenaissanceRe Holdings Ltd		(52)
14.917	Regency Centers Corp (REIT)	Morgan Stanley	13.127	(2.390)	Renasant Corp	Barclays Bank	167
(1.913)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	40.747	(6.023)	Renasant Corp	HSBC	(964)
(409)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	HSBC	4.759	(112.176)	Renasant Corp	Morgan Stanley	7.852
1.761	REGENXBIO Inc	Bank of America Merrill Lynch	933	1.801	Reneo Pharmaceuticals Inc	Bank of America	(87)
2.936	REGENXBIO Inc	Barclays Bank	2.789	2.149	Reneo Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	1.805
14.292	REGENXBIO Inc	Goldman Sachs	7.575	1.471	Reneo Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	1.236
7.476	REGENXBIO Inc	HSBC	(5.457)	(4.323)	Renewable Energy Group Inc	Bank of America	
577	REGENXBIO Inc	Morgan Stanley	548	(3.166)	Renewable Energy Group Inc	Merrill Lynch	8.646
7.860	Regional Management Corp	Goldman Sachs	17.606			Barclays Bank	(1.614)
12.814	Regional Management Corp	Morgan Stanley	(384)	(2.025)	Renewable Energy Group Inc		4.050
26.877	Regions Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	269	1.301	Rent-A-Center Inc	Bank of America	
26.430	Regions Financial Corp	Barclays Bank	14.272			Merrill Lynch	(845)
(16.210)	Regions Financial Corp	Barclays Bank	(8.753)	5.180	Rent-A-Center Inc	Barclays Bank	17.198
40.297	Regions Financial Corp	Goldman Sachs	403	7.459	Rent-A-Center Inc	Goldman Sachs	19.238
75.252	Regions Financial Corp	Morgan Stanley	40.636	2.260	Rent-A-Center Inc	Morgan Stanley	6.057
(6.308)	Regions Financial Corp	Morgan Stanley	(3.406)	(18.799)	Rentech Inc	Morgan Stanley	56
(14.031)	Regis Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.122)	(11.258)	Repay Holdings Corp	Bank of America	
(8.027)	Regis Corp	Barclays Bank	(2.809)			Merrill Lynch	(1.464)
(5.604)	Regis Corp	Goldman Sachs	(448)	(2.440)	Repay Holdings Corp	Barclays Bank	2.708
(16.599)	Regis Corp	HSBC	1.660	(4.543)	Repay Holdings Corp	Goldman Sachs	(591)
(7.687)	Regis Corp	Morgan Stanley	(2.690)	(45.669)	Repay Holdings Corp	Morgan Stanley	50.693
2.239	Reinsurance Group of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.597)	914	Repligen Corp	Bank of America	
13.793	Reinsurance Group of America Inc	Barclays Bank	31.172			Merrill Lynch	15.300
10.069	Reinsurance Group of America Inc	Goldman Sachs	(11.680)	353	Repligen Corp	Barclays Bank	2.090
9.327	Reinsurance Group of America Inc	Morgan Stanley	21.079	2.128	Repligen Corp	Goldman Sachs	35.623
(26.292)	Rekor Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19.456)	659	Repligen Corp	HSBC	4.929
(8.218)	Rekor Systems Inc	Barclays Bank	1.561	(568)	Repligen Corp	HSBC	(4.249)
(754)	Rekor Systems Inc	Goldman Sachs	(558)	(2.000)	Replimune Group Inc	Barclays Bank	(5.740)
(5.949)	Rekor Systems Inc	Morgan Stanley	1.130	(4.601)	Replimune Group Inc	Goldman Sachs	(16.242)
6.832	Relay Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.942	(1.677)	Replimune Group Inc	Morgan Stanley	(3.141)
6.516	Relay Therapeutics Inc	Barclays Bank	2.988	(52.745)	Repro-Med Systems Inc	Bank of America	
13.113	Reliance Steel & Aluminum Co	Bank of America Merrill Lynch	(32.613)			Merrill Lynch	1.055
2.196	Reliance Steel & Aluminum Co	Barclays Bank	4.106	(10.383)	Repro-Med Systems Inc	Barclays Bank	(1.661)
6.315	Reliance Steel & Aluminum Co	Goldman Sachs	(15.682)	(4.741)	Repro-Med Systems Inc	Goldman Sachs	95
448	Reliance Steel & Aluminum Co	HSBC	(3.409)	(14.462)	Repro-Med Systems Inc	HSBC	(9.256)
				(3.548)	Repro-Med Systems Inc	Morgan Stanley	(568)
				63.193	Republic Bancorp Inc 'A'	Bank of America	
				1.610	Republic Bancorp Inc 'A'	Merrill Lynch	56.874
				3.276	Republic Bancorp Inc 'A'	Barclays Bank	1.803
				805	Republic Bancorp Inc 'A'	Goldman Sachs	2.948
				90.036	Republic First Bancorp Inc	Morgan Stanley	902
				77.434	Republic First Bancorp Inc	Bank of America	(8.103)
				148.695	Republic First Bancorp Inc	Barclays Bank	7.743
				50.307	Republic First Bancorp Inc	Goldman Sachs	(13.383)
						HSBC	(9.558)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
247.629	Republic First Bancorp Inc	Morgan Stanley	23.826	4.311	Rexnord Corp	Barclays Bank	(560)
1.564	Republic Services Inc	Bank of America		(37.472)	Rexnord Corp	Goldman Sachs	23.982
		Merrill Lynch	(1.329)	6.616	Rexnord Corp	Goldman Sachs	(3.056)
(14.427)	Republic Services Inc	Barclays Bank	3.030	(13.023)	Rexnord Corp	Morgan Stanley	1.693
12.016	Republic Services Inc	Barclays Bank	1.098	6.794	Reynolds Consumer	Bank of America	
3.522	Republic Services Inc	Goldman Sachs	(2.994)		Products Inc	Merrill Lynch	(10.123)
1.905	Republic Services Inc	HSBC	(5.467)	12.542	Reynolds Consumer		
7.857	Republic Services Inc	Morgan Stanley	2.836		Products Inc	Barclays Bank	(6.020)
(14.831)	Research Frontiers Inc	Barclays Bank	(1.038)	789	Reynolds Consumer		
(14.789)	Research Frontiers Inc	HSBC	4.585		Products Inc	HSBC	(1.041)
(66.270)	Research Frontiers Inc	Morgan Stanley	(4.639)	26.406	Reynolds Consumer		
3.302	Resideo Technologies Inc	Bank of America			Products Inc	Morgan Stanley	(12.674)
		Merrill Lynch	3.203	(5.830)	RGC Resources Inc	Bank of America	
15.459	Resideo Technologies Inc	Barclays Bank	10.358			Merrill Lynch	(6.122)
5.919	Resideo Technologies Inc	Goldman Sachs	5.741	(6.892)	RGC Resources Inc	Barclays Bank	(3.722)
4.351	Resideo Technologies Inc	HSBC	5.787	(7.553)	RGC Resources Inc	Goldman Sachs	(7.152)
(1.057)	ResMed Inc	Bank of America		(7.122)	RGC Resources Inc	HSBC	(9.615)
		Merrill Lynch	(11.468)	(3.307)	RH	Bank of America	
(83)	ResMed Inc	Barclays Bank	40			Merrill Lynch	(25.596)
2.567	ResMed Inc	Morgan Stanley	(1.232)	203	RH	Bank of America	
(6.381)	Resonant Inc	Barclays Bank	(319)			Merrill Lynch	5.536
(14.699)	Resources Connection Inc	Morgan Stanley	1.323	(2.182)	RH	Barclays Bank	(56.601)
(1.855)	resTORbio Inc'	Bank of America		(109)	RH	Morgan Stanley	(2.827)
		Merrill Lynch	(182)	(2.764)	Rhythm Pharmaceuticals		
(2.339)	resTORbio Inc'	Barclays Bank	(2.569)		Inc	Goldman Sachs	7.698
(10.959)	Retail Opportunity	Bank of America		(8.996)	Rhythm Pharmaceuticals		
	Investments Corp (REIT)	Merrill Lynch	(4.164)		Inc	HSBC	8.096
(11.317)	Retail Opportunity			(4.190)	Rhythm Pharmaceuticals		
	Investments Corp (REIT)	Goldman Sachs	(4.300)		Inc	Morgan Stanley	5.112
(62.522)	Retail Opportunity			(16.139)	Ribbon Communications Inc	Bank of America	
	Investments Corp (REIT)	HSBC	(8.128)			Merrill Lynch	(8.070)
(41.196)	Retail Opportunity			(20.092)	Ribbon Communications Inc	Goldman Sachs	(10.046)
	Investments Corp (REIT)	Morgan Stanley	(824)	8.903	Richmond Mutual BanCorp	Bank of America	
28.905	Retail Properties of America	Bank of America			Inc	Merrill Lynch	6.143
	Inc 'A' (REIT)	Merrill Lynch	10.406	15.914	Richmond Mutual BanCorp		
13.927	Retail Properties of America				Inc	Barclays Bank	(318)
	Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	4.317	27.625	Richmond Mutual BanCorp		
10.411	Retail Properties of America				Inc	Goldman Sachs	19.061
	Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	3.748	11.338	Richmond Mutual BanCorp		
(5.444)	Retail Properties of America				Inc	HSBC	11.451
	Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(1.688)	17.366	Richmond Mutual BanCorp		
2.088	Retail Properties of America				Inc	Morgan Stanley	(347)
	Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	383	23.179	Rigel Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	927
(14.370)	Retractable Technologies			26.729	Rigel Pharmaceuticals Inc	HSBC	14.701
	Inc	Barclays Bank	(431)	18.325	Rimini Street Inc	Morgan Stanley	1.283
1.326	REV Group Inc	Bank of America		3.597	RingCentral Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(27)			Merrill Lynch	96.903
16.478	REV Group Inc	Barclays Bank	15.489	448	RingCentral Inc 'A'	Barclays Bank	7.087
10.326	REV Group Inc	HSBC	4.543	157	RingCentral Inc 'A'	HSBC	327
2.852	Revance Therapeutics Inc	Bank of America		(1.209)	RingCentral Inc 'A'	HSBC	(2.515)
		Merrill Lynch	1.312	222	RingCentral Inc 'A'	Morgan Stanley	2.590
19.098	Revance Therapeutics Inc	Goldman Sachs	8.785	(2.602)	Riot Blockchain Inc	Barclays Bank	(3.070)
4.738	Revance Therapeutics Inc	HSBC	7.426	(1.177)	Riot Blockchain Inc	Goldman Sachs	(3.319)
(2.122)	REVOLUTION Medicines	Bank of America		4.090	Rite Aid Corp	Bank of America	
	Inc	Merrill Lynch	3.332			Merrill Lynch	(5.685)
(12.638)	REVOLUTION Medicines			8.821	Rite Aid Corp	Barclays Bank	(8.292)
	Inc	Barclays Bank	11.501	2.399	Rite Aid Corp	Goldman Sachs	(3.335)
(360)	REX American Resources	Bank of America		146.554	Riverview Bancorp Inc	Bank of America	
	Corp	Merrill Lynch	(6.167)			Merrill Lynch	(35.173)
(150)	REX American Resources			29.024	Riverview Bancorp Inc	Goldman Sachs	(6.966)
	Corp	Goldman Sachs	(2.570)	79.247	Riverview Bancorp Inc	Morgan Stanley	(21.397)
(514)	REX American Resources			15.836	RLI Corp	Morgan Stanley	(10.135)
	Corp	Morgan Stanley	(8.234)	(19.534)	RLJ Lodging Trust (REIT)	HSBC	195
2.320	Rexford Industrial Realty Inc			(49.157)	RLJ Lodging Trust (REIT)	Morgan Stanley	(17.697)
	(REIT)	HSBC	1.740	3.298	RMR Group Inc 'A'	Bank of America	
42.126	Rexford Industrial Realty Inc					Merrill Lynch	(66)
	(REIT)	Morgan Stanley	(62.347)	1.925	RMR Group Inc 'A'	Barclays Bank	173
(5.940)	Rexford Industrial Realty Inc			4.302	RMR Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(86)
	(REIT)	Morgan Stanley	8.791	6.829	RMR Group Inc 'A'	HSBC	(683)
(1.423)	Rexnord Corp	Barclays Bank	185	31.757	RMR Group Inc 'A'	Morgan Stanley	2.858

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(11.680)	Roadrunner Transportation Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.168)	3.500	Royal Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15.085)
(16.747)	Roadrunner Transportation Systems Inc	Goldman Sachs	(1.675)	(2.098)	Royal Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.042
(3.298)	Roadrunner Transportation Systems Inc	HSBC	(726)	6.085	Royal Gold Inc	Barclays Bank	(10.101)
(9.988)	Roadrunner Transportation Systems Inc	Morgan Stanley	(2.497)	(1.762)	Royal Gold Inc	Barclays Bank	2.925
1.182	Robert Half International Inc	HSBC	(2.376)	2.898	Royal Gold Inc	Goldman Sachs	(12.490)
16.453	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	12.669	3.658	Royal Gold Inc	HSBC	17.595
(3.501)	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	(2.696)	(2.401)	Royal Gold Inc	HSBC	(11.549)
(4.936)	ROBLOX Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(83.122)	2.005	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	(3.328)
(5.761)	Rocket Cos Inc 'A'	Barclays Bank	(4.666)	(509)	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	845
(1.727)	Rocket Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.627)	(2.468)	Royalty Pharma Plc 'A'	Barclays Bank	1.481
(1.693)	Rocket Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(3.555)	(11.072)	Royalty Pharma Plc 'A'	Goldman Sachs	15.279
(2.312)	Rocket Pharmaceuticals Inc	HSBC	1.965	1.022	Royalty Pharma Plc 'A'	HSBC	(1.400)
(3.986)	Rocket Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(6.617)	(3.065)	Royalty Pharma Plc 'A'	HSBC	4.199
3.112	Rockwell Automation Inc	Barclays Bank	4.139	(4.639)	Royalty Pharma Plc 'A'	Morgan Stanley	2.783
1.430	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs	(1.745)	(50.215)	RPC Inc	Bank of America Merrill Lynch	53.730
3.176	Rockwell Automation Inc	HSBC	(22.518)	(81.224)	RPC Inc	Barclays Bank	10.246
(19.921)	Rockwell Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.269	(4.187)	RPC Inc	Morgan Stanley	275
(7.977)	Rockwell Medical Inc	Barclays Bank	(160)	(7.036)	RPM International Inc	HSBC	30.888
(87.368)	Rockwell Medical Inc	Morgan Stanley	(1.756)	(14.226)	RPM International Inc	Morgan Stanley	9.816
3.344	Rocky Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.815	8.971	RPT Realty (REIT)	Barclays Bank	2.691
10.019	Rocky Brands Inc	Morgan Stanley	51.598	14.418	RPT Realty (REIT)	Goldman Sachs	5.911
(618)	Rogers Corp	Barclays Bank	(2.589)	34.001	RPT Realty (REIT)	HSBC	(1.020)
(4.820)	Rogers Corp	Goldman Sachs	(22.859)	92.757	RPT Realty (REIT)	Morgan Stanley	27.827
(1.434)	Rogers Corp	HSBC	(9.565)	68.267	RR Donnelley & Sons Co	Bank of America Merrill Lynch	111.958
(5.316)	Rogers Corp	Morgan Stanley	(22.274)	11.185	RR Donnelley & Sons Co	Goldman Sachs	18.343
765	Roku Inc	Bank of America Merrill Lynch	26.224	(15.110)	Rubicon Technology Inc	Morgan Stanley	(4.231)
1.426	Roku Inc	Barclays Bank	(727)	(9.223)	Rubius Therapeutics Inc	Barclays Bank	2.490
181	Roku Inc	Morgan Stanley	(92)	7.614	Rush Enterprises Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(30.456)
6.869	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13.807)	23.453	Rush Enterprises Inc 'A'	Barclays Bank	(8.443)
9.214	Rollins Inc	Barclays Bank	(2.856)	7.954	Rush Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	(31.816)
29.530	Rollins Inc	Goldman Sachs	(59.355)	616	Rush Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	(12)
6.584	Rollins Inc	HSBC	(20.608)	5.156	Rush Enterprises Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(17.118)
2.733	Rollins Inc	Morgan Stanley	(847)	12.287	Rush Enterprises Inc 'B'	Barclays Bank	6.635
(3.461)	Root Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	—	8.302	Rush Enterprises Inc 'B'	Goldman Sachs	(27.563)
(1.494)	Root Inc 'A'	Barclays Bank	(284)	4.585	Rush Enterprises Inc 'B'	HSBC	(8.115)
5.514	Root Inc 'A'	Goldman Sachs	—	8.509	Rush Enterprises Inc 'B'	Morgan Stanley	4.595
879	Roper Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.447	8.643	Rush Street Interactive Inc	Barclays Bank	(2.420)
1.961	Roper Technologies Inc	Barclays Bank	10.378	3.951	Rush Street Interactive Inc	Goldman Sachs	1.541
130	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs	2.206	24.000	Rush Street Interactive Inc	HSBC	240
1.088	Roper Technologies Inc	HSBC	7.432	3.466	Rush Street Interactive Inc	Morgan Stanley	(970)
5.140	Roper Technologies Inc	Morgan Stanley	23.591	9.868	Ruth's Hospitality Group Inc	Morgan Stanley	808
(391)	Ross Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	794	11.314	Ryder System Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39.893)
(9.212)	Ross Stores Inc	Goldman Sachs	13.774	2.906	Ryder System Inc	Barclays Bank	523
(536)	Ross Stores Inc	HSBC	2.450	13.844	Ryder System Inc	Goldman Sachs	(58.709)
(23.029)	Ross Stores Inc	Morgan Stanley	(66.324)	3.990	Ryder System Inc	HSBC	(15.209)
(15.243)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(139.056)	14.256	Ryder System Inc	Morgan Stanley	11.321
(19.334)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Barclays Bank	(143.072)	47.156	Ryerson Holding Corp	Goldman Sachs	(18.862)
(2.997)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs	(27.759)	10.077	Ryerson Holding Corp	Morgan Stanley	(1.915)
(6.121)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	(45.296)	(2.978)	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(5.822)
				854	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(228)
				(1.359)	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	(3.226)
				4.116	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	10.743
				(2.571)	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(427)
				2.495	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	948
				(3.428)	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(3.906)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
362	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	945	(7.084)	Sally Beauty Holdings Inc	Bank of America	
(421)	S&P Global Inc	Bank of America		(13.997)	Sally Beauty Holdings Inc	Merrill Lynch	10.626
(5.100)	S&P Global Inc	Merrill Lynch	(1.903)	(13.089)	Sally Beauty Holdings Inc	Barclays Bank	(5.879)
(6.209)	S&P Global Inc	Barclays Bank	(2.142)	1.827	Sanderson Farms Inc	Goldman Sachs	19.634
(900)	S&P Global Inc	Goldman Sachs	(20.524)	3.329	Sanderson Farms Inc	Bank of America	
(31.691)	S&T Bancorp Inc	Morgan Stanley	(315)	8.091	Sanderson Farms Inc	Merrill Lynch	(22.417)
(32.783)	S&T Bancorp Inc	Barclays Bank	6.972	448	Sanderson Farms Inc	Barclays Bank	(21.772)
(21.581)	S&T Bancorp Inc	Goldman Sachs	6.557	27.970	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs	(99.277)
(33.929)	S&T Bancorp Inc	HSBC	(15.754)			HSBC	(104)
(36.764)	Sabra Health Care Inc (REIT)	Morgan Stanley	7.464	38.376	Sandy Spring Bancorp Inc	Bank of America	
6.193	Sabra Health Care Inc (REIT)	Bank of America		24.986	Sandy Spring Bancorp Inc	Merrill Lynch	(27.131)
(81.269)	Sabra Health Care Inc (REIT)	Merrill Lynch	(11.397)	9.584	Sandy Spring Bancorp Inc	Barclays Bank	2.686
(20.357)	Sabra Health Care Inc (REIT)	Bank of America	1.920	11.224	Sangamo Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(24.236)
15.738	Sabra Health Care Inc (REIT)	Merrill Lynch		1.524	Sangamo Therapeutics Inc	Morgan Stanley	671
(23.334)	Sabra Health Care Inc (REIT)	Barclays Bank	3.251	3.965	Sangamo Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.122
37.747	Sabra Health Care Inc (REIT)	Goldman Sachs	(6.311)	(30.134)	Sanmina Corp	HSBC	930
(12.761)	Sabre Corp	HSBC	(4.879)	(2.968)	Sanmina Corp	Morgan Stanley	397
(96.079)	Safe Bulkers Inc			(971)	Sanmina Corp	Bank of America	4.520
(77.943)	Safe Bulkers Inc			38.064	Santander Consumer USA Holdings Inc	Barclays Bank	1.395
(219.081)	Safeguard Scientifics Inc	Morgan Stanley	933	4.177	Santander Consumer USA Holdings Inc	Goldman Sachs	146
(9.877)	Safeguard Scientifics Inc	Morgan Stanley	(1.510)	18.074	Santander Consumer USA Holdings Inc	Merrill Lynch	46.438
(6.938)	Safeguard Scientifics Inc	Morgan Stanley	(6.891)	(52.923)	Sapiens International Corp NV	Goldman Sachs	5.096
(2.436)	Safety Insurance Group Inc	Barclays Bank	69.177	(6.860)	Sapiens International Corp NV	Morgan Stanley	(1.371)
(4.838)	Safety Insurance Group Inc	Goldman Sachs	13.250	(2.625)	Sarepta Therapeutics Inc	Barclays Bank	4.095
(16.612)	Saga Communications Inc 'A'	Barclays Bank	(8.763)	(1.021)	Sarepta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1.593
(771)	Sage Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(790)	9.076	Satsuma Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.906)
(1.052)	Sage Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(278)	6.906	Saul Centers Inc (REIT)	Bank of America	
(388)	Sage Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1.598	7.822	Saul Centers Inc (REIT)	Merrill Lynch	9.461
(2.330)	Sage Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.904	10.277	Saul Centers Inc (REIT)	Barclays Bank	16.113
(848)	Saia Inc	Goldman Sachs	1.222	18.567	Saul Centers Inc (REIT)	Goldman Sachs	14.079
1.887	Saia Inc	Morgan Stanley	4.217	(58.571)	Savara Inc	Morgan Stanley	38.248
(2.435)	Saia Inc	Bank of America		(3.639)	SB Financial Group Inc	Barclays Bank	(7.029)
1.210	Saia Inc	Merrill Lynch	8.845	(5.100)	SB Financial Group Inc	Bank of America	(4.258)
(798)	Saia Inc	Bank of America		174	SBA Communications Corp (REIT)	Merrill Lynch	(612)
4.066	Saia Inc	Merrill Lynch	(8.832)	1.900	SBA Communications Corp (REIT)	Barclays Bank	
(3.981)	Saia Inc	Barclays Bank	(6.697)	1.254	SBA Communications Corp (REIT)	Goldman Sachs	18.278
(3.768)	Saia Inc	Barclays Bank	619	21.538	ScanSource Inc	Morgan Stanley	1.981
5.930	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs	8.323	16.685	ScanSource Inc	Bank of America	
19.872	Sailpoint Technologies Holdings Inc	HSBC	24.214	4.296	ScanSource Inc	Merrill Lynch	(7.969)
30.521	Sailpoint Technologies Holdings Inc	HSBC	34.436	5.551	ScanSource Inc	Barclays Bank	(3.003)
17.277	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	(10.362)	11.604	Schlumberger NV	HSBC	(3.265)
5.863	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Bank of America	9.758	39.915	Schlumberger NV	Morgan Stanley	(910)
(6.771)	salesforce.com Inc	Merrill Lynch		29.964	Schlumberger NV	Bank of America	
3.032	Salisbury Bancorp Inc	Goldman Sachs	67.988	40.466	Schneider National Inc 'B'	Merrill Lynch	(31.563)
6.252	Salisbury Bancorp Inc	Barclays Bank	1.876	22.526	Schneider National Inc 'B'	Barclays Bank	(14.769)
7.461	Salisbury Bancorp Inc	Goldman Sachs	(156.004)	23.626	Schneider National Inc 'B'	Goldman Sachs	(81.502)
6.465	Salisbury Bancorp Inc	Merrill Lynch	(667)	25.703	Schneider National Inc 'B'	HSBC	(49.864)
		Barclays Bank	1.876	81.395	Schneider National Inc 'B'	Morgan Stanley	(30.116)
		Goldman Sachs	(1.641)	21.814	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Barclays Bank	4.145
		HSBC	2.327	8.952	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Goldman Sachs	(15.487)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
13.536	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Morgan Stanley	2.572	(1.157)	Seagate Technology Holdings Plc	Barclays Bank	2.777
(2.369)	Scholar Rock Holding Corp	Bank of America		(682)	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs	5.783
(4.441)	Scholar Rock Holding Corp	Merrill Lynch	3.648	(31.839)	Seagate Technology Holdings Plc	Morgan Stanley	64.358
(8.322)	Scholar Rock Holding Corp	Barclays Bank	(489)	(1.042)	Seagen Inc	Bank of America	(7.679)
(7.356)	Scholastic Corp	Morgan Stanley	(243)	(3.332)	Seagen Inc	Barclays Bank	(5.598)
(2.274)	Schrodinger Inc	Bank of America	(5.738)	15.352	Sealed Air Corp	Barclays Bank	3.743
(4.135)	Schrodinger Inc	Merrill Lynch	(19.852)	4.577	Sealed Air Corp	Goldman Sachs	1.465
(7.800)	Schrodinger Inc	Barclays Bank	(19.931)	7.298	Sealed Air Corp	HSBC	12.506
(1.623)	Schrodinger Inc	Goldman Sachs	(61.901)	17.491	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	6.012
(1.623)	Schrodinger Inc	HSBC	(10.013)	6.906	SeaSpine Holdings Corp	Goldman Sachs	2.555
(294)	Schrodinger Inc	Morgan Stanley	(1.417)	20.400	SeaSpine Holdings Corp	Morgan Stanley	(18.972)
(13.923)	Schweitzer-Mauduit International Inc	Bank of America	41.560	5.260	SeaWorld Entertainment Inc	Bank of America	
(13.040)	Schweitzer-Mauduit International Inc	Barclays Bank		12.548	SeaWorld Entertainment Inc	Merrill Lynch	7.968
(15.131)	Schweitzer-Mauduit International Inc	Goldman Sachs	72.939	21.716	SeaWorld Entertainment Inc	Barclays Bank	14.015
(15.235)	Schweitzer-Mauduit International Inc	HSBC	102.437	(3.416)	SecureWorks Corp 'A'	Goldman Sachs	45.821
1.587	Science Applications International Corp	Morgan Stanley	55.817	(866)	SecureWorks Corp 'A'	Bank of America	(1.571)
(7.852)	Science Applications International Corp	Bank of America	1.895	(5.216)	SecureWorks Corp 'A'	Merrill Lynch	(1.571)
2.757	Science Applications International Corp	Merrill Lynch	1.895	(37.301)	SecureWorks Corp 'A'	Barclays Bank	312
(7.209)	Science Applications International Corp	Barclays Bank	(629)	16.341	Security National Financial Corp 'A'	HSBC	(5.060)
1.365	Science Applications International Corp	Barclays Bank	221	26.337	Security National Financial Corp 'A'	Morgan Stanley	13.428
(11.822)	Science Applications International Corp	Barclays Bank		25.243	Security National Financial Corp 'A'	Bank of America	(3.922)
1.205	Science Applications International Corp	Goldman Sachs	(8.795)	5.632	Security National Financial Corp 'A'	Barclays Bank	(3.424)
(14.118)	Science Applications International Corp	Goldman Sachs	250	14.559	Security National Financial Corp 'A'	Goldman Sachs	(6.058)
(2.541)	Scientific Games Corp 'A'	HSBC	5.320	(2.073)	Seelos Therapeutics Inc	HSBC	2.196
(7.870)	Scientific Games Corp 'A'	Morgan Stanley	(1.130)	(3.343)	Seer Inc	Morgan Stanley	(1.893)
(4.783)	Scientific Games Corp 'A'	Bank of America		(1.364)	SEI Investments Co	Bank of America	
5.189	Scopus Biopharma Inc	Merrill Lynch	(31.766)	(5.583)	SEI Investments Co	Merrill Lynch	(669)
19.789	Scorpio Tankers Inc	Barclays Bank	(33.019)	(3.167)	SEI Investments Co	Barclays Bank	(3.049)
683	Scotts Miracle-Gro Co	HSBC	(89.481)	(3.160)	SEI Investments Co	Goldman Sachs	(778)
669	Scotts Miracle-Gro Co	Goldman Sachs	6.901	13.779	Select Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.212)
(592)	Scotts Miracle-Gro Co	Morgan Stanley	(5.145)	48.236	Select Bancorp Inc	Bank of America	
(13.909)	scPharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(1.168)	13.403	Select Bancorp Inc	Merrill Lynch	3.858
(15.143)	scPharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.144)	28.109	Select Bancorp Inc	Barclays Bank	(6.753)
(8.135)	scPharmaceuticals Inc	Bank of America	1.012	(2.103)	Select Energy Services Inc 'A'	Goldman Sachs	3.753
4.414	Sculptor Capital Management Inc	Merrill Lynch	3.060	(20.648)	Select Energy Services Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.935)
20.160	Sculptor Capital Management Inc	Barclays Bank	909	(28.160)	Select Energy Services Inc 'A'	Barclays Bank	(210)
4.619	Sculptor Capital Management Inc	Goldman Sachs	1.790	(54.852)	Select Energy Services Inc 'A'	Goldman Sachs	15.692
(72)	Seaboard Corp	Merrill Lynch	4.282	6.894	Select Interior Concepts Inc 'A'	HSBC	18.867
(88)	Seaboard Corp	Barclays Bank	800	9.007	Select Interior Concepts Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.485)
(122)	Seaboard Corp	Goldman Sachs	11.346	7.505	Select Medical Holdings Corp	HSBC	3.723
(149)	Seaboard Corp	HSBC	18.215	14.072	Select Medical Holdings Corp	Morgan Stanley	(3.783)
(511)	Seaboard Corp	Morgan Stanley	1.930	10.483	Select Medical Holdings Corp	Bank of America	15.685
(143.258)	SeaChange International Inc	Bank of America		17.233	Selecta Biosciences Inc	Merrill Lynch	4.222
(37.439)	Seacoast Banking Corp of Florida	Merrill Lynch	(7.163)	10.124	Selecta Biosciences Inc	Barclays Bank	
(8.369)	Seacoast Banking Corp of Florida	Goldman Sachs	37.439	23.950	Selecta Biosciences Inc	Morgan Stanley	3.145
(18.345)	Seacoast Banking Corp of Florida	HSBC	4.603	1.019	Selecta Biosciences Inc	Bank of America	24.126
		Morgan Stanley	9.173			Merrill Lynch	9.112
						Barclays Bank	33.530
						Goldman Sachs	1.549
						HSBC	

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
7.256 (10.927)	Selecta Biosciences Inc Selective Insurance Group Inc	Morgan Stanley HSBC	6.530 16.172	(22.683) (51.369)	Service Properties Trust (REIT) Service Properties Trust (REIT)	HSBC Morgan Stanley	 (29.261) (84.759)
(16.293) (26.870)	Selective Insurance Group Inc Selectquote Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	32.423 23.298	2.051 87	ServiceNow Inc ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	 18.471 (216)
(17.274) (6.821)	Selectquote Inc Selectquote Inc	Barclays Bank Goldman Sachs	5.517 2.270	115 2.615	ServiceNow Inc ServiceNow Inc	HSBC Morgan Stanley	1.725 (9.823)
(8.007) (5.588)	Selectquote Inc Selectquote Inc	HSBC Morgan Stanley	54.744 2.179	(140.523) (60.057)	ServiceSource International Inc ServiceSource International Inc	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	 8.431 601
(8.995) (12.612)	Sempra Energy Sempra Energy	Barclays Bank Goldman Sachs	21.433 20.418 25.195	(24.738) 8.754	ServiceSource International Inc ServisFirst Bancshares Inc	Goldman Sachs Morgan Stanley	1.484 9.192
(9.334) (2.430)	Sempra Energy Sempra Energy	HSBC Morgan Stanley	24.196 5.516	(43.860) (54.086)	SFL Corp Ltd SFL Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	 7.456
10.877 (943)	Semtech Corp Semtech Corp	Barclays Bank Goldman Sachs	7.723 (1.848)	(40.208) 8.397	SFL Corp Ltd Shake Shack Inc 'A'	Barclays Bank Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	15.144 6.835 74.652
370 (6.501)	Semtech Corp Semtech Corp	Goldman Sachs HSBC	725 (9.947)	5.512 13.329	Shake Shack Inc 'A' Shake Shack Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	40.350 100.521
(12.453) 544	Semtech Corp Seneca Foods Corp 'A'	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(8.842) (555)	2.036 7.877	Shake Shack Inc 'A' Shake Shack Inc 'A'	HSBC Morgan Stanley	21.679 2.515
3.911 1.953	Seneca Foods Corp 'A' Seneca Foods Corp 'A'	Barclays Bank Goldman Sachs	(156) (1.992)	(6.506) (5.933)	Sharps Compliance Corp SharpSpring Inc	Barclays Bank Bank of America Merrill Lynch	10.865 7.416
2.210 9.305	Seneca Foods Corp 'A' Seneca Foods Corp 'A'	HSBC Morgan Stanley	(3.334) (372)	(13.464) (4.790)	SharpSpring Inc Shattuck Labs Inc	Barclays Bank Bank of America Merrill Lynch	18.715 (1.581)
(6.937) (9.900)	Sensata Technologies Holding Plc Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	(19.289) (11.979)	(1.159) (74)	Shattuck Labs Inc Shenandoah Telecommunications Co	Barclays Bank Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	(1.901) 67
(12.810) (25.829)	Sensata Technologies Holding Plc Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(20.913) (31.253)	(5.734) (24.650)	Shenandoah Telecommunications Co Shenandoah Telecommunications Co	Barclays Bank HSBC Morgan Stanley Barclays Bank	 (3.842) 22.432
2.418 1.776	Sensei Biotherapeutics Inc Sensei Biotherapeutics Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	8.052 (2.220)	6.505 102	Sherwin-Williams Co Sherwin-Williams Co	Barclays Bank Goldman Sachs	(12.415) (71)
4.805 5.206	Sensei Biotherapeutics Inc Sensei Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs Morgan Stanley	16.001 (6.508)	4.665 6.907	Sherwin-Williams Co Sherwin-Williams Co	HSBC Morgan Stanley	(23.885) (13.884)
(16.531) (6.621)	Sensient Technologies Corp Sensient Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	(20.168) 1.091	(1.254) (1.442)	Shift4 Payments Inc 'A' Shift4 Payments Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	(9.581) (952)
(507) (40.697)	Sensient Technologies Corp Sensient Technologies Corp	Goldman Sachs Morgan Stanley	(619) 6.251	(626) (1.370)	Shift4 Payments Inc 'A' Shift4 Payments Inc 'A'	Goldman Sachs HSBC	(4.783) (13.289)
(1.816) (7.789)	Seres Therapeutics Inc Seres Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	(100) (712)	(13.086) (2.920)	Shift4 Payments Inc 'A' Shoals Technologies Group Inc 'A'	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(8.637) (17.286)
(1.120) (1.102)	Seres Therapeutics Inc Seres Therapeutics Inc	Goldman Sachs Morgan Stanley	436 248	(5.468) 2.631	Shoals Technologies Group Inc 'A' Shockwave Medical Inc	Barclays Bank Barclays Bank	(10.061) 14.734
14.863 (3.599)	Seritage Growth Properties (REIT) Service Corp International	Bank of America Merrill Lynch	12.634 2.519	1.477 237	Shockwave Medical Inc Shockwave Medical Inc	Goldman Sachs HSBC	33.115 3.044
(11.222) 8.637	Service Corp International Service Corp International	Barclays Bank Barclays Bank	(2.581) 1.987	(461) 1.710	Shockwave Medical Inc Shoe Carnival Inc	Morgan Stanley Barclays Bank	(2.582) 1.488
(3.185) 652	Service Corp International Service Corp International	Goldman Sachs Goldman Sachs	2.230 218	3.795 13.613	Shore Bancshares Inc Shore Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	 911 3.267
(10.449) 6.488	Service Corp International Service Corp International	Morgan Stanley Morgan Stanley	(2.403) 1.492	17.323 22.250	Shore Bancshares Inc Shore Bancshares Inc	Goldman Sachs Morgan Stanley	4.158 5.340
(12.608) (47.656)	Service Properties Trust (REIT) Service Properties Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch Barclays Bank	(18.408) (77.718)	(9.082) (8.775)	ShotSpotter Inc ShotSpotter Inc	Barclays Bank HSBC	11.353 (81.520)
(28.979)	Service Properties Trust (REIT)	Goldman Sachs	(32.762)	(1.948) 1.866	ShotSpotter Inc Shutterstock Inc	Morgan Stanley Barclays Bank	2.435 4.684
				4.106 930	Shutterstock Inc Shutterstock Inc	Goldman Sachs HSBC	22.624 8.826
				3.072	Shutterstock Inc	Morgan Stanley	7.711

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(7.468)	Shyft Group Inc	Goldman Sachs	(3.883)	(1.988)	Simpson Manufacturing Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.326
(11.868)	Shyft Group Inc	HSBC	(29.670)	(6.711)	Simpson Manufacturing Co Inc	Barclays Bank	3.758
(35.496)	Shyft Group Inc	Morgan Stanley	(9.939)	(28.637)	Simpson Manufacturing Co Inc	HSBC	120.848
8.544	SI-BONE Inc	Goldman Sachs	(11.705)	1.792	Simpson Manufacturing Co Inc	HSBC	(7.562)
5.115	SI-BONE Inc	Morgan Stanley	(12.071)	(23.027)	Simpson Manufacturing Co Inc	Morgan Stanley	12.895
(67.758)	Siebert Financial Corp	Barclays Bank	(22.360)	(1.814)	Simulations Plus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.884)
(760)	Siebert Financial Corp	Goldman Sachs	61	(2.374)	Simulations Plus Inc	Barclays Bank	(2.944)
(1.050)	Siebert Financial Corp	HSBC	(452)	(4.473)	Simulations Plus Inc	Goldman Sachs	(7.112)
(659)	Siebert Financial Corp	Morgan Stanley	(217)	(6.349)	Simulations Plus Inc	Morgan Stanley	(7.873)
777	Sienna Biopharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(11)	10.252	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	9.432
(9.983)	Sientra Inc	Barclays Bank	1.997	1.168	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Barclays Bank	1.156
(18.951)	Sientra Inc	HSBC	(6.064)	8.663	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	HSBC	3.292
28.046	Sierra Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(3.646)	36.609	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	36.243
20.395	Sierra Bancorp	Goldman Sachs	(2.651)	104.816	Sirius XM Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	39.118
67.340	Sierra Bancorp	Morgan Stanley	42.424	446.599	Sirius XM Holdings Inc	Barclays Bank	49.126
(18.449)	SIGA Technologies Inc	Goldman Sachs	(3.136)	212.453	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs	47.739
(26.087)	SIGA Technologies Inc	HSBC	(2.609)	64.678	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	6.840
(74.641)	SIGA Technologies Inc	Morgan Stanley	(6.718)	(229.460)	SiriusPoint Ltd	Barclays Bank	16.062
998	Sigilon Therapeutics Inc	Barclays Bank	(40)	(49.585)	SiriusPoint Ltd	HSBC	(10.909)
10.549	Sigilon Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(20.887)	(105.346)	SiriusPoint Ltd	Morgan Stanley	7.374
2.149	Sigilon Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(86)	13.405	SITE Centers Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	3.485
572	Signature Bank	Bank of America Merrill Lynch	1.888	25.624	SITE Centers Corp (REIT)	Barclays Bank	9.481
4.706	Signature Bank	Barclays Bank	48.096	74.764	SITE Centers Corp (REIT)	Goldman Sachs	19.439
115	Signature Bank	Goldman Sachs	380	20.389	SITE Centers Corp (REIT)	Morgan Stanley	7.544
1.647	Signature Bank	HSBC	(5.172)	4.626	SiteOne Landscape Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.491
8.057	Signet Jewelers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(39.882)	17.011	SiteOne Landscape Supply Inc	Barclays Bank	(43.037)
2.187	Signet Jewelers Ltd	Morgan Stanley	6.474	9.343	SiteOne Landscape Supply Inc	Goldman Sachs	38.540
9.344	Signify Health Inc 'A'	Morgan Stanley	5.326	9.371	SiteOne Landscape Supply Inc	HSBC	(275.039)
(796)	Silgan Holdings Inc	Barclays Bank	836	8.547	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	(30.442)
(9.326)	Silgan Holdings Inc	HSBC	8.487	(1.377)	SiTime Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20.999)
(25.369)	Silgan Holdings Inc	Morgan Stanley	26.637	(2.035)	SiTime Corp	Barclays Bank	(5.014)
6.305	Silicon Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	76.543	(7.112)	SiTime Corp	Goldman Sachs	(71.877)
20.382	Silicon Laboratories Inc	Barclays Bank	91.107	(285)	SiTime Corp	Morgan Stanley	(878)
10.024	Silicon Laboratories Inc	Goldman Sachs	114.132	(14.402)	SITO Mobile Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1
10.401	Silicon Laboratories Inc	HSBC	103.600	(66.470)	SITO Mobile Ltd	Goldman Sachs	7
30.013	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	134.159	5.866	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.663
9.700	Silk Road Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	19.788	1.053	Six Flags Entertainment Corp	Barclays Bank	1.793
2.158	Silk Road Medical Inc	Goldman Sachs	4.402	7.399	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs	21.309
11.465	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	21.784	470	Six Flags Entertainment Corp	HSBC	1.072
11.782	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Merrill Lynch	21.784	37.779	Six Flags Entertainment Corp	Morgan Stanley	54.919
11.133	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Barclays Bank	8.130	1.153	SJW Group	Bank of America Merrill Lynch	1.487
11.604	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Goldman Sachs	21.153	2.393	SJW Group	Barclays Bank	168
11.604	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	HSBC	22.164	9.698	SJW Group	Goldman Sachs	12.510
21.829	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	HSBC	22.164	3.506	SJW Group	Morgan Stanley	245
(365)	Silvergate Capital Corp 'A'	Morgan Stanley	15.062	5.616	Skechers USA Inc 'A'	Barclays Bank	4.121
(1.926)	Silvergate Capital Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7.358)				
(659)	Silvergate Capital Corp 'A'	Barclays Bank	(10.285)				
(10.133)	Simmons First National Corp 'A'	Goldman Sachs	(13.285)				
(19.893)	Simmons First National Corp 'A'	HSBC	(8.005)				
(8.295)	Simon Property Group Inc (REIT)	Morgan Stanley	(2.586)				
1.892	Simon Property Group Inc (REIT)	Barclays Bank	(33.373)				
(4.247)	Simply Good Foods Co	Morgan Stanley	7.284				
(5.379)	Simply Good Foods Co	Barclays Bank	595				
(5.995)	Simply Good Foods Co	Goldman Sachs	(15.276)				
		Morgan Stanley	839				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
24.354	Skechers USA Inc 'A'	Goldman Sachs	(40.915)	2.840	Snap-on Inc	Bank of America	
509	Skechers USA Inc 'A'	HSBC	(79)			Merrill Lynch	4.345
1.579	Skechers USA Inc 'A'	Morgan Stanley	(76)	4.210	Snap-on Inc	Goldman Sachs	6.441
835	Skillz Inc	Barclays Bank	(167)	2.207	Snap-on Inc	Morgan Stanley	2.737
888	Skillz Inc	Morgan Stanley	568	(2.750)	Snowflake Inc 'A'	Bank of America	
(1.379)	Skyline Champion Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(69.795)
		Merrill Lynch	(12.728)	(849)	Snowflake Inc 'A'	Barclays Bank	(3.513)
(1.209)	Skyline Champion Corp	Barclays Bank	(9.914)	(517)	Snowflake Inc 'A'	Goldman Sachs	(10.248)
(1.816)	Skyline Champion Corp	Goldman Sachs	(93)	(4.698)	Snowflake Inc 'A'	Morgan Stanley	(19.308)
(17.734)	Skyline Champion Corp	Morgan Stanley	(145.419)	29.936	SOC Telemed Inc	Bank of America	
1.154	SkyWater Technology Inc	Barclays Bank	(3.762)			Merrill Lynch	(47.000)
(6.127)	SkyWest Inc	Goldman Sachs	4.350	27.377	SOC Telemed Inc	Barclays Bank	(41.066)
(31.012)	SkyWest Inc	HSBC	(10.544)	7.712	SOC Telemed Inc	Goldman Sachs	(12.108)
(9.914)	SkyWest Inc	Morgan Stanley	(7.832)	3.092	SOC Telemed Inc	HSBC	(4.638)
(2.117)	Skyworks Solutions Inc	Bank of America		14.608	SOC Telemed Inc	Morgan Stanley	(21.912)
		Merrill Lynch	(8.743)	335	SolarEdge Technologies Inc	Bank of America	
(4.887)	Skyworks Solutions Inc	Barclays Bank	(5.473)			Merrill Lynch	1.865
(1.258)	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs	(6.227)	(4.889)	SolarEdge Technologies Inc	Barclays Bank	(16.193)
5.541	Skyworks Solutions Inc	HSBC	40.494	683	SolarEdge Technologies Inc	Barclays Bank	2.213
(1.580)	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	(1.968)	(1.435)	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs	(57.400)
947	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	1.061	(15.747)	Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'		
3.702	SL Green Realty Corp (REIT)	Barclays Bank	2.406	(6.074)	Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	Barclays Bank	(1.102)
4.279	SL Green Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	25.246	(25.675)	Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	Goldman Sachs	3.037
1.683	SL Green Realty Corp (REIT)	HSBC	11.360	(32.464)	Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	HSBC	8.473
2.044	SL Green Realty Corp (REIT)			(1.532)	SolarWinds Corp	Morgan Stanley	(2.272)
2.406	Slack Technologies Inc 'A'	Bank of America	1.329	1.955	SolarWinds Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	6.929			Merrill Lynch	(112)
4.601	Sleep Number Corp	Barclays Bank	35.658	14.736	SolarWinds Corp	Barclays Bank	743
1.730	Sleep Number Corp	Goldman Sachs	4.100	(1.343)	SolarWinds Corp	Goldman Sachs	(6.484)
(41.109)	SLM Corp	Bank of America		666	SolarWinds Corp	HSBC	526
		Merrill Lynch	(16.033)	(28.931)	SolarWinds Corp	Morgan Stanley	13
(52.781)	SLM Corp	Morgan Stanley	(28.502)	4.659	SolarWinds Corp	Morgan Stanley	12.730
3.766	SM Energy Co	HSBC	11.712	(31.398)	Soleno Therapeutics Inc	Bank of America	(2.050)
7.358	SMART Global Holdings Inc	Goldman Sachs	14.305			Merrill Lynch	(628)
6.373	SMART Global Holdings Inc	Morgan Stanley	1.006	(113.435)	Soleno Therapeutics Inc	Barclays Bank	(1.134)
3.890	SmartFinancial Inc	Bank of America		7.659	Solid Biosciences Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.918			Merrill Lynch	1.915
27.246	SmartFinancial Inc	Barclays Bank	4.087	7.494	Solid Biosciences Inc	Goldman Sachs	1.874
36.172	SmartFinancial Inc	Goldman Sachs	27.129	21.982	Solid Biosciences Inc	Morgan Stanley	(2.198)
8.372	SmartFinancial Inc	HSBC	7.284	(13.819)	Soliton Inc	Barclays Bank	138
26.213	SmartFinancial Inc	Morgan Stanley	3.932	(1.198)	Soliton Inc	Goldman Sachs	12
4.096	Smartsheet Inc 'A'	Bank of America		349	Sonic Automotive Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	20.029			Merrill Lynch	(304)
(6.114)	Smartsheet Inc 'A'	Bank of America		12.589	Sonic Automotive Inc 'A'	Barclays Bank	(629)
		Merrill Lynch	(21.572)	2.805	Sonic Automotive Inc 'A'	Morgan Stanley	54
(2.594)	Smartsheet Inc 'A'	Barclays Bank	(2.361)	5.689	Sonoco Products Co	Bank of America	
2.341	Smartsheet Inc 'A'	Goldman Sachs	11.447			Merrill Lynch	(9.102)
(6.428)	Smartsheet Inc 'A'	Goldman Sachs	(31.787)	4.000	Sonoco Products Co	Barclays Bank	(1.520)
411	Smartsheet Inc 'A'	HSBC	2.100	(7.562)	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	12.099
(2.485)	Smartsheet Inc 'A'	HSBC	(13.172)	1.556	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	(2.490)
1.571	Smartsheet Inc 'A'	Morgan Stanley	1.430	(6.105)	Sonoco Products Co	HSBC	5.983
(2.621)	Smartsheet Inc 'A'	Morgan Stanley	(2.385)	1.015	Sonoco Products Co	HSBC	694
(10.548)	SmileDirectClub Inc	Barclays Bank	(2.848)	(10.054)	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	3.821
(38.714)	Smith Micro Software Inc	Bank of America		16.014	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	(6.085)
		Merrill Lynch	(15.486)	13.335	Sonos Inc	Bank of America	
(66.584)	Smith Micro Software Inc	Barclays Bank	(27.965)			Merrill Lynch	42.243
(7.842)	Smith Micro Software Inc	Goldman Sachs	(1.318)	6.510	Sonos Inc	Barclays Bank	6.380
(12.679)	Smith Micro Software Inc	Morgan Stanley	(5.325)	12.877	Sonos Inc	Goldman Sachs	40.305
928	Snap Inc 'A'	Bank of America		1.735	Sonos Inc	HSBC	3.730
		Merrill Lynch	7.619	7.708	Sonos Inc	Morgan Stanley	7.554
(923)	Snap Inc 'A'	Bank of America		(3.777)	Sorrento Therapeutics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.578)			Merrill Lynch	(3.286)
(8.357)	Snap Inc 'A'	Barclays Bank	(16.714)	(3.043)	Sorrento Therapeutics Inc	Barclays Bank	(1.035)
(19.445)	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(159.643)	6.481	Sorrento Therapeutics Inc	Barclays Bank	2.204
2.655	Snap Inc 'A'	Morgan Stanley	5.310	2.240	Sorrento Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1.949

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.309)	Sorrento Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(445)	3.790	Spectrum Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.344)
7.740	Sotera Health Co	Bank of America Merrill Lynch	16.254	92.694	Spectrum Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	927
17.504	Sotera Health Co	Barclays Bank	4.026	82.779	Spectrum Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	19.039
20.236	Sotera Health Co	Goldman Sachs	42.496	86.318	Spectrum Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	863
2.339	Sotera Health Co	HSBC	164	10.841	Spectrum Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2.493
22.390	Sotera Health Co	Morgan Stanley	5.149	10.447	Spero Therapeutics Inc	Goldman Sachs	11.492
(56.768)	South Jersey Industries Inc	Morgan Stanley	(10.786)	6.500	Spero Therapeutics Inc	Morgan Stanley	3.900
51.353	South Plains Financial Inc	Barclays Bank	17.974	(20.013)	Spire Inc	Bank of America Merrill Lynch	56.437
3.099	South Plains Financial Inc	Goldman Sachs	403	(6.452)	Spire Inc	Barclays Bank	4.409
4.138	South Plains Financial Inc	HSBC	1.448	(5.303)	Spire Inc	Goldman Sachs	12.043
21.297	South Plains Financial Inc	Morgan Stanley	7.454	(27.915)	Spire Inc	HSBC	157.161
10.416	South State Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8.854)	(40.916)	Spire Inc	Morgan Stanley	60.147
5.557	South State Corp	Barclays Bank	(6.280)	(4.414)	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(11.388)
1.549	South State Corp	Goldman Sachs	(1.317)	13.112	Spirit Airlines Inc	Bank of America Merrill Lynch	524
2.452	South State Corp	HSBC	(932)	6.446	Spirit Airlines Inc	Barclays Bank	2.191
8.000	South State Corp	Morgan Stanley	(9.040)	8.059	Spirit Airlines Inc	Goldman Sachs	1.296
(7.575)	Southern Co	Morgan Stanley	3.788	5.586	Spirit Airlines Inc	HSBC	7.150
(4.800)	Southern Copper Corp	HSBC	51.408	49.770	Spirit Airlines Inc	Morgan Stanley	14.576
(24.447)	Southern Copper Corp	Morgan Stanley	(41.315)	(5.312)	Spirit of Texas Bancshares Inc	HSBC	(425)
4.328	Southern First Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.558)	(26.339)	Spirit of Texas Bancshares Inc	Morgan Stanley	(527)
11.302	Southern First Bancshares Inc	Barclays Bank	10.963	(4.962)	Spirit Realty Capital Inc (REIT)	HSBC	(2.580)
10.581	Southern First Bancshares Inc	Goldman Sachs	(3.809)	(41.692)	Spirit Realty Capital Inc (REIT)	Morgan Stanley	(14.175)
4.028	Southern First Bancshares Inc	Morgan Stanley	3.907	2.712	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	18.523
(460)	Southern Missouri Bancorp Inc	Goldman Sachs	308	9.384	Splunk Inc	Barclays Bank	14.170
2.129	Southern Missouri Bancorp Inc	Morgan Stanley	(16)	(1.576)	Splunk Inc	Barclays Bank	619
(20.775)	Southside Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.349	1.498	Splunk Inc	Goldman Sachs	10.231
(9.643)	Southside Bancshares Inc	Barclays Bank	(2.025)	3.514	Splunk Inc	Morgan Stanley	5.306
(35.282)	Southside Bancshares Inc	Goldman Sachs	15.877	39.243	Spok Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	45.914
(8.154)	Southside Bancshares Inc	HSBC	(4.322)	32.009	Spok Holdings Inc	Barclays Bank	10.883
(50.223)	Southside Bancshares Inc	Morgan Stanley	(10.547)	28.248	Spok Holdings Inc	Goldman Sachs	33.050
1.878	Southwest Airlines Co	Bank of America Merrill Lynch	(1.202)	20.727	Spok Holdings Inc	Morgan Stanley	7.047
6.883	Southwest Airlines Co	Barclays Bank	5.369	(5.016)	Sportsman's Warehouse Holdings Inc	Morgan Stanley	(502)
(40.721)	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	26.061	2.171	Spotify Technology SA	Bank of America Merrill Lynch	39.599
25.989	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	(16.633)	956	Spotify Technology SA	Barclays Bank	7.180
16.231	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	12.660	699	Spotify Technology SA	Goldman Sachs	12.750
18.424	Southwest Gas Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45.006)	663	Spotify Technology SA	HSBC	8.858
26.460	Southwest Gas Holdings Inc	Barclays Bank	(12.001)	1.339	Spotify Technology SA	Morgan Stanley	10.056
35.100	Southwest Gas Holdings Inc	Goldman Sachs	(97.295)	(2.131)	SpringWorks Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(18.540)
20.147	Southwest Gas Holdings Inc	HSBC	(114.183)	(2.313)	SpringWorks Therapeutics Inc	HSBC	(29.838)
32.348	Southwest Gas Holdings Inc	Morgan Stanley	(17.791)	(2.581)	SpringWorks Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(10.247)
(16.333)	Southwestern Energy Co	Goldman Sachs	3.920	6.620	Sprout Social Inc 'A'	Barclays Bank	29.790
(21.339)	Southwestern Energy Co	HSBC	(11.096)	6.920	Sprout Social Inc 'A'	Morgan Stanley	31.140
(71.785)	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	18.664	(38.275)	Sprouts Farmers Market Inc	Barclays Bank	(34.358)
604	SP Plus Corp	Barclays Bank	(338)	(2.751)	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	(2.834)
1.775	SP Plus Corp	Goldman Sachs	(1.438)	2.753	Spruce Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.772)
9.458	SP Plus Corp	Morgan Stanley	(5.296)	2.411	Spruce Biosciences Inc	Barclays Bank	277
(19.921)	Spark Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6.375	5.218	Spruce Biosciences Inc	Goldman Sachs	(4.199)
(24.472)	Spark Energy Inc 'A'	Barclays Bank	14.438	2.344	Spruce Biosciences Inc	Morgan Stanley	(164)
(6.725)	Spark Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	2.152				
(38.114)	Spark Energy Inc 'A'	HSBC	(8.766)				
(14.774)	Spark Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	8.717				
1.407	SpartanNash Co	Bank of America Merrill Lynch	746				
16.216	SpartanNash Co	Barclays Bank	11.351				
7.369	SpartanNash Co	Goldman Sachs	3.906				
8.197	SpartanNash Co	HSBC	6.558				
3.217	SpartanNash Co	Morgan Stanley	2.252				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(4.834)	SPS Commerce Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.354	(125)	Starbucks Corp	Bank of America Merrill Lynch	(363)
(1.967)	SPS Commerce Inc	Barclays Bank	3.364	(24.027)	Starbucks Corp	Barclays Bank	(32.677)
(6.502)	SPS Commerce Inc	Goldman Sachs	1.821	(22.039)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	(29.180)
(1.621)	SPX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(535)	14.771	StarTek Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.284
(1.845)	SPX Corp	Barclays Bank	(1.790)	13.568	StarTek Inc	Barclays Bank	1.357
(446)	SPX Corp	Goldman Sachs	(147)	10.982	StarTek Inc	Goldman Sachs	3.185
(1.952)	SPX Corp	HSBC	1.874	2.281	StarTek Inc	HSBC	(2.121)
(25.208)	SPX Corp	Morgan Stanley	(24.452)	4.338	StarTek Inc	Morgan Stanley	434
7.969	SPX FLOW Inc	Barclays Bank	661	(21.763)	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(10.882)
8.253	SPX FLOW Inc	Morgan Stanley	(2.167)	(18.177)	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	(5.635)
(1.415)	Square Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(27.734)	(16.761)	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(8.381)
(935)	Square Inc 'A'	Barclays Bank	(10.818)	2.861	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	155
(341)	Square Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.945)	1.591	Starwood Property Trust Inc (REIT)	HSBC	827
1.794	SQZ Biotechnologies Co	Barclays Bank	305	(49.828)	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(15.447)
14.396	SQZ Biotechnologies Co	Goldman Sachs	15.836	(18.274)	State Auto Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.203
(18.257)	SS&C Technologies Holdings Inc	Barclays Bank	10.144	(5.615)	State Auto Financial Corp	Barclays Bank	562
(3.743)	SS&C Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs	898	(6.462)	State Auto Financial Corp	HSBC	(6.914)
(8.326)	SS&C Technologies Holdings Inc	HSBC	(3.783)	(6.240)	State Auto Financial Corp	Morgan Stanley	624
(33.319)	SS&C Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	20.991	20.712	State Street Corp	Goldman Sachs	12.427
11.218	St Joe Co	Barclays Bank	13.782	8.000	Steel Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16.880)
5.636	St Joe Co	Goldman Sachs	104	3.829	Steel Dynamics Inc	Goldman Sachs	(8.079)
(797)	STAAR Surgical Co	Bank of America Merrill Lynch	(25.592)	5.542	Steel Dynamics Inc	HSBC	(8.590)
3.581	STAAR Surgical Co	Barclays Bank	57.081	45.440	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	16.813
(301)	STAAR Surgical Co	Goldman Sachs	(9.665)	5.676	Steelcase Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	341
234	STAAR Surgical Co	HSBC	8.264	35.338	Steelcase Inc 'A'	Barclays Bank	(4.947)
(10.115)	STAG Industrial Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(962)	36.118	Steelcase Inc 'A'	Goldman Sachs	2.167
(6.625)	STAG Industrial Inc (REIT)	Barclays Bank	795	2.840	Steelcase Inc 'A'	HSBC	(483)
16.616	STAG Industrial Inc (REIT)	Goldman Sachs	3.323	33.617	Steelcase Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.706)
(1.854)	STAG Industrial Inc (REIT)	Goldman Sachs	(371)	1.555	Stepan Co	Bank of America Merrill Lynch	(3.810)
(44.067)	STAG Industrial Inc (REIT)	HSBC	35.694	2.437	Stepan Co	Barclays Bank	975
(3.770)	STAG Industrial Inc (REIT)	Morgan Stanley	452	1.318	Stepan Co	Goldman Sachs	(3.229)
923	Stamps.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.285	11.712	Stepan Co	HSBC	(14.874)
1.041	Stamps.com Inc	Barclays Bank	1.717	3.947	Stepan Co	Morgan Stanley	1.579
1.858	Stamps.com Inc	Goldman Sachs	18.691	(8.014)	StepStone Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3.968
581	Stamps.com Inc	HSBC	8.418	(10.554)	StepStone Group Inc 'A'	Barclays Bank	12.348
4.507	Stamps.com Inc	Morgan Stanley	7.436	(3.629)	StepStone Group Inc 'A'	Goldman Sachs	930
6.286	Standard Motor Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.686)	(1.231)	StepStone Group Inc 'A'	Morgan Stanley	1.440
2.492	Standard Motor Products Inc	Barclays Bank	374	(16.820)	Stereotaxis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22.034)
6.723	Standard Motor Products Inc	Goldman Sachs	(11.429)	(17.792)	Stereotaxis Inc	Goldman Sachs	(23.308)
3.493	Standard Motor Products Inc	HSBC	(6.776)	(6.942)	Stereotaxis Inc	HSBC	(6.109)
5.854	Standard Motor Products Inc	Morgan Stanley	878	(6.625)	Stericycle Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.948
(9.138)	Standex International Corp	Bank of America Merrill Lynch	17.937	(21.566)	Stericycle Inc	Barclays Bank	5.392
(11.753)	Standex International Corp	Barclays Bank	(14.809)	189	Stericycle Inc	Barclays Bank	(47)
(3.529)	Standex International Corp	Goldman Sachs	9.846	(14.287)	Stericycle Inc	Goldman Sachs	6.358
(360)	Standex International Corp	Goldman Sachs	(454)	(21.263)	Stericycle Inc	HSBC	(31.257)
1.447	Stanley Black & Decker Inc	Morgan Stanley	(2.851)	(4.359)	Stericycle Inc	Morgan Stanley	1.090
152	Stanley Black & Decker Inc	Bank of America Merrill Lynch	792	1.294	Stericycle Inc	Morgan Stanley	(324)
(3.145)	Stanley Black & Decker Inc	Barclays Bank	(6.196)	(2.042)	STERIS Plc	Morgan Stanley	(1.756)
553	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	1.089	(61.423)	Sterling Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	—
(2.837)	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	11.036	(22.633)	Sterling Bancorp	Barclays Bank	(15.362)
(2.708)	Stanley Black & Decker Inc	HSBC	(14.109)	(7.787)	Sterling Bancorp	Goldman Sachs	—
2.110	Stanley Black & Decker Inc	Morgan Stanley	10.993	(14.176)	Sterling Bancorp	HSBC	(9.781)
		Morgan Stanley		(6.852)	Sterling Bancorp	Morgan Stanley	(2.609)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(18.459)	Sterling Bancorp Inc	Bank of America		9.407	Summit Financial Group Inc	Goldman Sachs	(11.288)
		Merrill Lynch	(5.722)	3.185	Summit Financial Group Inc	HSBC	(1.529)
(23.473)	Sterling Bancorp Inc	Barclays Bank	(1.643)	3.183	Summit Financial Group Inc	Morgan Stanley	(1.369)
(35.461)	Sterling Bancorp Inc	Goldman Sachs	(10.993)	(42.982)	Summit Hotel Properties Inc	Bank of America	
(10.178)	Sterling Bancorp Inc	HSBC	(1.628)		(REIT)	Merrill Lynch	9.886
(38.554)	Sterling Bancorp Inc	Morgan Stanley	(2.699)	(17.356)	Summit Hotel Properties Inc		
(4.461)	Sterling Construction Co Inc	HSBC	892		(REIT)	Barclays Bank	(2.430)
570	Steven Madden Ltd	Bank of America		(144.495)	Summit Hotel Properties Inc		
		Merrill Lynch	456		(REIT)	Goldman Sachs	33.234
25.736	Steven Madden Ltd	Barclays Bank	5.791	6.878	Summit Materials Inc 'A'	Bank of America	
2.445	Steven Madden Ltd	Goldman Sachs	547			Merrill Lynch	1.466
38.646	Steven Madden Ltd	Morgan Stanley	17.777	7.689	Summit Materials Inc 'A'	Barclays Bank	11.918
37.227	Stifel Financial Corp	Bank of America		6.688	Summit Materials Inc 'A'	Goldman Sachs	4.615
		Merrill Lynch	(24.779)	22.878	Summit Materials Inc 'A'	HSBC	97.231
43.946	Stifel Financial Corp	Barclays Bank	11.426	9.239	Summit Materials Inc 'A'	Morgan Stanley	14.320
12.842	Stifel Financial Corp	Goldman Sachs	(8.875)	11.219	Summit Therapeutics Inc	Barclays Bank	1.907
55.789	Stifel Financial Corp	HSBC	45.189	3.225	Summit Therapeutics Inc	Goldman Sachs	3.128
27.693	Stifel Financial Corp	Morgan Stanley	7.201	1.681	Sumo Logic Inc	Goldman Sachs	3.244
(7.627)	Stifel Financial Corp	Morgan Stanley	(1.983)	(1.780)	Sun Communities Inc	Bank of America	
2.724	Stitch Fix Inc 'A'	Barclays Bank	14.328		(REIT)	Merrill Lynch	(5.474)
(395)	Stitch Fix Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.588)	(2.056)	Sun Communities Inc		
(11.892)	Stock Yards Bancorp Inc	HSBC	(22.833)		(REIT)	Goldman Sachs	(4.780)
(14.356)	Stock Yards Bancorp Inc	Morgan Stanley	(34.885)	(3.771)	Sun Communities Inc		
4.723	Stoke Therapeutics Inc	Bank of America			(REIT)	HSBC	(5.430)
		Merrill Lynch	21.112	(3.067)	Sun Communities Inc		
834	Stoke Therapeutics Inc	Barclays Bank	2.560		(REIT)	Morgan Stanley	(153)
1.602	Stoke Therapeutics Inc	Goldman Sachs	7.161	6.107	Sun Country Airlines		
1.179	Stoke Therapeutics Inc	Morgan Stanley	3.620		Holdings Inc	HSBC	(5.496)
(274)	StoneCo Ltd 'A'	Bank of America		(13.542)	SunCoke Energy Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.797)			Merrill Lynch	948
(3.442)	StoneCo Ltd 'A'	Barclays Bank	(10.257)	(10.449)	SunCoke Energy Inc	Barclays Bank	(2.717)
1.744	StoneCo Ltd 'A'	Goldman Sachs	(15)	8.339	Sunnova Energy	Bank of America	
(1.718)	StoneCo Ltd 'A'	Goldman Sachs	(9.715)		International Inc	Merrill Lynch	21.681
(490)	StoneCo Ltd 'A'	Morgan Stanley	(1.460)	38.163	Sunnova Energy		
(1.728)	Stoneridge Inc	Bank of America			International Inc	Barclays Bank	30.149
		Merrill Lynch	297	11.061	Sunnova Energy		
(4.196)	Stoneridge Inc	Barclays Bank	1.430		International Inc	Goldman Sachs	28.759
(965)	Stoneridge Inc	Goldman Sachs	(605)	2.160	Sunnova Energy		
(4.441)	Stoneridge Inc	Morgan Stanley	4.752		International Inc	HSBC	3.262
(11.764)	StoneX Group Inc	Morgan Stanley	14.352	8.469	Sunnova Energy		
(14.851)	STORE Capital Corp (REIT)	Bank of America			International Inc	Morgan Stanley	6.691
		Merrill Lynch	(14.405)	(2.652)	SunPower Corp	Bank of America	
16.850	STORE Capital Corp (REIT)	Bank of America				Merrill Lynch	(3.819)
		Merrill Lynch	16.345	5.666	SunPower Corp	Bank of America	
(11.965)	STORE Capital Corp (REIT)	Barclays Bank	(3.623)			Merrill Lynch	5.776
(13.185)	STORE Capital Corp (REIT)	Goldman Sachs	(12.789)	(4.280)	SunPower Corp	Barclays Bank	214
6.076	STORE Capital Corp (REIT)	Goldman Sachs	5.894	11.055	SunPower Corp	Barclays Bank	3.033
(5.098)	STORE Capital Corp (REIT)	HSBC	48	(720)	SunPower Corp	Goldman Sachs	(1.037)
1.280	STORE Capital Corp (REIT)	HSBC	294	2.044	SunPower Corp	HSBC	2.069
(5.796)	STORE Capital Corp (REIT)	Morgan Stanley	(106)	1.669	SunPower Corp	Morgan Stanley	(83)
6.277	STORE Capital Corp (REIT)	Morgan Stanley	2.009	11.377	Sunrun Inc	Bank of America	
5.687	Strategic Education Inc	Barclays Bank	(14.900)			Merrill Lynch	53.699
474	Strategic Education Inc	Goldman Sachs	(2.896)	5.140	Sunrun Inc	Barclays Bank	(668)
201	Strategic Education Inc	HSBC	(1.678)	6.244	Sunrun Inc	Goldman Sachs	27.061
1.864	Strategic Education Inc	Morgan Stanley	(4.884)	9.020	Sunrun Inc	HSBC	35.358
841	Strattec Security Corp	Bank of America		375	Sunrun Inc	Morgan Stanley	(49)
		Merrill Lynch	3.499	(4.322)	Sunstone Hotel Investors	Bank of America	
1.531	Strattec Security Corp	Barclays Bank	1.577		Inc (REIT)	Merrill Lynch	475
2.386	Strattec Security Corp	HSBC	14.793	(5.966)	Sunstone Hotel Investors		
(22.193)	Stratus Properties Inc	Bank of America			Inc (REIT)	Barclays Bank	(418)
		Merrill Lynch	(19.974)	(79.588)	Sunstone Hotel Investors		
(6.172)	Stratus Properties Inc	Goldman Sachs	(5.555)		Inc (REIT)	HSBC	(25.468)
(7.225)	Stratus Properties Inc	Morgan Stanley	578	(57.321)	Sunstone Hotel Investors		
(5.460)	Stride Inc	Morgan Stanley	4.150		Inc (REIT)	Morgan Stanley	(4.012)
2.080	Stryker Corp	Morgan Stanley	(3.910)	(26.025)	Sunworks Inc	Barclays Bank	(5.465)
(3.544)	Stryker Corp	Morgan Stanley	6.663	4.707	Super League Gaming Inc	Barclays Bank	847
1.260	Summit Financial Group Inc	Bank of America		3.688	Super League Gaming Inc	Goldman Sachs	1.512
		Merrill Lynch	(1.512)	13.008	Super League Gaming Inc	HSBC	4.293
10.729	Summit Financial Group Inc	Barclays Bank	(4.613)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
5.855	Super Micro Computer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.138)	(942)	Syndax Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(641)
10.738	Super Micro Computer Inc	Barclays Bank	(12.778)	11.136	Syneos Health Inc	Bank of America	
10.105	Super Micro Computer Inc	Goldman Sachs	(14.046)			Merrill Lynch	27.840
2.860	Super Micro Computer Inc	HSBC	(1.230)	728	Syneos Health Inc	Barclays Bank	(590)
4.366	Super Micro Computer Inc	Morgan Stanley	(5.196)	1.146	Syneos Health Inc	Goldman Sachs	2.865
(2.631)	Superior Group of Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.078	347	Syneos Health Inc	Morgan Stanley	(281)
(8.100)	Superior Group of Cos Inc	Barclays Bank	243	(1.404)	Syneos Health Inc	Morgan Stanley	1.137
(5.689)	Superior Group of Cos Inc	Goldman Sachs	4.494	(10.234)	Synlogic Inc	Goldman Sachs	(1.535)
(4.058)	Superior Group of Cos Inc	HSBC	(1.136)	(31.575)	Synlogic Inc	HSBC	(23.366)
(7.745)	Superior Group of Cos Inc	Morgan Stanley	232	(3.507)	SYNNEX Corp	Bank of America	
3.445	Supernus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.755)	(2.632)	SYNNEX Corp	Merrill Lynch	(5.430)
5.333	Supernus Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(2.400)	(1.092)	SYNNEX Corp	Barclays Bank	(520)
22.345	Supernus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(24.356)	2.367	Synopsys Inc	Morgan Stanley	1.331
(12.483)	Surface Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.240)	(267)	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	43.411
(10.870)	Surface Oncology Inc	Barclays Bank	(3.152)	1.814	Synopsys Inc	HSBC	84
(13.967)	Surface Oncology Inc	Goldman Sachs	(8.101)	2.063	Synopsys Inc	Morgan Stanley	39.817
33.911	Surgalign Holdings Inc	Morgan Stanley	11.530	(328)	Synopsys Inc	Morgan Stanley	11.883
(1.588)	Surgery Partners Inc	Barclays Bank	(9.433)	(12.001)	Synovus Financial Corp	Bank of America	(125)
(5.629)	Surgery Partners Inc	HSBC	(45.539)	15.464	Synovus Financial Corp	Bank of America	1.440
(8.046)	Surgery Partners Inc	Morgan Stanley	(47.793)	(7.719)	Synovus Financial Corp	Merrill Lynch	(1.856)
(8.869)	Surmodics Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.860	(9.939)	Synovus Financial Corp	Barclays Bank	(7.565)
(5.105)	Surmodics Inc	Barclays Bank	6.075	2.958	Synovus Financial Corp	Goldman Sachs	1.193
(8.411)	Surmodics Inc	Goldman Sachs	12.196	6.822	Synovus Financial Corp	Goldman Sachs	(355)
(1.357)	Surmodics Inc	Morgan Stanley	1.615	(4.486)	Syros Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	6.686
9.745	Sutro Biopharma Inc	Morgan Stanley	3.801	(8.413)	Syros Pharmaceuticals Inc	Bank of America	(5.159)
(302)	SVB Financial Group	Goldman Sachs	(2.667)	(4.362)	Syros Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(10.769)
(48)	SVB Financial Group	HSBC	(223)	(6.104)	Syros Pharmaceuticals Inc	HSBC	(6.281)
523	SVB Financial Group	Morgan Stanley	3.990	(1.532)	Sysco Corp	Morgan Stanley	(7.813)
(609)	SVB Financial Group	Morgan Stanley	(4.647)	1.539	Sysco Corp	Bank of America	
16.181	SVMK Inc	Bank of America Merrill Lynch	20.388			Merrill Lynch	4.795
26.615	SVMK Inc	Barclays Bank	8.783	6.073	Sysco Corp	Bank of America	703
10.320	SVMK Inc	Morgan Stanley	3.406	(998)	Sysco Corp	Merrill Lynch	866)
(43.535)	Switch Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(11.319)	564	Sysco Corp	Barclays Bank	4.631
(29.214)	Switch Inc 'A'	Barclays Bank	3.506	(5.043)	Sysco Corp	HSBC	94
(39.789)	Switch Inc 'A'	HSBC	(30.240)	(26.066)	Systemax Inc	Morgan Stanley	(3.177)
(22.242)	Switch Inc 'A'	Morgan Stanley	2.669	(8.272)	Systemax Inc	Bank of America	(4.607)
(3.748)	SWK Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(600)	(1.601)	Systemax Inc	Merrill Lynch	(8.851)
(5.829)	SWK Holdings Corp	Goldman Sachs	(933)	235	T Rowe Price Group Inc	Barclays Bank	(489)
(5.948)	Sykes Enterprises Inc	Morgan Stanley	119	6.181	Tabula Rasa HealthCare Inc	Morgan Stanley	815
1.643	Synaptics Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.656	2.170	Tactile Systems Technology Inc	Goldman Sachs	16.441
3.477	Synaptics Inc	Barclays Bank	1.356	1.765	Tactile Systems Technology Inc	Barclays Bank	(152)
6.511	Synaptics Inc	Goldman Sachs	25.172	3.532	Tactile Systems Technology Inc	HSBC	(2.083)
5.931	Synaptics Inc	HSBC	20.225	1.037	Take-Two Interactive Software Inc	Morgan Stanley	(247)
260	Synaptics Inc	Morgan Stanley	101	5.911	Take-Two Interactive Software Inc	Bank of America	
10.531	Synchronoss Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(527)	665	Take-Two Interactive Software Inc	Merrill Lynch	17.982
23.494	Synchronoss Technologies Inc	Barclays Bank	2.114	2.275	Take-Two Interactive Software Inc	Barclays Bank	3.192
10.578	Synchronoss Technologies Inc	Goldman Sachs	(529)	6.251	Talis Biomedical Corp	Goldman Sachs	11.531
(16.574)	Synchrony Financial	Bank of America Merrill Lynch	(18.904)	6.634	Talis Biomedical Corp	HSBC	37.629
(35.878)	Synchrony Financial	Goldman Sachs	(17.939)	14.967	Talos Energy Inc	Barclays Bank	(3.251)
(8.197)	Syndax Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	35.467	Talos Energy Inc	Goldman Sachs	(2.985)
(12.132)	Syndax Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(8.250)	4.311	Tandem Diabetes Care Inc	Goldman Sachs	15.566
(941)	Syndax Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	75	1.072	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	6.739
				12.423	Tandem Diabetes Care Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	21.251
						Barclays Bank	386
						Goldman Sachs	81.102

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
724	Tandem Diabetes Care Inc	HSBC	3.540	537	Teledyne Technologies Inc	Bank of America	
3.242	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	1.167			Merrill Lynch	1.708
(46.172)	Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT)	Barclays Bank	(40.631)	(902)	Teledyne Technologies Inc	Barclays Bank	(7.938)
31.384	Tapestry Inc	Goldman Sachs	(65.361)	943	Teledyne Technologies Inc	Barclays Bank	8.298
573	Tapestry Inc	HSBC	(1.189)	(942)	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	(8.290)
16.481	Tapestry Inc	Morgan Stanley	24.557	422	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	3.714
1.971	Targa Resources Corp	Bank of America		(1.243)	Teleflex Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(374)			Merrill Lynch	(10.950)
21.724	Targa Resources Corp	Barclays Bank	4.562	(3.646)	Teleflex Inc	Barclays Bank	4.667
2.236	Targa Resources Corp	Goldman Sachs	183	(3.036)	Teleflex Inc	Goldman Sachs	(27.173)
1.726	Targa Resources Corp	HSBC	262	(2.026)	Teleflex Inc	HSBC	11.042
8.834	Targa Resources Corp	Morgan Stanley	1.855	(6.389)	Teleflex Inc	Morgan Stanley	7.122
723	Target Corp	Bank of America		(41.545)	Telephone and Data Systems Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	12.219	(29.766)	Telephone and Data Systems Inc	Merrill Lynch	(14.125)
3.870	Target Corp	Barclays Bank	5.844			Barclays Bank	(4.167)
1.942	Target Corp	Goldman Sachs	32.820	2.836	Telephone and Data Systems Inc	HSBC	624
1.586	Target Corp	HSBC	20.444	(1.639)	Telephone and Data Systems Inc	HSBC	(361)
4.068	Target Corp	Morgan Stanley	6.143	30.457	Telephone and Data Systems Inc	Morgan Stanley	4.264
27	Target Hospitality Corp	HSBC	31	(20.135)	Telephone and Data Systems Inc	Morgan Stanley	(2.819)
81.538	Target Hospitality Corp	Morgan Stanley	74.200	12.137	Tellurian Inc	Barclays Bank	19.419
(2.999)	Tarsus Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(6.658)	11.933	Tellurian Inc	Goldman Sachs	22.673
(11.031)	Taylor Morrison Home Corp	Bank of America		(8.799)	Telos Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.170)			Merrill Lynch	15.486
(43.562)	Taylor Morrison Home Corp	Barclays Bank	(40.577)	(6.945)	Telos Corp	Barclays Bank	(8.523)
(14.666)	Taylor Morrison Home Corp	Goldman Sachs	1.254	5.561	Tempur Sealy International Inc	Bank of America	
10.318	Taylor Morrison Home Corp	Goldman Sachs	(1.341)	(25.072)	Tempur Sealy International Inc	Bank of America	
(9.071)	Taylor Morrison Home Corp	HSBC	21.680	16.198	Tempur Sealy International Inc	Barclays Bank	28.994
(39.366)	Taylor Morrison Home Corp	Morgan Stanley	(40.154)	(4.412)	Tempur Sealy International Inc	Barclays Bank	(7.897)
14.680	Taysha Gene Therapies Inc	Barclays Bank	—	(3.957)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs	(5.572)
(504)	TCF Financial Corp	Bank of America		1.669	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	2.988
		Merrill Lynch	—	(8.325)	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	(14.902)
(3.295)	TCF Financial Corp	Barclays Bank	(2.900)	12.312	Tenable Holdings Inc	Bank of America	
(18.030)	TCF Financial Corp	Goldman Sachs	—	(7.401)	Tenable Holdings Inc	Merrill Lynch	31.395
(9.561)	TCF Financial Corp	HSBC	(4.494)			Bank of America	
(5.419)	TCF Financial Corp	Morgan Stanley	(4.769)	(14.050)	Tenable Holdings Inc	Merrill Lynch	(9.705)
(2.813)	TCR2 Therapeutics Inc	Goldman Sachs	338	7.615	Tenable Holdings Inc	Barclays Bank	(4.496)
(4.619)	TCR2 Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1.755)	(7.863)	Tenable Holdings Inc	Barclays Bank	2.437
(1.142)	TE Connectivity Ltd	HSBC	936	(5.343)	Tenable Holdings Inc	Goldman Sachs	(19.689)
(12.700)	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	(14.478)	(15.014)	Tenable Holdings Inc	HSBC	(3.840)
(7.467)	Team Inc	Goldman Sachs	1.120	21.359	Tenable Holdings Inc	Morgan Stanley	(4.804)
(14.611)	Team Inc	HSBC	146	1.699	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	6.835
(14.264)	Team Inc	Morgan Stanley	143			Bank of America	
1	Technip Energies NV ADR ¹	Morgan Stanley	—	10.146	Tenet Healthcare Corp	Merrill Lynch	5.275
32.879	TechnipFMC Plc	Goldman Sachs	7.233	5.160	Tenet Healthcare Corp	Barclays Bank	24.952
42.634	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	20.464	(3.359)	Tennant Co	Morgan Stanley	15.726
(2.480)	TechTarget Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.042)	(15.322)	Tennant Co	Merrill Lynch	5.878
(3.426)	TechTarget Inc	Barclays Bank	5.105	(12.179)	Tennant Co	Barclays Bank	22.064
(11.235)	TechTarget Inc	Goldman Sachs	(18.313)	(7.644)	Tennant Co	Goldman Sachs	21.313
12.412	Teekay Corp	Bank of America		(13.638)	Tennant Co	HSBC	10.778
		Merrill Lynch	621	10.681	Tenneco Inc 'A'	Morgan Stanley	19.639
33.529	Teekay Corp	Morgan Stanley	671	5.713	Teradata Corp	Barclays Bank	2.777
3.451	TEGNA Inc	Bank of America		(2.925)	Teradata Corp	Goldman Sachs	33.135
		Merrill Lynch	35	(8.127)	Teradata Corp	Goldman Sachs	(16.965)
(6.251)	TEGNA Inc	Barclays Bank	(1.004)	(6.256)	Teradyne Inc	Morgan Stanley	(11.703)
66.088	TEGNA Inc	Goldman Sachs	661			Bank of America	
(22.569)	TEGNA Inc	HSBC	5.335	(3.557)	Teradyne Inc	Merrill Lynch	(78.137)
(12.583)	TEGNA Inc	Morgan Stanley	(450)			Goldman Sachs	(44.427)
(66.653)	Tejon Ranch Co	Goldman Sachs	26.661				
(13.005)	Tejon Ranch Co	HSBC	5.072				
(72.026)	Tejon Ranch Co	Morgan Stanley	7.923				
(13.890)	Tela Bio Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(8.612)				
(6.207)	Tela Bio Inc	Barclays Bank	(2.607)				
2.867	Teladoc Health Inc	Goldman Sachs	37.902				
607	Teladoc Health Inc	HSBC	6.817				
2.033	Teladoc Health Inc	Morgan Stanley	16.772				
(1.575)	Teledyne Technologies Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(5.009)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(9.389)	Teradyne Inc	Morgan Stanley	(43.753)	(1.488)	TFF Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
(2.637)	Terex Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(1.830)
		Merrill Lynch	8.148	(14.472)	TFF Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(4.776)
(3.091)	Terex Corp	Barclays Bank	(3.895)	40.131	TFS Financial Corp	Bank of America	
(17.383)	Terex Corp	Morgan Stanley	(21.903)			Merrill Lynch	1.204
9.614	Terminix Global Holdings Inc	Bank of America		2.833	TFS Financial Corp	Barclays Bank	255
		Merrill Lynch	4.889	22.326	TFS Financial Corp	HSBC	50.456
12.403	Terminix Global Holdings Inc	Barclays Bank		56.763	TFS Financial Corp	Morgan Stanley	5.109
			6.822	(4.015)	TG Therapeutics Inc	Barclays Bank	(4.617)
16.627	Terminix Global Holdings Inc	Goldman Sachs		(8.947)	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(9.126)
			8.480	(658)	TG Therapeutics Inc	HSBC	(806)
1.987	Terminix Global Holdings Inc	HSBC	64	(6.806)	TG Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(7.827)
				145.140	TherapeuticsMD Inc	Morgan Stanley	(1.451)
18.141	Terminix Global Holdings Inc	Morgan Stanley	9.978	2.555	Theravance Biopharma Inc	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	(2.913)
2.709	Terns Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	2.005	7.703	Theravance Biopharma Inc	Barclays Bank	1.772
			17.063	3.614	Theravance Biopharma Inc	Goldman Sachs	(4.120)
13.125	Terns Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	1.750	8.393	Theravance Biopharma Inc	HSBC	(16.031)
1.346	Terns Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(6.738)	18.866	Theravance Biopharma Inc	Morgan Stanley	4.339
(8.638)	Terreno Realty Corp (REIT)	Bank of America	(11.964)	822	Thermo Fisher Scientific Inc	Barclays Bank	5.787
		Merrill Lynch	697	483	Thermo Fisher Scientific Inc	Morgan Stanley	3.400
(15.339)	Terreno Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	4.797	(1.135)	Thermon Group Holdings Inc	Bank of America	
(3.871)	Terreno Realty Corp (REIT)	HSBC	(45.144)			Merrill Lynch	2.576
(5.451)	Terreno Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	5.916	(2.209)	Thermon Group Holdings Inc	Goldman Sachs	5.014
51.300	Terreno Realty Corp (REIT)	Barclays Bank	2.453	(8.756)	Thermon Group Holdings Inc	HSBC	13.572
12.587	Territorial Bancorp Inc	HSBC	6.367	(16.289)	Thermon Group Holdings Inc	Morgan Stanley	36.162
5.840	Territorial Bancorp Inc	Morgan Stanley	(6.726)	(306)	Thor Industries Inc	Bank of America	
13.546	Territorial Bancorp Inc	Bank of America	(1.333)	(3.202)	Thor Industries Inc	Merrill Lynch	2.252
(139)	Tesla Inc	Merrill Lynch	3.475	(1.651)	Thor Industries Inc	Barclays Bank	(17.067)
		Barclays Bank	(5.658)	5.128	Thor Industries Inc	Goldman Sachs	12.151
(71)	Tesla Inc	Morgan Stanley	(8.436)	5.984	Thor Industries Inc	Morgan Stanley	(37.742)
(162)	Tesla Inc	Barclays Bank	1.545	8.412	Thryv Holdings Inc	Barclays Bank	31.895
24.818	TESSCO Technologies Inc	Goldman Sachs	(10.103)	1.478	Thryv Holdings Inc	Goldman Sachs	29.274
2.801	Tetra Tech Inc	Merrill Lynch	(943)	(32.721)	Tidewater Inc	Morgan Stanley	2.956
8.034	Tetra Tech Inc	Barclays Bank	(3.399)	(11.317)	Tilly's Inc	Morgan Stanley	(1.963)
9.653	Tetra Tech Inc	Goldman Sachs	(306)	(8.563)	Tilly's Inc	Barclays Bank	(8.727)
10.635	Texas Capital Bancshares Inc	HSBC		10.529	Timberland Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.536)
		Bank of America				Bank of America	
11.778	Texas Capital Bancshares Inc	Merrill Lynch		563	Timberland Bancorp Inc	Merrill Lynch	(5.896)
		Barclays Bank		24.108	Timberland Bancorp Inc	Barclays Bank	(23)
3.578	Texas Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs		6.743	Timberland Bancorp Inc	Goldman Sachs	(13.500)
				4.138	Timberland Bancorp Inc	Morgan Stanley	(270)
1.175	Texas Capital Bancshares Inc	HSBC		4.138	Timken Co	Bank of America	
(928)	Texas Instruments Inc	Bank of America		4.605	Timken Co	Merrill Lynch	(6.083)
		Merrill Lynch		6.627	Timken Co	Barclays Bank	10.638
(4.589)	Texas Instruments Inc	Barclays Bank		8.986	Timken Co	Goldman Sachs	(9.742)
(3.222)	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs		5.184	Timken Co	HSBC	(11.412)
8.940	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley		(6.697)	TimkenSteel Corp	Morgan Stanley	11.975
(489)	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley				Bank of America	
(71)	Texas Pacific Land Corp	Bank of America		11.681	Tiptree Inc	Merrill Lynch	4.889
		Merrill Lynch		(2.432)	Titan International Inc	Barclays Bank	(1.851)
(45)	Texas Pacific Land Corp	Barclays Bank		(26.640)	Titan International Inc	Goldman Sachs	(6.658)
(256)	Texas Pacific Land Corp	Barclays Bank		1.018	Titan Machinery Inc	HSBC	1.386
(206)	Texas Pacific Land Corp	Goldman Sachs				Bank of America	
(8.152)	Texas Roadhouse Inc	Bank of America		2.287	Titan Machinery Inc	Merrill Lynch	4.591
		Merrill Lynch		13.274	Titan Machinery Inc	Barclays Bank	13.470
(15.503)	Texas Roadhouse Inc	Barclays Bank		(3.210)	Tivity Health Inc	Goldman Sachs	59.866
(8.032)	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs		(1.738)	Tivity Health Inc	Goldman Sachs	(5.698)
1.278	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs		(1.609)	Tivity Health Inc	HSBC	(3.702)
(223)	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley		45.850	TJX Cos Inc	Morgan Stanley	(611)
(4.073)	Textainer Group Holdings Ltd	Bank of America		(3.386)	TJX Cos Inc	Morgan Stanley	54.103
		Merrill Lynch		(13.027)	T-Mobile US Inc	Barclays Bank	(3.995)
(6.041)	Textainer Group Holdings Ltd	Barclays Bank		(158)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	(48.460)
				(2.061)	T-Mobile US Inc	HSBC	(25)
(7.979)	Textainer Group Holdings Ltd	Goldman Sachs					(11.624)
(10.736)	Textainer Group Holdings Ltd	Morgan Stanley					

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(18.687)	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	(69.515)	(3.274)	Translate Bio Inc	Bank of America	
(6.423)	Toll Brothers Inc	Barclays Bank	(19.334)			Merrill Lynch	(3.307)
(1.232)	Toll Brothers Inc	Goldman Sachs	(80)	(13.118)	Translate Bio Inc	Barclays Bank	(4.067)
(1.566)	Toll Brothers Inc	HSBC	(7.196)	(3.326)	Translate Bio Inc	Goldman Sachs	(3.359)
(18.252)	Toll Brothers Inc	Morgan Stanley	(58.503)	(10.005)	Translate Bio Inc	Morgan Stanley	(3.102)
(9.303)	Tompkins Financial Corp	HSBC	(21.676)	(3.719)	TransMedics Group Inc	Bank of America	
(10.702)	Tompkins Financial Corp	Morgan Stanley	3.960			Merrill Lynch	(10.785)
(5.926)	Tootsie Roll Industries Inc	Bank of America		(5.481)	TransMedics Group Inc	Barclays Bank	(3.946)
		Merrill Lynch	5.215	(1.123)	TransMedics Group Inc	Goldman Sachs	(3.257)
(62.247)	Tootsie Roll Industries Inc	Barclays Bank	22.965	(81.633)	Transocean Ltd	Barclays Bank	5.714
(1.335)	TopBuild Corp	Bank of America		(161.114)	Transocean Ltd	Goldman Sachs	58.096
		Merrill Lynch	10.587	(14.121)	Transocean Ltd	HSBC	282
(5.056)	TopBuild Corp	Barclays Bank	(6.219)	(4.976)	TransUnion	Barclays Bank	11.395
3.671	TopBuild Corp	Barclays Bank	1.715	(1.261)	TransUnion	Goldman Sachs	1.311
(736)	TopBuild Corp	Goldman Sachs	5.836	(609)	TransUnion	Morgan Stanley	1.395
1.102	TopBuild Corp	Goldman Sachs	(3.909)	34.374	Travel + Leisure Co	Bank of America	
(1.773)	TopBuild Corp	Morgan Stanley	(2.181)			Merrill Lynch	(11.343)
824	TopBuild Corp	Morgan Stanley	1.014	(1.417)	Travel + Leisure Co	Bank of America	
(3.144)	Toro Co	Bank of America				Merrill Lynch	468
		Merrill Lynch	3.616	(8.828)	Travel + Leisure Co	Barclays Bank	1.766
(21.046)	Toro Co	Barclays Bank	(22.940)	480	Travel + Leisure Co	Goldman Sachs	(158)
(10.219)	Toro Co	Goldman Sachs	11.752	(2.932)	Travel + Leisure Co	Goldman Sachs	968
(1.553)	Toro Co	HSBC	7.610	(3.937)	Travel + Leisure Co	HSBC	(2.309)
(27.032)	Toro Co	Morgan Stanley	(29.465)	6.542	Travel + Leisure Co	Morgan Stanley	(1.308)
(16.027)	Towne Bank	Bank of America		(34.972)	Travel + Leisure Co	Morgan Stanley	6.994
		Merrill Lynch	(3.609)	(4.409)	TravelCenters of America Inc	Bank of America	
(28.063)	Towne Bank	Barclays Bank	4.771			Merrill Lynch	(8.553)
(19.235)	Towne Bank	Goldman Sachs	(4.255)	(4.854)	TravelCenters of America Inc	Barclays Bank	(5.436)
(54.442)	Towne Bank	Morgan Stanley	7.146	(1.211)	TravelCenters of America Inc	Goldman Sachs	(2.349)
21.283	Townsquare Media Inc 'A'	Bank of America		(1.435)	TravelCenters of America Inc	HSBC	(2.913)
		Merrill Lynch	20.645	(3.034)	TravelCenters of America Inc	Morgan Stanley	(3.398)
30.850	Townsquare Media Inc 'A'	Goldman Sachs	29.925	5.812	Travelers Cos Inc	Bank of America	
(8.214)	TPG RE Finance Trust Inc (REIT)	Bank of America		5.418	Travelers Cos Inc	Merrill Lynch	(3.197)
		Merrill Lynch	(1.725)	13.386	Travelers Cos Inc	Barclays Bank	5.255
(17.136)	TPG RE Finance Trust Inc (REIT)	Barclays Bank	(819)	1.832	Travelers Cos Inc	Goldman Sachs	(7.362)
(16.484)	TPG RE Finance Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(3.462)	4.782	Travelers Cos Inc	HSBC	(3.609)
(9.702)	TPG RE Finance Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(185)	(512)	Travelers Cos Inc	Morgan Stanley	4.639
7.656	TPI Composites Inc	Bank of America		5.241	Travere Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(497)
		Merrill Lynch	36.289	1.873	Travere Therapeutics Inc	Barclays Bank	(14.622)
1.338	TPI Composites Inc	Barclays Bank	1.084	6.835	Travere Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(6.331)
3.813	TPI Composites Inc	HSBC	10.638	25.517	Trean Insurance Group Inc	Morgan Stanley	(19.070)
1.557	TPI Composites Inc	Morgan Stanley	1.261	17.165	Trean Insurance Group Inc	Goldman Sachs	13.524
1.621	Tractor Supply Co	Bank of America		(39.476)	Trecora Resources	Morgan Stanley	(8.583)
		Merrill Lynch	(7.602)			Bank of America	
(70)	Trade Desk Inc 'A'	Bank of America		(23.597)	Trecora Resources	Merrill Lynch	(5.477)
		Merrill Lynch	(5.635)	(13.357)	Trecora Resources	Barclays Bank	(2.975)
1.857	Trade Desk Inc 'A'	Bank of America		(5.670)	Trecora Resources	Goldman Sachs	(1.826)
		Merrill Lynch	145.673	(29.425)	Trecora Resources	HSBC	(1.418)
(203)	Trade Desk Inc 'A'	Barclays Bank	(6.612)	(29.832)	Tredegar Corp	Morgan Stanley	(3.376)
1.937	Trade Desk Inc 'A'	Barclays Bank	63.088	(13.140)	Tredegar Corp	Goldman Sachs	25.059
(75)	Trade Desk Inc 'A'	Goldman Sachs	(6.038)	(24.094)	Tredegar Corp	HSBC	(5.782)
716	Trade Desk Inc 'A'	Goldman Sachs	32.242	(10.268)	Tredegar Corp	Morgan Stanley	6.264
(2.011)	Trade Desk Inc 'A'	Morgan Stanley	(65.499)	(573)	TreeHouse Foods Inc	Barclays Bank	21.768
(12.076)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Bank of America		(10.194)	TreeHouse Foods Inc	HSBC	768
		Merrill Lynch	(121)	(2.030)	Trex Co Inc	Morgan Stanley	21.611
(822)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	(3.475)			Bank of America	
(6.541)	Tradeweb Markets Inc 'A'	HSBC	(4.775)	16.389	Trex Co Inc	Merrill Lynch	8.871
(1.543)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.027)	(3.602)	Trex Co Inc	Goldman Sachs	(71.619)
6.695	Trane Technologies Plc	Bank of America		1.661	Trex Co Inc	HSBC	15.741
		Merrill Lynch	19.148	(1.645)	Trex Co Inc	Morgan Stanley	(17.324)
8.005	Trane Technologies Plc	Barclays Bank	34.422	5.888	Trex Co Inc	Morgan Stanley	(625)
6.941	Trane Technologies Plc	HSBC	(1.805)	(22.577)	Tri Pointe Homes Inc	Bank of America	2.237
5.318	Trane Technologies Plc	Morgan Stanley	22.867			Merrill Lynch	7.676
(4.861)	Transcat Inc	Bank of America		(7.041)	Tri Pointe Homes Inc	Barclays Bank	(5.844)
		Merrill Lynch	(21.875)	(32.208)	Tri Pointe Homes Inc	Goldman Sachs	10.951
(4.442)	Transcat Inc	Barclays Bank	13.681				
(2.460)	Transcat Inc	Goldman Sachs	(9.415)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.875	Tricida Inc	Bank of America		36.716	TrueCar Inc	Goldman Sachs	45.528
		Merrill Lynch	(488)	25.172	TrueCar Inc	Morgan Stanley	22.907
9.116	Tricida Inc	Goldman Sachs	(2.370)	43.197	Truist Financial Corp	Bank of America	
1.786	TriCo Bancshares	Bank of America				Merrill Lynch	(10.367)
		Merrill Lynch	1.340	813	Truist Financial Corp	Barclays Bank	463
14.118	TriCo Bancshares	Barclays Bank	8.692	23.800	Truist Financial Corp	Goldman Sachs	(5.712)
12.770	TriCo Bancshares	Goldman Sachs	9.578	2.355	Truist Financial Corp	Morgan Stanley	1.342
22.635	TriCo Bancshares	HSBC	33.273	3.903	Trupanion Inc	Bank of America	
29.076	TriCo Bancshares	Morgan Stanley	24.424			Merrill Lynch	50.232
(25.024)	TriMas Corp	HSBC	16.516	9.500	Trupanion Inc	Barclays Bank	81.795
(44.164)	TriMas Corp	Morgan Stanley	5.300	7.753	Trupanion Inc	Goldman Sachs	99.782
(559)	Trimble Inc	Bank of America		4.308	Trupanion Inc	HSBC	61.983
		Merrill Lynch	(872)	8.154	Trupanion Inc	Morgan Stanley	70.206
(2.114)	Trimble Inc	Barclays Bank	317	(10.930)	TrustCo Bank Corp NY	HSBC	(15.061)
(2.233)	Trimble Inc	Goldman Sachs	(3.483)	14.186	Trustmark Corp	Goldman Sachs	(13.335)
(257)	Trimble Inc	Morgan Stanley	39	38.412	Trustmark Corp	Morgan Stanley	(18.054)
1.947	TriNet Group Inc	Bank of America		4.615	TTEC Holdings Inc	Barclays Bank	27.229
		Merrill Lynch	(8.606)	1.466	TTEC Holdings Inc	Morgan Stanley	8.649
17.443	TriNet Group Inc	Barclays Bank	(56.690)	(62.019)	TTM Technologies Inc	Bank of America	
7.263	TriNet Group Inc	Goldman Sachs	(32.102)			Merrill Lynch	(11.163)
12.340	TriNet Group Inc	HSBC	(49.446)	(45.629)	TTM Technologies Inc	Barclays Bank	(1.825)
(72)	TriNet Group Inc	HSBC	296	(45.399)	TTM Technologies Inc	Goldman Sachs	(8.172)
2.367	TriNet Group Inc	Morgan Stanley	(7.693)	(12.588)	TTM Technologies Inc	HSBC	(2.895)
(4.307)	TriNet Group Inc	Morgan Stanley	13.998	(72.146)	TTM Technologies Inc	Morgan Stanley	(2.886)
4.882	Trinity Industries Inc	Bank of America		(1.681)	Tucows Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.246)			Merrill Lynch	701
6.550	Trinity Industries Inc	Barclays Bank	(870)	(31.104)	Tucows Inc 'A'	Barclays Bank	41.498
12.986	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs	(1.221)	(6.083)	Tupperware Brands Corp	Morgan Stanley	1.764
2.968	Trinity Industries Inc	HSBC	(1.473)	(2.217)	Turning Point Brands Inc	Morgan Stanley	2.261
6.949	Trinity Industries Inc	Morgan Stanley	(1.356)	300	Turning Point Therapeutics Inc	Bank of America	
(50.634)	Trinity Place Holdings Inc	Bank of America		(3.008)	Turning Point Therapeutics Inc	Merrill Lynch	(1.281)
		Merrill Lynch	(4.557)			Barclays Bank	13.295
(2.631)	Trinity Place Holdings Inc	Barclays Bank	—	1.861	Turning Point Therapeutics Inc	Barclays Bank	(8.226)
(16.263)	Trinity Place Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.464)	266	Turning Point Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1.136)
7.897	Trinseo SA	Goldman Sachs	(35.142)	(669)	Turning Point Therapeutics Inc	Morgan Stanley	2.957
2.131	Trinseo SA	HSBC	(1.683)	4.892	Turtle Beach Corp	Barclays Bank	15.263
3.443	Trinseo SA	Morgan Stanley	(5.922)	6.197	Turtle Beach Corp	Goldman Sachs	28.134
3.020	TripAdvisor Inc	Bank of America		4.264	Turtle Beach Corp	HSBC	26.650
		Merrill Lynch	6.338	19.102	Tutor Perini Corp	Goldman Sachs	(5.922)
(1.671)	TripAdvisor Inc	Bank of America		257	Twilio Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2)	(5.921)	Twin Disc Inc	Merrill Lynch	9.972
2.169	TripAdvisor Inc	Barclays Bank	5.531	(19.107)	Twin Disc Inc	Goldman Sachs	2.428
(12.109)	TripAdvisor Inc	Barclays Bank	(30.878)	(9.208)	Twin Disc Inc	HSBC	(23.502)
2.589	TripAdvisor Inc	Goldman Sachs	6.343	(1.663)	Twist Bioscience Corp	Morgan Stanley	(184)
3.116	TripAdvisor Inc	Morgan Stanley	4.626			Bank of America	
(2.763)	TripAdvisor Inc	Morgan Stanley	(7.168)	(1.784)	Twist Bioscience Corp	Merrill Lynch	(22.617)
(6.980)	Triple-S Management Corp	Morgan Stanley	1.675	(3.617)	Twist Bioscience Corp	Barclays Bank	(14.254)
43.124	TriState Capital Holdings Inc	Bank of America		(1.536)	Twist Bioscience Corp	Goldman Sachs	(49.191)
		Merrill Lynch	9.056	697	Twitter Inc	Morgan Stanley	(12.273)
8.802	TriState Capital Holdings Inc	Barclays Bank	3.521	2.898	Twitter Inc	Bank of America	
4.121	Triton International Ltd	Bank of America		12.121	Twitter Inc	Merrill Lynch	3.764
		Merrill Lynch	1.071	(7.613)	Two Harbors Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(464)
3.435	Triton International Ltd	Barclays Bank	6.114	(20.120)	Two Harbors Investment Corp (REIT)	Barclays Bank	(305)
702	Triton International Ltd	Goldman Sachs	183	(125.254)	Two Harbors Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	604
18.656	Triton International Ltd	Morgan Stanley	29.404	(47.401)	Two Harbors Investment Corp (REIT)	HSBC	(17.536)
(2.328)	Triumph Bancorp Inc	Bank of America		(3.320)	Tyler Technologies Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	382			Merrill Lynch	(37.914)
(2.920)	Triumph Bancorp Inc	Barclays Bank	(4.468)	(2.088)	Tyler Technologies Inc	Barclays Bank	1.399
(8.214)	Triumph Bancorp Inc	Morgan Stanley	(12.567)	1.457	Tyler Technologies Inc	Barclays Bank	(976)
(4.402)	Triumph Group Inc	Bank of America		(1.047)	Tyler Technologies Inc	Goldman Sachs	(7.713)
		Merrill Lynch	(302)				
(21.727)	Triumph Group Inc	Barclays Bank	(58.965)				
(10.603)	Triumph Group Inc	Morgan Stanley	(28.946)				
(780)	Tronox Holdings Plc 'A'	Barclays Bank	70				
(50.153)	Tronox Holdings Plc 'A'	Morgan Stanley	4.514				
8.434	TrueBlue Inc	Barclays Bank	3.205				
3.944	TrueBlue Inc	Goldman Sachs	(592)				
53.353	TrueCar Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	66.158				
6.666	TrueCar Inc	Barclays Bank	6.066				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
568	Tyler Technologies Inc	Goldman Sachs	6.487	30.454	Umpqua Holdings Corp	Bank of America	
1.187	Tyler Technologies Inc	HSBC	12.986			Merrill Lynch	(3.959)
(2.723)	Tyler Technologies Inc	Morgan Stanley	4.762	40.577	Umpqua Holdings Corp	Barclays Bank	16.637
301	Tyler Technologies Inc	Morgan Stanley	(202)	58.392	Umpqua Holdings Corp	Goldman Sachs	(7.591)
57.461	Tyme Technologies Inc	Barclays Bank	13.791	35.786	Umpqua Holdings Corp	HSBC	(537)
12.020	Tyme Technologies Inc	HSBC	4.267	50.295	Umpqua Holdings Corp	Morgan Stanley	20.621
16.663	Tyme Technologies Inc	Morgan Stanley	3.999	24.208	Under Armour Inc 'A'	Bank of America	
(8.188)	Tyson Foods Inc 'A'	Morgan Stanley	8.679			Merrill Lynch	2.879
(2.561)	Uber Technologies Inc	Barclays Bank	(2.049)	1.498	Under Armour Inc 'A'	Goldman Sachs	(432)
6.888	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	5.510	8.651	Under Armour Inc 'A'	HSBC	8.351
253	Ubiquiti Inc	Bank of America		84.889	Under Armour Inc 'A'	Morgan Stanley	109.507
		Merrill Lynch	5.556	(1.750)	Unifi Inc	Morgan Stanley	(595)
(140)	Ubiquiti Inc	Barclays Bank	20	(95)	UniFirst Corp	Barclays Bank	(530)
112	Ubiquiti Inc	Goldman Sachs	2.460	(921)	UniFirst Corp	Goldman Sachs	2.155
(355)	Ubiquiti Inc	Goldman Sachs	(3.732)	605	UniFirst Corp	HSBC	(188)
91	Ubiquiti Inc	HSBC	2.351	(1.072)	UniFirst Corp	HSBC	332
(151)	Ubiquiti Inc	HSBC	(222)	1.757	UniFirst Corp	Morgan Stanley	9.804
1.068	Ubiquiti Inc	Morgan Stanley	10.157	(5.137)	UniFirst Corp	Morgan Stanley	(27.890)
(4.538)	UDR Inc (REIT)	Bank of America		(2.465)	Union Bankshares Inc/Morrisville VT	Bank of America	
		Merrill Lynch	(5.582)	3.055	Union Pacific Corp	Merrill Lynch	(1.750)
(2.946)	UDR Inc (REIT)	HSBC	(2.858)			Bank of America	
43.856	UDR Inc (REIT)	Morgan Stanley	28.945	1.200	Union Pacific Corp	Merrill Lynch	363
(1.793)	UDR Inc (REIT)	Morgan Stanley	(1.183)	(11.472)	Union Pacific Corp	Barclays Bank	1.404
17.367	UFP Industries Inc	Bank of America		(8.504)	Unisys Corp	Morgan Stanley	(13.422)
		Merrill Lynch	(46.196)	3.826	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.888)
15.932	UFP Industries Inc	Barclays Bank	15.773			Bank of America	
(10.120)	UFP Industries Inc	Goldman Sachs	26.919	(14.473)	United Airlines Holdings Inc	Merrill Lynch	6.810
4.166	UFP Industries Inc	Goldman Sachs	(11.082)	(377)	United Airlines Holdings Inc	Barclays Bank	(31.985)
5.579	UFP Industries Inc	Morgan Stanley	5.523	(464)	United Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs	203
4.024	UFP Technologies Inc	Bank of America		1.285	United Airlines Holdings Inc	HSBC	(2.004)
		Merrill Lynch	(15.412)	(2.808)	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	2.840
1.412	UFP Technologies Inc	Barclays Bank	(1.779)	(12.609)	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.206)
1.208	UFP Technologies Inc	HSBC	(1.063)		United Bankshares Inc	Bank of America	
1.303	UFP Technologies Inc	Morgan Stanley	(1.642)	(19.347)	United Bankshares Inc	Merrill Lynch	14.122
26.134	UGI Corp	Bank of America		(64.791)	United Bankshares Inc	Barclays Bank	(3.676)
		Merrill Lynch	22.618	(26.449)	United Bankshares Inc	Goldman Sachs	72.566
11.255	UGI Corp	Barclays Bank	13.324	(42.624)	United Bankshares Inc	HSBC	(15.605)
15.093	UGI Corp	Goldman Sachs	3.217	49.167	United Community Banks Inc	Morgan Stanley	(8.098)
90.309	UGI Corp	Morgan Stanley	93.162			Bank of America	
3.944	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Barclays Bank	116.506	17.581	United Community Banks Inc	Merrill Lynch	(32.450)
5.492	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Goldman Sachs	90.554	2.456	United Fire Group Inc	Goldman Sachs	(11.603)
(3.164)	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Morgan Stanley	(93.465)	39.304	United Fire Group Inc	HSBC	(2.702)
1.922	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Morgan Stanley	56.776	46.359	United Insurance Holdings Corp	Morgan Stanley	(46.772)
13.317	Ultra Clean Holdings Inc	Bank of America		33.228	United Insurance Holdings Corp	Barclays Bank	927
		Merrill Lynch	104.538	33.228	United Insurance Holdings Corp	HSBC	(13.291)
18.105	Ultra Clean Holdings Inc	Barclays Bank	57.212	19.567	United Insurance Holdings Corp	Morgan Stanley	391
1.984	Ultra Clean Holdings Inc	Morgan Stanley	3.853	(8.724)	United Natural Foods Inc	Bank of America	
6.932	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Bank of America		(3.392)	United Natural Foods Inc	Merrill Lynch	(14.607)
		Merrill Lynch	(59.477)	(3.794)	United Natural Foods Inc	Barclays Bank	(4.918)
1.419	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	(12.175)	(1.017)	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs	(9.068)
(1.088)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	9.335	(3.930)	United Parcel Service Inc 'B'	Morgan Stanley	(563)
171	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	HSBC	(1.289)	(3.103)	United Parcel Service Inc 'B'	Goldman Sachs	962
(702)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	2.724	(7.874)	United Parcel Service Inc 'B'	HSBC	4.748
(2.875)	Ultralife Corp	HSBC	(3.680)	(433)	United Rentals Inc	Morgan Stanley	(9.213)
(40.983)	Ultralife Corp	Morgan Stanley	6.147	(81)	United Rentals Inc	Bank of America	
(4.088)	UMB Financial Corp	Goldman Sachs	9.689	(1.157)	United Rentals Inc	Merrill Lynch	(22)
(11.580)	UMB Financial Corp	HSBC	11.001	(3.001)	United Rentals Inc	Barclays Bank	(651)
(11.031)	UMB Financial Corp	Morgan Stanley	10.259	(1.063)	United Rentals Inc	Goldman Sachs	8.192
(71.164)	UMH Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(712)	26.904	United Security Bancshares/Fresno CA	HSBC	42.554
(19.304)	UMH Properties Inc (REIT)	HSBC	17.181	15.447	United Security Bancshares/Fresno CA	Morgan Stanley	(8.547)
(93.623)	UMH Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	24.342	21.793	United Security Bancshares/Fresno CA	Barclays Bank	4.036
						Goldman Sachs	5.406
						HSBC	12.640

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
34.348	United Security Bancshares/Fresno CA	Morgan Stanley	5.152	(5.926)	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	4.017
5.713	United States Cellular Corp	Bank of America Merrill Lynch	(440)	(10.016)	Universal Health Services Inc 'B'	Barclays Bank	(4.814)
1.776	United States Cellular Corp	Barclays Bank	(22)	(12.568)	Universal Health Services Inc 'B'	Goldman Sachs	7.001
25.679	United States Cellular Corp	Goldman Sachs	(519)	(16.097)	Universal Health Services Inc 'B'	Morgan Stanley	(9.935)
7.024	United States Cellular Corp	HSBC	101	7.214	Universal Insurance Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.453)
26.520	United States Cellular Corp	Morgan Stanley	(2.122)	15.342	Universal Insurance Holdings Inc	Barclays Bank	3.222
(5.003)	United States Lime & Minerals Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.253	7.965	Universal Insurance Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.708)
(305)	United States Lime & Minerals Inc	Goldman Sachs	259	13.064	Universal Insurance Holdings Inc	HSBC	(6.401)
(791)	United States Lime & Minerals Inc	Morgan Stanley	(1.052)	13.109	Universal Insurance Holdings Inc	Morgan Stanley	2.753
9.288	United States Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.802)	29.339	Universal Logistics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42.835)
26.960	United States Steel Corp	Barclays Bank	35.082	4.077	Universal Logistics Holdings Inc	Barclays Bank	(1.386)
507	United States Steel Corp	HSBC	(771)	20.914	Universal Technical Institute Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.255
8.676	United States Steel Corp	Morgan Stanley	13.968	12.201	Universal Technical Institute Inc	Barclays Bank	(1.464)
(594)	United Therapeutics Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.360	32.544	Universal Technical Institute Inc	Goldman Sachs	1.953
(2.943)	United Therapeutics Corp	Barclays Bank	7.976	7.929	Universal Technical Institute Inc	HSBC	(634)
(3.176)	UnitedHealth Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.181)	28.218	Universal Technical Institute Inc	Morgan Stanley	(2.489)
(1.353)	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs	1.399	67.134	Univest Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.699)
(2.631)	UnitedHealth Group Inc	HSBC	23.600	24.030	Univest Financial Corp	Barclays Bank	14.178
(2.454)	UnitedHealth Group Inc	Morgan Stanley	(2.380)	67.782	Univest Financial Corp	Goldman Sachs	(4.745)
16.121	Uniti Group Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	3.547	4.410	Univest Financial Corp	HSBC	176
56.723	Uniti Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	12.479	(4.849)	Unum Group	Bank of America Merrill Lynch	(436)
19.367	Uniti Group Inc (REIT)	Morgan Stanley	(194)	9.441	Unum Group	Bank of America Merrill Lynch	1.765
(12.890)	Unitil Corp	Goldman Sachs	5.543	(37.234)	Unum Group	Barclays Bank	(26.064)
(15.636)	Unitil Corp	HSBC	28.770	1.870	Unum Group	Barclays Bank	1.309
(18.880)	Unitil Corp	Morgan Stanley	6.419	(595)	Unum Group	Goldman Sachs	(54)
6.399	Unity Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.472	3.385	Unum Group	Morgan Stanley	2.370
3.928	Unity Bancorp Inc	Barclays Bank	1.532	(3.451)	Upland Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.004)
12.010	Unity Bancorp Inc	Goldman Sachs	2.762	(14.223)	Upland Software Inc	Goldman Sachs	(20.623)
9.580	Unity Bancorp Inc	Morgan Stanley	3.736	(10.619)	Upland Software Inc	Morgan Stanley	(1.274)
38.391	UNITY Biotechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.455	(1.306)	Upwork Inc	Barclays Bank	(4.898)
(1.188)	Unity Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.373)	1.439	Upwork Inc	Barclays Bank	5.396
3.267	Univar Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22)	3.291	Upwork Inc	Goldman Sachs	22.774
(5.323)	Univar Solutions Inc	Goldman Sachs	(586)	(2.822)	Upwork Inc	HSBC	(19.869)
1.953	Univar Solutions Inc	Goldman Sachs	17	(19.370)	Uranium Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.131
(21.315)	Univar Solutions Inc	HSBC	(49.664)	(44.932)	Uranium Energy Corp	Barclays Bank	(5.392)
(39.701)	Univar Solutions Inc	Morgan Stanley	7.543	(32.585)	Urban Edge Properties (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(11.055)
(4.711)	Universal Corp	HSBC	15.217	(48.314)	Urban Edge Properties (REIT)	Barclays Bank	(15.072)
(53.036)	Universal Corp	Morgan Stanley	221.160	(21.710)	Urban Edge Properties (REIT)	Goldman Sachs	(7.381)
1.912	Universal Display Corp	Barclays Bank	5.870	(36.613)	Urban Edge Properties (REIT)	HSBC	(11.716)
1.017	Universal Display Corp	Goldman Sachs	20.411	(66.556)	Urban Edge Properties (REIT)	Morgan Stanley	(25.957)
1.982	Universal Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.766	11.160	Urban Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.562
12.355	Universal Electronics Inc	Barclays Bank	(4.454)	2.565	Urban Outfitters Inc	Barclays Bank	11.389
1.098	Universal Electronics Inc	Goldman Sachs	2.086				
6.636	Universal Electronics Inc	HSBC	15.462				
1.378	Universal Electronics Inc	Morgan Stanley	(510)				
(3.680)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(8.022)				
(2.373)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Barclays Bank	(4.153)				
(2.177)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Goldman Sachs	(4.746)				
(9.800)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	HSBC	(36.358)				
(4.714)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Morgan Stanley	(8.250)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.280	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs	179	(95.308)	Valley National Bancorp	Bank of America	
1.738	Urban Outfitters Inc	HSBC	2.485			Merrill Lynch	29.545
9.909	Urban Outfitters Inc	Morgan Stanley	36.289	(52.907)	Valley National Bancorp	HSBC	2.645
3.782	UroGen Pharma Ltd	Barclays Bank	1.513	(370.002)	Valley National Bancorp	Morgan Stanley	(14.799)
11.300	UroGen Pharma Ltd	Goldman Sachs	18.758	(707)	Valmont Industries Inc	Bank of America	
12.971	UroGen Pharma Ltd	Morgan Stanley	5.188			Merrill Lynch	8.046
(6.549)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Barclays Bank	(184)	(345)	Valmont Industries Inc	Barclays Bank	(642)
(60.250)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	4.218	(1.702)	Valmont Industries Inc	Goldman Sachs	19.369
(31.714)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	HSBC	11.734	(2.629)	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	(4.890)
(60.195)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(4.214)	23	Value Line Inc	Bank of America	
(8.579)	US Bancorp	Bank of America				Merrill Lynch	(55)
		Merrill Lynch	12.268	512	Value Line Inc	Barclays Bank	(773)
(4.059)	US Bancorp	Barclays Bank	(43)	25	Value Line Inc	Goldman Sachs	(60)
(9.718)	US Bancorp	Goldman Sachs	2.851	11.375	Valvoline Inc	Bank of America	
(6.875)	US Bancorp	HSBC	2.681			Merrill Lynch	14.674
(37.639)	US Bancorp	Morgan Stanley	(15.959)	9.574	Valvoline Inc	Barclays Bank	3.542
2.027	US Concrete Inc	Bank of America		3.684	Valvoline Inc	Goldman Sachs	4.752
		Merrill Lynch	(1.338)	16.677	Valvoline Inc	HSBC	12.714
4.969	US Concrete Inc	Barclays Bank	6.062	28.174	Valvoline Inc	Morgan Stanley	10.424
12.798	US Concrete Inc	HSBC	4.479	(14.492)	Vanda Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
(967)	US Ecology Inc	Barclays Bank	590			Merrill Lynch	12.898
(24.926)	US Ecology Inc	Goldman Sachs	63.811	(56.254)	Vanda Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	50.066
(22.311)	US Ecology Inc	HSBC	54.885	10.019	Vapotherm Inc	Bank of America	
(39.968)	US Ecology Inc	Morgan Stanley	24.380			Merrill Lynch	8.445
(597)	US Foods Holding Corp	HSBC	322	6.924	Vapotherm Inc	Barclays Bank	6.786
3.579	US Foods Holding Corp	HSBC	2.506	2.911	Vapotherm Inc	HSBC	1.666
(6.941)	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	(5.180)	5.037	Varex Imaging Corp	HSBC	7.253
59.520	US Oncology Inc	Bank of America		24.625	Varex Imaging Corp	Morgan Stanley	(16.253)
		Merrill Lynch	(59)	10.296	Varonis Systems Inc	Bank of America	
7.474	US Oncology Inc	Barclays Bank	—			Merrill Lynch	38.095
41.718	US Oncology Inc	Goldman Sachs	(42)	33.177	Varonis Systems Inc	Barclays Bank	29.196
8.296	US Oncology Inc	Morgan Stanley	—	9.067	Varonis Systems Inc	Goldman Sachs	33.548
(203)	US Physical Therapy Inc	Bank of America		2.490	Varonis Systems Inc	HSBC	7.221
		Merrill Lynch	37	24.025	Varonis Systems Inc	Morgan Stanley	21.142
(4.983)	US Physical Therapy Inc	Barclays Bank	5.132	(25.337)	Vaxart Inc	Barclays Bank	(6.841)
(432)	US Physical Therapy Inc	Goldman Sachs	78	(5.716)	Vaxart Inc	Goldman Sachs	(1.086)
11.486	US Silica Holdings Inc	Goldman Sachs	(17.918)	(18.643)	Vaxcyte Inc	Barclays Bank	(6.525)
3.406	US Silica Holdings Inc	HSBC	(2.657)	(1.778)	Vaxcyte Inc	Morgan Stanley	465
(26.344)	US Xpress Enterprises Inc 'A'	Bank of America		(53.375)	VBI Vaccines Inc	Bank of America	
(13.457)	US Xpress Enterprises Inc 'A'	Merrill Lynch	(5.796)			Merrill Lynch	(9.896)
		Barclays Bank	(1.749)	(41.469)	VBI Vaccines Inc	Barclays Bank	(6.220)
4.317	USANA Health Sciences Inc	Barclays Bank	3.972	(11.810)	VBI Vaccines Inc	Goldman Sachs	(1.226)
2.196	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	12.803	(3.867)	VBI Vaccines Inc	HSBC	(2.282)
(1.967)	Utah Medical Products Inc	Bank of America		21.722	Vector Group Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	4.091			Merrill Lynch	(16.074)
(3.491)	Utah Medical Products Inc	Barclays Bank	3.002	16.501	Vector Group Ltd	Barclays Bank	(16.996)
(3.591)	Utah Medical Products Inc	Goldman Sachs	7.469	5.192	Vector Group Ltd	Goldman Sachs	(3.842)
(3.262)	Utah Medical Products Inc	HSBC	11.287	7.102	Vector Group Ltd	HSBC	(2.344)
(3.750)	Utah Medical Products Inc	Morgan Stanley	3.225	358	Vector Group Ltd	Morgan Stanley	(369)
267	Vail Resorts Inc	Bank of America		5.700	Vectrus Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.291			Merrill Lynch	(8.023)
444	Vail Resorts Inc	Barclays Bank	2.762	14.354	Vectrus Inc	Goldman Sachs	(26.698)
1.157	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs	9.927	16.018	Vectrus Inc	Morgan Stanley	(9.290)
(417)	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs	(3.578)	(8.327)	Veeco Instruments Inc	Bank of America	
1.474	Vail Resorts Inc	Morgan Stanley	9.168			Merrill Lynch	(12.824)
(590)	Vail Resorts Inc	Morgan Stanley	(3.670)	(19.221)	Veeco Instruments Inc	Barclays Bank	(15.569)
520	Valero Energy Corp	Barclays Bank	1.087	(22.358)	Veeco Instruments Inc	HSBC	(43.598)
1.254	Valero Energy Corp	Goldman Sachs	(1.530)	(19.241)	Veeco Instruments Inc	Morgan Stanley	(15.585)
11.120	Valero Energy Corp	Morgan Stanley	23.241	(3.879)	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America	
(4.085)	Valhi Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(168.426)
		Merrill Lynch	5.188	(2.962)	Veeva Systems Inc 'A'	Barclays Bank	(84.506)
(200)	Valhi Inc	Barclays Bank	(24)	(146)	Veeva Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	193
(2.339)	Valhi Inc	Goldman Sachs	2.971	573	Velocity Financial Inc	Bank of America	
(579)	Valhi Inc	HSBC	1.639			Merrill Lynch	(252)
(786)	Valhi Inc	Morgan Stanley	(94)	14.135	Velocity Financial Inc	HSBC	(2.968)
				15.185	Velocity Financial Inc	Morgan Stanley	2.126
				(5.883)	Ventas Inc (REIT)	Barclays Bank	(1.647)
				(10.640)	Ventas Inc (REIT)	Goldman Sachs	(12.715)
				(67.959)	Venus Concept Inc	Barclays Bank	4.757
				(19.015)	Venus Concept Inc	Goldman Sachs	(3.042)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(23.277)	Vera Bradley Inc	Barclays Bank	(21.880)	919	ViacomCBS Inc 'A'	Bank of America	
(1.163)	Veracyte Inc	Barclays Bank	(2.047)			Merrill Lynch	2.794
6.774	Veracyte Inc	Barclays Bank	11.922	550	ViacomCBS Inc 'A'	Barclays Bank	578
(3.550)	Veracyte Inc	Goldman Sachs	(12.176)	606	ViacomCBS Inc 'A'	Goldman Sachs	1.842
6.026	Veracyte Inc	Goldman Sachs	14.307	3.394	ViacomCBS Inc 'A'	Morgan Stanley	3.564
(1.214)	Veracyte Inc	HSBC	3.958	3.822	ViacomCBS Inc 'B'	Barclays Bank	3.639
(68.053)	Verastem Inc	Bank of America		6.583	ViacomCBS Inc 'B'	HSBC	18.859
		Merrill Lynch	(63.289)	6.342	ViacomCBS Inc 'B'	Morgan Stanley	5.581
(25.545)	Verastem Inc	Morgan Stanley	2.810	811	Viad Corp	HSBC	1.679
(2.187)	Vericel Corp	HSBC	(14.806)	6.496	Viad Corp	Morgan Stanley	12.018
(4.766)	Vericel Corp	Morgan Stanley	(17.444)	(7.232)	Viant Technology Inc 'A'	Bank of America	
18.209	Verint Systems Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(26.494)
		Merrill Lynch	19.848	(2.236)	Viant Technology Inc 'A'	Barclays Bank	21
22.496	Verint Systems Inc	Barclays Bank	(225)	(6.597)	Viasat Inc	Bank of America	
27.051	Verint Systems Inc	Goldman Sachs	29.485			Merrill Lynch	(34.832)
5.547	Verint Systems Inc	HSBC	(1.831)	(3.924)	Viasat Inc	Goldman Sachs	(20.719)
38.595	Verint Systems Inc	Morgan Stanley	(386)	(1.317)	Viasat Inc	Morgan Stanley	(7.586)
(7.081)	VeriSign Inc	Bank of America		1.672	Viasat Inc	Morgan Stanley	9.631
		Merrill Lynch	(1.841)	(8.386)	Viatris Inc	Bank of America	
8.544	VeriSign Inc	Bank of America				Merrill Lynch	7.631
		Merrill Lynch	2.221	(8.914)	Viatris Inc	Barclays Bank	1.070
(2.868)	VeriSign Inc	Goldman Sachs	(746)	(65.352)	Viatris Inc	Goldman Sachs	59.470
3.655	Verisk Analytics Inc	Bank of America		(7.715)	Viatris Inc	HSBC	3.790
		Merrill Lynch	(42)	26.006	Viavi Solutions Inc	Bank of America	
3.621	Verisk Analytics Inc	Barclays Bank	(4.852)			Merrill Lynch	28.867
4.725	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs	(520)	100.203	Viavi Solutions Inc	Barclays Bank	27.055
7.075	Verisk Analytics Inc	HSBC	(38.612)	10.591	Viavi Solutions Inc	Goldman Sachs	11.756
14.257	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	(19.104)	(23.089)	Viavi Solutions Inc	HSBC	(31.170)
(5.136)	Veritex Holdings Inc	Bank of America		93.021	Viavi Solutions Inc	Morgan Stanley	25.115
		Merrill Lynch	1.541	10.541	VICI Properties Inc (REIT)	Bank of America	
(7.000)	Veritex Holdings Inc	Barclays Bank	3.640			Merrill Lynch	(632)
(24.239)	Veritex Holdings Inc	Goldman Sachs	7.272	20.955	VICI Properties Inc (REIT)	Barclays Bank	(5.449)
(20.845)	Veritex Holdings Inc	HSBC	(4.586)	4.835	VICI Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(290)
(41.872)	Veritex Holdings Inc	Morgan Stanley	21.773	21.096	VICI Properties Inc (REIT)	HSBC	(3.165)
1.673	Veritiv Corp	HSBC	24.008	(3.481)	Vicor Corp	Bank of America	
(4.400)	Veritone Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(39.683)
		Merrill Lynch	(9.152)	(6.292)	Vicor Corp	Barclays Bank	(18.247)
(2.220)	Veritone Inc	Barclays Bank	(1.487)	(23.599)	Vicor Corp	Goldman Sachs	(269.029)
(841)	Verizon Communications Inc	Barclays Bank	412	(1.481)	Vicor Corp	Morgan Stanley	(4.295)
(65.269)	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs	94.640	(20.762)	Vidler Water Resources Inc	Bank of America	
13.774	Verra Mobility Corp	Barclays Bank	(14.738)	(60.213)	Vidler Water Resources Inc	Merrill Lynch	(9.551)
13.327	Verra Mobility Corp	Goldman Sachs	(2.532)	(7.837)	Vidler Water Resources Inc	Goldman Sachs	(27.698)
28.235	Verra Mobility Corp	Morgan Stanley	(30.211)	(48.887)	Viemed Healthcare Inc	HSBC	(8.699)
(4.709)	Verrica Pharmaceuticals Inc	Bank of America		14.834	ViewRay Inc	Barclays Bank	52.804
		Merrill Lynch	2.072	5.848	ViewRay Inc	Goldman Sachs	(1.928)
(3.298)	Verrica Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	726	7.510	ViewRay Inc	HSBC	2.602
(10.174)	Verrica Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	4.477	(39.118)	Viking Therapeutics Inc	Barclays Bank	5.182
(2.085)	Verrica Pharmaceuticals Inc	HSBC	250	(31.394)	Village Super Market Inc 'A'	Bank of America	24.644
(2.050)	Verrica Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	451	(28.740)	Village Super Market Inc 'A'	Merrill Lynch	40.812
(7.739)	Verso Corp 'A'	Goldman Sachs	3.947	(19.625)	Village Super Market Inc 'A'	Barclays Bank	5.689
(5.390)	Verso Corp 'A'	HSBC	(10.672)	(5.390)	Village Super Market Inc 'A'	Goldman Sachs	25.513
(14.584)	Verso Corp 'A'	Morgan Stanley	1.167	(8.139)	Village Super Market Inc 'A'	HSBC	6.899
563	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America		(1.095)	Vimeo Inc	Morgan Stanley	1.709
		Merrill Lynch	(2.989)			Bank of America	
4.014	Vertex Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	3.466	(7.336)	Vimeo Inc	Merrill Lynch	(45.990)
666	Vertex Pharmaceuticals Inc	HSBC	(3.081)	(560)	Vimeo Inc	Barclays Bank	(308.112)
11.248	Vertex Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(16.002)	411	Vimeo Inc	Goldman Sachs	(23.520)
(5.313)	Vertiv Holdings Co	Barclays Bank	(2.603)	(15.257)	Vimeo Inc	Goldman Sachs	17.262
(2.007)	Veru Inc	Barclays Bank	(1.244)	(11.185)	Vince Holding Corp	Morgan Stanley	(640.794)
(10.275)	Veru Inc	HSBC	(14.796)	(13.891)	Vince Holding Corp	Barclays Bank	(6.264)
(4.956)	VF Corp	Bank of America		3.678	Vincerx Pharma Inc	Morgan Stanley	(7.779)
		Merrill Lynch	34.345			Bank of America	
5.376	VF Corp	Bank of America		7.347	Vincerx Pharma Inc	Merrill Lynch	(9.342)
		Merrill Lynch	14.379	1.398	Vincerx Pharma Inc	Barclays Bank	(2.236)
(16.519)	VF Corp	Barclays Bank	(51.374)	12.191	Vincerx Pharma Inc	HSBC	(1.177)
(9.349)	VF Corp	Goldman Sachs	64.789	(32.051)	Vine Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.535)
2.857	VF Corp	Goldman Sachs	(13.681)	(4.434)	Vine Energy Inc 'A'	Bank of America	
6.322	VF Corp	Morgan Stanley	(265)			Merrill Lynch	(15.949)
						Goldman Sachs	(7)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(771)	Vir Biotechnology Inc	Goldman Sachs	2.143	(2.939)	Vornado Realty Trust (REIT)	HSBC	(2.263)
(2.746)	Vir Biotechnology Inc	Morgan Stanley	4.064	(4.365)	Vornado Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	(1.659)
2.668	Viracta Therapeutics Inc	Barclays Bank	694	7.758	VOXX International Corp	Bank of America	
300	Viracta Therapeutics Inc	Goldman Sachs	651			Merrill Lynch	4.500
(2.552)	Virgin Galactic Holdings Inc	Bank of America		7.589	Voya Financial Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(37.234)			Merrill Lynch	(22.995)
(1.451)	Virgin Galactic Holdings Inc	Barclays Bank	(6.297)	17.048	Voya Financial Inc	Barclays Bank	(13.809)
(381)	Virgin Galactic Holdings Inc	Goldman Sachs	(5.559)	8.600	Voya Financial Inc	Goldman Sachs	(26.058)
(145.558)	VirnetX Holding Corp	Goldman Sachs	(11.645)	20.271	Voya Financial Inc	HSBC	(61.016)
13.083	Virtu Financial Inc 'A'	Barclays Bank	20.409	23.437	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	(18.984)
7.207	Virtu Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	10.306	(17.367)	Voyager Therapeutics Inc	Bank of America	
(1.136)	Virtu Financial Inc 'A'	HSBC	(2.454)			Merrill Lynch	4.863
4.899	Virtu Financial Inc 'A'	HSBC	7.500	(16.684)	Voyager Therapeutics Inc	Barclays Bank	(2.503)
(8.964)	Virtu Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	(13.984)	(15.333)	Voyager Therapeutics Inc	Goldman Sachs	4.293
9.712	Virtu Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	15.151	(12.864)	Voyager Therapeutics Inc	HSBC	(1.930)
275	Virtus Investment Partners Inc	Bank of America		(5.325)	Voyager Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(799)
		Merrill Lynch	2.112	(6.477)	Vroom Inc	Bank of America	
1.007	Virtus Investment Partners Inc	Barclays Bank	2.383	(1.816)	Vroom Inc	Merrill Lynch	(26.297)
296	Virtus Investment Partners Inc	Goldman Sachs	2.273	(9.122)	Vroom Inc	Barclays Bank	(200)
2.435	Virtus Investment Partners Inc	Morgan Stanley	6.550	6.769	VSE Corp	HSBC	(53.774)
7.332	Visa Inc 'A'	Morgan Stanley	(9.066)	1.883	VSE Corp	Bank of America	
(109.988)	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	19.798	5.256	Vulcan Materials Co	Merrill Lynch	27.888
(7.389)	Vishay Precision Group Inc	Morgan Stanley	9.015	4.816	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs	7.758
(1.649)	Visteon Corp	Bank of America		7.626	Vulcan Materials Co	Merrill Lynch	(34.788)
		Merrill Lynch	(13.802)	(6.630)	Vuzix Corp	Barclays Bank	(6.962)
(2.882)	Visteon Corp	Barclays Bank	(28.474)	(8.953)	VYNE Therapeutics Inc	Barclays Bank	(3.581)
(618)	Visteon Corp	Goldman Sachs	(5.173)	(14.105)	VYNE Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(4.514)
(8.738)	Vistra Corp	Bank of America		3.066	W R Berkley Corp	Barclays Bank	(767)
		Merrill Lynch	(2.185)	415	W R Berkley Corp	Goldman Sachs	(589)
(5.354)	Vistra Corp	Barclays Bank	2.623	10.359	W R Berkley Corp	HSBC	(27.899)
(2.453)	Vistra Corp	Goldman Sachs	(613)	21.120	W R Berkley Corp	Morgan Stanley	(3.249)
(34.970)	Vistra Corp	Morgan Stanley	17.135	20.327	W&T Offshore Inc	Bank of America	
22.357	Vital Farms Inc	Barclays Bank	24.816			Merrill Lynch	(1.423)
1.016	Vital Farms Inc	Goldman Sachs	1.030	19.014	W&T Offshore Inc	Barclays Bank	951
1.389	Vital Farms Inc	HSBC	1.583	198.070	W&T Offshore Inc	Goldman Sachs	(13.865)
(18.542)	Vivint Smart Home Inc	Barclays Bank	(11.867)	5.623	W&T Offshore Inc	HSBC	1.406
(7.198)	Vivint Smart Home Inc	Goldman Sachs	(6.190)	126.442	W&T Offshore Inc	Morgan Stanley	6.322
(3.857)	Vivint Smart Home Inc	Morgan Stanley	(190)	19.763	Wabash National Corp	Bank of America	
2.380	VMware Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	(23.320)
		Merrill Lynch	(6.772)	42.242	Wabash National Corp	Goldman Sachs	(49.846)
626	VMware Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.863)	30.610	Wabash National Corp	HSBC	(56.935)
2.192	VMware Inc 'A'	HSBC	(12.648)	(21.780)	Waitr Holdings Inc	Bank of America	
7.496	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	(32.233)			Merrill Lynch	653
17.349	Vocera Communications Inc	Morgan Stanley	(1.561)	(63.654)	Waitr Holdings Inc	Goldman Sachs	1.910
9.696	VolitionRX Ltd	Bank of America		4.369	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	—	9.562	Walgreens Boots Alliance Inc	Merrill Lynch	(11.534)
5.227	VolitionRX Ltd	Barclays Bank	(209)	8.767	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs	(25.244)
12.853	VolitionRX Ltd	Morgan Stanley	(514)	9.498	Walgreens Boots Alliance Inc	HSBC	(3.085)
(5.435)	Vonage Holdings Corp	Bank of America		569	Walker & Dunlop Inc	Morgan Stanley	(20.611)
		Merrill Lynch	(1.794)			Bank of America	
(6.702)	Vonage Holdings Corp	Barclays Bank	(469)			Merrill Lynch	660
(8.633)	Vonage Holdings Corp	Goldman Sachs	(2.849)	7.453	Walker & Dunlop Inc	Goldman Sachs	8.645
(13.124)	Vonage Holdings Corp	HSBC	(14.699)	(2.623)	Walmart Inc	Barclays Bank	(708)
(45.659)	Vonage Holdings Corp	Morgan Stanley	(3.196)	(1.729)	Walmart Inc	HSBC	(2.092)
14.894	Vontier Corp	Bank of America		(3.401)	Warner Music Group Corp 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	14.149			Merrill Lynch	(510)
(3.180)	Vontier Corp	Barclays Bank	(1.399)	(14.099)	Warner Music Group Corp 'A'	Barclays Bank	(13.958)
(3.018)	Vontier Corp	HSBC	(1.811)				
(32.957)	Vontier Corp	Morgan Stanley	(14.501)	(17.552)	Warner Music Group Corp 'A'	Goldman Sachs	(2.633)
2.427	Vor BioPharma Inc	Bank of America		(8.586)	Warner Music Group Corp 'A'	Morgan Stanley	(8.500)
		Merrill Lynch	4.733	(6.547)	Warrior Met Coal Inc	Bank of America	
1.177	Vor BioPharma Inc	Barclays Bank	1.142			Merrill Lynch	(5.830)
1.134	Vor BioPharma Inc	Goldman Sachs	2.211				
2.328	Vor BioPharma Inc	HSBC	(2.538)				
454	Vor BioPharma Inc	Morgan Stanley	440				
1.399	Vornado Realty Trust (REIT)	Barclays Bank	532				
(2.498)	Vornado Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(2.898)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(27.022)	Warrior Met Coal Inc	Barclays Bank	(12.034)	240	WD-40 Co	Goldman Sachs	337
(8.627)	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs	(8.646)	(2.903)	WD-40 Co	HSBC	(11.873)
(13.968)	Warrior Met Coal Inc	HSBC	(35.060)	(4.859)	WD-40 Co	Morgan Stanley	(16.680)
(14.277)	Warrior Met Coal Inc	Morgan Stanley	(5.996)	15.016	Webster Financial Corp	Barclays Bank	1.952
13.216	Washington Federal Inc	Bank of America		18.247	Webster Financial Corp	Goldman Sachs	(12.407)
		Merrill Lynch	(5.947)	12.265	Webster Financial Corp	Morgan Stanley	1.542
24.926	Washington Federal Inc	Barclays Bank	(2.493)	(5.220)	WEC Energy Group Inc	Bank of America	
42.472	Washington Federal Inc	Goldman Sachs	(19.112)			Merrill Lynch	9.657
46.200	Washington Federal Inc	Morgan Stanley	(4.620)	1.731	WEC Energy Group Inc	Barclays Bank	(110)
19.790	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America		(1.631)	WEC Energy Group Inc	Goldman Sachs	3.017
		Merrill Lynch	17.217	1.575	WEC Energy Group Inc	Goldman Sachs	(113)
74.238	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	Barclays Bank	25.241	(8.952)	WEC Energy Group Inc	HSBC	47.893
19.934	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	9.250	2.940	WEC Energy Group Inc	HSBC	1.140
9.817	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	HSBC	8.136	(36.028)	WEC Energy Group Inc	Morgan Stanley	52.241
14.111	Washington Trust Bancorp Inc	Barclays Bank	25.823	(16.068)	Weingarten Realty Investors (REIT)	Bank of America	
9.575	Washington Trust Bancorp Inc	Goldman Sachs	10.820	(90.720)	Weingarten Realty Investors (REIT)	Merrill Lynch	(9.858)
791	Washington Trust Bancorp Inc	HSBC	2.041	(12.485)	Weingarten Realty Investors (REIT)	Barclays Bank	(87.091)
45.117	Washington Trust Bancorp Inc	Morgan Stanley	82.564	(20.252)	Weingarten Realty Investors (REIT)	Goldman Sachs	(8.192)
572	Waste Connections Inc	Bank of America		17.305	Weis Markets Inc	Morgan Stanley	(18.070)
		Merrill Lynch	(309)	8.252	Welbilt Inc	Morgan Stanley	(14.017)
2.276	Waste Connections Inc	Barclays Bank	1.320	21.905	Welbilt Inc	Bank of America	32.018
375	Waste Connections Inc	HSBC	(818)	11.434	Wells Fargo & Co	Barclays Bank	112.154
14.627	Waste Connections Inc	Morgan Stanley	8.483	(7.787)	Wells Fargo & Co	Barclays Bank	5.488
2.514	Waste Management Inc	Bank of America		(788)	Wells Fargo & Co	Barclays Bank	(3.738)
		Merrill Lynch	2.350	7.805	Welltower Inc (REIT)	Goldman Sachs	930
(19.525)	Waste Management Inc	Goldman Sachs	16.206	1.734	Wendy's Co	Morgan Stanley	859
2.767	Waste Management Inc	Goldman Sachs	735	2.210	Wendy's Co	Merrill Lynch	(35)
(7.363)	Waste Management Inc	HSBC	18.997	54.718	Wendy's Co	Barclays Bank	(66)
(8.882)	Waste Management Inc	Morgan Stanley	3.819	44.276	Wendy's Co	Goldman Sachs	(1.094)
219	Waters Corp	Bank of America		5.526	Werner Enterprises Inc	Morgan Stanley	(1.328)
		Merrill Lynch	1.720	33.007	Werner Enterprises Inc	Bank of America	
1.147	Waters Corp	Barclays Bank	5.792	13.990	Werner Enterprises Inc	Merrill Lynch	(3.260)
399	Waters Corp	Goldman Sachs	5.311	7.152	Werner Enterprises Inc	Barclays Bank	(15.787)
(1.226)	Waters Corp	Goldman Sachs	(16.318)	83.034	Werner Enterprises Inc	Goldman Sachs	(8.254)
(1.133)	Waters Corp	Morgan Stanley	(5.722)	4.571	WesBanco Inc	HSBC	(6.580)
(32.703)	Waterstone Financial Inc	Morgan Stanley	327	21.818	WesBanco Inc	Morgan Stanley	(44.008)
1.552	Watsco Inc	Bank of America		53.220	WesBanco Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.474)	28.319	WesBanco Inc	Merrill Lynch	(3.565)
530	Watsco Inc	Barclays Bank	2.947	18.747	WesBanco Inc	Barclays Bank	(2.836)
3.334	Watsco Inc	Goldman Sachs	(18.970)	(680)	WESCO International Inc	Goldman Sachs	(41.512)
314	Watsco Inc	HSBC	972	4.580	WESCO International Inc	HSBC	13.876
5.524	Watts Water Technologies Inc 'A'	Bank of America		(4.451)	WESCO International Inc	Morgan Stanley	(932)
		Merrill Lynch	497	(136)	WESCO International Inc	Goldman Sachs	(10.351)
6.738	Watts Water Technologies Inc 'A'	Barclays Bank	22.909	8.520	West BanCorp Inc	Morgan Stanley	(65)
(788)	Watts Water Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	(71)	9.616	West BanCorp Inc	Bank of America	
406	Watts Water Technologies Inc 'A'	HSBC	(1.255)	1.920	West Pharmaceutical Services Inc	Merrill Lynch	2.556
17.221	Watts Water Technologies Inc 'A'	Morgan Stanley	58.552	2.497	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	2.885
(423)	Watts Water Technologies Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.438)	185	West Pharmaceutical Services Inc	Barclays Bank	15.341
(12.530)	WaVe Life Sciences Ltd	Barclays Bank	(4.761)	1.206	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	51.962
(1.513)	Wayfair Inc 'A'	Barclays Bank	10.773	(1.664)	Westamerica BanCorp	HSBC	54
(1.100)	Wayfair Inc 'A'	Morgan Stanley	7.832	(5.300)	Westamerica BanCorp	Morgan Stanley	9.636
(4.223)	WD-40 Co	Bank of America		(8.640)	Westamerica BanCorp	Barclays Bank	383
		Merrill Lynch	(7.348)	(9.332)	Westamerica BanCorp	Goldman Sachs	5.724
316	WD-40 Co	Bank of America		4.893	Western Alliance Bancorp	HSBC	6.221
		Merrill Lynch	938	(1.987)	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	2.146
(2.794)	WD-40 Co	Barclays Bank	(10.170)	(6.289)	Western Alliance Bancorp	Barclays Bank	7.193
(2.045)	WD-40 Co	Goldman Sachs	(3.559)			HSBC	9.875
						Morgan Stanley	(9.245)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
2.735	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	4.020	(524)	White Mountains Insurance		
(65.967)	Western Asset Mortgage	Bank of America			Group Ltd	Goldman Sachs	(1.747)
	Capital Corp (REIT)	Merrill Lynch	(7.916)	(180)	White Mountains Insurance	HSBC	3.761
(24.823)	Western Asset Mortgage			(134)	White Mountains Insurance		
	Capital Corp (REIT)	Goldman Sachs	(2.979)		Group Ltd	Morgan Stanley	2.227
(12.814)	Western Digital Corp	Bank of America		31.473	Whitestone REIT (REIT)	Bank of America	
		Merrill Lynch	15.070			Merrill Lynch	(16.681)
(9.900)	Western Digital Corp	Barclays Bank	(13.068)	72.683	Whitestone REIT (REIT)	Barclays Bank	(10.176)
(23.796)	Western Digital Corp	Goldman Sachs	(19.668)	52.414	Whitestone REIT (REIT)	Goldman Sachs	(27.779)
(4.843)	Western Digital Corp	Morgan Stanley	(6.393)	64.165	Whitestone REIT (REIT)	HSBC	(57.749)
(36.338)	Western New England	Bank of America		55.959	Whitestone REIT (REIT)	Morgan Stanley	(7.834)
	Bancorp Inc	Merrill Lynch	1.454	(544)	Whiting Petroleum Corp	Bank of America	
(5.658)	Western New England					Merrill Lynch	(3.862)
	Bancorp Inc	Barclays Bank	(566)	(11.278)	Whiting Petroleum Corp	Goldman Sachs	(80.074)
(10.087)	Western New England			9.930	Whole Earth Brands Inc	Bank of America	
	Bancorp Inc	Goldman Sachs	403	16.999	Whole Earth Brands Inc	Merrill Lynch	3.972
(7.453)	Western Union Co	Barclays Bank	1.714	38.299	Whole Earth Brands Inc	HSBC	(9.179)
(10.929)	Western Union Co	HSBC	14.536	7.098	WideOpenWest Inc	Morgan Stanley	1.915
(4.095)	Westinghouse Air Brake	Bank of America		(7.926)	Willdan Group Inc	Bank of America	
	Technologies Corp	Merrill Lynch	(9.584)	(2.890)	Willdan Group Inc	Merrill Lynch	7.311
(2.406)	Westinghouse Air Brake			(10.770)	Willdan Group Inc	Barclays Bank	6.579
	Technologies Corp	Barclays Bank	(4.086)	(14.989)	Willdan Group Inc	Goldman Sachs	7.283
2.742	Westinghouse Air Brake			(4.547)	Williams Cos Inc	HSBC	6.354
	Technologies Corp	Barclays Bank	5.100	(1.210)	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	12.441
(4.545)	Westinghouse Air Brake	Goldman Sachs	(10.726)	3.005	Williams-Sonoma Inc	Barclays Bank	2.118
(5.642)	Westinghouse Air Brake			3.142	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	13.823
	Technologies Corp	HSBC	(10.720)	(806)	Willis Lease Finance Corp	Goldman Sachs	14.453
(20.102)	Westinghouse Air Brake			(2.474)	Willis Lease Finance Corp	HSBC	(282)
	Technologies Corp	Morgan Stanley	(31.649)	(1.303)	Willis Lease Finance Corp	Morgan Stanley	3.934
6.564	Westlake Chemical Corp	Bank of America		(25)	Willis Towers Watson Plc	Barclays Bank	1.955
		Merrill Lynch	(27.109)	(109)	Willis Towers Watson Plc	Goldman Sachs	39
691	Westlake Chemical Corp	Barclays Bank	(87)	(710)	Willis Towers Watson Plc	Morgan Stanley	506
3.228	Westlake Chemical Corp	Goldman Sachs	(13.332)	14.182	WillScot Mobile Mini	Morgan Stanley	1.108
2.866	Westlake Chemical Corp	HSBC	(4.418)		Holdings Corp	Bank of America	
2.475	Westlake Chemical Corp			8.064	WillScot Mobile Mini	Merrill Lynch	17.018
(20.356)	Westrock Co	Morgan Stanley	—		Holdings Corp	Barclays Bank	403
		Merrill Lynch	71.042	18.287	WillScot Mobile Mini	Goldman Sachs	14.706
(11.612)	Westrock Co	Barclays Bank	(697)	8.617	WillScot Mobile Mini	HSBC	8.919
(3.968)	Westrock Co	Goldman Sachs	13.848	79.223	WillScot Mobile Mini	Morgan Stanley	4.128
9.782	Westwater Resources Inc	HSBC	4.304	2.831	Wingstop Inc	Bank of America	
18.357	Westwood Holdings Group			1.661	Wingstop Inc	Merrill Lynch	26.810
	Inc	Goldman Sachs	(11.198)	1.114	Wingstop Inc	Barclays Bank	731
11.267	Westwood Holdings Group			222	Wingstop Inc	Goldman Sachs	10.550
	Inc	Morgan Stanley	(1.915)	1.549	Wingstop Inc	HSBC	2.302
3.277	WEX Inc	Bank of America		(2.401)	Winmark Corp	Morgan Stanley	682
		Merrill Lynch	25.721	(4.226)	Winmark Corp	Bank of America	
434	WEX Inc	Barclays Bank	872	(1.863)	Winmark Corp	Merrill Lynch	2.113
330	WEX Inc	Goldman Sachs	2.653	(1.285)	Winmark Corp	Barclays Bank	19.693
(2.102)	WEX Inc	HSBC	862	(195)	Winmark Corp	Goldman Sachs	1.639
350	WEX Inc	HSBC	(144)	(4.215)	Winnebago Industries Inc	HSBC	(386)
(2.106)	WEX Inc	Morgan Stanley	(5.328)	6.147	Wintrust Financial Corp	Morgan Stanley	909
1.191	WEX Inc	Morgan Stanley	3.013			Barclays Bank	(19.937)
(3.097)	Weyco Group Inc	Bank of America		11.817	Wintrust Financial Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.716	10.713	Wintrust Financial Corp	Merrill Lynch	(2.582)
(5.501)	Weyco Group Inc	Barclays Bank	6.436	91.885	WisdomTree Investments	Goldman Sachs	(4.963)
(9.164)	Weyco Group Inc	Goldman Sachs	10.997		Inc	HSBC	22.390
(2.718)	Weyerhaeuser Co (REIT)	Bank of America		22.081	WisdomTree Investments		
		Merrill Lynch	299		Inc	Morgan Stanley	(1.987)
(2.175)	Weyerhaeuser Co (REIT)	Barclays Bank	(1.762)	(2.245)	Wix.com Ltd	Barclays Bank	(28.399)
928	Weyerhaeuser Co (REIT)	HSBC	(2.626)	711	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	24.942
(39.487)	Weyerhaeuser Co (REIT)	Morgan Stanley	(31.984)	(568)	Wix.com Ltd	HSBC	12.343
467	Whirlpool Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	(3.937)				
(1.149)	Whirlpool Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	5.269				
4.714	Whirlpool Corp	Barclays Bank	9.852				
(4.337)	Whirlpool Corp	Barclays Bank	(9.064)				
(1.359)	Whirlpool Corp	Goldman Sachs	11.456				
(33)	White Mountains Insurance						
	Group Ltd	Barclays Bank	115				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(2.785)	Wolverine World Wide Inc	Bank of America Merrill Lynch	612	14.632	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	5.121
(26.605)	Wolverine World Wide Inc	Barclays Bank	4.789	1.117	Wynn Resorts Ltd	Bank of America	
(6.354)	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs	10.276			Merrill Lynch	7.975
(8.200)	Wolverine World Wide Inc	Morgan Stanley	1.476	12.435	Wynn Resorts Ltd	Barclays Bank	29.968
2.770	Woodward Inc	Goldman Sachs	14.875	3.563	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs	25.440
13.950	Woodward Inc	Morgan Stanley	65.007	1.820	Wynn Resorts Ltd	HSBC	11.175
92	Workday Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(499)	1.800	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	4.338
338	Workday Inc 'A'	Barclays Bank	(1.785)	9.744	X4 Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
(1.600)	Workday Inc 'A'	Barclays Bank	8.448	7.804	X4 Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	19.585
1.864	Workday Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.469)	7.084	X4 Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	8.584
(3.260)	Workday Inc 'A'	Goldman Sachs	2.380	7.084	X4 Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	14.239
449	Workday Inc 'A'	HSBC	140	3.686	X4 Pharmaceuticals Inc	HSBC	5.529
4.076	Workday Inc 'A'	Morgan Stanley	(21.521)	6.224	X4 Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	6.846
(557)	Workday Inc 'A'	Morgan Stanley	2.941	(21.459)	XBiotech Inc	Barclays Bank	(2.146)
(11.093)	Workhorse Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.424)	(1.759)	XBiotech Inc	HSBC	(457)
(17.328)	Workhorse Group Inc	Barclays Bank	(18.368)	21.628	Xcel Energy Inc	Bank of America	
(1.398)	Workiva Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.990)	10.050	Xcel Energy Inc	Merrill Lynch	1.730
(4.830)	Workiva Inc	Barclays Bank	1.932	10.568	Xcel Energy Inc	Barclays Bank	(7.940)
(10.045)	Workiva Inc	Goldman Sachs	(50.225)	10.568	Xcel Energy Inc	HSBC	(18.071)
(1.157)	Workiva Inc	HSBC	(6.942)	23.944	Xcel Energy Inc	Morgan Stanley	(18.916)
(12.520)	Workiva Inc	Morgan Stanley	5.008	(6.760)	Xencor Inc	Bank of America	
(6.020)	World Acceptance Corp	Barclays Bank	(20.950)			Merrill Lynch	1.829
(425)	World Acceptance Corp	Goldman Sachs	(2.852)	(7.314)	Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT)	Morgan Stanley	(6.656)
(197)	World Acceptance Corp	Morgan Stanley	(686)	4.938	Xeris Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1.778)
11.735	World Fuel Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10.877)	6.588	Xeris Pharmaceuticals Inc	HSBC	(922)
19.135	World Fuel Services Corp	Barclays Bank	(37.313)	7.373	Xeris Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.106)
9.284	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs	(34.613)	5.361	Xerox Holdings Corp	Bank of America	
1.661	World Fuel Services Corp	Morgan Stanley	(1.247)	13.817	Xerox Holdings Corp	Merrill Lynch	(4.610)
(2.949)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5.721)	4.933	Xerox Holdings Corp	Barclays Bank	(6.080)
(4.194)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Barclays Bank	5.393	948	Xerox Holdings Corp	Goldman Sachs	(3.149)
(11.011)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	HSBC	964	39.929	Xerox Holdings Corp	HSBC	20
(698)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Morgan Stanley	1.452	(20.536)	XOMA Corp	Morgan Stanley	(17.743)
3.068	Worthington Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.493)	(2.931)	XOMA Corp	Barclays Bank	616
18.581	Worthington Industries Inc	Goldman Sachs	(63.547)	(4.927)	XPEL Inc	Morgan Stanley	88
35.914	Worthington Industries Inc	Morgan Stanley	8.979	(1.441)	XPEL Inc	Bank of America	
(13.813)	WP Carey Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(22.239)	(2.579)	XPEL Inc	Merrill Lynch	(25.620)
(3.125)	WP Carey Inc (REIT)	HSBC	(1.313)	(2.340)	Xperi Holding Corp	Barclays Bank	(7.320)
(13.392)	WP Carey Inc (REIT)	Morgan Stanley	2.009			Goldman Sachs	(13.411)
4.322	WP Carey Inc (REIT)	Morgan Stanley	(648)	(10.735)	Xperi Holding Corp	Merrill Lynch	(1.287)
(17.998)	WSFS Financial Corp	Goldman Sachs	8.639	(2.391)	Xperi Holding Corp	Barclays Bank	(6.130)
548	WW Grainger Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.691)	(14.231)	Xperi Holding Corp	Goldman Sachs	(1.315)
423	WW Grainger Inc	Barclays Bank	909	(17.997)	Xperi Holding Corp	HSBC	(15.369)
4.347	WW Grainger Inc	Goldman Sachs	(21.344)	2.232	XPO Logistics Inc	Morgan Stanley	(14.578)
3.335	WW Grainger Inc	HSBC	(40.220)	3.223	XPO Logistics Inc	Bank of America	
298	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	641	2.178	XPO Logistics Inc	Merrill Lynch	4.053
(8.850)	WW International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19.072)	2.178	XPO Logistics Inc	Barclays Bank	5.398
(2.292)	WW International Inc	Barclays Bank	(3.644)	(1.557)	XPO Logistics Inc	HSBC	4.291
(8.175)	WW International Inc	Goldman Sachs	(17.617)	1.907	Xylem Inc	Morgan Stanley	(4.951)
9.646	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(675)	3.680	Xylem Inc	Bank of America	
5.218	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Barclays Bank	1.826	14.975	Xylem Inc	Merrill Lynch	1.106
21.306	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs	(1.491)	22.612	Xylem Inc	Barclays Bank	8.170
117	Wyndham Hotels & Resorts Inc	HSBC	216	(2.885)	Yandex NV 'A'	HSBC	(25.158)
				(39.936)	Yellow Corp	Morgan Stanley	50.199
				(5.294)	Yellow Corp	Morgan Stanley	(2.539)
				3.676	Yelp Inc	Barclays Bank	(5.192)
				8.394	Yelp Inc	Morgan Stanley	12
				1.969	Yelp Inc	Bank of America	
				10.281	Yelp Inc	Merrill Lynch	2.262
				(2.243)	YETI Holdings Inc	Barclays Bank	9.905
				(3.694)	YETI Holdings Inc	Goldman Sachs	2.476
				(3.844)	YETI Holdings Inc	Morgan Stanley	12.132
						Bank of America	
						Merrill Lynch	(3.566)
						Barclays Bank	(443)
						Goldman Sachs	(6.112)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
872	YETI Holdings Inc	Goldman Sachs	191	(604)	Zoom Vidéo		
52.919	Yext Inc	Barclays Bank	69.213		Communications Inc 'A'	Barclays Bank	(6.022)
2.981	Yext Inc	Goldman Sachs	5.604	(542)	Zoom Vidéo		
9.983	Yext Inc	HSBC	18.932		Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	(8.653)
45.438	Yext Inc	Morgan Stanley	84.969	(2.182)	Zoom Vidéo		
5.725	Y-mAbs Therapeutics Inc	Bank of America			Communications Inc 'A'	HSBC	(89.587)
		Merrill Lynch	13.912	(609)	Zoom Vidéo		
2.565	Y-mAbs Therapeutics Inc	Barclays Bank	359		Communications Inc 'A'	Morgan Stanley	(6.072)
1.759	Y-mAbs Therapeutics Inc	Goldman Sachs	4.274	572	ZoomInfo Technologies Inc	Bank of America	
5.748	Y-mAbs Therapeutics Inc	Morgan Stanley	805		'A'	Merrill Lynch	1.449
(9.274)	York Water Co	Bank of America		(1.504)	ZoomInfo Technologies Inc		
		Merrill Lynch	(20.959)		'A'	Barclays Bank	(1.459)
(25.763)	York Water Co	Barclays Bank	(20.610)	567	ZoomInfo Technologies Inc		
(13.109)	York Water Co	Goldman Sachs	(29.626)		'A'	Goldman Sachs	2.177
(3.117)	York Water Co	Morgan Stanley	(711)	1.255	ZoomInfo Technologies Inc		
(7.228)	Yum China Holdings Inc	Goldman Sachs	(30.213)		'A'	HSBC	1.856
(851)	Yum China Holdings Inc	HSBC	(5.863)	2.765	ZoomInfo Technologies Inc		
(13.218)	Yum China Holdings Inc	Morgan Stanley	(33.045)		'A'	Morgan Stanley	2.682
(33.002)	Yum! Brands Inc	Bank of America		(17.339)	Zovio Inc	Barclays Bank	(2.254)
		Merrill Lynch	(43.563)	(26.573)	Zovio Inc	Morgan Stanley	(3.454)
(21.115)	Yum! Brands Inc	Barclays Bank	11.014	115	Zscaler Inc	Bank of America	
(26.003)	Yum! Brands Inc	Goldman Sachs	(34.324)			Merrill Lynch	3.556
(212)	Yum! Brands Inc	HSBC	413	5.530	Zscaler Inc	Barclays Bank	109.494
(1.517)	Yum! Brands Inc	Morgan Stanley	834	796	Zscaler Inc	Goldman Sachs	21.414
(3.554)	Yumanity Therapeutics Inc	Barclays Bank	(4.869)	9.510	Zscaler Inc	Morgan Stanley	198.741
(3.106)	Yumanity Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(4.255)	3.607	Zumiez Inc	Barclays Bank	6.312
(25.209)	ZAGG Inc [*]	Bank of America		66.147	Zuora Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.244)			Merrill Lynch	58.209
(18.879)	ZAGG Inc [*]	Goldman Sachs	—	17.878	Zuora Inc 'A'	Barclays Bank	8.045
(10.414)	ZAGG Inc [*]	HSBC	(937)	(10.617)	Zynerba Pharmaceuticals		
136	Zebra Technologies Corp 'A'	Bank of America			Inc	Barclays Bank	(10.617)
		Merrill Lynch	2.045	(2.515)	Zynerba Pharmaceuticals		
1.248	Zebra Technologies Corp 'A'	Barclays Bank	(5.704)		Inc	Goldman Sachs	(2.993)
1.013	Zebra Technologies Corp 'A'	Goldman Sachs	15.236	(11.987)	Zynerba Pharmaceuticals		
150	Zebra Technologies Corp 'A'	HSBC	1.697		Inc	HSBC	(18.100)
1.459	Zebra Technologies Corp 'A'	Morgan Stanley	(6.668)	2.491	Zynex Inc	Barclays Bank	1.320
(9.640)	Zedge Inc 'B'	Barclays Bank	(11.375)	4.133	Zynex Inc	Goldman Sachs	5.786
2.877	Zendesk Inc	Bank of America		7.124	Zynga Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	12.688			Merrill Lynch	4.987
1.348	Zendesk Inc	Barclays Bank	(350)	16.899	Zynga Inc 'A'	Barclays Bank	7.605
12.586	Zendesk Inc	Morgan Stanley	(3.272)	(29.941)	Zynga Inc 'A'	Barclays Bank	(13.473)
1.258	Zentalis Pharmaceuticals			8.234	Zynga Inc 'A'	Goldman Sachs	5.764
	LLC	Morgan Stanley	(1.635)	(52.267)	Zynga Inc 'A'	Goldman Sachs	(36.587)
1.891	Zillow Group Inc 'C'	Morgan Stanley	8.301	80.398	Zynga Inc 'A'	HSBC	41.003
(8.026)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America		2.450	Zynga Inc 'A'	Morgan Stanley	1.103
		Merrill Lynch	(20.226)	(19.156)	Zynga Inc 'A'	Morgan Stanley	(8.620)
(289)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Barclays Bank	(136)				(2.925.274)
(626)	Zimmer Biomet Holdings Inc	HSBC	2.266	Total (Exposition brute sous-jacente - USD 4.863.663.088)			(2.417.136)
(891)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Morgan Stanley	(419)				
8.421	Zions Bancorp NA	Barclays Bank	2.947				
(3.546)	Zions Bancorp NA	Goldman Sachs	8.475				
(1.328)	Zions Bancorp NA	HSBC	1.381				
29.814	Zions Bancorp NA	Morgan Stanley	10.435				
(3.895)	Zions Bancorp NA	Morgan Stanley	(1.363)				
(116.251)	ZIOPHARM Oncology Inc	Barclays Bank	1.163				
(23.706)	Zix Corp	Barclays Bank	2.371				
(12.963)	Zix Corp	Goldman Sachs	(389)				
(17.091)	Zix Corp	HSBC	(5.555)				
(40.433)	Zix Corp	Morgan Stanley	4.043				
1.678	Zoetis Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	10.756				
1.102	Zoetis Inc	Barclays Bank	309				
12.692	Zoetis Inc	Morgan Stanley	3.554				
9.861	Zogenix Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(14.397)				
16.590	Zogenix Inc	Barclays Bank	(2.323)				
38.248	Zogenix Inc	Goldman Sachs	(49.481)				
15.174	Zogenix Inc	HSBC	(17.905)				
(1.359)	Zoom Vidéo	Bank of America					
	Communications Inc 'A'	Merrill Lynch	(29.128)				

* Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.

** Les montants inférieurs à 0,5 USD ont été arrondis à zéro.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	452.939	USD	498.794	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	4.389
USD	20.005	CHF	17.986	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	22
						4.411
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	269.269.745	USD	325.601.191	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	3.097.500
USD	6.987.591	EUR	5.723.029	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1.467
						3.098.967
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	16.138	USD	22.456	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	411
USD	332	GBP	235	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
						411
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	19.809.328.206	USD	181.558.355	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(864.966)
USD	6.570.423	JPY	715.458.412	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	44.275
						(820.691)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	316.922.995	USD	37.761.564	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	463.007
USD	543.915	SEK	4.509.642	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1
						463.008
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 562.219.201)						2.746.106

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	73,57
Gouvernement	19,30
Technologie	0,82
Matériaux de base	0,65
Diversifiés	0,22
Biens de consommation non cyclique	0,11
Communications	0,06
Biens de consommation cyclique	0,01
Portefeuille de titres à la valeur de marché	94,74
Autres éléments de l'actif net	5,26
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché USD	% de l'actif net			Valeur de marché USD	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Corée du Sud suite			
ACTIONS ORDINAIRES				3.568	SK Innovation Co Ltd	851.015	2,46
Australie							
26.150	ALS Ltd	250.556	0,72				
		250.556	0,72	Taïwan			
Îles Caïmans				32.000	Chunghwa Precision Test Tech Co Ltd	790.581	2,28
235.000	China Feihe Ltd	658.577	1,90	51.000	Hiwin Technologies Corp	679.877	1,96
179.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	1.085.156	3,13	36.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	778.555	2,25
41.700	ENN Energy Holdings Ltd	766.725	2,21	29.000	Wiwynn Corp	978.047	2,82
158.000	Jiumaojiu International Holdings Ltd	626.010	1,80				
150.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	599.146	1,73	Thaïlande			
114.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd	980.473	2,83	679.600	Precious Shipping PCL NVDR	391.638	1,13
		4.716.087	13,60	526.200	PTT PCL NVDR	665.436	1,92
Chine							
6.800	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd 'A'	398.223	1,15	États-Unis			
285.700	Baoshan Iron & Steel Co Ltd 'A'	353.464	1,02	5.904	Cree Inc [^]	590.459	1,70
1.324.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	704.559	2,03	14.300	Yum China Holdings Inc [^]	951.669	2,75
131.400	Haier Smart Home Co Ltd 'H'	553.634	1,60				
152.700	Jinyu Bio-Technology Co Ltd 'A'	484.043	1,40	Total des actions ordinaires			
33.700	Joinn Laboratories China Co Ltd 'H'	660.014	1,90				
1.500	Kweichow Moutai Co Ltd 'A'	522.349	1,51	BILLET DE TRÉSORERIE			
95.200	Shenzhen Megmeet Electrical Co Ltd 'A'	486.963	1,40	États-Unis			
240.000	Shenzhen Topband Co Ltd 'A'	570.486	1,64	USD 1.536.000	Barton Capital SA 9/6/2021 (Zero Coupon)	1.535.969	4,43
65.000	Sungrow Power Supply Co Ltd 'A'	988.884	2,85	USD 1.509.000	Federation Des Caisses Desjardins FRN 14/7/2021	1.508.829	4,35
91.500	Suzhou Basecare Medical Corp Ltd 'H'	332.468	0,96				
		6.055.087	17,46	Total des billets de trésorerie			
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Hong Kong				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
262.000	Hang Lung Properties Ltd [^]	660.988	1,90	ACTIONS ORDINAIRES			
386.000	Melco International Development Ltd [^]	707.239	2,04	Hong Kong			
		1.368.227	3,94	54.600	Kuaishou Technology Lockup [^]	1.342.141	3,87
Inde				Corée du Sud			
54.621	ICICI Bank Ltd ADR [^]	983.724	2,84	3.522	SK IE Technology [^]	471.014	1,36
27.113	Infosys Ltd ADR	524.366	1,51				
		1.508.090	4,35	Total des actions ordinaires			
				Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
Indonésie				Organismes de placement collectif			
389.100	Bank Central Asia Tbk PT	868.527	2,50	Irlande			
931.600	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	789.381	2,28	27.750	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) [~]	2.776.184	8,00
3.321.100	XL Axiata Tbk PT	572.122	1,65				
		2.230.030	6,43	Total des organismes de placement collectif			
				Portefeuille de titres à la valeur de marché			
Philippines				Autres éléments de l'actif net			
60.540	GT Capital Holdings Inc	748.896	2,16				
		748.896	2,16	Total de l'actif net (USD)			
Singapour							
75.600	BOC Aviation Ltd [^]	672.126	1,94				
		672.126	1,94				
Corée du Sud							
9.563	Eoflow Co Ltd	486.305	1,40				
81.542	Korean Reinsurance Co	719.240	2,07				
5.621	SK Hynix Inc	642.516	1,85				

[^] Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.

[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

[~] Investissement dans un fonds de partie liée.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				Corée du Sud suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(5.622)	Samsung Life Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(966)
Australie				(2.235)	Seegene Inc	Bank of America Merrill Lynch	20.186
(29.423)	a2 Milk Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.556)	(7.880)	Shin Poong Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.430
(69.796)	a2 Milk Co Ltd	Morgan Stanley	(5.061)				(15.100)
(22.859)	Fortescue Metals Group Ltd	Morgan Stanley	(18.314)				
			(26.931)	Taiwan			
			(38.624)	(195.000)	Acer Inc	JP Morgan	(17.497)
			(38.624)	(460.000)	Acer Inc	Morgan Stanley	(20.464)
				(175.000)	Nantex Industry Co Ltd	Morgan Stanley	(41.408)
				(20.000)	Novatek Microelectronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21.233)
				(330.000)	Primax Electronics Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(40.256)
				(5.000)	Primax Electronics Ltd	JP Morgan	475
				(1.681.701)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(83.698)
							(224.081)
				Thaïlande			
				(483.500)	Berli Jucker PCL	Morgan Stanley	(13.709)
				(90.100)	Bumrungrad Hospital PCL NVDR	JP Morgan	(9.383)
				(21.000)	Delta Electronics Thailand PCL NVDR	JP Morgan	(64.014)
				(120.100)	Siam Commercial Bank PCL NVDR	Morgan Stanley	(9.230)
							(96.336)
				Royaume-Uni			
				55.329	Prudential Plc	Morgan Stanley	(2.961)
							(2.961)
				États-Unis			
				(15.634)	Corsair Gaming Inc	Bank of America Merrill Lynch	16.728
				(10.617)	Dada Nexus Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(30.789)
				(4.808)	Daqo New Energy Corp ADR	JP Morgan	(12.424)
				(41.814)	Himax Technologies Inc ADR	Morgan Stanley	(67.739)
				(7.905)	iQIYI Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	(12.727)
				(5.120)	Pinduoduo Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	(35.123)
				(14.139)	XPeng Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	(84.975)
				(14.411)	ZTO Express Cayman Inc ADR	JP Morgan	(10.808)
							(237.857)
				Vietnam			
				121.200	Mobile World Investment Corp	JP Morgan	2.545
							2.545
				Total (Exposition brute sous-jacente - USD 26.046.247)			
							(1.106.724)
Îles Caïmans							
(14.148)	NIO Inc ADR	Morgan Stanley	(38.624)				
Hong Kong							
(15.600)	Alibaba Group Holding Ltd	Morgan Stanley	(12.286)				
(168.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	Bank of America Merrill Lynch	47.017				
(890.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Morgan Stanley	(9.364)				
(50.400)	China Literature Ltd	JP Morgan	(43.857)				
598.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Morgan Stanley	2.484				
(2.170.000)	China Tower Corp Ltd 'H'	JP Morgan	10.964				
(66.500)	CK Asset Holdings Ltd	Morgan Stanley	(18.653)				
(34.000)	Country Garden Services Holdings Co Ltd	JP Morgan	(6.381)				
(235.500)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	JP Morgan	(81.770)				
(26.600)	Hang Seng Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.996)				
(70.500)	Hengan International Group Co Ltd	Morgan Stanley	(17.508)				
(390.000)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Morgan Stanley	(4.389)				
(7.500)	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(39.787)				
15.200	Joynn Laboratories China Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	6.231				
(165.000)	Kingdee International Software Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(134.388)				
(15.800)	Meituan 'B'	JP Morgan	(85.780)				
(59.500)	MTR Corp Ltd	JP Morgan	10.489				
(40.400)	Nongfu Spring Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(41.809)				
(68.800)	Nongfu Spring Co Ltd 'H'	JP Morgan	(61.414)				
(831.000)	Razer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.441)				
(95.000)	Sinotruk Hong Kong Ltd	JP Morgan	6.691				
(332.000)	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	JP Morgan	(31.228)				
(89.000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22.207)				
(70.400)	Yeahka Ltd	JP Morgan	57.230				
			(481.152)				
Malaisie							
(175.000)	Supermax Corp Bhd	JP Morgan	21.812				
(159.800)	Telekom Malaysia Bhd	Morgan Stanley	(12.799)				
			9.013				
Singapour							
(152.800)	Top Glove Corp Bhd	Morgan Stanley	4.760				
			4.760				
Corée du Sud							
(1.508)	Celltrion Inc	Morgan Stanley	(22.045)				
(2.614)	Kumho Petrochemical Co Ltd	Morgan Stanley	(19.968)				
(669)	LG Chem Ltd	JP Morgan	45.955				
(14.168)	LG Display Co Ltd	JP Morgan	(22.673)				
(386)	LG Household & Health Care Ltd	JP Morgan	(24.019)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Moins-value nette non réalisée USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(199)	USD	FTSE China A50 Futures June 2021	Juin 2021	3.613.442	(16.518)
(5)	KRW	KOSPI 200 Index Futures June 2021	Juin 2021	481.189	(21.320)
(115)	USD	SGX FTSE Indonesia Index Futures June 2021	Juin 2021	1.727.875	(51.090)
(42)	USD	SGX NIFTY 50 Futures June 2021	Juin 2021	1.308.720	(26.796)
Total				7.131.226	(115.724)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	353.480	USD	389.293	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	3.398
USD	7.489	CHF	6.706	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	38
						3.436
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	591.513	USD	714.688	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	7.373
USD	47.227	EUR	38.594	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	117
						7.490
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	433.588	USD	603.657	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	10.745
USD	11.684	GBP	8.252	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(10)
						10.735
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 1.795.408)						21.661

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	20,03
Valeurs industrielles	13,71
Biens de consommation non cyclique	13,35
Biens de consommation cyclique	13,18
Technologie	12,41
Organismes de placement collectif	8,00
Énergie	6,41
Communications	5,52
Matériaux de base	2,38
Services aux collectivités	2,21
Portefeuille de titres à la valeur de marché	97,20
Autres éléments de l'actif net	2,80
	100,00

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché USD	% de l'actif net			Valeur de marché USD	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
États-Unis							
USD 1.000.000	United States Cash Management Bill 3/8/2021 (Zero Coupon)	999.956	2,84				
USD 1.000.000	United States Treasury Bill 1/7/2021 (Zero Coupon)	999.925	2,84				
USD 500.000	United States Treasury Bill 27/1/2022 (Zero Coupon)	499.700	1,42				
USD 2.400.000	United States Treasury Bill - WI Post Auction 5/8/2021 (Zero Coupon)	2.399.944	6,82				
		4.899.525	13,92				
Total des obligations		4.899.525	13,92				
CERTIFICAT DE DÉPÔTS							
Japon							
USD 250.000	The Norinchukin Bank FRN 13/8/2021	250.003	0,71				
		250.003	0,71				
Singapour							
USD 500.000	Oversea-Chinese Banking Corp 0,18% 9/11/2021	499.989	1,42				
		499.989	1,42				
Suisse							
USD 500.000	Credit Suisse AG FRN 15/2/2022	500.000	1,42				
		500.000	1,42				
États-Unis							
USD 750.000	DZ Bank AG Deutsche Zentral Genoss 0,14% 8/7/2021	750.000	2,13				
USD 250.000	KBC Bank NV 0,07% 24/6/2021	250.000	0,71				
USD 295.000	Landesbank Baden Wuerttemberg 0,10% 23/6/2021	295.000	0,84				
USD 500.000	Landesbank Baden Wuerttemberg 0,25% 7/7/2021	500.000	1,42				
USD 1.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,17% 1/6/2021	1.000.000	2,84				
USD 450.000	Norinchukin Bank 0,20% 14/10/2021	450.017	1,28				
USD 525.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0,23% 4/8/2021	525.000	1,49				
USD 500.000	UBS AG 0,27% 11/3/2022	500.000	1,42				
USD 1.000.000	Westpac Banking Corp 0,39% 9/6/2021	1.000.053	2,84				
		5.270.070	14,97				
Total des Certificats de dépôts		6.520.062	18,52				
BILLET DE TRÉSORERIE							
Australie							
USD 500.000	Australia & New Zealand Banking Group 17/6/2021 (Zero Coupon)	499.944	1,42				
USD 400.000	Australia & New Zealand Banking Group 23/6/2021 (Zero Coupon)	399.939	1,14				
		899.883	2,56				
Canada							
USD 300.000	Alberta 7/6/2021 (Zero Coupon)	299.993	0,85				
USD 750.000	CDP Financial Inc FRN 6/4/2022	748.712	2,13				
USD 375.000	National Bank of Canada FRN 7/7/2021	374.948	1,06				
				Canada suite			
USD 1.000.000	Ontario Teachers' Finance Trust FRN 14/9/2021					999.621	2,84
USD 1.000.000	Toronto-Dominion Bank FRN 6/8/2021					999.725	2,84
						3.422.999	9,72
				France			
USD 990.000	Antalis SA FRN 6/7/2021					989.836	2,81
USD 805.000	LVMH Moet Hennessy Vuitton 12/10/2021 (Zero Coupon)					804.495	2,29
						1.794.331	5,10
				Allemagne			
USD 500.000	Erste Abwicklungsanstalt FRN 8/4/2022					499.136	1,42
						499.136	1,42
				Irlande			
USD 1.000.000	Matchpoint Finance Plc FRN 12/10/2021					999.224	2,84
						999.224	2,84
				Japon			
USD 300.000	MUFG Bank Ltd 22/6/2021 (Zero Coupon)					299.986	0,85
						299.986	0,85
				Luxembourg			
USD 1.000.000	Banque et Caisse Epargne 7/7/2021 (Zero Coupon)					999.850	2,84
						999.850	2,84
				Norvège			
USD 500.000	DNB Bank ASA 15/7/2021 (Zero Coupon)					499.881	1,42
						499.881	1,42
				Singapour			
USD 500.000	DBS Bank Ltd FRN 2/8/2021					499.862	1,42
USD 500.000	Oversea-Chinese Banking Corp 14/6/2021 (Zero Coupon)					499.971	1,42
USD 1.000.000	United Overseas Bank Ltd 2/7/2021 (Zero Coupon)					999.837	2,84
						1.999.670	5,68
				Suède			
USD 1.000.000	Nordea Bank Abp FRN 8/11/2021					999.289	2,84
USD 500.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 7/9/2021 (Zero Coupon)					499.769	1,42
USD 900.000	Svenska Handelsbanken AB 5/10/2021 (Zero Coupon)					899.433	2,55
USD 700.000	Swedbank AB 1/6/2021 (Zero Coupon)					700.000	1,99
USD 500.000	Swedish Export Credit Corp 22/6/2021 (Zero Coupon)					499.924	1,42
						3.598.415	10,22
				Royaume-Uni			
USD 400.000	Santander UK Plc 3/8/2021 (Zero Coupon)					399.909	1,13
						399.909	1,13
				États-Unis			
USD 1.000.000	CAFCO LLC FRN 1/9/2021					999.719	2,84
USD 500.000	Charta LLC FRN 1/9/2021					499.859	1,42
USD 500.000	Fairway Finance Co LLC 2/6/2021 (Zero Coupon)					499.998	1,42
USD 500.000	Ionic Capital II Trust 16/6/2021 (Zero Coupon)					499.962	1,42

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
États-Unis suite			
USD 250.000	KFW 1/6/2021 (Zero Coupon)	250.000	0,71
USD 500.000	La Fayette Asset Securitization LLC 16/6/2021 (Zero Coupon)	499.967	1,42
USD 500.000	La Fayette Asset Securitization LLC 8/7/2021 (Zero Coupon)	499.923	1,42
USD 1.050.000	Lime Funding LLC 17/6/2021 (Zero Coupon)	1.049.921	2,98
USD 500.000	Macquarie Bank Ltd 1/6/2021 (Zero Coupon)	500.000	1,42
USD 500.000	Macquarie Bank Ltd FRN 13/7/2021	499.912	1,42
USD 1.000.000	Old Line Funding LLC FRN 17/6/2021	999.935	2,84
USD 250.000	Salisbury Receivables Co LLC FRN 11/6/2021	249.990	0,71
USD 930.000	Suncorp Metway Ltd FRN 13/10/2021	929.308	2,64
		7.978.494	22,66
Total des billets de trésorerie		23.391.778	66,44
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		34.811.365	98,88
Portefeuille de titres à la valeur de marché		34.811.365	98,88
Autres éléments de l'actif net		394.110	1,12
Total de l'actif net (USD)		35.205.475	100,00

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				Australie suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(14.082)	Bega Cheese Ltd	HSBC	1.816
	Australie			(53.363)	Bega Cheese Ltd	JP Morgan	6.321
29.969	Abacus Property Group (REIT)	Citibank	1.017	(31.891)	Bellevue Gold Ltd	Citibank	834
6.160	Abacus Property Group (REIT)	HSBC	(478)	(11.290)	Bellevue Gold Ltd	HSBC	663
13.918	Abacus Property Group (REIT)	JP Morgan	(973)	(18.776)	Bellevue Gold Ltd	JP Morgan	1.058
4.174	Adbri Ltd	Citibank	(115)	952	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Citibank	17
15.067	Adbri Ltd (79)	JP Morgan	(1.219)	955	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	JP Morgan	(161)
	Afterpay Ltd (132)	HSBC	386	(26.259)	Bingo Industries Ltd	HSBC	937
26.738	Alkane Resources Ltd (327)	JP Morgan	613	(8.713)	Bingo Industries Ltd	JP Morgan	236
(1.442)	Altium Ltd	HSBC	210	(236)	Blackmores Ltd	HSBC	(486)
4.147	Alumina Ltd	JP Morgan	(3.417)	(71)	Blackmores Ltd	JP Morgan	(158)
4.346	Alumina Ltd	HSBC	(437)	808	BlueScope Steel Ltd	JP Morgan	402
40.225	Alumina Ltd	JP Morgan	(3.858)	(454)	Boral Ltd	HSBC	(71)
(1.333)	Ancor Plc - CDI	JP Morgan	805	(7.187)	Boral Ltd	JP Morgan	(1.248)
17.064	AMP Ltd	Citibank	158	244	Brambles Ltd	HSBC	19
28.485	AMP Ltd (3.802)	JP Morgan	(327)	7.777	Brambles Ltd	JP Morgan	446
	Ampol Ltd (766)	HSBC	(3.062)	(8.456)	Bravura Solutions Ltd	HSBC	(1.948)
	Ansell Ltd (198)	JP Morgan	(726)	(738)	Breville Group Ltd	JP Morgan	(786)
	Ansell Ltd (508)	HSBC	146	15.605	BWP Trust (REIT)	JP Morgan	(190)
	APA Group (Unit) (505)	JP Morgan	322	(61.962)	Capricorn Metals Ltd	Citibank	(4.910)
6.550	APA Group (Unit) (770)	Citibank	(3.647)	(2.551)	Capricorn Metals Ltd	JP Morgan	(94)
2.617	Appen Ltd (261)	JP Morgan	(67)	2	Cardno Ltd	Citibank	—
	ARB Corp Ltd (487)	HSBC	(873)	(163.549)	Carnarvon Petroleum Ltd	Citibank	1.225
	ARB Corp Ltd (246)	JP Morgan	(945)	(173.735)	Carnarvon Petroleum Ltd	JP Morgan	6.556
2.561	Aristocrat Leisure Ltd (604)	Citibank	798	(32)	carsales.com Ltd	JP Morgan	(45)
	Aristocrat Leisure Ltd (248)	JP Morgan	1.192	1.809	Cedar Woods Properties Ltd	JP Morgan	(185)
	Atlas Arteria Ltd (Unit) (2.731)	Citibank	(15)	29.699	Centuria Industrial REIT (REIT)	Citibank	3.781
(15.381)	Atlas Arteria Ltd (Unit) (3.150)	HSBC	(7)	3.990	Centuria Industrial REIT (REIT)	HSBC	223
	AUB Group Ltd (1.052)	JP Morgan	(499)	31.590	Centuria Industrial REIT (REIT)	JP Morgan	2.044
(11.158)	Auckland International Airport Ltd	Citibank	(766)	(29.944)	Centuria Office REIT (REIT)	HSBC	(778)
(11.314)	Auckland International Airport Ltd	HSBC	2.586	(2.795)	Chalice Mining Ltd	Citibank	(1.407)
(9.054)	Auckland International Airport Ltd	JP Morgan	1.910	(2.280)	Chalice Mining Ltd	JP Morgan	(1.542)
(136.557)	Aurelia Metals Ltd (39.651)	Citibank	(3.755)	4.946	Challenger Ltd	Citibank	1.134
	Aurizon Holdings Ltd	JP Morgan	(1.297)	3.954	Challenger Ltd	HSBC	920
10.009	Aurizon Holdings Ltd	Citibank	578	8.148	Challenger Ltd	JP Morgan	1.876
19.066	Austral Ltd	Citibank	(546)	(653)	Champion Iron Ltd	Citibank	81
3.143	Austral Ltd	JP Morgan	(516)	(2.821)	Champion Iron Ltd	HSBC	1.766
1.981	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Citibank	899	(1.512)	Champion Iron Ltd	JP Morgan	665
605	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	HSBC	412	378	Charter Hall Group (REIT)	Citibank	157
4.108	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	JP Morgan	3.081	8.038	Charter Hall Group (REIT)	JP Morgan	(1.116)
15.079	Australian Finance Group Ltd	Citibank	43	25.800	Charter Hall Long Wale REIT (REIT)	Citibank	522
10.571	Australian Finance Group Ltd	JP Morgan	525	13.517	Charter Hall Long Wale REIT (REIT)	HSBC	(1.246)
(180.779)	Aventus Group (REIT) (9.835)	Citibank	(17.303)	39.769	Charter Hall Long Wale REIT (REIT)	JP Morgan	(507)
	Aventus Group (REIT) (244)	JP Morgan	(621)	6.104	Charter Hall Retail REIT (REIT)	Citibank	684
12.915	Baby Bunting Group Ltd (620)	JP Morgan	8	12.590	Charter Hall Retail REIT (REIT)	JP Morgan	701
	Bapcor Ltd (5.257)	HSBC	(306)	13.383	Charter Hall Social Infrastructure REIT (REIT)	Citibank	1.080
	Bapcor Ltd (8.830)	JP Morgan	(2.694)	19.717	Charter Hall Social Infrastructure REIT (REIT)	JP Morgan	1.937
	Bapcor Ltd (8.717)	JP Morgan	4.526	1.832	Chorus Ltd	Citibank	(187)
	Beach Energy Ltd (400)	JP Morgan	557	(22.667)	Cleanaway Waste Management Ltd	HSBC	1.408
	Bega Cheese Ltd	Citibank	(43)	(4.361)	Cleanaway Waste Management Ltd	JP Morgan	431
				925	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	Citibank	(1.131)
				345	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	JP Morgan	273
				1.837	Coles Group Ltd	JP Morgan	208
				4.192	Collins Foods Ltd	Citibank	3.196

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Australie suite				Australie suite			
250	Collins Foods Ltd	HSBC	264	(1.856)	Flight Centre Travel Group Ltd	JP Morgan	748
5.381	Collins Foods Ltd	JP Morgan	6.439	(8.182)	Fortescue Metals Group Ltd	JP Morgan	17.013
1.535	Commonwealth Bank of Australia	Citibank	1.292	38.995	G8 Education Ltd	Citibank	2.150
658	Commonwealth Bank of Australia	JP Morgan	1.689	5.055	G8 Education Ltd	HSBC	53
434	Computershare Ltd	HSBC	443	44.583	G8 Education Ltd	JP Morgan	691
(4.607)	Cooper Energy Ltd	HSBC	30	(4.093)	Galaxy Resources Ltd	Citibank	(1.091)
(50.298)	Cooper Energy Ltd	JP Morgan	535	77.710	GDI Property Group (REIT)	JP Morgan	(567)
(2.247)	Corporate Travel Management Ltd	JP Morgan	(3.417)	2.128	Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd	Citibank	39
(1.206)	Costa Group Holdings Ltd	HSBC	890	2.521	Goodman Group (REIT)	Citibank	419
(6.181)	Costa Group Holdings Ltd	JP Morgan	4.794	2.820	Goodman Group (REIT)	JP Morgan	(780)
(531)	Credit Corp Group Ltd	JP Morgan	(235)	7.450	GPT Group (REIT)	HSBC	(349)
89.331	Cromwell Property Group (REIT)	JP Morgan	(1.525)	1.537	GPT Group (REIT)	JP Morgan	25
(8.682)	Crown Resorts Ltd	JP Morgan	1.958	12.944	GrainCorp Ltd 'A'	Citibank	1.866
(275)	CSL Ltd	HSBC	(2.517)	15.844	Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT)	Citibank	1.871
(150)	CSL Ltd	JP Morgan	(1.310)	1.968	Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT)	HSBC	12
32.125	CSR Ltd	Citibank	(3.789)	18.356	Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT)	JP Morgan	405
9.816	CSR Ltd	HSBC	(1.803)	(206)	GUD Holdings Ltd	HSBC	163
28.124	CSR Ltd	JP Morgan	(6.741)	(660)	GUD Holdings Ltd	JP Morgan	501
7.834	Data#3 Ltd	Citibank	1.681	7.199	GWA Group Ltd	Citibank	(313)
(10.813)	De Grey Mining Ltd	Citibank	(17)	4.233	GWA Group Ltd	HSBC	(920)
(5.579)	De Grey Mining Ltd	HSBC	(687)	3.620	Harvey Norman Holdings Ltd	Citibank	(2)
(6.654)	De Grey Mining Ltd	JP Morgan	(260)	497	Harvey Norman Holdings Ltd	HSBC	11
(6.737)	Deterra Royalties Ltd	HSBC	440	(13.211)	Harvey Norman Holdings Ltd	JP Morgan	(319)
(28.103)	Deterra Royalties Ltd	JP Morgan	4.996	5.057	Healius Ltd	Citibank	803
3.173	Dexus (REIT)	Citibank	470	4.955	Healius Ltd	HSBC	243
603	Dexus (REIT)	HSBC	6	24.838	Hotel Property Investments (REIT)	Citibank	638
3.291	Dexus (REIT)	JP Morgan	929	16.432	Hotel Property Investments (REIT)	HSBC	358
(342)	Domain Holdings Australia Ltd	HSBC	(32)	7.707	Hotel Property Investments (REIT)	JP Morgan	229
(5.292)	Domain Holdings Australia Ltd	JP Morgan	(564)	(329)	HUB24 Ltd	JP Morgan	(852)
34	Domino's Pizza Enterprises Ltd	Citibank	40	1.968	HUB24 Ltd	JP Morgan	5.094
451	Domino's Pizza Enterprises Ltd	JP Morgan	1.474	23.596	Humm Group Ltd	Citibank	389
(7.409)	Downer EDI Ltd	HSBC	1.282	10.943	Humm Group Ltd	HSBC	634
(5.669)	Downer EDI Ltd	JP Morgan	900	29.904	Humm Group Ltd	JP Morgan	1.512
771	Eagers Automotive Ltd	Citibank	358	540	IDP Education Ltd	JP Morgan	611
246	Eagers Automotive Ltd	JP Morgan	106	(18.907)	IGO Ltd	JP Morgan	5.320
3.290	Eclixp Group Ltd	Citibank	83	(4.594)	Iluka Resources Ltd	JP Morgan	(644)
3.479	Elders Ltd	Citibank	523	30.960	Incitec Pivot Ltd	JP Morgan	(4.483)
6.602	Elders Ltd	HSBC	(2.767)	10.802	Infomedia Ltd	Citibank	474
7.954	Elders Ltd	JP Morgan	(3.733)	4.511	Infomedia Ltd	HSBC	66
(25.591)	Electro Optic Systems Holdings Ltd	Citibank	(3.863)	(6.993)	Ingenia Communities Group (REIT)	JP Morgan	(150)
(2.685)	Electro Optic Systems Holdings Ltd	JP Morgan	218	2.551	Inghams Group Ltd	Citibank	778
1.745	EML Payments Ltd	Citibank	6	1.307	Inghams Group Ltd	HSBC	229
(1.369)	EML Payments Ltd	JP Morgan	143	15.967	Inghams Group Ltd	JP Morgan	2.931
(8.775)	Estia Health Ltd	Citibank	724	(406)	Insurance Australia Group Ltd	Citibank	(46)
(14.759)	Estia Health Ltd	HSBC	817	(7.811)	Insurance Australia Group Ltd	HSBC	990
(2.220)	EVENT Hospitality and Entertainment Ltd	JP Morgan	(408)	(9.748)	Insurance Australia Group Ltd	JP Morgan	1.111
2.050	Evolution Mining Ltd	JP Morgan	401	(13.631)	Integral Diagnostics Ltd	HSBC	(3.495)
(2.032)	Fineos Corp Ltd - CDI	Citibank	(212)	(1.152)	Integral Diagnostics Ltd	JP Morgan	(303)
110	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Citibank	(322)	(8.565)	Integrated Research Ltd	HSBC	386
1.335	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	HSBC	(4.296)	(2.387)	Integrated Research Ltd	JP Morgan	94
127	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	JP Morgan	35	(1.206)	InvoCare Ltd	Citibank	(386)
13.101	Fletcher Building Ltd	Citibank	3.535	(6.516)	InvoCare Ltd	HSBC	2.662
9.636	Fletcher Building Ltd	JP Morgan	(267)	(1.567)	ioneeer Ltd	JP Morgan	598
(1.171)	Flight Centre Travel Group Ltd	Citibank	(99)	(8.034)		Citibank	(127)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Australie suite				Australie suite			
(81.227)	ioneer Ltd	JP Morgan	1.820	246	News Corp - CDI	HSBC	44
(2.372)	IOOF Holdings Ltd	HSBC	(323)	768	News Corp - CDI	JP Morgan	199
(2.732)	IOOF Holdings Ltd	JP Morgan	(369)	(1.138)	NEXTDC Ltd	HSBC	(199)
27.505	IOOF Holdings Ltd	JP Morgan	6.477	(296)	NEXTDC Ltd	JP Morgan	44
(25.505)	IPH Ltd	HSBC	1.037	4.029	nib holdings Ltd	Citibank	181
(5.056)	IPH Ltd	JP Morgan	459	(3.287)	nib holdings Ltd	HSBC	133
4.269	IRESS Ltd	Citibank	1.300	3.695	nib holdings Ltd	JP Morgan	(92)
4.014	IRESS Ltd	JP Morgan	1.545	(25.238)	Nickel Mines Ltd	Citibank	(1.001)
1.031	James Hardie Industries Plc - CDI	Citibank	1.391	8.878	Nickel Mines Ltd	HSBC	163
564	James Hardie Industries Plc - CDI	HSBC	(667)	(9.006)	Nickel Mines Ltd	JP Morgan	730
2.611	James Hardie Industries Plc - CDI	JP Morgan	(2.803)	616	Northern Star Resources Ltd	Citibank	169
(41)	Janus Henderson Group Plc - CDI	HSBC	(42)	841	Northern Star Resources Ltd	JP Morgan	137
(581)	Janus Henderson Group Plc - CDI	JP Morgan	(659)	(56.361)	NRW Holdings Ltd	HSBC	8.915
44.538	Jupiter Mines Ltd	Citibank	13	7.456	Nufarm Ltd	Citibank	151
66.915	Jupiter Mines Ltd	JP Morgan	(1.510)	4.700	Nufarm Ltd	HSBC	(1.328)
(108.594)	Karoon Energy Ltd	Citibank	(3.071)	9.680	Nufarm Ltd	JP Morgan	(2.406)
(47.845)	Karoon Energy Ltd	HSBC	1.688	(5.114)	Nuix Ltd	HSBC	2.442
(54.911)	Karoon Energy Ltd	JP Morgan	1.765	(3.143)	Nuix Ltd	JP Morgan	1.568
(5.582)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	HSBC	213	(16.037)	Oil Search Ltd	JP Morgan	4.620
(1.184)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	JP Morgan	9	(61.550)	Omni Bridgeway Ltd	HSBC	(8.348)
(1.740)	Link Administration Holdings Ltd	JP Morgan	(33)	(15.966)	Omni Bridgeway Ltd	JP Morgan	(2.356)
(242)	Lovisa Holdings Ltd	JP Morgan	(23)	(1.374)	Orica Ltd	HSBC	647
(8.037)	Lynas Rare Earths Ltd	JP Morgan	3.352	(5.449)	Orica Ltd	JP Morgan	2.377
7.870	MACA Ltd	Citibank	(115)	(5.990)	Origin Energy Ltd	HSBC	1.197
21.533	MACA Ltd	JP Morgan	(2.444)	(1.682)	Orocobre Ltd	Citibank	(648)
474	Macquarie Group Ltd	JP Morgan	(3.069)	(984)	Orocobre Ltd	HSBC	(334)
1.064	Magellan Financial Group Ltd	Citibank	155	(2.511)	Orocobre Ltd	JP Morgan	1.350
1.327	Marley Spoon AG - CDI	Citibank	3	(8.352)	Orora Ltd	HSBC	729
999	Marley Spoon AG - CDI	JP Morgan	(51)	(2.372)	OZ Minerals Ltd	HSBC	3.710
3.097	McMillan Shakespeare Ltd	Citibank	759	(8.710)	OZ Minerals Ltd	JP Morgan	13.038
2.183	McMillan Shakespeare Ltd	HSBC	314	13.452	Pendal Group Ltd	Citibank	2.913
6.264	McMillan Shakespeare Ltd	JP Morgan	1.078	4.794	Pendal Group Ltd	HSBC	1.297
15.347	Medibank Pvt Ltd	Citibank	404	16.681	Pendal Group Ltd	JP Morgan	4.819
5.096	Medibank Pvt Ltd	HSBC	78	78.000	Pepper Money Ltd	JP Morgan	(29.180)
19.702	Medibank Pvt Ltd	JP Morgan	452	(134)	Perpetual Ltd	HSBC	(165)
(1.774)	Megaport Ltd	Citibank	(1.041)	(479)	Perpetual Ltd	JP Morgan	(631)
(4.984)	Megaport Ltd	HSBC	(5.285)	2.535	Perpetual Ltd	JP Morgan	3.338
(7.288)	Megaport Ltd	JP Morgan	(7.972)	(99.394)	Perseus Mining Ltd	HSBC	(10.287)
7.669	Mesoblast Ltd	Citibank	163	(25.450)	Perseus Mining Ltd	JP Morgan	(2.717)
6.583	Mesoblast Ltd	JP Morgan	514	(20.362)	Pilbara Minerals Ltd	HSBC	690
(124)	Mineral Resources Ltd	HSBC	(158)	(15.441)	Pilbara Minerals Ltd	JP Morgan	1.042
(155)	Mineral Resources Ltd	JP Morgan	547	3.833	Pinnacle Investment Management Group Ltd	JP Morgan	1.264
(17.220)	Mirvac Group (REIT)	HSBC	881	16.089	Platinum Asset Management Ltd	Citibank	199
(1.198)	Monadelphous Group Ltd	JP Morgan	2.460	(7.619)	Platinum Asset Management Ltd	HSBC	1.046
11.662	Money3 Corp Ltd	Citibank	(143)	1.057	Platinum Asset Management Ltd	HSBC	(11)
1.716	Money3 Corp Ltd	HSBC	(70)	12.792	Platinum Asset Management Ltd	JP Morgan	(1.606)
(96.500)	Mount Gibson Iron Ltd	HSBC	10.543	(2.055)	PointsBet Holdings Ltd	Citibank	(1.249)
1.818	MyState Ltd	Citibank	79	(7.055)	PolyNovo Ltd	Citibank	(460)
275	MyState Ltd	Citibank	128	(18.188)	PolyNovo Ltd	HSBC	(141)
11.495	MyState Ltd	JP Morgan	577	(683)	PolyNovo Ltd	JP Morgan	35
(14.425)	Nanosonics Ltd	HSBC	243	1.412	Pro Medicus Ltd	Citibank	2.423
(12.071)	Nanosonics Ltd	JP Morgan	(514)	1.749	Pro Medicus Ltd	JP Morgan	5.403
1.515	National Australia Bank Ltd	JP Morgan	(583)	(7.700)	Qantas Airways Ltd	JP Morgan	120
56.255	National Storage REIT (REIT)	Citibank	1.857	(725)	QBE Insurance Group Ltd	JP Morgan	(73)
34.204	National Storage REIT (REIT)	JP Morgan	612	(12.719)	Qube Holdings Ltd	HSBC	1.287
(5.701)	Nearmap Ltd	Citibank	(32)	(894)	Ramelius Resources Ltd	Citibank	(9)
(1.305)	Nearmap Ltd	HSBC	61	(85.880)	Ramelius Resources Ltd	HSBC	(5.621)
(115)	Netwealth Group Ltd	HSBC	(91)	(10.291)	Ramelius Resources Ltd	JP Morgan	(721)
(2.547)	Netwealth Group Ltd	JP Morgan	(2.100)	(187)	Ramsay Health Care Ltd	JP Morgan	36
2.502	Newcrest Mining Ltd	JP Morgan	(291)	387	REA Group Ltd	Citibank	2.597
502	News Corp - CDI	Citibank	44	103	REA Group Ltd	HSBC	47
				479	REA Group Ltd	JP Morgan	410

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Australie suite				Australie suite			
(11.378)	Redbubble Ltd	HSBC	754	4.919	Suncorp Group Ltd	JP Morgan	258
(2.061)	Reece Ltd	HSBC	1.914	8.207	Super Retail Group Ltd	Citibank	4.737
(5.824)	Reece Ltd	JP Morgan	5.098	6.917	Super Retail Group Ltd	HSBC	3.059
1.875	Regis Resources Ltd	Citibank	48	6.393	Super Retail Group Ltd	JP Morgan	3.021
32.531	Regis Resources Ltd	HSBC	(2.374)	(13.113)	Sydney Airport (Unit)	JP Morgan	1.916
74.565	Regis Resources Ltd	JP Morgan	(3.872)	2.088	Tabcorp Holdings Ltd	Citibank	11
(4.953)	Reliance Worldwide Corp Ltd	HSBC	480	(41.229)	Tassal Group Ltd	HSBC	1.237
(350)	Reliance Worldwide Corp Ltd	JP Morgan	13	(22.172)	Tassal Group Ltd	JP Morgan	487
(5.200)	Resolute Mining Ltd	HSBC	(226)	9.893	Technology One Ltd	Citibank	1.697
(18.862)	Resolute Mining Ltd	JP Morgan	(844)	2.382	Technology One Ltd	HSBC	29
17.192	Resolute Mining Ltd	JP Morgan	769	23.187	Technology One Ltd	JP Morgan	1.479
287	Rio Tinto Ltd	JP Morgan	(2.435)	(2.007)	Temple & Webster Group Ltd	JP Morgan	292
1.394	Rural Funds Group (REIT)	JP Morgan	74	1.513	TPG Telecom Ltd	Citibank	354
(11.417)	Santos Ltd	HSBC	3.554	5.688	TPG Telecom Ltd	HSBC	(242)
(19.477)	Santos Ltd	JP Morgan	6.512	25.977	TPG Telecom Ltd	JP Morgan	(648)
39.114	Scentre Group (REIT)	Citibank	1.316	796	Transurban Group (Unit)	JP Morgan	(400)
736	Scentre Group (REIT)	HSBC	(25)	476	Treasury Wine Estates Ltd	Citibank	223
15.275	Scentre Group (REIT)	JP Morgan	(424)	2.166	Treasury Wine Estates Ltd	JP Morgan	660
(13.072)	Select Harvests Ltd	HSBC	4.650	(516)	Unibail-Rodamco-Westfield	Citibank	(147)
(4.004)	Select Harvests Ltd	JP Morgan	1.367	(554)	Unibail-Rodamco-Westfield	HSBC	(4)
(17.966)	Senex Energy Ltd	JP Morgan	(2.198)	(2.076)	Unibail-Rodamco-Westfield	JP Morgan	(43)
3.193	Service Stream Ltd	Citibank	336	3.227	Unibail-Rodamco-Westfield	JP Morgan	66
15.228	Service Stream Ltd	HSBC	803	1.794	United Malt Grp Ltd	Citibank	(17)
14.558	Service Stream Ltd	JP Morgan	559	4.213	United Malt Grp Ltd	HSBC	(334)
(6.764)	Seven Group Holdings Ltd	JP Morgan	7.270	683	United Malt Grp Ltd	JP Morgan	(6)
25.479	Shopping Centres Australasia Property Group (REIT)	JP Morgan	160	(40.843)	Uniti Group Ltd	JP Morgan	(5.230)
26.733	Shopping Centres Australasia Property Group (REIT)	Citibank	2.390	39.618	Vicinity Centres (REIT)	Citibank	1.287
(22.521)	Silver Lake Resources Ltd	HSBC	(1.325)	50.921	Vicinity Centres (REIT)	JP Morgan	(93)
(38.094)	Silver Lake Resources Ltd	JP Morgan	(862)	(13.408)	Virgin Money UK Plc - CDI	HSBC	(997)
3.923	Sims Ltd	Citibank	1.638	(13.906)	Virgin Money UK Plc - CDI	JP Morgan	(444)
(1.092)	Sims Ltd	HSBC	1.840	1.792	Virtus Health Ltd	Citibank	94
(1.388)	Sims Ltd	JP Morgan	2.278	12.906	Viva Energy Group Ltd	Citibank	(473)
(75.742)	SKY Network Television Ltd	HSBC	(144)	(7.886)	Vocus Group Ltd	HSBC	331
9.378	SKYCITY Entertainment Group Ltd	Citibank	684	(3.184)	Vocus Group Ltd	JP Morgan	177
3.022	SKYCITY Entertainment Group Ltd	HSBC	179	29.104	Waypoint REIT (REIT)	Citibank	975
14.039	SKYCITY Entertainment Group Ltd	JP Morgan	964	30.284	Waypoint REIT (REIT)	HSBC	(282)
(1.593)	Sonic Healthcare Ltd	HSBC	1.130	49.529	Waypoint REIT (REIT)	JP Morgan	(11)
(957)	Sonic Healthcare Ltd	JP Morgan	372	(10.709)	Webjet Ltd	HSBC	(1.071)
9.564	Southern Cross Media Group Ltd	Citibank	(19)	(90.264)	West African Resources Ltd	HSBC	(4.282)
851	Southern Cross Media Group Ltd	JP Morgan	7	(20.670)	West African Resources Ltd	JP Morgan	(983)
10.357	Spark Infrastructure Group (Unit)	Citibank	96	(19.831)	Western Areas Ltd	HSBC	1.551
20.854	Spark Infrastructure Group (Unit)	JP Morgan	(840)	(7.312)	Western Areas Ltd	JP Morgan	526
21.652	Spark New Zealand Ltd	Citibank	929	(24.874)	Westgold Resources Ltd	HSBC	(2.138)
34.338	Spark New Zealand Ltd	JP Morgan	389	(4.443)	Westgold Resources Ltd	JP Morgan	(315)
(25.182)	SpeedCast International Ltd ¹⁷	Citibank	—	1.564	WiseTech Global Ltd	JP Morgan	254
(42.399)	SpeedCast International Ltd ¹⁷	HSBC	26.349	(3.677)	Woodside Petroleum Ltd	JP Morgan	5.460
2.143	SSR Mining Inc - CDI	Citibank	1.195	(1.612)	Woolworths Group Ltd	HSBC	(337)
(4.668)	Star Entertainment Grp Ltd	HSBC	864	(3.808)	Woolworths Group Ltd	JP Morgan	(1.728)
(5.998)	Star Entertainment Grp Ltd	JP Morgan	72	1.921	Zip Co Ltd	Citibank	(76)
(13.330)	Starpharma Holdings Ltd	Citibank	(796)	207	Zip Co Ltd	JP Morgan	(24)
(3.572)	Starpharma Holdings Ltd	JP Morgan	9				116.668
37.673	Steadfast Group Ltd	Citibank	2.350	Bermudes			
12.225	Steadfast Group Ltd	HSBC	(720)	(126.000)	Sinopec Kantons Holdings Ltd	Citibank	(1.002)
35.667	Steadfast Group Ltd	JP Morgan	(986)				(1.002)
(2.727)	Stockland (REIT)	JP Morgan	108	Îles Caïmans			
				488	Weibo Corp ADR	JP Morgan	1.059
							1.059
				Chine			
				857	Li Auto Inc ADR	Citibank	2.134
				155	Li Auto Inc ADR	HSBC	975
							3.109
				Hong Kong			
				36.500	3SBio Inc	Citibank	7.593
				15.500	3SBio Inc	HSBC	4.981
				70.500	3SBio Inc	JP Morgan	22.664

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
1.500	AAC Technologies Holdings Inc	Citibank	247	16.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	HSBC	1.267
5.000	AAC Technologies Holdings Inc	HSBC	2.645	12.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	JP Morgan	957
3.000	AAC Technologies Holdings Inc	JP Morgan	2.099	(108.000)	Beijing Enterprises Urban Resources Group Ltd	Citibank	547
1.200	AIA Group Ltd	Citibank	(347)	108.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd	JP Morgan	2.117
3.800	AIA Group Ltd	HSBC	(1.294)	14.000	Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H'	Citibank	(16)
13.600	AIA Group Ltd	JP Morgan	(4.604)	2.000	Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H'	HSBC	5
(22.000)	Air China Ltd 'H'	HSBC	(350)	98.000	Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd 'H'	JP Morgan	268
(3.000)	Akeso Inc	JP Morgan	(5.561)	(32.000)	Beijing North Star Co Ltd 'H'	Citibank	120
(38.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	Citibank	10.663	(6.000)	Beijing North Star Co Ltd 'H'	JP Morgan	15
(2.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	HSBC	1.038	7.000	Blue Moon Group Holdings Ltd	Citibank	745
(210.000)	Alibaba Pictures Group Ltd	Citibank	(557)	3.500	Blue Moon Group Holdings Ltd	JP Morgan	608
(80.000)	Alibaba Pictures Group Ltd	HSBC	97	(700)	BOC Aviation Ltd	JP Morgan	311
(50.000)	Alibaba Pictures Group Ltd	JP Morgan	60	7.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Citibank	305
6.000	A-Living Smart City Services Co Ltd	Citibank	(795)	500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	HSBC	(92)
500	A-Living Smart City Services Co Ltd	HSBC	159	12.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	JP Morgan	(2.209)
4.750	A-Living Smart City Services Co Ltd	JP Morgan	1.515	8.000	Bosideng International Holdings Ltd	Citibank	157
1.000	Alphamab Oncology	Citibank	(242)	54.000	Bosideng International Holdings Ltd	HSBC	2.450
3.000	Alphamab Oncology	JP Morgan	(1.118)	42.000	Bosideng International Holdings Ltd	JP Morgan	1.909
12.000	Aluminum Corp of China Ltd 'H'	HSBC	(985)	(82.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Citibank	(44)
(14.500)	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	Citibank	(3.319)	(50.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	HSBC	(26)
(5.000)	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	HSBC	(49)	(8.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	JP Morgan	(5)
(500)	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	JP Morgan	(5)	1.900	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Citibank	(21)
1.000	ANTA Sports Products Ltd	Citibank	977	3.100	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	HSBC	46
1.000	ANTA Sports Products Ltd	HSBC	2.432	16.500	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	JP Morgan	252
2.000	ANTA Sports Products Ltd	JP Morgan	4.870	500	BYD Co Ltd 'H'	JP Morgan	2.184
3.000	Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd	Citibank	175	(6.000)	BYD Electronic International Co Ltd	Citibank	(5.392)
16.000	Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd	HSBC	1.552	(500)	BYD Electronic International Co Ltd	HSBC	(742)
60.000	Aoyuan Healthy Life Group Co Ltd	JP Morgan	5.826	(13.000)	C&D International Investment Group Ltd	Citibank	(147)
(14.000)	Asia Cement China Holdings Corp	JP Morgan	428	(36.000)	C&D International Investment Group Ltd	HSBC	6.376
1.200	AsialInfo Technologies Ltd	Citibank	1	(18.000)	C&D International Investment Group Ltd	JP Morgan	3.360
9.600	AsialInfo Technologies Ltd	HSBC	(362)	(101.000)	CA Cultural Technology Group Ltd	Citibank	(1.065)
24.800	AsialInfo Technologies Ltd	JP Morgan	(929)	(49.000)	CA Cultural Technology Group Ltd	JP Morgan	(2.622)
2.300	ASM Pacific Technology Ltd	Citibank	832	1.000	Cathay Pacific Airways Ltd	Citibank	7
300	ASM Pacific Technology Ltd	HSBC	(376)	3.000	Cathay Pacific Airways Ltd	HSBC	21
6.400	ASM Pacific Technology Ltd	JP Morgan	(7.082)	155.000	Cathay Pacific Airways Ltd	JP Morgan	1.093
(64.000)	AviChina Industry & Technology Co Ltd 'H'	Citibank	(3.487)	(18.000)	Central China Management Co Ltd	Citibank	(6.123)
(66.000)	AviChina Industry & Technology Co Ltd 'H'	JP Morgan	(4.197)	(21.000)	Central China Management Co Ltd	JP Morgan	(7.143)
43.500	BAIC Motor Corp Ltd 'H'	Citibank	(383)	12.000	Central China New Life Ltd	Citibank	(241)
59.000	BAIC Motor Corp Ltd 'H'	HSBC	(140)	48.000	Central China New Life Ltd	HSBC	6.330
50.000	BAIC Motor Corp Ltd 'H'	JP Morgan	461	69.000	Central China New Life Ltd	JP Morgan	9.108
5.000	Bank of China Ltd 'H'	JP Morgan	(147)				
(28.000)	Bank of East Asia Ltd	Citibank	1.122				
(4.400)	Bank of East Asia Ltd	HSBC	222				
(800)	Bank of East Asia Ltd	JP Morgan	40				
(100.000)	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	Citibank	2.666				
(10.000)	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	HSBC	756				
(12.000)	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	JP Morgan	906				
4.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	Citibank	162				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(200)	Central China Real Estate Ltd	Citibank	—	14.000	China Everbright Ltd	JP Morgan	892
(233)	Central China Real Estate Ltd	JP Morgan	—	(18.000)	China Evergrande Group	Citibank	1.932
(78.000)	CGN New Energy Holdings Co Ltd	Citibank	(1.420)	(73.000)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Citibank	(684)
(274.000)	CGN New Energy Holdings Co Ltd	JP Morgan	(10.314)	(17.500)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	HSBC	(705)
(5.000)	Champion REIT (REIT)	Citibank	(15)	(4.500)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	(182)
(214.000)	Champion REIT (REIT)	HSBC	1.701	(5.000)	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holdings Ltd	Citibank	(705)
(48.000)	Champion REIT (REIT)	JP Morgan	413	(8.500)	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holdings Ltd	HSBC	(1.625)
(7.200)	Changsha Broad Homes Industrial Group Co Ltd 'H'	Citibank	2.773	(142.000)	China Harmony Auto Holding Ltd	Citibank	512
(11.700)	Changsha Broad Homes Industrial Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	3.127	(42.000)	China Harmony Auto Holding Ltd	JP Morgan	1.446
25.000	China Aoyuan Group Ltd	Citibank	1.337	18.000	China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd	Citibank	(54)
37.000	China Aoyuan Group Ltd	HSBC	4.455	14.000	China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd	HSBC	(136)
23.000	China Aoyuan Group Ltd	JP Morgan	2.773	6.000	China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd	JP Morgan	(7)
(39.000)	China Bohai Bank Co Ltd 'H'	Citibank	(9)	11.000	China Hongqiao Group Ltd	JP Morgan	(2.168)
(26.500)	China Bohai Bank Co Ltd 'H'	HSBC	642	(320.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H'	Citibank	10.490
(10.500)	China Bohai Bank Co Ltd 'H'	JP Morgan	254	(2.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H'	HSBC	66
(239.000)	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	Citibank	(1.260)	(98.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H'	JP Morgan	3.211
(120.000)	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	JP Morgan	(791)	9.600	China International Capital Corp Ltd 'H'	Citibank	2.798
14.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	Citibank	94	5.200	China International Capital Corp Ltd 'H'	HSBC	2.727
72.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	JP Morgan	770	12.800	China International Capital Corp Ltd 'H'	JP Morgan	6.718
(22.000)	China Conch Venture Holdings Ltd	Citibank	2.067	(19.000)	China Isotope & Radiation Corp	Citibank	(2.855)
(20.000)	China Conch Venture Holdings Ltd	JP Morgan	6.372	(9.000)	China Isotope & Radiation Corp	JP Morgan	(1.242)
7.000	China Construction Bank Corp 'H'	Citibank	184	(58.000)	China Lesso Group Holdings Ltd	Citibank	(9.124)
50.000	China Construction Bank Corp 'H'	HSBC	538	(8.000)	China Lesso Group Holdings Ltd	JP Morgan	(870)
29.000	China Construction Bank Corp 'H'	JP Morgan	316	4.000	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Citibank	180
135.000	China Dongxiang Group Co Ltd	Citibank	531	2.000	China Life Insurance Co Ltd 'H'	HSBC	100
16.000	China Dongxiang Group Co Ltd	HSBC	(61)	5.000	China Life Insurance Co Ltd 'H'	JP Morgan	252
87.000	China Dongxiang Group Co Ltd	JP Morgan	(328)	(9.000)	China Lilang Ltd	Citibank	(84)
2.000	China East Education Holdings Ltd	Citibank	(250)	(46.000)	China Lilang Ltd	HSBC	339
1.000	China East Education Holdings Ltd	HSBC	(17)	(120.000)	China Lilang Ltd	JP Morgan	606
3.000	China Education Group Holdings Ltd	Citibank	217	(3.600)	China Literature Ltd	Citibank	(1.088)
1.000	China Education Group Holdings Ltd	HSBC	247	(2.200)	China Literature Ltd	JP Morgan	(495)
3.000	China Education Group Holdings Ltd	JP Morgan	743	(43.000)	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	Citibank	1.184
(53.000)	China Everbright Environment Group Ltd	Citibank	(496)	(1.000)	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	HSBC	2
(18.000)	China Everbright Greentech Ltd	Citibank	(166)	(17.000)	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	JP Morgan	27
(17.000)	China Everbright Greentech Ltd	HSBC	171	12.000	China Maple Leaf Educational Systems Ltd	Citibank	79
(86.000)	China Everbright Greentech Ltd	JP Morgan	862	(8.000)	China Medical System Holdings Ltd	Citibank	(321)
6.000	China Everbright Ltd	Citibank	327				
8.000	China Everbright Ltd	HSBC	557				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(4.000)	China Medical System Holdings Ltd	HSBC	(1.314)	(26.000)	China Southern Airlines Co Ltd 'H'	Citibank	660
(6.000)	China Meidong Auto Holdings Ltd	Citibank	(1.138)	(45.000)	China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H'	Citibank	(416)
6.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	HSBC	4.695	(45.000)	China Suntien Green Energy Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(767)
2.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	JP Morgan	1.567	13.200	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Citibank	218
(18.000)	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Citibank	(12.727)	10.400	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	HSBC	171
(1.000)	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	HSBC	(677)	11.200	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	JP Morgan	188
(2.500)	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	JP Morgan	(1.202)	42.000	China Tian Lun Gas Holdings Ltd	Citibank	(483)
8.400	China Merchants Securities Co Ltd 'H'	Citibank	830	9.500	China Tian Lun Gas Holdings Ltd	HSBC	556
(69.500)	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H'	HSBC	69	12.500	China Tian Lun Gas Holdings Ltd	JP Morgan	734
125.000	China Modern Dairy Holdings Ltd	Citibank	(2.710)	156.000	China Tower Corp Ltd 'H'	Citibank	12
81.000	China Modern Dairy Holdings Ltd	HSBC	950	(240.000)	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	Citibank	(5.033)
153.000	China Modern Dairy Holdings Ltd	JP Morgan	1.800	(36.000)	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	HSBC	(2.702)
(42.000)	China Molybdenum Co Ltd 'H'	Citibank	(1.531)	(734.000)	China Travel International Investment Hong Kong Ltd	Citibank	(1.958)
(8.000)	China New Higher Education Group Ltd	Citibank	275	(540.000)	China Travel International Investment Hong Kong Ltd	JP Morgan	1.288
(3.000)	China New Higher Education Group Ltd	JP Morgan	(94)	(25.500)	China Vanke Co Ltd 'H'	Citibank	(2.020)
(120.000)	China Oriental Group Co Ltd	HSBC	10.278	(7.800)	China Vanke Co Ltd 'H'	HSBC	(216)
(14.000)	China Oriental Group Co Ltd	JP Morgan	1.277	(4.900)	China Vanke Co Ltd 'H'	JP Morgan	(138)
(5.000)	China Overseas Property Holdings Ltd	Citibank	(16)	32.000	China Water Affairs Group Ltd	Citibank	(728)
12.200	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	HSBC	1.911	60.000	China Water Affairs Group Ltd	HSBC	(3.761)
(87.000)	China Power International Development Ltd	Citibank	(348)	66.000	China Water Affairs Group Ltd	JP Morgan	(4.128)
(248.000)	China Power International Development Ltd	JP Morgan	(4.834)	1.500	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	Citibank	(39)
39.000	China Railway Group Ltd 'H'	Citibank	(89)	4.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	JP Morgan	31
134.000	China Railway Group Ltd 'H'	HSBC	(3.757)	(144.000)	China Youzan Ltd	Citibank	(574)
50.000	China Railway Group Ltd 'H'	JP Morgan	(1.397)	(12.000)	China Youzan Ltd	HSBC	632
5.300	China Renaissance Holdings Ltd	JP Morgan	318	(20.000)	China Youzan Ltd	JP Morgan	1.053
(14.000)	China Resources Beer Holdings Co Ltd	Citibank	(5.209)	10.000	China Yuhua Education Corp Ltd	Citibank	(329)
(2.000)	China Resources Beer Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.450)	12.000	China Yuhua Education Corp Ltd	HSBC	1.011
(70.000)	China Resources Cement Holdings Ltd	Citibank	(2.115)	58.000	China Yuhua Education Corp Ltd	JP Morgan	4.895
(30.500)	China Resources Medical Holdings Co Ltd	HSBC	(5.517)	27.600	China Zhongwang Holdings Ltd	Citibank	111
400	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	Citibank	(37)	12.800	China Zhongwang Holdings Ltd	HSBC	(377)
1.600	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	JP Morgan	872	28.800	China Zhongwang Holdings Ltd	JP Morgan	(848)
23.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd	Citibank	631	(2.000)	Chinasoft International Ltd	Citibank	(298)
26.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd	HSBC	1.182	8.000	Chinasoft International Ltd	Citibank	1.191
15.500	China Resources Pharmaceutical Group Ltd	JP Morgan	706	4.000	Chinasoft International Ltd	HSBC	801
(18.000)	China Sanjiang Fine Chemicals Co Ltd	Citibank	(213)	44.000	Chinasoft International Ltd	JP Morgan	8.822
(109.000)	China Sanjiang Fine Chemicals Co Ltd	JP Morgan	3.823	4.800	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	Citibank	883
13.000	China SCE Group Holdings Ltd	Citibank	171	4.400	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	HSBC	1.331
7.000	China SCE Group Holdings Ltd	JP Morgan	(43)	6.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	Citibank	96
				16.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	HSBC	49
				26.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	JP Morgan	83
				17.000	CITIC Ltd	Citibank	471
				1.000	CITIC Ltd	HSBC	(25)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
163.000	CITIC Ltd	JP Morgan	(4.063)	(164.000)	Differ Group Holding Co Ltd	Citibank	(7.204)
(51.000)	CITIC Securities Co Ltd 'H'	Citibank	(5.662)	(504.000)	Differ Group Holding Co Ltd	JP Morgan	(66.929)
(15.000)	CITIC Securities Co Ltd 'H'	HSBC	(3.481)	(5.600)	Dongfang Electric Corp Ltd		
(15.000)	CITIC Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	(3.487)		'H'	Citibank	(17)
342.000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	Citibank	(3.900)	(800)	Dongfang Electric Corp Ltd		
				'H'	JP Morgan		2
82.000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	HSBC	(2.625)	14.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Citibank	116
159.000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	JP Morgan	(5.080)	(4.000)	Dongyue Group Ltd	Citibank	(110)
10.000	CK Asset Holdings Ltd	Citibank	2.806	(16.000)	Dongyue Group Ltd	HSBC	1.037
2.500	CK Asset Holdings Ltd	HSBC	299	(11.000)	Dongyue Group Ltd	JP Morgan	984
13.000	CK Asset Holdings Ltd	JP Morgan	1.568	(97.000)	Dynagreen Environmental Protection Group Co Ltd		
7.000	CK Hutchison Holdings Ltd	Citibank	31	'H'	Citibank		(276)
7.000	CK Hutchison Holdings Ltd	HSBC	(4.477)	(4.000)	Dynagreen Environmental Protection Group Co Ltd		
2.500	CK Hutchison Holdings Ltd	JP Morgan	(1.595)	'H'	JP Morgan		105
(1.000)	CK Infrastructure Holdings Ltd	JP Morgan	195	9.000	EEKA Fashion Holdings Ltd	Citibank	(109)
(5.000)	COFCO Joycome Foods Ltd	Citibank	198	2.500	EEKA Fashion Holdings Ltd	HSBC	(352)
(16.000)	COFCO Joycome Foods Ltd	JP Morgan	283	7.000	EEKA Fashion Holdings Ltd	JP Morgan	(985)
(60.000)	Convoy Global Holdings Ltd	Citibank	968	(7.800)	ENN Energy Holdings Ltd	Citibank	(2.994)
(324.000)	Convoy Global Holdings Ltd	HSBC	5.225	(2.900)	ENN Energy Holdings Ltd	JP Morgan	(1.586)
(192.000)	Convoy Global Holdings Ltd	JP Morgan	3.096	(23.800)	ESR Cayman Ltd	Citibank	264
(20.000)	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H'	Citibank	24	(400)	ESR Cayman Ltd	HSBC	12
(57.000)	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H'	HSBC	1.389	8.000	Ever Sunshine Lifestyle Services Group Ltd	Citibank	1.888
8.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H'	Citibank	12	6.000	Ever Sunshine Lifestyle Services Group Ltd	JP Morgan	2.839
4.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H'	HSBC	(200)	11.000	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd	Citibank	(148)
30.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H'	JP Morgan	(1.496)	6.000	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd	HSBC	(390)
19.500	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H'	Citibank	(579)	6.000	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd	JP Morgan	(389)
2.500	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H'	HSBC	(467)	277.500	Fantasia Holdings Group Co Ltd	Citibank	1.450
5.500	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H'	JP Morgan	(1.026)	45.000	Fantasia Holdings Group Co Ltd	HSBC	177
34.000	COSCO SHIPPING Ports Ltd	Citibank	(1.342)	400.500	Fantasia Holdings Group Co Ltd	JP Morgan	1.562
16.000	COSCO SHIPPING Ports Ltd	HSBC	(1.744)	45.000	Far East Horizon Ltd	Citibank	839
34.000	COSCO SHIPPING Ports Ltd	JP Morgan	(3.701)	8.000	Far East Horizon Ltd	HSBC	(490)
(110.000)	Country Garden Holdings Co Ltd	Citibank	63	30.000	Far East Horizon Ltd	JP Morgan	(763)
5.000	Country Garden Services Holdings Co Ltd	Citibank	351	46.000	FIH Mobile Ltd	Citibank	241
2.000	Country Garden Services Holdings Co Ltd	HSBC	372	112.000	FIH Mobile Ltd	HSBC	1.460
7.000	Country Garden Services Holdings Co Ltd	JP Morgan	1.314	22.000	FIH Mobile Ltd	JP Morgan	399
2.000	CPMC Holdings Ltd	Citibank	50	(28.000)	First Tractor Co Ltd 'H'	Citibank	(838)
11.000	CPMC Holdings Ltd	HSBC	485	(14.000)	First Tractor Co Ltd 'H'	JP Morgan	202
177.000	CPMC Holdings Ltd	JP Morgan	7.824	(3.000)	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	Citibank	(662)
(2.500)	CSC Financial Co Ltd 'H'	Citibank	(227)	(7.000)	Flat Glass Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	(5.126)
(42.000)	CSC Financial Co Ltd 'H'	JP Morgan	(6.311)	(5.000)	Fortune Real Estate Investment Trust (REIT)	Citibank	(48)
5.600	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Citibank	452	(92.000)	Fortune Real Estate Investment Trust (REIT)	HSBC	(2.779)
320	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	JP Morgan	100	(1.000)	Fortune Real Estate Investment Trust (REIT)	JP Morgan	(30)
11.500	Dali Foods Group Co Ltd	Citibank	256	(89.000)	Fosun International Ltd	Citibank	(8.563)
44.000	Dali Foods Group Co Ltd	HSBC	922	14.000	FriendTimes Inc	JP Morgan	(41)
19.000	Dali Foods Group Co Ltd	JP Morgan	400	(60.000)	Fu Shou Yuan International Group Ltd	Citibank	(345)
278.000	Datang International Power Generation Co Ltd 'H'	Citibank	383	(6.000)	Fu Shou Yuan International Group Ltd	HSBC	(42)
282.000	Datang International Power Generation Co Ltd 'H'	HSBC	944	(6.000)	Fu Shou Yuan International Group Ltd	JP Morgan	(43)
34.000	Datang International Power Generation Co Ltd 'H'	JP Morgan	135	400	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	455
				(15.000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Citibank	(1.035)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(1.000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	HSBC	569	(12.400)	Haitong Securities Co Ltd 'H'	Citibank	(321)
1.600	Ganfeng Lithium Co Ltd 'H'	JP Morgan	3.437	(94.000)	Hang Lung Properties Ltd	Citibank	(2.313)
(71.000)	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	Citibank	4.258	(3.000)	Hang Lung Properties Ltd	HSBC	255
(16.000)	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	JP Morgan	959	(6.800)	Hang Seng Bank Ltd	Citibank	(343)
(23.000)	Geely Automobile Holdings Ltd	Citibank	(2.580)	(1.700)	Hang Seng Bank Ltd	HSBC	265
(6.000)	Geely Automobile Holdings Ltd	HSBC	(426)	2.000	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H'	Citibank	(363)
(154.000)	Gemdale Properties & Investment Corp Ltd	HSBC	(1.401)	200	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H'	HSBC	435
(42.000)	Gemdale Properties & Investment Corp Ltd	JP Morgan	(383)	300	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H'	JP Morgan	653
(34.500)	Genertec Universal Medical Group Co Ltd	HSBC	(3.126)	(4.000)	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	Citibank	(209)
(130.000)	Genertec Universal Medical Group Co Ltd	JP Morgan	(5.880)	2.000	Hebei Construction Group Corp Ltd 'H'	Citibank	(10)
(4.000)	Genscript Biotech Corp	Citibank	(1.863)	7.000	Hebei Construction Group Corp Ltd 'H'	HSBC	19
(45.600)	GF Securities Co Ltd 'H'	Citibank	(1.564)	7.000	Hebei Construction Group Corp Ltd 'H'	JP Morgan	20
(57.400)	GF Securities Co Ltd 'H'	HSBC	(637)	(6.000)	Henderson Land Development Co Ltd	Citibank	(1.059)
(2.200)	GF Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	(25)	(61.000)	Henderson Land Development Co Ltd	HSBC	(8.802)
(64.000)	GOME Retail Holdings Ltd	Citibank	(500)	(30.000)	Henderson Land Development Co Ltd	JP Morgan	(4.351)
120.000	Goodbaby International Holdings Ltd	Citibank	10.685	(8.000)	HengTen Networks Group Ltd	Citibank	1.232
120.000	Goodbaby International Holdings Ltd	JP Morgan	12.325	(4.000)	HengTen Networks Group Ltd	JP Morgan	(75)
(21.000)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Citibank	(4.955)	9.000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Citibank	7
4.000	Greentown China Holdings Ltd	JP Morgan	(25)	14.000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	HSBC	(1.684)
(4.000)	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H'	Citibank	(1.011)	20.000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	JP Morgan	(2.401)
(14.400)	Guangzhou R&F Properties Co Ltd 'H'	Citibank	(345)	(20.000)	Homeland Interactive Technology Ltd	Citibank	(239)
(8.000)	Guangzhou R&F Properties Co Ltd 'H'	HSBC	(336)	(12.000)	Homeland Interactive Technology Ltd	JP Morgan	(145)
(2.800)	Guangzhou R&F Properties Co Ltd 'H'	JP Morgan	(118)	(13.800)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Citibank	(156)
488.000	Guotai Junan International Holdings Ltd	Citibank	(580)	(49.450)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	HSBC	80
113.000	Guotai Junan International Holdings Ltd	HSBC	(717)	(17.800)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	JP Morgan	24
456.000	Guotai Junan International Holdings Ltd	JP Morgan	(2.878)	(71.000)	Hong Kong Television Network Ltd	Citibank	(1.421)
40.400	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H'	Citibank	1.491	(25.000)	Hong Kong Television Network Ltd	JP Morgan	(1.645)
6.400	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H'	HSBC	450	(374.000)	Hope Education Group Co Ltd	Citibank	8.064
35.600	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	2.513	(108.000)	Hope Education Group Co Ltd	HSBC	1.373
10.000	Haidilao International Holding Ltd	Citibank	(354)	(78.000)	Hope Education Group Co Ltd	JP Morgan	988
2.000	Haidilao International Holding Ltd	HSBC	689	(30.000)	Hopson Development Holdings Ltd	Citibank	(13.991)
13.000	Haidilao International Holding Ltd	JP Morgan	4.489	(300)	Hopson Development Holdings Ltd	JP Morgan	(122)
(4.400)	Haier Smart Home Co Ltd 'H'	HSBC	(549)	2.000	Hua Hong Semiconductor Ltd	HSBC	(780)
(18.000)	Hainan Meilan International Airport Co Ltd 'H'	Citibank	(7.001)	(43.000)	Huabao International Holdings Ltd	Citibank	2.176
(2.000)	Hainan Meilan International Airport Co Ltd 'H'	HSBC	(559)	(13.400)	Huatai Securities Co Ltd 'H'	Citibank	(1.151)
(7.000)	Hainan Meilan International Airport Co Ltd 'H'	JP Morgan	(2.461)	200	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	JP Morgan	723
(11.000)	Haitian International Holdings Ltd	Citibank	3.732	4.000	Hysan Development Co Ltd	Citibank	(17)
(3.000)	Haitian International Holdings Ltd	JP Morgan	1.827	3.000	Hysan Development Co Ltd	HSBC	373
				54.000	Hysan Development Co Ltd	JP Morgan	6.755
				6.000	IGG Inc	Citibank	607
				1.000	IGG Inc	HSBC	(9)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
31.000	IGG Inc	JP Morgan	(286)	13.500	Koolearn Technology Holding Ltd	HSBC	(232)
(15.000)	Immunotech Biopharm Ltd	Citibank	(1.719)	10.000	Koolearn Technology Holding Ltd	JP Morgan	(861)
(2.000)	InnoCare Pharma Ltd	HSBC	(90)	(112.000)	Kunlun Energy Co Ltd	Citibank	44.951
(2.000)	InnoCare Pharma Ltd	JP Morgan	(514)	(28.000)	Kunlun Energy Co Ltd	HSBC	10.157
500	Innovent Biologics Inc	JP Morgan	867	(11.500)	KWG Group Holdings Ltd	Citibank	(839)
300	Jacobio Pharmaceuticals Group Co Ltd	Citibank	(25)	14.000	KWG Living Group Holdings Ltd	Citibank	567
300	Jacobio Pharmaceuticals Group Co Ltd	HSBC	99	52.000	KWG Living Group Holdings Ltd	HSBC	6.057
900	Jacobio Pharmaceuticals Group Co Ltd	JP Morgan	297	23.000	KWG Living Group Holdings Ltd	JP Morgan	2.682
(2.800)	JD Health International Inc	Citibank	2.755	(70.000)	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	Citibank	1.408
(34.000)	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	HSBC	21	(26.000)	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	HSBC	1.427
(32.000)	Jiangxi Copper Co Ltd 'H'	Citibank	(5.318)	(13.000)	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	JP Morgan	712
(7.000)	Jiangxi Copper Co Ltd 'H'	HSBC	3.912	14.000	Lenovo Group Ltd	Citibank	(45)
(1.000)	Jiangxi Copper Co Ltd 'H'	JP Morgan	558	6.000	Lenovo Group Ltd	HSBC	(691)
100	Jinke Smart Services Group Co Ltd 'H'	HSBC	164	92.000	Lenovo Group Ltd	JP Morgan	(7.314)
(34.000)	Jinxin Fertility Group Ltd	Citibank	(13.410)	5.500	Li Ning Co Ltd	Citibank	4.527
(8.000)	Jinxin Fertility Group Ltd	HSBC	(2.866)	4.000	Li Ning Co Ltd	HSBC	4.322
21.000	Jiumaojiu International Holdings Ltd	Citibank	588	3.500	Li Ning Co Ltd	JP Morgan	3.786
7.000	Jiumaojiu International Holdings Ltd	HSBC	2.044	202.000	Liaoning Port Co Ltd 'H'	Citibank	272
6.000	Jiumaojiu International Holdings Ltd	JP Morgan	1.755	18.000	Liaoning Port Co Ltd 'H'	HSBC	(45)
24.500	JNBY Design Ltd	Citibank	(2.120)	100.000	Liaoning Port Co Ltd 'H'	JP Morgan	(250)
11.500	JNBY Design Ltd	HSBC	(166)	(40.000)	Lifetech Scientific Corp	Citibank	(1.355)
7.000	JNBY Design Ltd	JP Morgan	(99)	(44.000)	Lifetech Scientific Corp	HSBC	(4.719)
7.500	Johnson Electric Holdings Ltd	Citibank	706	(212.000)	Lifetech Scientific Corp	JP Morgan	(22.756)
500	Johnson Electric Holdings Ltd	HSBC	10	900	Link REIT (REIT)	Citibank	(13)
16.500	Johnson Electric Holdings Ltd	JP Morgan	349	5.900	Link REIT (REIT)	HSBC	(919)
3.000	Joynn Laboratories China Co Ltd 'H'	JP Morgan	5.488	14.700	Link REIT (REIT)	JP Morgan	(1.222)
(26.000)	Joy Spreader Interactive Technology Ltd	Citibank	263	21.000	Logan Group Co Ltd	Citibank	344
(13.000)	Joy Spreader Interactive Technology Ltd	JP Morgan	(3)	16.000	Logan Group Co Ltd	HSBC	591
2.000	JS Global Lifestyle Co Ltd	Citibank	364	22.000	Logan Group Co Ltd	JP Morgan	818
500	JS Global Lifestyle Co Ltd	JP Morgan	91	182.000	Lonking Holdings Ltd	Citibank	(10.511)
(90.000)	K Wah International Holdings Ltd	HSBC	(742)	86.000	Lonking Holdings Ltd	HSBC	(8.289)
(10.000)	K Wah International Holdings Ltd	JP Morgan	(55)	128.000	Lonking Holdings Ltd	JP Morgan	(12.329)
1.000	Kaisa Prosperity Holdings Ltd	Citibank	356	(3.000)	Luk Fook Holdings International Ltd	Citibank	(82)
250	Kaisa Prosperity Holdings Ltd	HSBC	221	(46.000)	Luk Fook Holdings International Ltd	HSBC	(12.510)
500	Kaisa Prosperity Holdings Ltd	JP Morgan	442	(4.000)	Luoyang Glass Co Ltd 'H'	JP Morgan	(92)
19.000	Kerry Logistics Network Ltd	JP Morgan	(669)	22.000	LVGEM China Real Estate Investment Co Ltd	HSBC	(110)
7.000	Kerry Properties Ltd	Citibank	(1.114)	26.000	LVGEM China Real Estate Investment Co Ltd	JP Morgan	(129)
(6.500)	Kingboard Holdings Ltd	Citibank	2.533	2.800	Man Wah Holdings Ltd	Citibank	559
(4.500)	Kingboard Holdings Ltd	JP Morgan	1.895	(10.000)	Man Wah Holdings Ltd	Citibank	(1.997)
(26.500)	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Citibank	2.971	800	Man Wah Holdings Ltd	HSBC	267
(500)	Kingboard Laminates Holdings Ltd	HSBC	90	22.000	Man Wah Holdings Ltd	JP Morgan	7.346
(7.000)	Kingboard Laminates Holdings Ltd	JP Morgan	1.251	(3.400)	Maoyan Entertainment	Citibank	14
(2.000)	Kingdee International Software Group Co Ltd	Citibank	(1.267)	(20.000)	Maoyan Entertainment	JP Morgan	348
(2.000)	Kingdee International Software Group Co Ltd	HSBC	(448)	4.000	Meitu Inc	HSBC	(23)
5.500	Koolearn Technology Holding Ltd	Citibank	5	30.500	Meitu Inc	JP Morgan	13
				200	Meituan 'B'	Citibank	597
				100	Meituan 'B'	HSBC	404
				1.200	Meituan 'B'	JP Morgan	4.853
				(125.000)	Melco International Development Ltd	Citibank	(3.993)
				(4.000)	Melco International Development Ltd	HSBC	(76)
				(1.000)	Melco International Development Ltd	JP Morgan	(19)
				(79.000)	Metallurgical Corp of China Ltd 'H'	Citibank	(214)
				(156.000)	MGM China Holdings Ltd	Citibank	(14.203)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(2.800)	MGM China Holdings Ltd	JP Morgan	(227)	(700)	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	HSBC	(487)
(10.000)	Microport Scientific Corp	Citibank	(10.221)	(3.700)	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	JP Morgan	(2.580)
(1.000)	Microport Scientific Corp	HSBC	(777)	5.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Citibank	2.059
(3.000)	Microport Scientific Corp	JP Morgan	(2.336)	3.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	HSBC	1.061
(6.000)	Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd	Citibank	(2.413)	10.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	JP Morgan	3.732
2.000	Minth Group Ltd	Citibank	481	(400)	Pop Mart International Group Ltd	Citibank	(275)
2.000	Minth Group Ltd	JP Morgan	547	(2.800)	Pop Mart International Group Ltd	JP Morgan	(3.587)
124.000	MMG Ltd	Citibank	(1.396)	13.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H'	HSBC	650
72.000	MMG Ltd	HSBC	(14.070)	(36.000)	Power Assets Holdings Ltd	Citibank	107
44.000	MMG Ltd	JP Morgan	(8.593)	(12.500)	Power Assets Holdings Ltd	HSBC	4.867
(11.000)	Mobvista Inc	JP Morgan	(2.249)	(3.500)	Power Assets Holdings Ltd	JP Morgan	1.359
11.000	MTR Corp Ltd	Citibank	(1.240)	6.000	Powerlong Commercial Management Holdings Ltd	Citibank	979
500	MTR Corp Ltd	HSBC	(89)	14.000	Powerlong Commercial Management Holdings Ltd	HSBC	(1.322)
17.000	MTR Corp Ltd	JP Morgan	(2.997)	8.500	Powerlong Commercial Management Holdings Ltd	JP Morgan	(797)
24.000	NagaCorp Ltd	Citibank	354	8.000	Q Technology Group Co Ltd	Citibank	1.141
4.000	NagaCorp Ltd	HSBC	(23)	(16.000)	Redsun Properties Group Ltd	Citibank	(127)
20.000	NagaCorp Ltd	JP Morgan	(114)	(92.000)	Redsun Properties Group Ltd	HSBC	(1.321)
51.000	NetDragon Websoft Holdings Ltd	Citibank	6.325	5.700	Samsonite International SA	HSBC	1.092
6.000	NetDragon Websoft Holdings Ltd	HSBC	1.594	(33.600)	Sands China Ltd	Citibank	(5.061)
23.000	NetDragon Websoft Holdings Ltd	JP Morgan	6.131	(16.000)	Sands China Ltd	HSBC	785
(7.000)	Netjoy Holdings Ltd	Citibank	(31)	(2.000)	Sands China Ltd	JP Morgan	97
5.000	New World Development Co Ltd	Citibank	691	(30.000)	Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd	Citibank	1.642
1.000	New World Development Co Ltd	HSBC	(61)	(8.000)	Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd	HSBC	1.654
8.000	New World Development Co Ltd	JP Morgan	(484)	(27.000)	Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd	JP Morgan	5.576
(2.000)	Newborn Town Inc	JP Morgan	(324)	31.000	Scholar Education Group	Citibank	(1.385)
1.000	Nissin Foods Co Ltd	Citibank	26	11.000	Scholar Education Group	HSBC	(1.894)
5.000	Nissin Foods Co Ltd	JP Morgan	235	37.000	Scholar Education Group	JP Morgan	(6.211)
(131.000)	NWS Holdings Ltd	HSBC	1.520	(50.000)	Seazen Group Ltd	Citibank	(2.479)
(1.000)	NWS Holdings Ltd	JP Morgan	21	(7.500)	Shandong Gold Mining Co Ltd 'H'	Citibank	29
2.000	Ocumension Therapeutics	Citibank	1.897	(24.000)	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd 'H'	Citibank	2.195
1.000	Ocumension Therapeutics	HSBC	1.124	(86.000)	Shanghai Electric Group Co Ltd 'H'	Citibank	4.306
1.500	Ocumension Therapeutics	JP Morgan	1.753	(22.000)	Shanghai Electric Group Co Ltd 'H'	HSBC	1.300
46.000	Orient Securities Co Ltd 'H'	Citibank	3.277	(30.000)	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd 'H'	Citibank	(724)
6.000	Orient Securities Co Ltd 'H'	HSBC	481	(2.000)	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	(744)
6.000	Orient Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	482	300	Shanghai Haohai Biological Technology Co Ltd 'H'	Citibank	1.121
218.000	Pacific Basin Shipping Ltd	Citibank	5.100	200	Shanghai Haohai Biological Technology Co Ltd 'H'	HSBC	756
57.000	Pacific Basin Shipping Ltd	HSBC	489	2.000	Shanghai Haohai Biological Technology Co Ltd 'H'	JP Morgan	7.563
59.000	Pacific Basin Shipping Ltd	JP Morgan	(201)				
26.000	Pacific Textiles Holdings Ltd	Citibank	10				
12.000	Pacific Textiles Holdings Ltd	HSBC	(88)				
21.000	Pacific Textiles Holdings Ltd	JP Morgan	(152)				
(8.000)	PAX Global Technology Ltd	Citibank	(706)				
(38.000)	PCCW Ltd	Citibank	331				
(17.000)	PCCW Ltd	HSBC	914				
(202.000)	People's Insurance Co Group of China Ltd 'H'	Citibank	(3.424)				
(58.000)	People's Insurance Co Group of China Ltd 'H'	HSBC	(1.058)				
(17.000)	People's Insurance Co Group of China Ltd 'H'	JP Morgan	(311)				
34.000	PetroChina Co Ltd 'H'	Citibank	139				
18.000	PetroChina Co Ltd 'H'	HSBC	(112)				
616.000	PetroChina Co Ltd 'H'	JP Morgan	(3.786)				
200	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H'	Citibank	186				
1.500	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H'	HSBC	5.042				
200	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H'	JP Morgan	673				
(38.000)	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	Citibank	224				
(200)	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	Citibank	(31)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(1.800)	Shanghai Kindly Medical Instruments Co Ltd 'H'	Citibank	(770)	44.000	Sinopec Oilfield Service Corp 'H'	JP Morgan	(337)
(11.600)	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H'	Citibank	(1.807)	38.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	JP Morgan	(143)
(4.000)	Shangri-La Asia Ltd	HSBC	(64)	(4.000)	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Citibank	(394)
(14.000)	Shangri-La Asia Ltd	JP Morgan	(226)	3.000	Sinotrans Ltd 'H'	Citibank	(3)
(6.000)	Shenzhen Expressway Co Ltd 'H'	HSBC	414	35.000	Sinotrans Ltd 'H'	JP Morgan	(574)
1.000	Shenzhen Hepalink Pharmaceutical Group Co Ltd 'H'	Citibank	32	5.000	Sinotruk Hong Kong Ltd	JP Morgan	76
1.500	Shenzhen Hepalink Pharmaceutical Group Co Ltd 'H'	HSBC	21	46.000	SITC International Holdings Co Ltd	Citibank	7.202
9.000	Shenzhen Hepalink Pharmaceutical Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	125	30.000	SITC International Holdings Co Ltd	HSBC	(14.235)
(12.500)	Shenzhen International Holdings Ltd	Citibank	730	25.000	SITC International Holdings Co Ltd	JP Morgan	(11.846)
(4.000)	Shenzhen International Holdings Ltd	HSBC	831	(27.000)	SJM Holdings Ltd	Citibank	365
(2.000)	Shenzhen International Holdings Ltd	JP Morgan	415	(87.000)	SJM Holdings Ltd	HSBC	2.858
(36.000)	Shenzhen Investment Ltd	Citibank	(285)	(46.000)	Skyworth Group Ltd	HSBC	407
(4.177)	Shenzhen Investment Ltd	HSBC	10	(54.000)	Skyworth Group Ltd	JP Morgan	129
700	Shenzhou International Group Holdings Ltd	Citibank	506	(96.000)	SMI Holdings Group Ltd'	Citibank	—
14.500	Shimao Group Holdings Ltd	Citibank	117	(216.000)	SMI Holdings Group Ltd'	JP Morgan	65.213
2.500	Shimao Group Holdings Ltd	HSBC	(109)	(9.000)	Smooere International Holdings Ltd	Citibank	4.078
7.500	Shimao Group Holdings Ltd	JP Morgan	(323)	(157.000)	SOHO China Ltd	Citibank	175
7.000	Shimao Services Holdings Ltd	Citibank	1.273	(7.000)	SOHO China Ltd	JP Morgan	(45)
5.000	Shimao Services Holdings Ltd	JP Morgan	1.104	(30.000)	SSY Group Ltd	HSBC	(1.363)
98.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	Citibank	520	(2.900)	Standard Chartered Plc	Citibank	(348)
4.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	HSBC	(138)	(21.600)	Standard Chartered Plc	HSBC	1.165
56.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	JP Morgan	(1.936)	(1.200)	Standard Chartered Plc	JP Morgan	63
(60.000)	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	Citibank	(7.357)	17.000	Sun Art Retail Group Ltd	Citibank	(36)
(8.000)	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	JP Morgan	(1.074)	19.000	Sun Art Retail Group Ltd	HSBC	(2.390)
17.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	Citibank	(660)	5.000	Sun Art Retail Group Ltd	JP Morgan	(628)
17.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	HSBC	1.215	(8.500)	Sun Hung Kai Properties Ltd	Citibank	(2.044)
11.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	JP Morgan	788	(12.000)	Sun Hung Kai Properties Ltd	HSBC	825
(87.346)	Sino Land Co Ltd	Citibank	1.272	2.000	Sunac China Holdings Ltd	Citibank	17
(32.000)	Sino Land Co Ltd	HSBC	(770)	6.000	Sunac China Holdings Ltd	HSBC	(335)
(28.000)	Sino Land Co Ltd	JP Morgan	(680)	12.000	Sunac China Holdings Ltd	JP Morgan	(2.827)
339.500	Sino-Ocean Group Holding Ltd	Citibank	(3.894)	1.000	Sunac Services Holdings Ltd	Citibank	40
114.000	Sino-Ocean Group Holding Ltd	HSBC	(1.095)	4.000	Sunac Services Holdings Ltd	HSBC	1.011
157.500	Sino-Ocean Group Holding Ltd	JP Morgan	(2.613)	8.000	Sunac Services Holdings Ltd	JP Morgan	2.027
2.500	Sino-Ocean Service Holding Ltd	Citibank	358	(26.000)	SUNeVision Holdings Ltd	Citibank	83
18.500	Sino-Ocean Service Holding Ltd	HSBC	3.748	(77.000)	SUNeVision Holdings Ltd	HSBC	(1.013)
41.500	Sino-Ocean Service Holding Ltd	JP Morgan	8.231	(13.000)	SUNeVision Holdings Ltd	JP Morgan	(43)
83.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	Citibank	350	500	Swire Pacific Ltd 'A'	Citibank	(33)
121.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	HSBC	(5.100)	500	Swire Pacific Ltd 'A'	HSBC	(326)
253.500	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	(10.656)	4.500	Swire Pacific Ltd 'A'	JP Morgan	(2.931)
18.000	Sinopec Oilfield Service Corp 'H'	Citibank	(69)	15.400	Swire Properties Ltd	Citibank	(272)
				19.600	Swire Properties Ltd	HSBC	(94)
				15.200	Swire Properties Ltd	JP Morgan	(66)
				3.000	TCL Electronics Holdings Ltd	Citibank	1
				13.000	TCL Electronics Holdings Ltd	HSBC	(430)
				1.000	TCL Electronics Holdings Ltd	JP Morgan	(33)
				3.000	Techtronic Industries Co Ltd	Citibank	1.152
				5.000	Techtronic Industries Co Ltd	HSBC	(4.327)
				5.000	Techtronic Industries Co Ltd	JP Morgan	(4.312)
				900	Tencent Holdings Ltd	Citibank	3.923
				500	Tencent Holdings Ltd	HSBC	1.567
				2.100	Tencent Holdings Ltd	JP Morgan	6.609
				5.500	Texhong Textile Group Ltd	Citibank	76
				1.000	Texhong Textile Group Ltd	HSBC	81
				4.000	Texhong Textile Group Ltd	JP Morgan	324

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
17.000	Tianli Education International Holdings Ltd	Citibank	(257)	2.000	Vitasoy International Holdings Ltd	Citibank	249
16.000	Tianli Education International Holdings Ltd	JP Morgan	(1.484)	2.000	Vitasoy International Holdings Ltd	HSBC	378
8.000	Tianneng Power International Ltd	Citibank	1.080	4.000	Vitasoy International Holdings Ltd	JP Morgan	758
2.000	Tianneng Power International Ltd	HSBC	229	(13.000)	Vobile Group Ltd	Citibank	50
12.000	Tianneng Power International Ltd	JP Morgan	1.375	(5.000)	Vobile Group Ltd	JP Morgan	(3.203)
1.000	Times China Holdings Ltd	Citibank	(97)	20.000	VSTECs Holdings Ltd	Citibank	(221)
6.000	Times China Holdings Ltd	HSBC	(165)	28.000	VSTECs Holdings Ltd	HSBC	303
75.000	Times China Holdings Ltd	JP Morgan	(2.051)	8.000	VSTECs Holdings Ltd	JP Morgan	88
(34.000)	Times Neighborhood Holdings Ltd	Citibank	(1.898)	7.500	VTech Holdings Ltd	Citibank	(536)
(2.000)	Times Neighborhood Holdings Ltd	HSBC	(186)	3.700	VTech Holdings Ltd	HSBC	963
9.000	Times Neighborhood Holdings Ltd	HSBC	839	13.300	VTech Holdings Ltd	JP Morgan	4.046
22.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	Citibank	(373)	162.000	Want Want China Holdings Ltd	Citibank	485
16.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	HSBC	1.500	65.000	Want Want China Holdings Ltd	HSBC	(224)
4.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	JP Morgan	376	130.000	Want Want China Holdings Ltd	JP Morgan	(433)
3.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H'	Citibank	465	7.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	Citibank	86
2.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H'	HSBC	449	3.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	HSBC	96
7.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H'	JP Morgan	1.573	6.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	JP Morgan	173
(42.000)	Tongcheng-Elong Holdings Ltd	Citibank	(5.419)	(24.000)	Weimob Inc	Citibank	(5.347)
(5.200)	Tongcheng-Elong Holdings Ltd	HSBC	(1.568)	25.500	WH Group Ltd	Citibank	(86)
410.000	Tongda Group Holdings Ltd	Citibank	(510)	44.500	WH Group Ltd	HSBC	(928)
210.000	Tongda Group Holdings Ltd	HSBC	1.632	33.000	WH Group Ltd	JP Morgan	(348)
1.030.000	Tongda Group Holdings Ltd	JP Morgan	8.015	(7.000)	Wharf Holdings Ltd	Citibank	(1.470)
4.000	Topsports International Holdings Ltd	Citibank	(17)	(28.000)	Wharf Holdings Ltd	HSBC	(8.527)
9.000	Topsports International Holdings Ltd	HSBC	564	(11.000)	Wharf Holdings Ltd	JP Morgan	(3.708)
19.000	Topsports International Holdings Ltd	JP Morgan	1.195	(9.000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Citibank	(783)
71.000	Towngas China Co Ltd	Citibank	118	1.536	WuXi AppTec Co Ltd 'H'	Citibank	1.838
16.000	Towngas China Co Ltd	HSBC	1.592	360	WuXi AppTec Co Ltd 'H'	HSBC	1.157
166.000	Towngas China Co Ltd	JP Morgan	16.536	2.280	WuXi AppTec Co Ltd 'H'	JP Morgan	7.335
(67.000)	TravelSky Technology Ltd 'H'	Citibank	4.749	500	Wuxi Biologics Cayman Inc	Citibank	745
(2.000)	TravelSky Technology Ltd 'H'	JP Morgan	(158)	1.000	Wuxi Biologics Cayman Inc	HSBC	2.340
2.000	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H'	Citibank	1.326	1.500	Wuxi Biologics Cayman Inc	JP Morgan	3.512
62.000	Uni-President China Holdings Ltd	Citibank	(1.798)	5.200	Wynn Macau Ltd	Citibank	45
10.000	Uni-President China Holdings Ltd	HSBC	(1.333)	5.200	Wynn Macau Ltd	HSBC	(384)
32.000	Uni-President China Holdings Ltd	JP Morgan	(4.260)	14.000	Wynn Macau Ltd	JP Morgan	(1.029)
(30.000)	United Co RUSAL International PJSC	Citibank	(477)	(3.800)	XD Inc	Citibank	(2.489)
(34.000)	United Laboratories International Holdings Ltd	HSBC	(2.820)	(3.400)	XD Inc	JP Morgan	(2.778)
4.000	Vesync Co Ltd	Citibank	467	16.500	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd	Citibank	139
7.000	Vinda International Holdings Ltd	Citibank	238	35.000	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd	HSBC	(10.367)
1.000	Vinda International Holdings Ltd	HSBC	(159)	27.000	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd	JP Morgan	(8.094)
4.000	Vinda International Holdings Ltd	JP Morgan	(635)	2.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	Citibank	726
				2.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	HSBC	738
				4.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	JP Morgan	1.479
				(658)	Xinyi Solar Holdings Ltd	Citibank	(68)
				(10.192)	Xinyi Solar Holdings Ltd	HSBC	(4.263)
				(1.269)	Xinyi Solar Holdings Ltd	JP Morgan	(531)
				(10.500)	Xtep International Holdings Ltd	Citibank	(1.277)
				(19.500)	Xtep International Holdings Ltd	HSBC	(5.159)
				(17.500)	Xtep International Holdings Ltd	JP Morgan	(4.465)
				2.000	Yadea Group Holdings Ltd	JP Morgan	364
				16.500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H'	Citibank	(10)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
2.000	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H'	JP Morgan	4	200	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	HSBC	(18)
(3.200)	Yeahka Ltd	Citibank	(609)	63.400	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	JP Morgan	(4.798)
(1.600)	Yeahka Ltd	JP Morgan	1.301				(62.889)
14.200	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd 'H'	Citibank	721				
12.400	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd 'H'	JP Morgan	950	Indonésie			
2.000	Yihai International Holding Ltd	Citibank	(365)	37.900	Bank Central Asia Tbk PT	Citibank	1.102
2.000	Yihai International Holding Ltd	HSBC	(1.755)	200	Bank Central Asia Tbk PT	HSBC	(6)
2.000	Yihai International Holding Ltd	JP Morgan	(1.753)	41.700	Bank Central Asia Tbk PT	JP Morgan	(624)
(87.000)	Youyuan International Holdings Ltd	Citibank	1.164	49.900	Bank Mandiri Persero Tbk PT	Citibank	979
(38.000)	Youyuan International Holdings Ltd	JP Morgan	509	7.300	Bank Mandiri Persero Tbk PT	HSBC	(5)
38.500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Citibank	(1.183)	83.700	Bank Mandiri Persero Tbk PT	JP Morgan	159
25.000	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	HSBC	(798)	113.100	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	Citibank	1.011
94.500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	JP Morgan	(1.607)	(35.000)	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	JP Morgan	(518)
8.000	Yuexiu Property Co Ltd	Citibank	73	65.300	Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT	Citibank	494
18.000	Yuexiu Property Co Ltd	HSBC	165	(751.000)	Barito Pacific Tbk PT	JP Morgan	1.298
68.000	Yuexiu Property Co Ltd	JP Morgan	625	(14.200)	Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	HSBC	(401)
(34.000)	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	HSBC	470	(134.700)	Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	JP Morgan	(1.663)
(2.000)	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	JP Morgan	27	678.300	Erajaya Swasembada Tbk PT	HSBC	(222)
15.000	Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H'	Citibank	473	67.800	Erajaya Swasembada Tbk PT	JP Morgan	(23)
10.500	Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H'	HSBC	(237)	(50.500)	Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT	JP Morgan	87
26.000	Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H'	JP Morgan	(583)	(2.000)	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT	HSBC	232
24.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	HSBC	(174)	(73.400)	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT	JP Morgan	8.206
28.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	JP Morgan	(199)	2.700	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	HSBC	(80)
16.600	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H'	Citibank	1.850	(32.500)	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	JP Morgan	507
4.400	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H'	HSBC	601	1.596.900	Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT	Citibank	1.009
4.200	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	629	335.800	Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT	HSBC	(106)
(14.000)	Zhenro Properties Group Ltd	HSBC	915	407.900	Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT	JP Morgan	8
(1.000)	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd 'H'	Citibank	197	24.800	Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT	Citibank	165
(8.500)	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Citibank	(4.307)	72.100	Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT	HSBC	(566)
(8.000)	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd	Citibank	(614)	214.800	Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT	JP Morgan	(952)
(2.500)	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd	JP Morgan	(112)	(179.500)	Kalbe Farma Tbk PT	JP Morgan	245
(8.500)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	Citibank	(697)	(105.000)	Merdeka Copper Gold Tbk PT	HSBC	633
(2.900)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	JP Morgan	(906)	(50.500)	Merdeka Copper Gold Tbk PT	JP Morgan	244
6.000	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	Citibank	197	(23.400)	Mitra Adiperkasa Tbk PT	JP Morgan	98
				10.500	Mitra Keluarga Karyasehat Tbk PT	Citibank	(12)
				(1.700)	Pabrik Kertas Tjiwi Kimia Tbk PT	JP Morgan	232

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Indonésie suite				Japon suite			
53.300	Perusahaan Gas Negara Tbk PT	Citibank	244	1.500	Alfresa Holdings Corp	HSBC	318
98.900	Perusahaan Gas Negara Tbk PT	HSBC	(502)	2.300	Alfresa Holdings Corp	JP Morgan	(1.907)
471.300	Perusahaan Gas Negara Tbk PT	JP Morgan	(3.037)	(100)	Alpha Systems Inc	HSBC	64
(17.700)	Sarana Menara Nusantara Tbk PT	HSBC	33	(300)	Alpha Systems Inc	JP Morgan	138
(156.500)	Sarana Menara Nusantara Tbk PT	JP Morgan	215	1.200	Alps Alpine Co Ltd	Citibank	(200)
41.600	Surya Citra Media Tbk PT	Citibank	707	500	Alps Alpine Co Ltd	HSBC	57
92.600	Surya Citra Media Tbk PT	HSBC	1.371	4.200	Alps Alpine Co Ltd	JP Morgan	(3.745)
83.900	Surya Citra Media Tbk PT	JP Morgan	1.295	1.000	Altech Corp	HSBC	(994)
213.700	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	Citibank	2.949	300	Altech Corp	JP Morgan	(307)
33.000	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	Citibank	181	1.900	Amada Co Ltd	Citibank	576
(12.000)	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	HSBC	13	400	Amada Co Ltd	HSBC	(297)
10.900	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	HSBC	(12)	4.700	Amada Co Ltd	JP Morgan	(3.568)
175.800	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	JP Morgan	236	(100)	Amano Corp	HSBC	105
(109.200)	Unilever Indonesia Tbk PT	JP Morgan	(1.162)	(200)	Amano Corp	JP Morgan	219
			14.062	200	Amuse Inc	JP Morgan	(373)
Japon				(600)	ANA Holdings Inc	JP Morgan	(432)
(200)	77 Bank Ltd	HSBC	226	1.000	AOKI Holdings Inc	HSBC	(67)
(4.200)	77 Bank Ltd	JP Morgan	4.835	3.200	AOKI Holdings Inc	JP Morgan	(243)
600	ABC-Mart Inc	Citibank	975	(1.100)	Aomori Bank Ltd	JP Morgan	1.892
2.800	ABC-Mart Inc	JP Morgan	4.341	(3.100)	Aozora Bank Ltd	JP Morgan	(336)
(1.400)	Access Co Ltd	HSBC	161	1.700	Arcland Service Holdings Co Ltd	Citibank	1
(5.500)	Access Co Ltd	JP Morgan	1.120	500	Arcland Service Holdings Co Ltd	HSBC	(151)
(17.100)	Acom Co Ltd	JP Morgan	(1.922)	200	Arcland Service Holdings Co Ltd	JP Morgan	(67)
(7)	Activia Properties Inc (REIT)	JP Morgan	283	2.000	Arcs Co Ltd	JP Morgan	(1.223)
900	Adastria Co Ltd	Citibank	79	400	Ariake Japan Co Ltd	Citibank	22
1.500	Adastria Co Ltd	HSBC	(101)	300	Ariake Japan Co Ltd	HSBC	(973)
900	Adastria Co Ltd	JP Morgan	(137)	200	Ariake Japan Co Ltd	JP Morgan	(668)
(3.000)	ADEKA Corp	JP Morgan	7.432	1.400	ARTERIA Networks Corp	Citibank	(963)
2.800	Advan Co Ltd	Citibank	(706)	200	Aruhi Corp	Citibank	(279)
1.400	Advan Co Ltd	HSBC	(563)	700	Aruhi Corp	HSBC	(1.738)
4.300	Advan Co Ltd	JP Morgan	(1.791)	1.200	Aruhi Corp	JP Morgan	(3.011)
(13)	Advance Residence Investment Corp (REIT)	JP Morgan	533	400	As One Corp	Citibank	(1.528)
200	Advantest Corp	JP Morgan	274	500	Asahi Co Ltd	Citibank	(109)
(500)	Aeon Co Ltd	JP Morgan	557	2.100	Asahi Co Ltd	HSBC	(1.923)
(300)	Aeon Delight Co Ltd	JP Morgan	249	700	Asahi Co Ltd	JP Morgan	(656)
(400)	Aeon Fantasy Co Ltd	Citibank	(514)	(900)	Asahi Group Holdings Ltd	JP Morgan	(3.538)
(200)	AEON Financial Service Co Ltd	Citibank	101	400	Asahi Holdings Inc	Citibank	189
(2.200)	AEON Financial Service Co Ltd	JP Morgan	212	300	Asahi Holdings Inc	HSBC	405
(800)	Aeon Hokkaido Corp	HSBC	857	2.400	Asahi Holdings Inc	JP Morgan	202
(6.400)	Aeon Hokkaido Corp	JP Morgan	6.957	700	Asahi Intecc Co Ltd	Citibank	(1.168)
800	Aeon Mall Co Ltd	Citibank	182	600	Asahi Intecc Co Ltd	JP Morgan	(1.584)
700	Aeon Mall Co Ltd	HSBC	196	2.400	Asahi Kasei Corp	Citibank	(1.197)
100	AGC Inc	Citibank	(47)	5.000	Asahi Kasei Corp	JP Morgan	(659)
300	AGC Inc	HSBC	65	(100)	Asanuma Corp	JP Morgan	41
800	AGC Inc	JP Morgan	942	500	Asics Corp	JP Morgan	3.571
100	Aica Kogyo Co Ltd	HSBC	(333)	1.400	ASKUL Corp	Citibank	61
1.100	Aica Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(3.582)	(800)	Astellas Pharma Inc	JP Morgan	(426)
600	Aichi Corp	Citibank	17	3.500	Atom Corp	HSBC	(428)
900	Aichi Corp	HSBC	(357)	200	Atrae Inc	Citibank	258
300	Aichi Corp	JP Morgan	(123)	400	Atrae Inc	HSBC	(109)
800	Aichi Steel Corp	JP Morgan	(3.318)	900	Autobacs Seven Co Ltd	Citibank	(428)
(13.700)	Aiful Corp	JP Morgan	(5.097)	400	Autobacs Seven Co Ltd	HSBC	(212)
1.000	Ain Holdings Inc	JP Morgan	2.790	7.500	Autobacs Seven Co Ltd	JP Morgan	(3.608)
(700)	Air Water Inc	JP Morgan	2	500	Avant Corp	Citibank	(364)
100	Ajinomoto Co Inc	JP Morgan	40	900	Avant Corp	JP Morgan	(1.332)
500	Alfresa Holdings Corp	Citibank	84	(300)	Awa Bank Ltd	HSBC	742
				(2.200)	Awa Bank Ltd	JP Morgan	5.145
				(900)	Axxzia Inc	JP Morgan	(2.117)
				200	Azbil Corp	JP Morgan	(466)
				(100)	Bank of Iwate Ltd	JP Morgan	337
				(300)	Bank of Nagoya Ltd	Citibank	563
				(1.200)	Bank of Nagoya Ltd	JP Morgan	2.049
				(2.500)	Bank of Okinawa Ltd	JP Morgan	4.152
				200	Base Co Ltd	Citibank	116
				200	Base Co Ltd	HSBC	(1.442)
				300	BASE Inc	Citibank	239
				300	BASE Inc	JP Morgan	132

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
1.200	Bell System24 Holdings Inc	Citibank	(113)	(58.000)	Concordia Financial Group Ltd	JP Morgan	20.703
1.800	Bell System24 Holdings Inc	JP Morgan	(676)	1.100	CONEXIO Corp	Citibank	(102)
(1.100)	Belluna Co Ltd	JP Morgan	1.208	1.700	CONEXIO Corp	JP Morgan	(350)
600	Benefit One Inc	Citibank	516	(4.200)	COOKPAD Inc	HSBC	658
1.100	Benefit One Inc	JP Morgan	3.420	2.600	Cosel Co Ltd	Citibank	1.207
1.200	Benesse Holdings Inc	Citibank	(852)	1.000	Cosel Co Ltd	JP Morgan	(24)
3.230	BeNext-Yumeshin Group Co	Citibank	124	(2.800)	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	JP Morgan	8.882
900	BeNext-Yumeshin Group Co	HSBC	(1.288)	(4)	CRE Logistics Inc (REIT)	Citibank	(164)
400	BeNext-Yumeshin Group Co	JP Morgan	(581)	(19)	CRE Logistics Inc (REIT)	JP Morgan	(154)
300	Bengo4.com Inc	JP Morgan	(1.044)	1.500	Credit Saison Co Ltd	JP Morgan	522
2.800	Bic Camera Inc	Citibank	(325)	1.200	CyberAgent Inc	Citibank	219
2.100	Bic Camera Inc	HSBC	(401)	1.100	CyberAgent Inc	HSBC	(103)
400	Bridgestone Corp	Citibank	37	(2.700)	CYBERDYNE Inc	JP Morgan	1.673
1.100	Bridgestone Corp	JP Morgan	1.326	2.500	Dai Nippon Printing Co Ltd	JP Morgan	895
(1.200)	Broadleaf Co Ltd	JP Morgan	345	(1.900)	Daibiru Corp	JP Morgan	722
(400)	Bushiroad Inc	JP Morgan	(179)	(600)	Daido Steel Co Ltd	JP Morgan	4.162
600	Calbee Inc	Citibank	(504)	200	Daifuku Co Ltd	HSBC	(3.892)
900	Calbee Inc	HSBC	(1.422)	300	Daifuku Co Ltd	JP Morgan	(5.886)
2.500	Calbee Inc	JP Morgan	(4.047)	(100)	Daiho Corp	Citibank	130
1.900	Canon Inc	JP Morgan	(1.516)	(300)	Daiho Corp	HSBC	(142)
600	Canon Marketing Japan Inc	HSBC	(370)	(3.500)	Daiho Corp	JP Morgan	1.540
1.800	Canon Marketing Japan Inc	JP Morgan	(1.178)	(3.600)	Dai-ichi Life Holdings Inc	JP Morgan	(5.127)
1.100	Capcom Co Ltd	JP Morgan	2.074	1.000	Daiichi Sankyo Co Ltd	HSBC	(640)
300	Carta Holdings Inc	HSBC	201	2.000	Daiichi Sankyo Co Ltd	JP Morgan	(4.533)
900	Carta Holdings Inc	JP Morgan	582	(800)	Daiichikoshu Co Ltd	JP Morgan	125
100	CellSource Co Ltd	Citibank	230	1.000	Daiken Corp	Citibank	(784)
100	CellSource Co Ltd	JP Morgan	52	100	Daiken Corp	HSBC	(181)
100	Central Security Patrols Co Ltd	JP Morgan	(89)	400	Daiken Corp	JP Morgan	(737)
(1.800)	Chiba Bank Ltd	HSBC	426	500	Daikin Industries Ltd	JP Morgan	(7.930)
(33.800)	Chiba Bank Ltd	JP Morgan	8.351	600	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	Citibank	(388)
900	Chiyoda Co Ltd	Citibank	99	1.200	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	HSBC	(1.069)
1.000	Chiyoda Co Ltd	HSBC	(250)	800	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(739)
800	Chiyoda Co Ltd	JP Morgan	(210)	(100)	Daio Paper Corp	JP Morgan	183
100	Chiyoda Integre Co Ltd	JP Morgan	(16)	(700)	Daiseiki Co Ltd	JP Morgan	86
(400)	Chofu Seisakusho Co Ltd	JP Morgan	173	(2.700)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	JP Morgan	1.793
(6.300)	Chubu Electric Power Co Inc	JP Morgan	3.734	(400)	Daito Trust Construction Co Ltd	JP Morgan	821
300	Chubu Shiryo Co Ltd	Citibank	(102)	(700)	Daiwa House Industry Co Ltd	JP Morgan	1.184
200	Chubu Shiryo Co Ltd	HSBC	(42)	(28)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	JP Morgan	(1.161)
(300)	Chudenko Corp	Citibank	143	1.100	Daiwa Industries Ltd	Citibank	(296)
(600)	Chudenko Corp	JP Morgan	347	400	Daiwa Industries Ltd	HSBC	(275)
100	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	(7)	(6)	Daiwa Office Investment Corp (REIT)	JP Morgan	422
700	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(91)	(6.400)	Daiwa Securities Group Inc	JP Morgan	513
(7.600)	Chugoku Bank Ltd	JP Morgan	4.229	(114)	Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT)	JP Morgan	1.062
200	Chukyo Bank Ltd	Citibank	(96)	300	Demae-Can Co Ltd	Citibank	222
100	Ci Medical Co Ltd	Citibank	(820)	400	Demae-Can Co Ltd	HSBC	(162)
300	CI Takiron Corp	HSBC	(251)	400	Demae-Can Co Ltd	JP Morgan	(48)
200	CI Takiron Corp	JP Morgan	(169)	(2.500)	DeNA Co Ltd	JP Morgan	(1.669)
2.400	Citizen Watch Co Ltd	Citibank	1	(2.600)	Denka Co Ltd	JP Morgan	10.966
700	Citizen Watch Co Ltd	HSBC	(47)	200	Densan System Co Ltd	HSBC	(804)
200	CKD Corp	Citibank	439	200	Densan System Co Ltd	JP Morgan	(814)
300	CKD Corp	HSBC	476	(300)	Denso Corp	JP Morgan	(430)
2.300	CMIC Holdings Co Ltd	HSBC	(1.807)	1.600	Dentsu Group Inc	Citibank	1.677
1.800	CMIC Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.455)	(200)	Descente Ltd	HSBC	1
(400)	cocokara fine Inc	HSBC	(1.194)	(2.200)	Descente Ltd	JP Morgan	52
(1.000)	cocokara fine Inc	JP Morgan	(4.377)	1.100	DIC Corp	Citibank	(871)
(200)	Colowide Co Ltd	HSBC	(61)	300	DIC Corp	HSBC	(477)
(1.300)	Colowide Co Ltd	JP Morgan	(362)				
(11)	Comforia Residential Inc (REIT)	JP Morgan	980				
800	Computer Engineering & Consulting Ltd	Citibank	(232)				
1.400	Computer Engineering & Consulting Ltd	HSBC	(260)				
1.400	Computer Engineering & Consulting Ltd	JP Morgan	(147)				
(600)	COMSYS Holdings Corp	JP Morgan	2.524				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
2.900	DIC Corp	JP Morgan	(4.739)	100	Food & Life Cos Ltd	JP Morgan	135
200	Digital Arts Inc	Citibank	(634)	1.100	FP Corp	Citibank	(2.768)
100	Digital Arts Inc	HSBC	(705)	500	FP Corp	HSBC	(1.149)
400	Digital Arts Inc	JP Morgan	(2.220)	1.000	France Bed Holdings Co Ltd	Citibank	(187)
(300)	Digital Garage Inc	JP Morgan	124	600	France Bed Holdings Co Ltd	HSBC	(75)
600	Digital Holdings Inc	Citibank	828	400	France Bed Holdings Co Ltd	JP Morgan	(56)
100	Digital Holdings Inc	HSBC	318	400	Freee KK	Citibank	2.436
400	Digital Holdings Inc	JP Morgan	1.110	200	Freee KK	JP Morgan	293
200	Direct Marketing MiX Inc	Citibank	652	(7)	Frontier Real Estate		
200	Direct Marketing MiX Inc	HSBC	212		Investment Corp (REIT)	JP Morgan	(1.099)
500	Disco Corp	JP Morgan	(4.970)	(200)	Fudo Tetra Corp	HSBC	107
1.400	DMG Mori Co Ltd	Citibank	1.093	(1.900)	Fudo Tetra Corp	JP Morgan	421
2.700	DMG Mori Co Ltd	JP Morgan	2.272	(1.800)	Fuji Corp	JP Morgan	4.554
400	Doshisha Co Ltd	Citibank	(244)	(1.500)	Fuji Electric Co Ltd	JP Morgan	971
300	Doshisha Co Ltd	HSBC	(648)	(200)	Fuji Kyuko Co Ltd	HSBC	353
400	Doshisha Co Ltd	JP Morgan	(874)	(100)	Fuji Kyuko Co Ltd	JP Morgan	184
(500)	Dowa Holdings Co Ltd	JP Morgan	2.623	200	Fuji Oil Holdings Inc	HSBC	(198)
900	Duskin Co Ltd	Citibank	(773)	100	Fuji Pharma Co Ltd	Citibank	(6)
700	Duskin Co Ltd	HSBC	(659)	800	Fuji Pharma Co Ltd	HSBC	(724)
1.400	Duskin Co Ltd	JP Morgan	(1.517)	1.900	Fuji Pharma Co Ltd	JP Morgan	(1.752)
(500)	DyDo Group Holdings Inc	JP Morgan	1.651	1.400	Fujicco Co Ltd	Citibank	(388)
(2.100)	East Japan Railway Co	JP Morgan	2.089	1.200	Fujicco Co Ltd	HSBC	(538)
600	Ebara Corp	Citibank	2.247	400	Fujicco Co Ltd	JP Morgan	(191)
1.500	EDION Corp	Citibank	(571)	100	FUJIFILM Holdings Corp	JP Morgan	244
3.700	EDION Corp	JP Morgan	(3.974)	(600)	Fujitec Co Ltd	Citibank	(184)
100	EduLab Inc	Citibank	(118)	(1.300)	Fujitec Co Ltd	JP Morgan	2.486
100	EduLab Inc	JP Morgan	(106)	(700)	Fujitsu General Ltd	JP Morgan	1.621
100	Eisai Co Ltd	JP Morgan	33	(500)	Fujitsu Ltd	JP Morgan	247
1.400	Elan Corp	Citibank	18	(100)	Fukuda Corp	HSBC	15
1.800	Elan Corp	HSBC	190	(300)	Fukuda Corp	JP Morgan	67
300	Elan Corp	JP Morgan	26	(700)	Fukuoka Financial Group		
1.100	Elecom Co Ltd	Citibank	(570)		Inc	JP Morgan	(67)
400	Elecom Co Ltd	HSBC	(135)	(200)	Fukuyama Transporting Co		
1.200	Elematec Corp	Citibank	(214)		Ltd	HSBC	222
100	Elematec Corp	JP Morgan	1	(600)	Fukuyama Transporting Co		
(600)	EM Systems Co Ltd	JP Morgan	243		Ltd	JP Morgan	1.740
(1.700)	ENEOS Holdings Inc	HSBC	(44)	200	FULLCAST Holdings Co Ltd	HSBC	116
(7.900)	ENEOS Holdings Inc	JP Morgan	(128)	400	Funai Soken Holdings Inc	HSBC	124
900	Enigmo Inc	HSBC	25	500	Funai Soken Holdings Inc	JP Morgan	139
700	Enigmo Inc	JP Morgan	7	(900)	Furukawa Battery Co Ltd	HSBC	752
400	en-japan Inc	Citibank	11	(200)	Furukawa Battery Co Ltd	JP Morgan	172
100	en-japan Inc	JP Morgan	329	1.200	Furukawa Co Ltd	Citibank	(382)
4.900	EPS Holdings Inc	Citibank	20.099	3.300	Furukawa Co Ltd	HSBC	(1.760)
6.800	EPS Holdings Inc	HSBC	23.962	1.600	Furukawa Co Ltd	JP Morgan	(1.075)
(4.100)	ES-Con Japan Ltd	HSBC	(389)	100	Furukawa Electric Co Ltd	JP Morgan	44
300	eSOL Co Ltd	Citibank	(176)	400	Future Corp	Citibank	99
600	eSOL Co Ltd	JP Morgan	(366)	1.200	Future Corp	HSBC	(1.056)
100	ESPEC Corp	HSBC	63	800	Future Corp	JP Morgan	(728)
400	ESPEC Corp	JP Morgan	240	100	Fuyo General Lease Co Ltd	Citibank	(468)
1.500	Ezaki Glico Co Ltd	Citibank	(1.775)	200	Fuyo General Lease Co Ltd	JP Morgan	(647)
300	Ezaki Glico Co Ltd	HSBC	(275)	300	GA Technologies Co Ltd	Citibank	112
700	Ezaki Glico Co Ltd	JP Morgan	(683)	1.700	Gakken Holdings Co Ltd	Citibank	(237)
8.500	FAN Communications Inc	Citibank	(363)	100	Gakken Holdings Co Ltd	HSBC	(79)
9.100	FAN Communications Inc	HSBC	(1.437)	600	Gakken Holdings Co Ltd	JP Morgan	(487)
5.100	FAN Communications Inc	JP Morgan	(835)	200	Genki Sushi Co Ltd	Citibank	(99)
(300)	Fancl Corp	JP Morgan	342	2.000	Geo Holdings Corp	Citibank	(489)
400	FANUC Corp	JP Morgan	(1.982)	100	Geo Holdings Corp	HSBC	(102)
100	Fast Retailing Co Ltd	JP Morgan	586	1.500	Geo Holdings Corp	JP Morgan	(1.559)
2.200	FCC Co Ltd	Citibank	(1.228)	100	giftee Inc	HSBC	218
700	FCC Co Ltd	HSBC	(702)	1.600	Glory Ltd	Citibank	(977)
2.400	FCC Co Ltd	JP Morgan	(2.468)	600	Glory Ltd	HSBC	(891)
300	Feedforce Inc	Citibank	6	5.200	Glory Ltd	JP Morgan	(7.905)
200	Feedforce Inc	JP Morgan	(58)	(22)	GLP J-Reit (REIT)	JP Morgan	(422)
(700)	Ferrotec Holdings Corp	JP Morgan	(1.609)	4.100	GMO Financial Holdings Inc	Citibank	(77)
800	Fibergate Inc	Citibank	36	400	GMO Financial Holdings Inc	JP Morgan	16
600	Fibergate Inc	JP Morgan	(1.399)	100	GMO GlobalSign Holdings		
1.100	Fixstars Corp	Citibank	(181)		KK	Citibank	14
200	Fixstars Corp	HSBC	(282)	200	GMO GlobalSign Holdings		
1.000	Fixstars Corp	JP Morgan	(527)		KK	JP Morgan	(859)
400	Food & Life Cos Ltd	Citibank	1.095	600	GMO internet Inc	Citibank	(156)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
900	GMO internet Inc	JP Morgan	(909)	200	Hokuhoku Financial Group Inc	Citibank	(38)
100	GMO Pepabo Inc	Citibank	(153)	2.200	Hokuto Corp	Citibank	(1.219)
200	GMO Pepabo Inc	JP Morgan	(818)	1.600	Hokuto Corp	JP Morgan	(1.709)
100	Godo Steel Ltd	JP Morgan	(26)	(4.100)	Honda Motor Co Ltd	JP Morgan	547
800	Goldcrest Co Ltd	Citibank	(238)	100	Horiba Ltd	HSBC	(16)
900	Goldcrest Co Ltd	HSBC	658	100	Horiba Ltd	JP Morgan	87
2.500	Goldcrest Co Ltd	JP Morgan	2.374	500	Hoshizaki Corp	JP Morgan	(2.788)
300	Goldwin Inc	Citibank	(501)	(100)	House Foods Group Inc	HSBC	42
200	Goldwin Inc	JP Morgan	(1.399)	(1.000)	House Foods Group Inc	JP Morgan	315
1.700	Grace Technology Inc	Citibank	(657)	600	Hoya Corp	JP Morgan	5.827
200	Grace Technology Inc	JP Morgan	(1.142)	3.300	Hulic Co Ltd	Citibank	(69)
(5.700)	Gree Inc	JP Morgan	2.285	4.800	Hulic Co Ltd	HSBC	(1.773)
(200)	GS Yuasa Corp	HSBC	(156)	100	Hulic Co Ltd	JP Morgan	(44)
(1.700)	GS Yuasa Corp	JP Morgan	(1.047)	(10)	Hulic Reit Inc (REIT)	JP Morgan	(63)
(1.500)	GungHo Online Entertainment Inc	JP Morgan	1.203	(300)	Hyakugo Bank Ltd	Citibank	33
(38.500)	Gunma Bank Ltd	JP Morgan	10.444	(1.300)	Hyakugo Bank Ltd	HSBC	189
(400)	H.U. Group Holdings Inc	Citibank	387	(17.000)	Hyakugo Bank Ltd	JP Morgan	2.193
(1.000)	H.U. Group Holdings Inc	JP Morgan	6.870	(100)	Ibiden Co Ltd	JP Morgan	(143)
2.200	Hachijuni Bank Ltd	Citibank	(193)	300	IBJ Inc	HSBC	346
2.100	Hachijuni Bank Ltd	JP Morgan	(377)	200	IBJ Inc	JP Morgan	228
(6.700)	Hakuhodo DY Holdings Inc	JP Morgan	2.672	(100)	Ichibanya Co Ltd	HSBC	206
400	Halows Co Ltd	HSBC	(996)	(500)	Ichibanya Co Ltd	JP Morgan	892
700	Halows Co Ltd	JP Morgan	(1.774)	(2.900)	Ichikoh Industries Ltd	JP Morgan	55
400	Hamakyorex Co Ltd	HSBC	(644)	100	Icom Inc	JP Morgan	(81)
400	Hamamatsu Photonics KK	JP Morgan	791	800	Idemitsu Kosan Co Ltd	JP Morgan	(1.830)
(1.500)	Hankyu Hanshin Holdings Inc	JP Morgan	1.914	1.700	IDOM Inc	JP Morgan	(312)
(5)	Hankyu Hanshin Inc (REIT)	HSBC	29	(1.100)	IHI Corp	JP Morgan	(3.201)
(8)	Hankyu Hanshin Inc (REIT)	JP Morgan	98	(3.200)	Iida Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.719)
1.600	Hanwa Co Ltd	Citibank	(2.077)	(1.300)	Iino Kaiun Kaisha Ltd	JP Morgan	438
700	Hanwa Co Ltd	HSBC	(2.385)	600	I'll Inc	Citibank	(147)
300	Harmonic Drive Systems Inc	Citibank	187	200	I'll Inc	HSBC	(406)
100	Harmonic Drive Systems Inc	HSBC	(173)	300	I'll Inc	JP Morgan	(617)
800	Harmonic Drive Systems Inc	JP Morgan	(7.969)	1.100	Inaba Denki Sangyo Co Ltd	Citibank	(481)
(500)	Haseko Corp	HSBC	204	600	Inaba Denki Sangyo Co Ltd	JP Morgan	(487)
(10.900)	Haseko Corp	JP Morgan	3.269	(3)	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT)	HSBC	89
(400)	Hazama Ando Corp	HSBC	179	(43)	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT)	JP Morgan	1.395
(14.700)	Hazama Ando Corp	JP Morgan	5.876	100	Infocom Corp	Citibank	(207)
100	Heiwa Corp	Citibank	(67)	400	Infocom Corp	JP Morgan	(924)
1.100	Heiwa Corp	JP Morgan	(398)	1.100	Infomart Corp	Citibank	(64)
(1)	Heiwa Real Estate Inc (REIT)	HSBC	6	9.000	Inpex Corp	Citibank	(1.173)
(37)	Heiwa Real Estate Inc (REIT)	JP Morgan	386	1.700	Inpex Corp	HSBC	(336)
1.600	Hibiya Engineering Ltd	Citibank	(1.198)	4.700	Inpex Corp	JP Morgan	(2.917)
400	Hibiya Engineering Ltd	HSBC	(460)	600	Insour Co Ltd	Citibank	(1.242)
1.200	Hibiya Engineering Ltd	JP Morgan	(1.413)	600	Insour Co Ltd	HSBC	(1.819)
800	Hino Motors Ltd	JP Morgan	354	1.500	Internet Initiative Japan Inc	JP Morgan	7.591
300	Hioki EE Corp	HSBC	(889)	(100)	IR Japan Holdings Ltd	JP Morgan	(493)
(20.900)	Hirogin Holdings Inc	JP Morgan	7.651	(1.200)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	HSBC	84
(200)	Hirose Electric Co Ltd	JP Morgan	116	(6.000)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	JP Morgan	(3.272)
(1.000)	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	JP Morgan	5.700	3.400	Isuzu Motors Ltd	JP Morgan	8.545
(800)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	JP Morgan	410	300	ITmedia Inc	Citibank	(149)
(1.300)	Hitachi Ltd	JP Morgan	(3.542)	800	ITmedia Inc	HSBC	(854)
(200)	Hitachi Metals Ltd	HSBC	49	900	ITmedia Inc	JP Morgan	(1.858)
(2.000)	Hitachi Metals Ltd	JP Morgan	549	(800)	Ito En Ltd	JP Morgan	1.764
1.400	Hitachi Transport System Ltd	Citibank	(253)	(6)	Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT)	Citibank	(51)
100	Hitachi Transport System Ltd	HSBC	55	(2)	Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT)	JP Morgan	(50)
1.000	Hitachi Transport System Ltd	JP Morgan	92	900	ITOCHU Corp	Citibank	(48)
300	Hochiki Corp	Citibank	11	700	Itochu Enex Co Ltd	Citibank	(167)
800	Hochiki Corp	HSBC	(714)	1.400	Itochu Techno-Solutions Corp	JP Morgan	(5.272)
100	Hodogaya Chemical Co Ltd	JP Morgan	80	200	Itochu-Shokuhin Co Ltd	Citibank	(155)
(4.100)	Hokkaido Electric Power Co Inc	JP Morgan	1.545	700	Itochu-Shokuhin Co Ltd	JP Morgan	(960)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
9.700	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Citibank	(2.573)	600	JGC Holdings Corp	Citibank	(166)
3.500	Itoham Yonekyu Holdings Inc	HSBC	(961)	900	JGC Holdings Corp	JP Morgan	(373)
11.000	Itoham Yonekyu Holdings Inc	JP Morgan	(3.136)	1.000	JM Holdings Co Ltd	Citibank	(847)
600	Itokuro Inc	HSBC	123	1.100	JM Holdings Co Ltd	HSBC	(818)
600	Itokuro Inc	JP Morgan	114	2.100	JM Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.682)
(4.400)	IwaiCosmo Holdings Inc	JP Morgan	4.641	100	JMDC Inc	Citibank	322
(1.800)	Iwatani Corp	JP Morgan	13.116	100	JMDC Inc	HSBC	7
(1.800)	Iyo Bank Ltd	JP Morgan	1.055	700	J-Oil Mills Inc	Citibank	(346)
(1.500)	J Front Retailing Co Ltd	HSBC	255	1.300	J-Oil Mills Inc	JP Morgan	(530)
(4.000)	J Front Retailing Co Ltd	JP Morgan	(192)	700	JSP Corp	JP Morgan	(595)
1.800	JAFCO Co Ltd	HSBC	794	(600)	JSR Corp	JP Morgan	948
1.000	J Trust Co Ltd	JP Morgan	436	500	JTEKT Corp	Citibank	(178)
1.000	JAC Recruitment Co Ltd	JP Morgan	(180)	700	JTEKT Corp	HSBC	223
(1.000)	Jaccs Co Ltd	Citibank	847	(100)	Juroku Bank Ltd	HSBC	6
(500)	JAFCO Group Co Ltd	JP Morgan	(102)	(1.200)	Juroku Bank Ltd	JP Morgan	510
(200)	Japan Airport Terminal Co Ltd	HSBC	65	(400)	Kagome Co Ltd	JP Morgan	1.247
(500)	Japan Airport Terminal Co Ltd	JP Morgan	197	(16.900)	Kajima Corp	JP Morgan	11.963
(3.000)	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	JP Morgan	441	(100)	Kakaku.com Inc	Citibank	(137)
3.100	Japan Best Rescue System Co Ltd	Citibank	(176)	(200)	Kakaku.com Inc	HSBC	(283)
1.800	Japan Best Rescue System Co Ltd	HSBC	(658)	(2.300)	Kakaku.com Inc	JP Morgan	(6.217)
1.400	Japan Best Rescue System Co Ltd	JP Morgan	(305)	(700)	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	673
(17)	Japan Excellent Inc (REIT)	JP Morgan	(883)	500	Kamei Corp	Citibank	(197)
(1.800)	Japan Exchange Group Inc	JP Morgan	2.359	800	Kamei Corp	JP Morgan	(110)
(21)	Japan Hotel Investment Corp (REIT)	JP Morgan	(375)	800	Kamigumi Co Ltd	Citibank	(499)
(2.400)	Japan Lifeline Co Ltd	JP Morgan	2.599	3.400	Kamigumi Co Ltd	JP Morgan	(2.451)
(38)	Japan Logistics Fund Inc (REIT)	JP Morgan	2.636	2.300	Kanamic Network Co Ltd	Citibank	517
2.700	Japan Material Co Ltd	Citibank	529	1.500	Kanamic Network Co Ltd	HSBC	49
800	Japan Material Co Ltd	HSBC	(128)	2.600	Kanamic Network Co Ltd	JP Morgan	862
800	Japan Material Co Ltd	JP Morgan	(209)	700	Kandenko Co Ltd	HSBC	(186)
(6)	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	HSBC	(77)	500	Kandenko Co Ltd	JP Morgan	(26)
(58)	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	JP Morgan	369	(1.200)	Kaneka Corp	JP Morgan	484
(600)	Japan Post Bank Co Ltd	HSBC	655	(9.200)	Kansai Electric Power Co Inc	JP Morgan	5.947
(14.500)	Japan Post Bank Co Ltd	JP Morgan	14.575	300	Kansai Paint Co Ltd	Citibank	283
7.100	Japan Post Holdings Co Ltd	Citibank	(1.257)	3.900	Kansai Paint Co Ltd	JP Morgan	4.024
1.400	Japan Post Holdings Co Ltd	JP Morgan	(613)	1.500	Kansai Super Market Ltd	Citibank	(52)
(2.300)	Japan Post Insurance Co Ltd	JP Morgan	2.661	200	Kansai Super Market Ltd	JP Morgan	(123)
(19)	Japan Prime Realty Investment Corp (REIT)	JP Morgan	826	(5.900)	Kanto Denka Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(3.234)
400	Japan Pulp & Paper Co Ltd	Citibank	(604)	2.200	Kao Corp	Citibank	(5.073)
1.200	Japan Pulp & Paper Co Ltd	HSBC	(1.702)	300	Kao Corp	HSBC	(942)
500	Japan Pulp & Paper Co Ltd	JP Morgan	(736)	600	Kao Corp	JP Morgan	(1.943)
(11)	Japan Real Estate Investment Corp (REIT)	JP Morgan	2.186	300	Kaonavi Inc	JP Morgan	1.950
(14.400)	Japan Securities Finance Co Ltd	JP Morgan	(7.699)	4.600	Kasai Kogyo Co Ltd	HSBC	(3.395)
(1.700)	Japan Steel Works Ltd	JP Morgan	(425)	1.000	Kasai Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(745)
200	JBCC Holdings Inc	Citibank	(120)	(100)	Katakura Industries Co Ltd	JP Morgan	(48)
1.300	JBCC Holdings Inc	HSBC	(813)	1.300	Katitas Co Ltd	JP Morgan	(3.771)
200	JBCC Holdings Inc	JP Morgan	(129)	800	Kato Sangyo Co Ltd	Citibank	(240)
500	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Citibank	216	200	Kato Sangyo Co Ltd	HSBC	(78)
200	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	JP Morgan	428	800	Kato Sangyo Co Ltd	JP Morgan	(348)
(500)	JDC Corp	HSBC	180	(1.500)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	JP Morgan	2.774
(13.300)	JDC Corp	JP Morgan	5.870	(700)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	JP Morgan	(1.211)
6.700	JFE Holdings Inc	JP Morgan	(17.360)	(3.100)	KDDI Corp	JP Morgan	(6.869)
				2.900	Keihan Holdings Co Ltd	Citibank	4.252
				1.400	Keihan Holdings Co Ltd	JP Morgan	(16)
				1.200	Keihanshin Building Co Ltd	Citibank	283
				100	Keihanshin Building Co Ltd	JP Morgan	(163)
				2.700	Keikyu Corp	Citibank	1.172
				3.500	Keikyu Corp	JP Morgan	(513)
				(800)	Keio Corp	JP Morgan	3.513
				(5.800)	Keiyo Co Ltd	JP Morgan	8
				(5)	Kenedix Office Investment Corp (REIT)	JP Morgan	(554)
				300	Kewpie Corp	Citibank	(137)
				(100)	Key Coffee Inc	HSBC	4
				(3.600)	Key Coffee Inc	JP Morgan	451
				600	Keyence Corp	JP Morgan	(819)
				300	Kikkoman Corp	Citibank	912

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
100	Kikkoman Corp	JP Morgan	111	400	Kyoei Steel Ltd	JP Morgan	(453)
(1.500)	Kinden Corp	JP Morgan	429	(300)	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(221)
(900)	Kintetsu Department Store Co Ltd	JP Morgan	392	(1.800)	KYORIN Holdings Inc	JP Morgan	3.577
100	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	HSBC	(222)	500	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Citibank	1.170
700	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.440)	100	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	JP Morgan	91
100	Kintetsu World Express Inc	Citibank	(6)	800	Kyowa Exeo Corp	JP Morgan	(2.442)
300	Kintetsu World Express Inc	HSBC	(738)	(2.100)	Kyowa Kirin Co Ltd	JP Morgan	1.885
3.600	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(416)	(400)	Kyudenko Corp	Citibank	637
900	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	(1.643)	(3.400)	Kyudenko Corp	JP Morgan	14.349
2.600	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(4.832)	(1.600)	Kyushu Electric Power Co Inc	JP Morgan	2.000
1.400	Kitz Corp	Citibank	10	(19.600)	Kyushu Financial Group Inc	JP Morgan	6.503
2.500	Kitz Corp	JP Morgan	589	1.700	Kyushu Railway Co	JP Morgan	(900)
(6.800)	Kiyo Bank Ltd	JP Morgan	3.740	600	LAC Co Ltd	Citibank	(16)
(2.500)	KLab Inc	Citibank	383	400	Lacto Japan Co Ltd	HSBC	(828)
(1.400)	KLab Inc	HSBC	1.347	300	Lacto Japan Co Ltd	JP Morgan	(634)
(200)	KLab Inc	JP Morgan	152	(10)	LaSalle Logiport REIT (REIT)	HSBC	(214)
1.700	Koatsu Gas Kogyo Co Ltd	Citibank	6	(10)	LaSalle Logiport REIT (REIT)	JP Morgan	(189)
2.400	Koatsu Gas Kogyo Co Ltd	HSBC	(1.039)	100	Lasertec Corp	Citibank	2.405
2.900	Koatsu Gas Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(2.031)	300	LEC Inc	Citibank	(57)
(200)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	378	100	LEC Inc	HSBC	(77)
200	Kobe Bussan Co Ltd	Citibank	(141)	200	LEC Inc	JP Morgan	(158)
2.400	Kobe Bussan Co Ltd	JP Morgan	(3.959)	(1.800)	Leopalace21 Corp	Citibank	181
1.400	Kobe Steel Ltd	Citibank	(207)	(17.600)	Leopalace21 Corp	JP Morgan	2.904
300	Kobe Steel Ltd	HSBC	(94)	(100)	Lifenet Insurance Co	JP Morgan	4
900	Kobe Steel Ltd	JP Morgan	(447)	200	Like Co Ltd	Citibank	(499)
(30)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Citibank	(67)	2.100	Lintec Corp	Citibank	(938)
(590)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.978)	2.100	Lintec Corp	HSBC	(2.104)
(800)	Koito Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(1.830)	1.800	Lintec Corp	JP Morgan	(1.869)
100	Kokopelli Inc	HSBC	128	100	Lion Corp	Citibank	(25)
(1.200)	Kokuyo Co Ltd	JP Morgan	511	1.000	Lion Corp	JP Morgan	(1.306)
1.900	Komatsu Ltd	HSBC	(4.533)	400	LITALICO Inc	Citibank	(686)
2.200	Komatsu Ltd	JP Morgan	(4.640)	100	LITALICO Inc	HSBC	622
1.800	KOMEDA Holdings Co Ltd	Citibank	(825)	200	LITALICO Inc	JP Morgan	1.230
500	KOMEDA Holdings Co Ltd	JP Morgan	(248)	400	Lixil Corp	Citibank	(727)
1.700	Komori Corp	Citibank	(460)	300	Lixil Corp	HSBC	(226)
1.800	Komori Corp	HSBC	223	300	Locoguide Inc	Citibank	(154)
3.300	Komori Corp	JP Morgan	372	100	M3 Inc	Citibank	186
(200)	Konami Holdings Corp	JP Morgan	(1.185)	1.300	M3 Inc	JP Morgan	(1.528)
1.000	Konica Minolta Inc	Citibank	146	1.100	Mabuchi Motor Co Ltd	Citibank	(1.462)
5.600	Konica Minolta Inc	JP Morgan	(2.366)	2.100	Mabuchi Motor Co Ltd	JP Morgan	(3.201)
900	Konishi Co Ltd	HSBC	(792)	1.600	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc	Citibank	284
100	Konishi Co Ltd	JP Morgan	(90)	100	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc	HSBC	69
3.200	Konoike Transport Co Ltd	Citibank	(698)	600	Macromill Inc	Citibank	(352)
1.700	Konoike Transport Co Ltd	HSBC	(927)	500	Macromill Inc	HSBC	(201)
3.100	Konoike Transport Co Ltd	JP Morgan	(1.743)	600	Macromill Inc	JP Morgan	(173)
(100)	Kose Corp	JP Morgan	(403)	900	Maeda Corp	Citibank	(435)
(900)	Koshidaka Holdings Co Ltd	HSBC	(536)	9.600	Maeda Corp	JP Morgan	(3.127)
(3.400)	Koshidaka Holdings Co Ltd	JP Morgan	(2.044)	(300)	Maeda Kosen Co Ltd	HSBC	217
100	Krosaki Harima Corp	Citibank	77	(600)	Maeda Kosen Co Ltd	JP Morgan	440
200	Krosaki Harima Corp	JP Morgan	106	(2.200)	Maeda Road Construction Co Ltd	HSBC	1.209
(1.300)	K's Holdings Corp	JP Morgan	2.140	300	Makino Milling Machine Co Ltd	Citibank	(402)
1.300	Kubota Corp	JP Morgan	(3.052)	1.800	Makita Corp	JP Morgan	3.332
(4.600)	Kumagai Gumi Co Ltd	JP Morgan	3.738	400	Makuake Inc	Citibank	(454)
(200)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	Citibank	86	200	Makuake Inc	JP Morgan	1.209
(8.500)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	JP Morgan	6.117	(2.900)	Mandom Corp	JP Morgan	4.270
5.900	Kuraray Co Ltd	Citibank	(857)	1.400	Mani Inc	Citibank	(1.306)
1.200	Kuraray Co Ltd	HSBC	(1.384)	900	Mani Inc	HSBC	(1.431)
900	Kuraray Co Ltd	JP Morgan	(1.054)	2.000	Mani Inc	JP Morgan	(3.254)
(1.800)	Kurita Water Industries Ltd	JP Morgan	799	(7.800)	Marubeni Corp	JP Morgan	2.499
200	Kyoei Steel Ltd	Citibank	(128)	(400)	Maruha Nichiro Corp	JP Morgan	1.070
700	Kyoei Steel Ltd	HSBC	(777)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
(800)	Marui Group Co Ltd	JP Morgan	239	500	Mitsubishi Logistics Corp	JP Morgan	(685)
2.300	Maruichi Steel Tube Ltd	JP Morgan	(3.476)	1.200	Mitsubishi Materials Corp	Citibank	397
(400)	Marusan Securities Co Ltd	Citibank	39	4.100	Mitsubishi Materials Corp	JP Morgan	(16.494)
(1.300)	Marusan Securities Co Ltd	HSBC	(194)	(11.200)	Mitsubishi Motors Corp	JP Morgan	1.030
2.600	Maruwa Unyu Kikan Co Ltd	Citibank	(2.640)	500	Mitsubishi Pencil Co Ltd	Citibank	(358)
500	Maruwa Unyu Kikan Co Ltd	HSBC	(1.870)	100	Mitsubishi Pencil Co Ltd	HSBC	(57)
1.400	Maruwa Unyu Kikan Co Ltd	JP Morgan	(5.275)	500	Mitsubishi Pencil Co Ltd	JP Morgan	(295)
(100)	Matsuda Sangyo Co Ltd	HSBC	138	200	Mitsubishi Research Institute Inc	Citibank	(683)
(2.300)	Matsuda Sangyo Co Ltd	JP Morgan	3.376	(500)	Mitsubishi Shokuhin Co Ltd	JP Morgan	796
(3.400)	Matsui Securities Co Ltd	JP Morgan	1.477	(28.700)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	JP Morgan	(1.592)
(400)	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	HSBC	15	1.800	Mitsuboshi Belting Ltd	Citibank	(580)
(100)	Matsuyafoods Holdings Co Ltd	JP Morgan	(5)	1.400	Mitsuboshi Belting Ltd	HSBC	100
800	Max Co Ltd	Citibank	(41)	100	Mitsuboshi Belting Ltd	JP Morgan	8
800	Max Co Ltd	HSBC	(14)	3.700	Mitsui & Co Ltd	JP Morgan	(5.084)
1.100	Max Co Ltd	JP Morgan	91	2.100	Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd	Citibank	(724)
200	Maxvalu Tokai Co Ltd	Citibank	(64)	1.300	Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd	HSBC	(670)
(300)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	JP Morgan	259	3.000	Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.626)
(10.300)	Mebuki Financial Group Inc	JP Morgan	1.829	(5.000)	Mitsui E&S Holdings Co Ltd	JP Morgan	4.967
300	MEC Co Ltd	Citibank	112	(12)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	JP Morgan	(165)
500	Medipal Holdings Corp	Citibank	(34)	100	Mitsui High-Tec Inc	Citibank	(49)
100	Medley Inc	Citibank	279	500	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	JP Morgan	(4.038)
100	Megachips Corp	Citibank	(122)	(1.000)	Mitsui OSK Lines Ltd	JP Morgan	3.022
900	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Citibank	(1.079)	2.200	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Citibank	(1.429)
(200)	MEIJI Holdings Co Ltd	JP Morgan	263	1.100	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.108)
(100)	Meiko Electronics Co Ltd	Citibank	(155)	(1.700)	Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	2.410
(700)	Meiko Electronics Co Ltd	HSBC	(2.408)	(3.100)	Mizuho Financial Group Inc	JP Morgan	1.237
2.400	Meiko Network Japan Co Ltd	Citibank	(418)	(400)	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	1.492
4.100	Meiko Network Japan Co Ltd	HSBC	(632)	200	Modalis Therapeutics Corp	Citibank	(104)
400	Meiko Network Japan Co Ltd	JP Morgan	(65)	200	Modalis Therapeutics Corp	HSBC	(45)
600	Meisei Industrial Co Ltd	Citibank	(127)	(500)	Modec Inc	HSBC	816
400	Meisei Industrial Co Ltd	HSBC	(214)	(1.400)	Modec Inc	JP Morgan	2.332
(100)	Meitec Corp	JP Morgan	(111)	(1.100)	Monex Group Inc	JP Morgan	1.115
400	Menicon Co Ltd	Citibank	(2.230)	(400)	Money Forward Inc	JP Morgan	(1.404)
300	Menicon Co Ltd	JP Morgan	(213)	800	MonotaRO Co Ltd	Citibank	217
(600)	Mercari Inc	JP Morgan	(309)	800	MonotaRO Co Ltd	HSBC	(213)
300	METAWATER Co Ltd	Citibank	207	2.800	MonotaRO Co Ltd	JP Morgan	(849)
100	Milbon Co Ltd	Citibank	(68)	(35)	Mori Hills Investment Corp (REIT)	JP Morgan	305
600	Milbon Co Ltd	JP Morgan	585	(1.000)	Morinaga & Co Ltd	JP Morgan	3.713
(4.600)	MINEBEA MITSUMI Inc	JP Morgan	(3.635)	(100)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	HSBC	613
(100)	Ministop Co Ltd	HSBC	47	(1.800)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	JP Morgan	11.200
800	Miroku Jyoho Service Co Ltd	Citibank	(794)	1.600	Morita Holdings Corp	Citibank	(1.728)
800	MISUMI Group Inc	JP Morgan	114	300	Morita Holdings Corp	HSBC	(220)
500	Mitsuba Corp	JP Morgan	1.078	400	Morita Holdings Corp	JP Morgan	(309)
900	Mitsubishi Corp	JP Morgan	(466)	1.100	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	JP Morgan	998
2.600	Mitsubishi Electric Corp	JP Morgan	(493)	700	Murata Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(3.231)
2.300	Mitsubishi Estate Co Ltd	Citibank	(679)	(100)	Musashino Bank Ltd	Citibank	60
1.700	Mitsubishi Estate Co Ltd	HSBC	(1.777)	(500)	Musashino Bank Ltd	HSBC	195
200	Mitsubishi Estate Co Ltd	JP Morgan	(104)	(3.100)	Musashino Bank Ltd	JP Morgan	944
(1)	Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT)	HSBC	(7)	(2.400)	Nabtesco Corp	JP Morgan	1.530
(30)	Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT)	JP Morgan	(152)	500	Nachi-Fujikoshi Corp	Citibank	(729)
(2.100)	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JP Morgan	1.683	200	Nachi-Fujikoshi Corp	HSBC	(422)
(2.180)	Mitsubishi HC Capital Inc	Citibank	905	500	Nachi-Fujikoshi Corp	JP Morgan	(954)
(7.600)	Mitsubishi HC Capital Inc	JP Morgan	3.001	(1.100)	Nafco Co Ltd	JP Morgan	2.380
300	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Citibank	(148)	100	Nagaileben Co Ltd	Citibank	(71)
1.800	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	JP Morgan	(2.015)	100	Nagaileben Co Ltd	HSBC	(20)
100	Mitsubishi Logistics Corp	Citibank	(145)	1.300	Nagaileben Co Ltd	JP Morgan	(302)
100	Mitsubishi Logistics Corp	HSBC	(1)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
400	Nagase & Co Ltd	Citibank	(224)	200	Nippon Electric Glass Co Ltd	JP Morgan	(364)
200	Nagase & Co Ltd	HSBC	(120)	(100)	Nippon Express Co Ltd	HSBC	23
200	Nagase & Co Ltd	JP Morgan	(22)	(1.100)	Nippon Express Co Ltd	JP Morgan	1.996
1.100	Nagatanien Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.290)	800	Nippon Gas Co Ltd	Citibank	(997)
1.000	Nagoya Railroad Co Ltd	JP Morgan	1.056	1.000	Nippon Gas Co Ltd	HSBC	(1.968)
(2.400)	Nankai Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	1.436	1.800	Nippon Gas Co Ltd	JP Morgan	(3.319)
(100)	Nanto Bank Ltd	HSBC	36	(800)	Nippon Kayaku Co Ltd	Citibank	191
(2.600)	Nanto Bank Ltd	JP Morgan	568	(7.100)	Nippon Kayaku Co Ltd	JP Morgan	2.991
500	NEC Corp	Citibank	(402)	(2.500)	Nippon Koei Co Ltd	JP Morgan	(596)
600	NEC Corp	JP Morgan	(748)	1.200	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	Citibank	(322)
(1.100)	NEC Networks & System Integration Corp	JP Morgan	1.613	100	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	HSBC	(423)
200	NEOJAPAN Inc	Citibank	(164)	270	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.150)
400	NEOJAPAN Inc	JP Morgan	(377)	500	Nippon Paint Holdings Co Ltd	HSBC	179
100	NET One Systems Co Ltd	Citibank	(159)	2.500	Nippon Paint Holdings Co Ltd	JP Morgan	(4.249)
400	NET One Systems Co Ltd	HSBC	(395)	5.600	Nippon Paper Industries Co Ltd	Citibank	(3.801)
200	NET One Systems Co Ltd	JP Morgan	(138)	9.700	Nippon Paper Industries Co Ltd	JP Morgan	(14.891)
2.000	Neturen Co Ltd	Citibank	(107)	(10)	Nippon Prologis Inc (REIT)	JP Morgan	1.090
2.300	Neturen Co Ltd	JP Morgan	(666)	(100)	Nippon Road Co Ltd	JP Morgan	22
(600)	Nexon Co Ltd	JP Morgan	4.318	100	Nippon Sanso Holdings Corp	Citibank	(72)
(1.700)	NGK Insulators Ltd	JP Morgan	2.283	500	Nippon Seiki Co Ltd	Citibank	(237)
4.400	NGK Spark Plug Co Ltd	Citibank	1.353	200	Nippon Seiki Co Ltd	HSBC	(208)
900	NGK Spark Plug Co Ltd	HSBC	15	1.400	Nippon Seiki Co Ltd	JP Morgan	(1.482)
5.800	NGK Spark Plug Co Ltd	JP Morgan	772	(100)	Nippon Sharyo Ltd	Citibank	(22)
(800)	NH Foods Ltd	JP Morgan	2.615	(700)	Nippon Sharyo Ltd	HSBC	1.777
1.700	NHK Spring Co Ltd	Citibank	686	(6.200)	Nippon Sheet Glass Co Ltd	JP Morgan	9.709
1.600	NHK Spring Co Ltd	HSBC	762	100	Nippon Shinyaku Co Ltd	Citibank	6
2.900	NHK Spring Co Ltd	JP Morgan	1.347	900	Nippon Shinyaku Co Ltd	JP Morgan	3.147
(100)	Nichias Corp	HSBC	273	300	Nippon Shokubai Co Ltd	Citibank	(216)
(300)	Nichias Corp	JP Morgan	831	100	Nippon Shokubai Co Ltd	HSBC	(392)
1.100	Nichiha Corp	JP Morgan	(3.956)	(2.800)	Nippon Signal Company Ltd	JP Morgan	805
(1.100)	Nichi-iko Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	1.100	1.300	Nippon Steel Corp	Citibank	(891)
400	Nichireki Co Ltd	HSBC	(328)	100	Nippon Steel Corp	HSBC	(223)
700	Nidec Corp	JP Morgan	(534)	1.300	Nippon Steel Corp	JP Morgan	(2.455)
400	Nifco Inc	Citibank	(425)	400	Nippon Steel Trading Corp	Citibank	(825)
200	Nifco Inc	HSBC	(287)	700	Nippon Steel Trading Corp	HSBC	(2.707)
1.000	Nifco Inc	JP Morgan	(811)	1.800	Nippon Steel Trading Corp	JP Morgan	(5.770)
1.800	Nihon Chouzai Co Ltd	Citibank	(3.124)	(12.400)	Nippon Suisan Kaisha Ltd	JP Morgan	3.717
300	Nihon Jyoho Create Co Ltd	JP Morgan	(899)	1.100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Citibank	(88)
100	Nihon Kohden Corp	HSBC	(235)	700	Nippon Telegraph & Telephone Corp	HSBC	343
900	Nihon Kohden Corp	JP Morgan	(2.105)	1.100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	JP Morgan	494
1.100	Nihon M&A Center Inc	Citibank	(1.116)	(6.800)	Nippon Thompson Co Ltd	JP Morgan	5.685
500	Nihon M&A Center Inc	HSBC	(794)	600	Nippon Yakin Kogyo Co Ltd	HSBC	(885)
3.000	Nihon M&A Center Inc	JP Morgan	(2.492)	2.000	Nippon Yakin Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(4.288)
(2.300)	Nihon Nohyaku Co Ltd	JP Morgan	1.252	600	Nippon Yusen KK	JP Morgan	308
1.600	Nihon Parkerizing Co Ltd	Citibank	(845)	(6.600)	Nipro Corp	JP Morgan	3.349
600	Nihon Parkerizing Co Ltd	HSBC	(17)	(100)	Nishimatsu Construction Co Ltd	Citibank	44
1.600	Nihon Parkerizing Co Ltd	JP Morgan	(69)	(6.100)	Nishimatsu Construction Co Ltd	JP Morgan	(20.642)
100	Nihon Unisys Ltd	Citibank	(71)	900	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	HSBC	(534)
2.300	Nikken Holdings Co Ltd	JP Morgan	(590)	1.900	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	JP Morgan	(1.148)
(600)	Nikon Corp	HSBC	22	(3.100)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	JP Morgan	4.332
(700)	Nikon Corp	JP Morgan	38	200	Nissan Chemical Corp	Citibank	(329)
100	Nintendo Co Ltd	JP Morgan	6.560	1.200	Nissan Chemical Corp	JP Morgan	(4.041)
4.100	Nippn Corp	Citibank	(725)	1.100	Nissha Co Ltd	Citibank	(520)
1.900	Nippn Corp	JP Morgan	(1.229)				
(200)	Nippo Corp	Citibank	221				
(100)	Nippo Corp	HSBC	92				
(5.300)	Nippo Corp	JP Morgan	4.849				
2	Nippon Accommodations Fund Inc (REIT)	HSBC	(96)				
(1)	Nippon Building Fund Inc (REIT)	HSBC	117				
(26)	Nippon Building Fund Inc (REIT)	JP Morgan	3.194				
(100)	Nippon Carbon Co Ltd	HSBC	672				
(100)	Nippon Carbon Co Ltd	JP Morgan	679				
500	Nippon Chemi-Con Corp	Citibank	1.907				
(13.800)	Nippon Denko Co Ltd	JP Morgan	7.826				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
1.200	Nissha Co Ltd	HSBC	1.936	100	OBIC Business Consultants Co Ltd	HSBC	(367)
2.900	Nissha Co Ltd	JP Morgan	4.622	200	OBIC Business Consultants Co Ltd	JP Morgan	(127)
800	Nisshin Oillio Group Ltd	JP Morgan	(1.226)	300	Obic Co Ltd	JP Morgan	991
(700)	Nisshin Seifun Group Inc	JP Morgan	1.393	(5.200)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	9.518
7.400	Nisshinbo Holdings Inc	Citibank	(2.666)	300	Oiles Corp	HSBC	(256)
200	Nissin Corp	Citibank	(70)	1.200	Oiles Corp	JP Morgan	(922)
400	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Citibank	(494)	(11.400)	Oji Holdings Corp	JP Morgan	12.408
300	Nitori Holdings Co Ltd	Citibank	(1.078)	300	Oki Electric Industry Co Ltd	Citibank	(123)
200	Nitori Holdings Co Ltd	HSBC	(701)	500	Oki Electric Industry Co Ltd	HSBC	(1.044)
400	Nitori Holdings Co Ltd	JP Morgan	(3.430)	(700)	Okinawa Cellular Telephone Co	HSBC	(246)
(100)	Nittetsu Mining Co Ltd	HSBC	636	300	OKUMA Corp	Citibank	(312)
(400)	Nittetsu Mining Co Ltd	JP Morgan	2.584	400	OKUMA Corp	HSBC	(404)
400	Nitto Denko Corp	Citibank	116	100	OKUMA Corp	JP Morgan	(8)
200	Nitto Denko Corp	HSBC	(1.122)	1.200	Okuwa Co Ltd	Citibank	(459)
200	Nitto Denko Corp	JP Morgan	(1.148)	100	Okuwa Co Ltd	HSBC	(68)
600	Nitto Kogyo Corp	Citibank	(431)	600	Okuwa Co Ltd	JP Morgan	(419)
400	Nitto Kogyo Corp	HSBC	(841)	4.200	Olympus Corp	JP Morgan	1.894
1.800	Nitto Kogyo Corp	JP Morgan	(3.836)	2.000	Omron Corp	JP Morgan	101
900	Nitto Kohki Co Ltd	Citibank	(710)	(3.700)	Onward Holdings Co Ltd	JP Morgan	63
100	Nitto Kohki Co Ltd	HSBC	(100)	(1.100)	Open Door Inc	Citibank	(3.585)
(300)	Noevir Holdings Co Ltd	JP Morgan	(361)	(600)	Open House Co Ltd	JP Morgan	(2.764)
(500)	NOF Corp	JP Morgan	2.467	100	Optex Group Co Ltd	Citibank	3
2.400	NOK Corp	Citibank	(1.240)	400	Optex Group Co Ltd	JP Morgan	501
2.100	NOK Corp	JP Morgan	(2.325)	(2.500)	Optoron Co Ltd	JP Morgan	3.168
200	Nomura Co Ltd	Citibank	(19)	100	Oracle Corp Japan	Citibank	(467)
200	Nomura Co Ltd	JP Morgan	55	300	Oracle Corp Japan	JP Morgan	(2.702)
1.600	Nomura Holdings Inc	HSBC	229	(100)	Organo Corp	JP Morgan	951
(200)	Nomura Micro Science Co Ltd	Citibank	(501)	(19.500)	Orient Corp	Citibank	1.442
(700)	Nomura Micro Science Co Ltd	JP Morgan	929	(91.100)	Orient Corp	JP Morgan	(2.937)
(600)	Nomura Real Estate Holdings Inc	JP Morgan	422	(600)	Oriental Land Co Ltd	JP Morgan	(4.892)
(1)	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	Citibank	25	(500)	ORIX Corp	HSBC	(27)
(2)	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	HSBC	(7)	(15.400)	ORIX Corp	JP Morgan	(11.416)
(17)	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	JP Morgan	(16)	(73)	Orix JREIT Inc (REIT)	JP Morgan	(6.593)
1.200	Nomura Research Institute Ltd	Citibank	562	1.500	Osaka Gas Co Ltd	HSBC	(1.476)
1.300	Nomura Research Institute Ltd	HSBC	971	600	Osaka Gas Co Ltd	JP Morgan	(50)
100	Noritake Co Ltd/Nagoya Japan	Citibank	(30)	300	Osaka Organic Chemical Industry Ltd	JP Morgan	(152)
100	Noritake Co Ltd/Nagoya Japan	HSBC	(55)	400	Osaka Soda Co Ltd	Citibank	(319)
200	Noritake Co Ltd/Nagoya Japan	JP Morgan	9	400	Osaka Soda Co Ltd	JP Morgan	(546)
(1.000)	Noritsu Koki Co Ltd	JP Morgan	2.416	1.800	Osaka Steel Co Ltd	Citibank	(1.385)
1.400	Noritz Corp	Citibank	(1.455)	300	Osaka Steel Co Ltd	HSBC	(793)
700	Noritz Corp	HSBC	1.134	2.100	Osaka Steel Co Ltd	JP Morgan	(4.390)
600	Noritz Corp	JP Morgan	957	2.700	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	Citibank	677
(62.900)	North Pacific Bank Ltd	JP Morgan	29.572	900	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	HSBC	(2.051)
(300)	NS Solutions Corp	JP Morgan	446	1.100	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	JP Morgan	(2.524)
300	NS United Kaiun Kaisha Ltd	HSBC	(801)	800	OSG Corp	Citibank	(427)
2.300	NS United Kaiun Kaisha Ltd	JP Morgan	(6.222)	400	OSG Corp	HSBC	(462)
300	NSK Ltd	Citibank	(7)	1.600	OSG Corp	JP Morgan	(1.775)
4.500	NSK Ltd	JP Morgan	743	1.000	Outsourcing Inc	HSBC	923
2.700	NTN Corp	Citibank	(300)	1.000	Pack Corp	JP Morgan	(1.049)
4.800	NTN Corp	JP Morgan	(879)	200	PALTAC Corp	HSBC	464
100	NTT Data Corp	Citibank	20	200	PALTAC Corp	JP Morgan	448
100	NTT Data Corp	JP Morgan	(8)	1.300	Pan Pacific International Holdings Corp	HSBC	(2.664)
100	Obara Group Inc	Citibank	3	1.000	Panasonic Corp	Citibank	514
600	Obara Group Inc	HSBC	(229)	4.200	Panasonic Corp	JP Morgan	(2.156)
500	Obara Group Inc	JP Morgan	(218)	1.000	Paramount Bed Holdings Co Ltd	Citibank	(614)
(15.200)	Obayashi Corp	JP Morgan	14.332	200	Paramount Bed Holdings Co Ltd	HSBC	(463)
700	OBIC Business Consultants Co Ltd	Citibank	(1.429)	(700)	Park24 Co Ltd	JP Morgan	(217)
				1.700	Pasona Group Inc	Citibank	(110)
				1.100	Pasona Group Inc	JP Morgan	(467)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
600	PC Depot Corp	Citibank	(143)	(400)	RPA Holdings Inc	JP Morgan	(122)
800	PC Depot Corp	HSBC	(211)	(700)	RS Technologies Co Ltd	HSBC	6.399
200	PC Depot Corp	JP Morgan	(54)	(700)	RS Technologies Co Ltd	JP Morgan	6.462
(16.700)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	JP Morgan	13.160	1.700	Ryohin Keikaku Co Ltd	JP Morgan	(1.589)
200	PeptiDream Inc	Citibank	312	300	Ryosan Co Ltd	Citibank	(204)
100	PeptiDream Inc	HSBC	200	1.700	Ryosan Co Ltd	HSBC	(4.232)
500	PeptiDream Inc	JP Morgan	1.469	1.500	Ryosan Co Ltd	JP Morgan	(3.784)
900	Persol Holdings Co Ltd	Citibank	(93)	(400)	Saibu Gas Holdings Co Ltd	JP Morgan	468
1.600	Persol Holdings Co Ltd	JP Morgan	(934)	(100)	Saizeriya Co Ltd	HSBC	52
4.000	Pigeon Corp	Citibank	(11.250)	(500)	Saizeriya Co Ltd	JP Morgan	26
100	Pigeon Corp	HSBC	(589)	2.300	Sakai Chemical Industry Co Ltd	JP Morgan	(3.951)
3.400	Pigeon Corp	JP Morgan	(18.681)	(1.700)	SAMTY Co Ltd	JP Morgan	1.676
1.400	Pilot Corp	JP Morgan	(2.624)	(100)	San-Ai Oil Co Ltd	HSBC	94
800	Piolax Inc	Citibank	(257)	(400)	San-Ai Oil Co Ltd	JP Morgan	382
800	Piolax Inc	HSBC	(530)	100	SanBio Co Ltd	HSBC	(21)
2.000	Piolax Inc	JP Morgan	(1.369)	100	SanBio Co Ltd	JP Morgan	(41)
1.000	Poletowin Pitcrew Holdings Inc	JP Morgan	(898)	900	Sangetsu Corp	Citibank	(632)
500	PR Times Inc	Citibank	(172)	2.600	Sangetsu Corp	JP Morgan	(2.825)
200	PR Times Inc	HSBC	(225)	(500)	Sankyo Co Ltd	JP Morgan	1.355
400	PR Times Inc	JP Morgan	269	400	Sankyo Tateyama Inc	Citibank	(101)
4.500	Press Kogyo Co Ltd	Citibank	(216)	2.000	Sankyo Tateyama Inc	JP Morgan	(1.469)
2.800	Press Kogyo Co Ltd	HSBC	(77)	200	Sankyu Inc	JP Morgan	(427)
1.100	Press Kogyo Co Ltd	JP Morgan	3	(1.100)	Sanoh Industrial Co Ltd	HSBC	1.195
200	Pressance Corp	Citibank	(185)	(3.300)	Sanoh Industrial Co Ltd	JP Morgan	3.641
600	Pressance Corp	JP Morgan	(289)	(100)	Sanrio Co Ltd	HSBC	(40)
(300)	Prima Meat Packers Ltd	JP Morgan	712	(600)	Sanrio Co Ltd	JP Morgan	(222)
1.800	Proto Corp	Citibank	(777)	5.600	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	305
800	Proto Corp	HSBC	(262)	2.100	Santen Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	404
2.200	Proto Corp	JP Morgan	(758)	1.500	Santen Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	258
(300)	QD Laser Inc	JP Morgan	(265)	1.200	Sanwa Holdings Corp	Citibank	(960)
(200)	Raccoon Holdings Inc	Citibank	523	1.100	Sanwa Holdings Corp	HSBC	(1.122)
(400)	Raccoon Holdings Inc	JP Morgan	1.969	600	Sanwa Holdings Corp	JP Morgan	(509)
(100)	Raito Kogyo Co Ltd	JP Morgan	71	(300)	Sanyo Denki Co Ltd	JP Morgan	925
(8.900)	Raiznext Corp	JP Morgan	4.284	(100)	Sapporo Holdings Ltd	Citibank	72
100	Raksul Inc	Citibank	112	(800)	Sapporo Holdings Ltd	HSBC	509
300	Raksul Inc	HSBC	(659)	(7.800)	Sapporo Holdings Ltd	JP Morgan	7.258
200	Raksul Inc	JP Morgan	(453)	700	Sato Holdings Corp	HSBC	(1.514)
300	Rakus Co Ltd	Citibank	17	1.300	Sato Holdings Corp	JP Morgan	(2.863)
1.300	Rakus Co Ltd	JP Morgan	(741)	(500)	Sawai Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	2.749
1.000	Raysum Co Ltd	Citibank	260	100	SB Technology Corp	Citibank	(129)
600	Raysum Co Ltd	HSBC	(71)	(300)	SBS Holdings Inc	JP Morgan	(505)
600	Raysum Co Ltd	JP Morgan	(78)	(400)	Scroll Corp	Citibank	96
1.800	Recruit Holdings Co Ltd	JP Morgan	4.038	(700)	Scroll Corp	JP Morgan	53
1.400	Relo Group Inc	Citibank	(956)	200	SCSK Corp	Citibank	140
2.100	Relo Group Inc	JP Morgan	1.780	200	SCSK Corp	HSBC	(60)
1.400	Renasas Electronics Corp	HSBC	(1.754)	400	SCSK Corp	JP Morgan	(156)
4.600	Renasas Electronics Corp	JP Morgan	(5.844)	(4.000)	Sega Sammy Holdings Inc	JP Morgan	8.277
(7.300)	Rengo Co Ltd	JP Morgan	3.766	1.500	Seibu Holdings Inc	JP Morgan	1.675
(1.600)	ReproCELL Inc	JP Morgan	186	(400)	Seikagaku Corp	HSBC	(377)
(200)	Resona Holdings Inc	Citibank	27	(1.100)	Seikagaku Corp	JP Morgan	(1.020)
(4.000)	Resona Holdings Inc	HSBC	572	1.400	Seiko Epson Corp	JP Morgan	323
(34.606)	Resona Holdings Inc	JP Morgan	2.247	(300)	Seino Holdings Co Ltd	HSBC	(17)
100	Resorttrust Inc	JP Morgan	45	(4.500)	Seino Holdings Co Ltd	JP Morgan	296
500	Ricoh Co Ltd	HSBC	254	(100)	Seiren Co Ltd	HSBC	(44)
1.100	Ricoh Co Ltd	JP Morgan	475	(800)	Seiren Co Ltd	JP Morgan	(332)
(200)	Ringer Hut Co Ltd	Citibank	59	4.400	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	(2.562)
(700)	Ringer Hut Co Ltd	JP Morgan	200	(300)	Sekisui House Ltd	JP Morgan	172
(100)	Rinnai Corp	HSBC	624	(5)	Sekisui House Reit Inc (REIT)	Citibank	(8)
(500)	Rinnai Corp	JP Morgan	3.199	(245)	Sekisui House Reit Inc (REIT)	JP Morgan	(252)
700	Riso Kagaku Corp	Citibank	303	1.500	Sekisui Jushi Corp	Citibank	(1.271)
600	Riso Kagaku Corp	JP Morgan	1.287	1.000	Sekisui Jushi Corp	JP Morgan	(1.118)
1.200	Rock Field Co Ltd	JP Morgan	(270)	4.000	Sekisui Kasei Co Ltd	HSBC	(839)
(2.200)	Rohito Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	3.779	2.900	Sekisui Kasei Co Ltd	JP Morgan	(633)
(100)	Rokko Butter Co Ltd	HSBC	91				
(300)	Round Corp	JP Morgan	(1.373)				
(3.100)	Round One Corp	JP Morgan	(6.920)				
(1.000)	RPA Holdings Inc	Citibank	(339)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
900	Senshukai Co Ltd	Citibank	51	100	SoftBank Group Corp	Citibank	(181)
600	Septeni Holdings Co Ltd	Citibank	(94)	400	SoftBank Group Corp	JP Morgan	(178)
6.700	Septeni Holdings Co Ltd	JP Morgan	(263)	200	Softcreate Holdings Corp	Citibank	(286)
100	Seria Co Ltd	Citibank	(99)	500	Softcreate Holdings Corp	HSBC	(1.263)
400	Seria Co Ltd	JP Morgan	(420)	300	Sohgo Security Services Co Ltd	JP Morgan	167
(600)	Seven & i Holdings Co Ltd	HSBC	34	500	Solasto Corp	Citibank	(119)
(2.000)	Seven & i Holdings Co Ltd	JP Morgan	336	(200)	Sosei Group Corp	HSBC	285
2.200	SG Holdings Co Ltd	Citibank	306	(500)	Sosei Group Corp	JP Morgan	725
500	SG Holdings Co Ltd	JP Morgan	(378)	200	Sotetsu Holdings Inc	Citibank	131
500	Shiga Bank Ltd	Citibank	30	700	Sotetsu Holdings Inc	JP Morgan	(381)
1.900	Shikoku Chemicals Corp	Citibank	(462)	(7.400)	Sourcenext Corp	Citibank	274
400	Shikoku Chemicals Corp	HSBC	(115)	(3.300)	Sourcenext Corp	HSBC	1.197
600	Shikoku Chemicals Corp	JP Morgan	(183)	(5.400)	Sourcenext Corp	JP Morgan	1.984
(1.300)	Shima Seiki Manufacturing Ltd	JP Morgan	1.530	100	SRE Holdings Corp	JP Morgan	447
800	Shimadzu Corp	Citibank	(231)	500	Stanley Electric Co Ltd	Citibank	310
1.800	Shimadzu Corp	JP Morgan	(3.110)	700	Starts Corp Inc	Citibank	(847)
100	Shimamura Co Ltd	HSBC	(603)	200	Starts Corp Inc	HSBC	(82)
200	Shimano Inc	Citibank	752	400	Starts Corp Inc	JP Morgan	(180)
100	Shimano Inc	JP Morgan	(597)	1.600	Starzen Co Ltd	JP Morgan	(3.162)
(100)	Shimizu Corp	Citibank	21	(200)	StemRIM Inc	Citibank	31
(1.000)	Shimizu Corp	HSBC	287	(1.000)	StemRIM Inc	JP Morgan	196
(19.700)	Shimizu Corp	JP Morgan	3.000	500	Strike Co Ltd	Citibank	97
(1.600)	Shin Nippon Biomedical Laboratories Ltd	Citibank	960	100	Strike Co Ltd	HSBC	(27)
400	Shinko Shoji Co Ltd	Citibank	(26)	100	Strike Co Ltd	JP Morgan	(56)
500	Shinko Shoji Co Ltd	HSBC	(157)	1.700	Studio Alice Co Ltd	Citibank	(818)
3.500	Shinko Shoji Co Ltd	JP Morgan	(1.135)	100	Studio Alice Co Ltd	HSBC	(167)
(300)	Shinnihon Corp	HSBC	55	3.100	Subaru Corp	Citibank	1.504
(800)	Shinnihon Corp	JP Morgan	121	(100)	Sugi Holdings Co Ltd	Citibank	183
500	Shinnihonseiyaku Co Ltd	Citibank	(419)	(600)	Sugi Holdings Co Ltd	JP Morgan	522
800	Shinnihonseiyaku Co Ltd	HSBC	(397)	(3.100)	SUMCO Corp	JP Morgan	3.795
600	Shinnihonseiyaku Co Ltd	JP Morgan	(223)	(200)	Sumitomo Bakelite Co Ltd	HSBC	14
(3.900)	Shinsei Bank Ltd	JP Morgan	(2.167)	(700)	Sumitomo Bakelite Co Ltd	JP Morgan	932
100	Shionogi & Co Ltd	Citibank	(217)	7.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Citibank	(73)
(1.200)	Ship Healthcare Holdings Inc	JP Morgan	924	5.200	Sumitomo Chemical Co Ltd	JP Morgan	(425)
(300)	Shiseido Co Ltd	JP Morgan	(373)	16.200	Sumitomo Corp	JP Morgan	(3.994)
(16.700)	Shizuoka Bank Ltd	JP Morgan	2.197	(100)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	HSBC	(106)
1.500	Shizuoka Gas Co Ltd	Citibank	(499)	(3.400)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	JP Morgan	(3.657)
500	Shizuoka Gas Co Ltd	JP Morgan	243	(2.800)	Sumitomo Electric Industries Ltd	JP Morgan	450
600	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Citibank	(532)	(3.700)	Sumitomo Forestry Co Ltd	JP Morgan	8.634
600	SHO-BOND Holdings Co Ltd	HSBC	(677)	(1.800)	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	JP Morgan	957
800	SHO-BOND Holdings Co Ltd	JP Morgan	(957)	1.200	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Citibank	(795)
(100)	Shochiku Co Ltd	JP Morgan	(170)	900	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Citibank	(1.536)
600	Shoei Co Ltd	Citibank	(921)	1.400	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	JP Morgan	(8.701)
(100)	Shoei Foods Corp	HSBC	168	300	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	HSBC	(839)
(500)	Shoei Foods Corp	JP Morgan	870	400	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	JP Morgan	(135)
1.100	Showa Denko KK	Citibank	(995)	3.700	Sumitomo Riko Co Ltd	Citibank	(972)
400	Showa Denko KK	JP Morgan	(1.099)	1.400	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Citibank	(691)
300	Showa Sangyo Co Ltd	Citibank	7	2.300	Sumitomo Rubber Industries Ltd	JP Morgan	(125)
1.100	Siix Corp	Citibank	(8)	3.600	Sumitomo Warehouse Co Ltd	Citibank	(1.624)
500	Siix Corp	HSBC	(25)	2.700	Sumitomo Warehouse Co Ltd	JP Morgan	(582)
1.500	Siix Corp	JP Morgan	19	1.800	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Citibank	(602)
(200)	Sinko Industries Ltd	HSBC	897	200	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	JP Morgan	(54)
(1.100)	Sinko Industries Ltd	JP Morgan	3.860	200	Sun* Inc	HSBC	(282)
4.900	Sintokogio Ltd	Citibank	1.644	300	Sun* Inc	JP Morgan	(204)
7.500	Sintokogio Ltd	HSBC	(511)				
6.600	Sintokogio Ltd	JP Morgan	188				
1.700	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	JP Morgan	(552)				
(700)	Skylark Holdings Co Ltd	Citibank	197				
200	SMC Corp	JP Morgan	(649)				
2.900	SMS Co Ltd	Citibank	(1.975)				
1.000	SMS Co Ltd	HSBC	(1.454)				
400	SMS Co Ltd	JP Morgan	(599)				
(600)	Snow Peak Inc	JP Morgan	1.716				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
(900)	Sundrug Co Ltd	JP Morgan	1.056	200	Toagosei Co Ltd	HSBC	(138)
1.000	Suntory Beverage & Food Ltd	Citibank	112	1.000	Toagosei Co Ltd	JP Morgan	(706)
1.800	Suntory Beverage & Food Ltd	JP Morgan	3.655	(600)	Tobu Railway Co Ltd	JP Morgan	1.041
100	SuRaLa Net Co Ltd	Citibank	(38)	(500)	Toda Corp	Citibank	245
200	SuRaLa Net Co Ltd	HSBC	(181)	(2.000)	Toda Corp	HSBC	761
400	SuRaLa Net Co Ltd	JP Morgan	(596)	(25.000)	Toda Corp	JP Morgan	9.234
(18.300)	Suruga Bank Ltd	JP Morgan	10.867	(200)	Toei Animation Co Ltd	JP Morgan	(257)
500	Suzuken Co Ltd	JP Morgan	(1.725)	(700)	Toei Co Ltd	JP Morgan	14.838
(500)	Suzuki Motor Corp	JP Morgan	(1.840)	(12.400)	Toho Bank Ltd	JP Morgan	2.285
(500)	SWCC Showa Holdings Co Ltd	JP Morgan	(255)	(2.000)	Toho Co Ltd	JP Morgan	(1.484)
(1.300)	Symbio Pharmaceuticals Ltd	JP Morgan	(7.321)	(2.000)	Toho Gas Co Ltd	JP Morgan	7.011
300	Systemex Corp	Citibank	1.097	(9.700)	Tohoku Electric Power Co Inc	JP Morgan	8.464
200	System Information Co Ltd	Citibank	(94)	(2.400)	Tokai Carbon Co Ltd	JP Morgan	7.026
(4.300)	T Hasegawa Co Ltd	JP Morgan	3.828	300	Tokai Corp	JP Morgan	(231)
(11.900)	T&D Holdings Inc	JP Morgan	(8.593)	800	TOKAI Holdings Corp	HSBC	(318)
2.200	Tachibana Eletech Co Ltd	Citibank	(104)	3.000	Tokai Rika Co Ltd	Citibank	(857)
500	Tachibana Eletech Co Ltd	HSBC	(672)	700	Tokai Rika Co Ltd	JP Morgan	(221)
4.200	Tachibana Eletech Co Ltd	JP Morgan	(4.011)	(6.900)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	JP Morgan	539
(100)	Tadano Ltd	Citibank	21	(100)	Token Corp	HSBC	431
(3.600)	Tadano Ltd	JP Morgan	4.058	(600)	Token Corp	JP Morgan	2.672
1.300	Taiheiyō Cement Corp	Citibank	(446)	700	Tokio Marine Holdings Inc	Citibank	(4)
700	Taiheiyō Cement Corp	HSBC	(2.651)	700	Tokio Marine Holdings Inc	JP Morgan	(903)
1.400	Taiheiyō Cement Corp	JP Morgan	(5.361)	(100)	Tokuyama Corp	Citibank	56
500	Taikisha Ltd	Citibank	(490)	(1.600)	Tokuyama Corp	JP Morgan	3.795
(1.900)	Taisei Corp	JP Morgan	7.055	(500)	Tokyo Century Corp	JP Morgan	1.534
1.900	Takamatsu Construction Group Co Ltd	Citibank	(1.380)	(1.200)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Citibank	92
400	Takamatsu Construction Group Co Ltd	HSBC	(165)	(1.200)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	HSBC	97
2.000	Takamatsu Construction Group Co Ltd	JP Morgan	(886)	(15.400)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	JP Morgan	1.323
(5.800)	Takara Holdings Inc	JP Morgan	1.764	100	Tokyo Electron Ltd	JP Morgan	(1.729)
3.100	Takara Leben Co Ltd	Citibank	(499)	(700)	Tokyo Gas Co Ltd	HSBC	585
500	Takara Leben Co Ltd	JP Morgan	(135)	(500)	Tokyo Gas Co Ltd	JP Morgan	427
1.800	Takara Standard Co Ltd	Citibank	(1.009)	(600)	Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc	JP Morgan	259
1.200	Takara Standard Co Ltd	HSBC	(256)	800	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd	Citibank	(1.004)
1.500	Takara Standard Co Ltd	JP Morgan	(355)	400	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(2.198)
(100)	Takasago International Corp	HSBC	17	(200)	Tokyu Construction Co Ltd	HSBC	(205)
(100)	Takasago International Corp	JP Morgan	21	(15.300)	Tokyu Construction Co Ltd	JP Morgan	(15.519)
(8.400)	Takashimaya Co Ltd	JP Morgan	(457)	(600)	Tokyu Corp	HSBC	34
100	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(44)	(3.700)	Tokyu Corp	JP Morgan	285
(200)	Taki Chemical Co Ltd	Citibank	749	900	Tokyu Fudosan Holdings Corp	HSBC	14
(700)	Taki Chemical Co Ltd	JP Morgan	1.911	(600)	TOMONY Holdings Inc	HSBC	80
(200)	Takuma Co Ltd	HSBC	801	(7.500)	TOMONY Holdings Inc	JP Morgan	809
(3.300)	Takuma Co Ltd	JP Morgan	11.387	100	Topcon Corp	HSBC	103
(100)	Tamron Co Ltd	HSBC	(8)	2.200	Topcon Corp	JP Morgan	2.212
(800)	Tamron Co Ltd	JP Morgan	(37)	(300)	Toppa Printing Co Ltd	HSBC	30
(300)	Tanaka Chemical Corp	Citibank	(33)	(7.200)	Toppa Printing Co Ltd	JP Morgan	(5.883)
(1.700)	Tanaka Chemical Corp	JP Morgan	6.612	1.100	Topy Industries Ltd	Citibank	(416)
600	Tayca Corp	Citibank	(170)	200	Topy Industries Ltd	HSBC	(149)
800	Tayca Corp	JP Morgan	(697)	2.000	Topy Industries Ltd	JP Morgan	(1.529)
(200)	TDK Corp	JP Morgan	1.873	(1.000)	Toridoll Holdings Corp	HSBC	(41)
700	TeamSpirit Inc	JP Morgan	(1.399)	1.100	Tosei Corp	Citibank	(618)
200	TechnoPro Holdings Inc	Citibank	(375)	(600)	Toshiba Corp	JP Morgan	(193)
200	TechnoPro Holdings Inc	HSBC	(468)	(1.400)	Toshiba TEC Corp	JP Morgan	3.050
300	TechnoPro Holdings Inc	JP Morgan	(1.367)	(5.600)	Tosoh Corp	JP Morgan	6.669
1.000	Teijin Ltd	JP Morgan	(199)	200	TOTO Ltd	Citibank	315
800	Teikoku Sen-I Co Ltd	HSBC	(675)	400	TOTO Ltd	HSBC	78
800	Teikoku Sen-I Co Ltd	JP Morgan	(699)	200	TOTO Ltd	JP Morgan	477
(2.400)	Tenma Corp	JP Morgan	(1.835)	2.600	Toyo Ink SC Holdings Co Ltd	Citibank	(644)
2.300	T-Gaia Corp	Citibank	(2.215)	1.800	Toyo Ink SC Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.341)
1.000	T-Gaia Corp	HSBC	(721)	1.900	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Citibank	2.228
100	THK Co Ltd	JP Morgan	106	200	Toyo Suisan Kaisha Ltd	HSBC	(185)
(900)	TIS Inc	JP Morgan	(185)				
(400)	Toa Corp	JP Morgan	(17)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
(600)	Toyo Tire Corp	Citibank	67	2.300	VT Holdings Co Ltd	JP Morgan	624
(1.900)	Toyo Tire Corp	JP Morgan	(1.425)	200	Wacom Holdings Corp	JP Morgan	(233)
400	Toyobo Co Ltd	Citibank	(233)	4.400	Wacom Co Ltd	Citibank	(2.044)
900	Toyobo Co Ltd	HSBC	(928)	4.200	Wacom Co Ltd	HSBC	(1.120)
3.400	Toyobo Co Ltd	JP Morgan	(3.578)	1.800	Wacom Co Ltd	JP Morgan	(473)
400	Toyoda Gosei Co Ltd	Citibank	73	1.000	Warabeya Nichiyo Holdings Co Ltd	HSBC	(1.313)
700	Toyoda Gosei Co Ltd	JP Morgan	307	1.800	WDB Holdings Co Ltd	Citibank	123
(200)	Toyota Motor Corp	HSBC	(317)	1.100	WDB Holdings Co Ltd	HSBC	1.740
(500)	Toyota Motor Corp	JP Morgan	(1.027)	1.800	WDB Holdings Co Ltd	JP Morgan	2.785
(3.500)	Toyota Tsusho Corp	JP Morgan	6.879	(100)	WealthNavi Inc	Citibank	(368)
800	TPR Co Ltd	HSBC	(1.700)	(300)	WealthNavi Inc	JP Morgan	(1.235)
700	TPR Co Ltd	JP Morgan	(1.504)	1.200	Welbe Inc	Citibank	(396)
100	Trancom Co Ltd	HSBC	(625)	2.400	Welbe Inc	JP Morgan	(1.241)
1.600	Transaction Co Ltd	HSBC	(122)	1.000	Welcia Holdings Co Ltd	Citibank	(325)
1.200	Transcosmos Inc	Citibank	38	200	Welcia Holdings Co Ltd	JP Morgan	(59)
1.300	Trend Micro Inc	Citibank	(456)	(1.300)	West Japan Railway Co	JP Morgan	624
700	Trend Micro Inc	JP Morgan	939	(1.300)	WingArc1st Inc	JP Morgan	1.907
(300)	Tri Chemical Laboratories Inc	JP Morgan	701	(600)	Wowow Inc	HSBC	762
200	TS Tech Co Ltd	Citibank	65	(100)	Wowow Inc	JP Morgan	140
1.000	TS Tech Co Ltd	HSBC	320	(600)	W-Scope Corp	Citibank	223
2.400	TS Tech Co Ltd	JP Morgan	446	(600)	W-Scope Corp	HSBC	471
9.400	TSI Holdings Co Ltd	HSBC	(3.241)	(1.800)	W-Scope Corp	JP Morgan	935
3.600	TSI Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.259)	2.500	Xebio Holdings Co Ltd	Citibank	(539)
300	Tsubakimoto Chain Co	HSBC	(224)	7.200	Xebio Holdings Co Ltd	HSBC	1.141
1.100	Tsubakimoto Chain Co	JP Morgan	(69)	6.200	Xebio Holdings Co Ltd	JP Morgan	901
400	Tsugami Corp	Citibank	329	(1.200)	Yahagi Construction Co Ltd	JP Morgan	534
300	Tsugami Corp	JP Morgan	153	(600)	Yakult Honsha Co Ltd	JP Morgan	(1.771)
(700)	Tsukui Holdings Corp	HSBC	17	3.100	YAMABIKO Corp	Citibank	(1.919)
(200)	Tsumura & Co	Citibank	227	100	YAMABIKO Corp	HSBC	—
(100)	Tsumura & Co	HSBC	67	900	YAMABIKO Corp	JP Morgan	(16)
(1.900)	Tsumura & Co	JP Morgan	5.045	5.800	Yamada Holdings Co Ltd	Citibank	(621)
500	TV Asahi Holdings Corp	Citibank	(126)	5.900	Yamada Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.914)
800	TV Asahi Holdings Corp	HSBC	(1.114)	400	Yamagata Bank Ltd	HSBC	12
900	TV Asahi Holdings Corp	JP Morgan	(1.280)	900	Yamagata Bank Ltd	JP Morgan	(114)
400	UACJ Corp	Citibank	(404)	(4.500)	Yamaguchi Financial Group Inc	JP Morgan	1.710
100	UACJ Corp	HSBC	(103)	(3.700)	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	(9.838)
1.800	UACJ Corp	JP Morgan	(7.055)	300	YA-MAN Ltd	JP Morgan	(219)
2.700	Ube Industries Ltd	Citibank	(2.154)	(300)	Yamashin-Filter Corp	Citibank	(4)
200	Ube Industries Ltd	HSBC	(88)	(1.400)	Yamashin-Filter Corp	HSBC	459
500	Ube Industries Ltd	JP Morgan	(238)	(200)	Yamashin-Filter Corp	JP Morgan	68
100	Ubicom Holdings Inc	HSBC	(70)	900	Yamato Holdings Co Ltd	JP Morgan	(69)
100	Ubicom Holdings Inc	JP Morgan	(74)	(2.200)	Yamato Kogyo Co Ltd	JP Morgan	3.298
(400)	Ulvac Inc	JP Morgan	(219)	1.700	Yamazen Corp	Citibank	(464)
(200)	Unipres Corp	HSBC	320	1.800	Yamazen Corp	HSBC	(946)
(300)	Unipres Corp	JP Morgan	484	900	Yamazen Corp	JP Morgan	(509)
(25)	United Urban Investment Corp (REIT)	JP Morgan	2.105	800	Yaoko Co Ltd	JP Morgan	(5.685)
(900)	Universal Entertainment Corp	Citibank	1.019	1.400	Yaskawa Electric Corp	Citibank	5.059
(700)	Universal Entertainment Corp	HSBC	1.924	900	Yaskawa Electric Corp	JP Morgan	1.042
(400)	Universal Entertainment Corp	JP Morgan	1.139	(500)	Yokogawa Bridge Holdings Corp	JP Morgan	338
100	Usen-Next Holdings Co Ltd	HSBC	79	100	Yokogawa Electric Corp	Citibank	(10)
1.000	Usen-Next Holdings Co Ltd	JP Morgan	(218)	2.400	Yokohama Rubber Co Ltd	JP Morgan	1.136
600	User Local inc	Citibank	(1.726)	500	Yokowo Co Ltd	Citibank	56
(1.700)	Ushio Inc	JP Morgan	37	200	Yokowo Co Ltd	HSBC	(655)
500	UT Group Co Ltd	Citibank	(741)	400	Yokowo Co Ltd	JP Morgan	(1.325)
500	Valqua Ltd	JP Morgan	(411)	300	Yondoshi Holdings Inc	Citibank	(131)
400	ValueCommerce Co Ltd	JP Morgan	(1.398)	600	Yondoshi Holdings Inc	HSBC	(349)
300	Valuence Holdings Inc	Citibank	(479)	1.000	Yondoshi Holdings Inc	JP Morgan	(609)
100	Valuence Holdings Inc	HSBC	(307)	(1.600)	Yonex Co Ltd	JP Morgan	(398)
200	VisasQ Inc	HSBC	(277)	(2.500)	Yoshinoya Holdings Co Ltd	Citibank	1.442
900	Visional Inc	JP Morgan	14.052	(300)	Yoshinoya Holdings Co Ltd	JP Morgan	228
3.600	Vital KSK Holdings Inc	Citibank	730	300	Yuasa Trading Co Ltd	Citibank	31
1.500	Vital KSK Holdings Inc	HSBC	328	100	Yuasa Trading Co Ltd	HSBC	(142)
1.700	Vital KSK Holdings Inc	JP Morgan	(485)	1.400	Yuasa Trading Co Ltd	JP Morgan	471
1.800	VT Holdings Co Ltd	Citibank	261	8.400	Z Holdings Corp	HSBC	2.716
2.200	VT Holdings Co Ltd	HSBC	611	1.400	Z Holdings Corp	JP Morgan	615
				1.300	Zenkoku Hoshio Co Ltd	Citibank	(2.049)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Malaisie suite			
600	Zenkoku Hoshō Co Ltd	JP Morgan	(503)	12.400	Press Metal Aluminium Holdings Bhd	HSBC	(608)
(200)	Zensho Holdings Co Ltd	HSBC	214	3.400	Press Metal Aluminium Holdings Bhd	JP Morgan	(162)
(3.000)	Zensho Holdings Co Ltd	JP Morgan	3.337	78.000	Public Bank Bhd	Citibank	1.354
200	Zeon Corp	Citibank	(134)	6.600	Public Bank Bhd	HSBC	149
1.200	Zeon Corp	HSBC	(1.736)	22.500	Public Bank Bhd	JP Morgan	532
900	Zeon Corp	JP Morgan	(1.324)	(2.200)	QL Resources Bhd	Citibank	(17)
(100)	ZERIA Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	13	28.900	RHB Bank Bhd	Citibank	750
(4.000)	ZERIA Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(2.419)	28.300	RHB Bank Bhd	HSBC	814
(800)	Zojirushi Corp	JP Morgan	622	57.900	RHB Bank Bhd	JP Morgan	1.745
700	ZOZO Inc	JP Morgan	475	376.800	Sapura Energy Bhd	Citibank	(398)
100	Zuken Inc	Citibank	(57)	687.600	Sapura Energy Bhd	HSBC	(3.072)
			39.436	593.200	Sapura Energy Bhd	JP Morgan	(2.938)
				(36.900)	SCGM Bhd	JP Morgan	(3.157)
				460	Scientex BHD	Citibank	(6)
				1.240	Scientex BHD	JP Morgan	(20)
				10.100	Sime Darby Bhd	JP Morgan	106
				(24.900)	Sime Darby Plantation Bhd	Citibank	(646)
				(8.800)	Sime Darby Plantation Bhd	HSBC	512
				(37.300)	Sime Darby Plantation Bhd	JP Morgan	2.121
				(29.400)	Sunway Bhd	Citibank	864
				(47.953)	Sunway Bhd	JP Morgan	(1.763)
				9.200	TASCO Bhd	Citibank	191
				73.300	TASCO Bhd	JP Morgan	501
				(9.000)	Telekom Malaysia Bhd	JP Morgan	(915)
				(8.300)	Tenaga Nasional Bhd	Citibank	(137)
				5.400	UWC BHD	HSBC	89
				3.500	UWC BHD	JP Morgan	63
				45.600	Uzma Bhd	Citibank	(128)
				6.200	Uzma Bhd	HSBC	(140)
				338.400	Uzma Bhd	JP Morgan	(7.569)
				361.300	Velesto Energy Bhd	Citibank	61
				(38)	Velesto Energy Bhd	HSBC	—
				527.000	Velesto Energy Bhd	HSBC	(1.354)
				425.400	Velesto Energy Bhd	JP Morgan	(1.077)
				(6.000)	VS Industry Bhd	JP Morgan	111
				1.900	Westports Holdings Bhd	Citibank	(8)
				100	Westports Holdings Bhd	HSBC	(1)
				24.000	Westports Holdings Bhd	JP Morgan	(135)
				180.500	YTL Corp Bhd	Citibank	(936)
				416.400	YTL Corp Bhd	HSBC	(2.809)
				16.000	YTL Corp Bhd	JP Morgan	(105)
							(43.937)
				Philippines			
				(94.600)	Alliance Global Group Inc	JP Morgan	(487)
				5	Altus Property Ventures Inc	HSBC	—
				(7.870)	Ayala Corp	JP Morgan	(10.552)
				(18.300)	Ayala Land Inc	JP Morgan	(1.055)
				(1.350)	Bank of the Philippine Islands	JP Morgan	(41)
				1.890	BDO Unibank Inc	Citibank	134
				5.900	BDO Unibank Inc	HSBC	(175)
				7.190	BDO Unibank Inc	JP Morgan	(207)
				12.570	International Container Terminal Services Inc	Citibank	1.131
				6.330	International Container Terminal Services Inc	HSBC	321
				5.030	International Container Terminal Services Inc	JP Morgan	260
				(11.487)	JG Summit Holdings Inc	JP Morgan	(1.494)
				3.000	Metro Pacific Investments Corp	Citibank	25
				11.000	Metro Pacific Investments Corp	HSBC	15
				95.000	Metro Pacific Investments Corp	JP Morgan	131
				(33.160)	Metropolitan Bank & Trust Co	JP Morgan	(2.904)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Philippines suite				Singapour suite			
100	PLDT Inc	Citibank	138	43.000	Hutchison Port Holdings Trust 'U'	HSBC	—
475	PLDT Inc	HSBC	842	71.700	Hutchison Port Holdings Trust 'U'	JP Morgan	220
385	PLDT Inc	JP Morgan	686	(400)	Jardine Matheson Holdings Ltd	Citibank	(364)
(8.595)	SM Investments Corp	JP Morgan	(6.362)	(400)	Jardine Matheson Holdings Ltd	HSBC	832
(129.100)	SM Prime Holdings Inc	JP Morgan	(6.799)	(1.800)	Jardine Matheson Holdings Ltd	JP Morgan	3.744
(1.010)	Universal Robina Corp	HSBC	(225)	10.300	Keppel DC REIT (REIT)	Citibank	(193)
(10.610)	Universal Robina Corp	JP Morgan	(1.984)	(7.300)	Keppel DC REIT (REIT)	HSBC	83
			(28.602)	5.500	Keppel DC REIT (REIT)	HSBC	(64)
				(21.800)	Keppel DC REIT (REIT)	JP Morgan	178
Singapour				30.200	Keppel Infrastructure Trust (Unit)	Citibank	187
(11.700)	AEM Holdings Ltd	Citibank	(1.333)	229.200	Keppel REIT (REIT)	Citibank	1.162
54.200	AIMS APAC REIT (REIT)	Citibank	1.059	18.200	Keppel REIT (REIT)	HSBC	(489)
(72.000)	ARA LOGOS Logistics Trust (REIT)	Citibank	(2.693)	323.600	Keppel REIT (REIT)	JP Morgan	(8.727)
(14.500)	ARA LOGOS Logistics Trust (REIT)	HSBC	(442)	26.900	Lendlease Global Commercial REIT (REIT)	JP Morgan	(148)
10.600	Ascendas Real Estate Investment Trust (REIT)	HSBC	(595)	(70.400)	Mapletree Commercial Trust (REIT)	HSBC	(747)
18.100	Ascendas Real Estate Investment Trust (REIT)	JP Morgan	(949)	(18.000)	Mapletree Commercial Trust (REIT)	JP Morgan	(237)
(208.400)	Ascott Residence Trust (Unit)	Citibank	(4.833)	420	Mapletree Industrial Trust	Citibank	60
(162.500)	Ascott Residence Trust (Unit)	HSBC	7.740	3.500	Mapletree Industrial Trust	JP Morgan	503
2.300	Best World International Ltd*	JP Morgan	(103)	8.400	Mapletree Industrial Trust (REIT)	Citibank	27
(67.400)	CapitaLand China Trust (REIT)	HSBC	(767)	70.000	Mapletree Industrial Trust (REIT)	JP Morgan	4.225
(96.200)	CapitaLand China Trust (REIT)	JP Morgan	(1.076)	1.900	Mapletree North Asia Commercial Trust (REIT)	HSBC	(40)
(127.800)	CapitaLand Integrated Commercial Trust (REIT)	HSBC	1.541	170.100	Mapletree North Asia Commercial Trust (REIT)	JP Morgan	(3.377)
(102.100)	CapitaLand Ltd	Citibank	(5.314)	(6.800)	Medtecs International Corp Ltd	JP Morgan	(120)
(100.700)	CapitaLand Ltd	HSBC	(3.449)	(65.600)	NetLink NBN Trust (Unit)	Citibank	(279)
(115.100)	CDL Hospitality Trusts (Unit)	Citibank	(599)	(420.800)	NetLink NBN Trust (Unit)	HSBC	4.679
(77.700)	CDL Hospitality Trusts (Unit)	HSBC	3.707	(5.200)	NetLink NBN Trust (Unit)	JP Morgan	45
19.100	City Developments Ltd	JP Morgan	825	200	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	HSBC	41
100.100	ComfortDelGro Corp Ltd	Citibank	4.515	(2.500)	Parkway Life Real Estate Investment Trust (REIT)	HSBC	(571)
125.600	ComfortDelGro Corp Ltd	HSBC	5.053	(37.700)	Parkway Life Real Estate Investment Trust (REIT)	JP Morgan	(6.500)
535.700	ComfortDelGro Corp Ltd	JP Morgan	22.743	101.700	Raffles Medical Group Ltd	Citibank	5.866
(13.800)	Dairy Farm International Holdings Ltd	Citibank	690	24.000	Raffles Medical Group Ltd	JP Morgan	797
(10.100)	Dairy Farm International Holdings Ltd	HSBC	—	56.400	Sasseur Real Estate Investment Trust (REIT)	Citibank	636
(7.200)	Dairy Farm International Holdings Ltd	JP Morgan	—	46.300	Sasseur Real Estate Investment Trust (REIT)	HSBC	(288)
100	DBS Group Holdings Ltd	HSBC	35	184.900	Sasseur Real Estate Investment Trust (REIT)	JP Morgan	(938)
(1.900)	Eagle Hospitality Trust (Unit)*	Citibank	65	(4.200)	SATS Ltd	Citibank	(768)
(15.200)	Eagle Hospitality Trust (Unit)*	JP Morgan	521	(15.200)	SATS Ltd	HSBC	258
(20.340)	Ezion Holdings Ltd**	Citibank	—	16.900	SATS Ltd	JP Morgan	(205)
(5.400)	Ezion Holdings Ltd	HSBC	—	(66.800)	Sembcorp Industries Ltd	Citibank	(10.706)
(6.480)	Ezion Holdings Ltd	JP Morgan	—	60.600	Sembcorp Marine Ltd	HSBC	533
(14.900)	First Resources Ltd	Citibank	472	70.600	Sheng Siong Group Ltd	Citibank	(1.098)
(36.600)	First Resources Ltd	HSBC	3.245	22.100	Sheng Siong Group Ltd	JP Morgan	1.260
(25.100)	Frasers Centrepoint Trust (REIT)	JP Morgan	409	(13.700)	SIA Engineering Co Ltd	Citibank	(1.371)
92.500	Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT)	HSBC	(1.718)	(39.200)	SIA Engineering Co Ltd	JP Morgan	(825)
183.700	Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT)	JP Morgan	(3.639)	(13.700)	Singapore Airlines Ltd	HSBC	(1.237)
33.500	Frencken Group Ltd	JP Morgan	9.502	(28.633)	Singapore Airlines Ltd**	HSBC	—
(14.200)	Genting Singapore Ltd	Citibank	(427)	(1.900)	Singapore Airlines Ltd	JP Morgan	(224)
(181.100)	Genting Singapore Ltd	HSBC	(2.875)	(3.971)	Singapore Airlines Ltd	JP Morgan	—
(56.900)	Genting Singapore Ltd	JP Morgan	(343)	23.100	Singapore Post Ltd	JP Morgan	45
(28.700)	Hongkong Land Holdings Ltd	JP Morgan	—				
87.900	Hutchison Port Holdings Trust 'U'	Citibank	—				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(2.717)	Hwaseung Enterprise Co Ltd	Citibank	(2.961)	(478)	L&F Co Ltd	Citibank	(756)
61	Hyosung Advanced Materials Corp	Citibank	918	294	LEENO Industrial Inc	JP Morgan	704
(110)	Hyosung Corp	HSBC	1.022	(246)	LegoChem Biosciences Inc	Citibank	(516)
(36)	Hyosung Corp	JP Morgan	335	94	LG Chem Ltd	Citibank	(5.098)
2.245	Hyosung Corp	JP Morgan	(16.119)	18	LG Display Co Ltd	Citibank	23
69	Hyosung TNC Corp	JP Morgan	(2.556)	726	LG Hausys Ltd	JP Morgan	(5.770)
931	Hyundai Construction Equipment Co Ltd	Citibank	2.426	(2)	LG Household & Health Care Ltd	JP Morgan	(26)
3.261	HYUNDAI Corp	Citibank	2.015	725	LG International Corp	JP Morgan	(3.012)
(589)	Hyundai Department Store Co Ltd	JP Morgan	888	288	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd	Citibank	2.226
299	Hyundai Elevator Co Ltd	HSBC	1.231	554	LOTTE Fine Chemical Co Ltd	JP Morgan	1.417
3.383	Hyundai Elevator Co Ltd	JP Morgan	12.794	1.060	LS Electric Co Ltd	Citibank	2.373
84	Hyundai Glovis Co Ltd	Citibank	390	555	Mando Corp	Citibank	3.034
887	Hyundai Home Shopping Network Corp	JP Morgan	3.465	(3.413)	Mcnex Co Ltd	Citibank	(7.126)
3.820	Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	Citibank	2.384	(383)	Mcnex Co Ltd	JP Morgan	(22)
(2.630)	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	Citibank	11.083	(202)	Medipost Co Ltd	Citibank	(110)
(2.758)	Hyundai Rotem Co Ltd	Citibank	(3.199)	(53)	Medipost Co Ltd	JP Morgan	13
(458)	Hyundai Rotem Co Ltd	JP Morgan	(539)	282	MegaStudyEdu Co Ltd	Citibank	436
(1.586)	Hyundai Wia Corp	Citibank	(9.523)	1.819	MegaStudyEdu Co Ltd	JP Morgan	(110)
(89)	Hyundai Wia Corp	JP Morgan	(964)	(366)	Mezzion Pharma Co Ltd	Citibank	3.421
226	Il Dong Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(22)	(216)	Mezzion Pharma Co Ltd	JP Morgan	3.862
(39)	Iijin Materials Co Ltd	Citibank	(40)	4.833	Moorim P&P Co Ltd	HSBC	(1.938)
(1.685)	Iijin Materials Co Ltd	JP Morgan	2.995	5.339	Namhae Chemical Corp	Citibank	2.602
4.802	InBody Co Ltd	Citibank	12.671	1.528	Nasmedia Co Ltd	Citibank	3.035
24.861	Industrial Bank of Korea	HSBC	11.767	(821)	Naturecell Co Ltd	Citibank	(442)
(605)	iNtRON Biotechnology Inc	Citibank	(447)	152	NAVER Corp	JP Morgan	184
(1.749)	IS Dongseo Co Ltd	Citibank	2.841	531	NeoPharm Co Ltd	Citibank	1.460
(602)	IS Dongseo Co Ltd	JP Morgan	1.473	(6.684)	NEPES Corp	Citibank	(5.263)
(1.881)	ITM Semiconductor Co Ltd	Citibank	(1.815)	(31)	NEPES Corp	JP Morgan	(16)
11.988	JB Financial Group Co Ltd	HSBC	209	(676)	Netmarble Corp	Citibank	(2.073)
1.918	JR Reit XXVII (REIT)	JP Morgan	281	2.812	NH Investment & Securities Co Ltd	JP Morgan	(679)
84	JYP Entertainment Corp	JP Morgan	92	1.978	NICE Information Service Co Ltd	HSBC	234
(587)	Kakao Corp	JP Morgan	(4.835)	(324)	NongShim Co Ltd	Citibank	(101)
(2.399)	Kangwon Land Inc	JP Morgan	(5.724)	(330)	NOVAREX Co Ltd	Citibank	37
2.250	KB Financial Group Inc	HSBC	(1.115)	(90)	NOVAREX Co Ltd	JP Morgan	(52)
(3.174)	KEPCO Engineering & Construction Co Inc	Citibank	(27.574)	(48)	OCI Co Ltd	JP Morgan	(187)
(384)	KEPCO Engineering & Construction Co Inc	JP Morgan	(7.399)	1.189	Optipharm Co Ltd	JP Morgan	1.741
(1.695)	KH Vatec Co Ltd	Citibank	(1.871)	(1.743)	Oscotec Inc	Citibank	(5.278)
462	Koh Young Technology Inc	HSBC	171	(113)	Oscotec Inc	JP Morgan	(293)
2.941	Koh Young Technology Inc	JP Morgan	1.436	1.441	Osstem Implant Co Ltd	Citibank	5.086
(558)	Kolmar BNH Co Ltd	Citibank	(281)	399	Osstem Implant Co Ltd	HSBC	223
(438)	Kolmar BNH Co Ltd	JP Morgan	(304)	(830)	Pan Ocean Co Ltd	Citibank	(132)
1.655	Kolon Industries Inc	Citibank	7.052	(11.086)	Pan Ocean Co Ltd	HSBC	5.602
3.693	Kolon Plastic Inc	JP Morgan	(1.004)	(5.241)	Paradise Co Ltd	Citibank	(7.382)
2.059	Komipharm International Co Ltd	Citibank	361	(3.732)	Paradise Co Ltd	JP Morgan	(4.832)
990	Korea Gas Corp	Citibank	1.648	(11.896)	Partron Co Ltd	Citibank	(4.764)
113	Korea Petrochemical Ind Co Ltd	JP Morgan	(169)	(5.844)	Partron Co Ltd	JP Morgan	(3.048)
(254)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Citibank	774	(1.058)	Pearl Abyss Corp	Citibank	(2.858)
(184)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	JP Morgan	2.420	(65)	Pearl Abyss Corp	JP Morgan	33
5.703	KT Corp	JP Morgan	22.431	(135)	People & Technology Inc	Citibank	(205)
2.283	KT Skylife Co Ltd	Citibank	1.812	446	PharmaResearch Co Ltd	Citibank	1.591
(13.729)	Kuk-il Paper Manufacturing Co Ltd	Citibank	1.603	(187)	PI Advanced Materials Co Ltd	Citibank	(224)
(3.825)	Kuk-il Paper Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	563	661	PI Advanced Materials Co Ltd	Citibank	732
6.629	Kumho Tire Co Inc	JP Morgan	3.881	(79)	PI Advanced Materials Co Ltd	JP Morgan	269
325	L&C Bio Co Ltd	JP Morgan	270	551	POSCO	HSBC	(25.281)
				16.145	Posco International Corp	Citibank	(2.865)
				412	Posco International Corp	JP Morgan	(307)
				(2.983)	RFHIC Corp	Citibank	(7.631)
				(30)	RFHIC Corp	JP Morgan	(48)
				(458)	Sam Chun Dang Pharm Co Ltd	JP Morgan	1.971
				1	Samsung Biologics Co Ltd	Citibank	(1)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Corée du Sud suite				Taiwan suite			
(63)	Samsung C&T Corp	JP Morgan	(132)	1.000	Advanced Ceramic X Corp	HSBC	740
4.722	Samsung Card Co Ltd	HSBC	(2.180)	4.000	Advanced Ceramic X Corp	JP Morgan	3.155
2.875	Samsung Electronics Co Ltd	JP Morgan	(6.482)	(42.000)	Advanced Wireless Semiconductor Co	Citibank	(22.907)
761	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	JP Morgan	3.415	(22.000)	Advanced Wireless Semiconductor Co	JP Morgan	(16.303)
(1.833)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	HSBC	(58)	3.000	Advantech Co Ltd	Citibank	591
(130)	Samsung SDI Co Ltd	JP Morgan	2.351	(90.000)	Aerospace Industrial Development Corp	Citibank	(2.552)
(843)	Samyang Foods Co Ltd	Citibank	(5.224)	(172.000)	Aerospace Industrial Development Corp	JP Morgan	3.462
(33)	Samyang Holdings Corp	JP Morgan	205	1.000	Airtac International Group	Citibank	(1.243)
(944)	Sang-A Frontec Co Ltd	Citibank	(3.508)	1.000	Airtac International Group	JP Morgan	(3.286)
(112)	Sang-A Frontec Co Ltd	JP Morgan	(331)	1.000	Alchip Technologies Ltd	Citibank	3.942
490	SaraminHR Co Ltd	JP Morgan	1.218	(2.000)	Alltop Technology Co Ltd	Citibank	(372)
2.994	Seah Besteel Corp	Citibank	(807)	(105.000)	Alpha Networks Inc	Citibank	(5.420)
84	SeAH Steel Corp	Citibank	375	(29.000)	Alpha Networks Inc	JP Morgan	1.884
(577)	Seojin System Co Ltd	Citibank	(2.062)	(6.000)	Ample Electronic Technology Co Ltd	Citibank	(3.104)
245	Seoul Broadcasting System Ltd	JP Morgan	1.018	(1.000)	Ample Electronic Technology Co Ltd	JP Morgan	(98)
(7.972)	Seoul Semiconductor Co Ltd	Citibank	(2.565)	(4.000)	AP Memory Technology Corp	JP Morgan	(8.521)
(521)	SFA Engineering Corp	HSBC	67	11.000	Apex International Co Ltd	Citibank	1.376
(15.555)	SFA Semicon Co Ltd	Citibank	(1.728)	(13.000)	Apex International Co Ltd	Citibank	(1.626)
(810)	SFA Semicon Co Ltd	JP Morgan	(73)	61.000	Arcadyan Technology Corp	Citibank	10.678
9.117	Shinhan Financial Group Co Ltd	Citibank	16.704	14.000	Arcadyan Technology Corp	HSBC	(191)
742	Shinsegae Food Co Ltd	JP Morgan	5.053	25.000	Arcadyan Technology Corp	JP Morgan	(86)
97	Shinsegae International Inc	JP Morgan	1.533	3.000	Argosy Research Inc	Citibank	1.006
87	Silicon Works Co Ltd	JP Morgan	535	1.000	Argosy Research Inc	JP Morgan	(87)
61	SK Gas Ltd	Citibank	275	(13.000)	ASE Technology Holding Co Ltd	JP Morgan	(3.607)
3.069	SK IE Technology Co Ltd	Citibank	23.577	8.000	Asia Optical Co Inc	Citibank	1.606
(175)	SK Materials Co Ltd	Citibank	(783)	10.000	Asia Optical Co Inc	HSBC	39
389	SK Telecom Co Ltd	Citibank	2.448	24.000	Asia Optical Co Inc	JP Morgan	1.086
(185)	SKC Co Ltd	Citibank	107	15.000	Asia Polymer Corp	Citibank	2.439
3.322	SL Corp	JP Morgan	11.334	33.000	Asia Polymer Corp	HSBC	816
(388)	SM Entertainment Co Ltd	Citibank	(1.457)	14.000	Asia Polymer Corp	JP Morgan	392
(73)	SM Entertainment Co Ltd	JP Morgan	(734)	(1.000)	Asia Vital Components Co Ltd	Citibank	(272)
2.329	SM Entertainment Co Ltd	JP Morgan	8.721	(27.000)	Asia Vital Components Co Ltd	JP Morgan	(4.802)
(1.241)	Soulbrain Co Ltd	Citibank	(5.644)	(2.000)	ASROCK Inc	Citibank	(680)
540	SPC Samlip Co Ltd	JP Morgan	2.611	(6.000)	ASROCK Inc	JP Morgan	3.080
(319)	ST Pharm Co Ltd	Citibank	(3.507)	8.000	Asustek Computer Inc	Citibank	2.822
(25)	ST Pharm Co Ltd	JP Morgan	(132)	1.000	Asustek Computer Inc	HSBC	393
14	Taekwang Industrial Co Ltd	JP Morgan	1.216	1.000	Asustek Computer Inc	JP Morgan	434
(1.055)	TES Co Ltd	Citibank	(138)	10.000	AU Optronics Corp	Citibank	1.323
(458)	TES Co Ltd	JP Morgan	1.245	1.000	AU Optronics Corp	HSBC	156
(4.680)	Toptec Co Ltd	Citibank	(1.543)	25.000	AU Optronics Corp	JP Morgan	(656)
2.458	Value Added Technology Co Ltd	JP Morgan	1.489	(17.000)	AURAS Technology Co Ltd	Citibank	(11.362)
(678)	Wemade Co Ltd	Citibank	(4.665)	(3.000)	AURAS Technology Co Ltd	JP Morgan	(1.219)
2.290	Whanin Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	2.169	(139.000)	BES Engineering Corp	JP Morgan	4.074
(36.968)	Wonik Holdings Co Ltd	Citibank	(850)	13.000	Bizlink Holding Inc	Citibank	5.348
(312)	WONIK IPS Co Ltd	Citibank	(327)	6.000	Bizlink Holding Inc	HSBC	(2.091)
(284)	WONIK IPS Co Ltd	JP Morgan	429	17.000	Bizlink Holding Inc	JP Morgan	(5.471)
18.395	Woori Financial Group Inc	HSBC	(2.013)	(3.690)	Brave C&H Supply Co Ltd	HSBC	1.811
710	YG Entertainment Inc	JP Morgan	5.080	(244.000)	Capital Securities Corp	JP Morgan	2.802
5.272	Yonwoo Co Ltd	JP Morgan	8.863	(107.000)	Career Technology MFG. Co Ltd	Citibank	(3.304)
1.851	Youngone Corp	JP Morgan	(76)	(165.000)	Career Technology MFG. Co Ltd	JP Morgan	12.982
(791)	Yuhan Corp	HSBC	(757)	(2.000)	Caswell Inc	JP Morgan	(1.657)
(52)	Zinus Inc	Citibank	(605)	(1.000)	Catcher Technology Co Ltd	Citibank	(153)
			(9.365)	(28.000)	Catcher Technology Co Ltd	JP Morgan	5.114
(43.000)	AcBel Polytech Inc	Citibank	(1.500)	6.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	HSBC	(407)
(68.000)	AcBel Polytech Inc	JP Morgan	3.844	(8.000)	Center Laboratories Inc	Citibank	248
(12.000)	Accton Technology Corp	Citibank	(1.624)	(35.000)	Center Laboratories Inc	JP Morgan	(4.394)
47.000	Acer Inc	Citibank	2.089				
81.000	Acer Inc	HSBC	(8.922)				
2.000	Acer Inc	JP Morgan	(213)				
(15.000)	ACES Electronic Co Ltd	JP Morgan	(2.618)				
(8.000)	ADATA Technology Co Ltd	JP Morgan	(3.986)				
2.000	Advanced Ceramic X Corp	Citibank	3.860				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
(63.000)	Century Iron & Steel Industrial Co Ltd	Citibank	(18.846)	(41.000)	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp	JP Morgan	(240)
(48.000)	Century Iron & Steel Industrial Co Ltd	JP Morgan	18.682	(32.000)	CMC Magnetics Corp	JP Morgan	34
(292.000)	Chang Hwa Commercial Bank Ltd	JP Morgan	10.212	87.000	Compal Electronics Inc	Citibank	1.365
(61.000)	Chenbro Micom Co Ltd	Citibank	5.848	10.000	Compal Electronics Inc	HSBC	(243)
(35.000)	Chenbro Micom Co Ltd	JP Morgan	9.897	3.000	Compal Electronics Inc	JP Morgan	(65)
7.000	Cheng Loong Corp	Citibank	(136)	(17.000)	Compeq Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	32
18.000	Cheng Loong Corp	HSBC	(3.038)	(13.000)	Continental Holdings Corp	Citibank	(119)
21.000	Cheng Loong Corp	JP Morgan	(3.443)	(109.000)	Continental Holdings Corp	JP Morgan	14.358
21.000	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	Citibank	1.972	(77.138)	CSBC Corp Taiwan	Citibank	218
(7.000)	Cheng Uei Precision Industry Co Ltd	Citibank	(399)	(30.591)	CSBC Corp Taiwan	JP Morgan	2.601
(20.000)	Cheng Uei Precision Industry Co Ltd	JP Morgan	(1.715)	36.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	Citibank	1.074
(3.000)	Chia Hsin Cement Corp	Citibank	(99)	42.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	HSBC	(1.101)
(45.000)	Chia Hsin Cement Corp	JP Morgan	(1.092)	256.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	(6.069)
23.045	Chicony Electronics Co Ltd	Citibank	1.119	(1.091)	Cub Elecparts Inc	JP Morgan	1.190
2.010	Chicony Electronics Co Ltd	HSBC	(276)	(3.000)	Cyberlink Corp	JP Morgan	197
4.175	Chicony Electronics Co Ltd	JP Morgan	(538)	(3.000)	DA CIN Construction Co Ltd	Citibank	(71)
2.000	Chief Telecom Inc	Citibank	524	(1.000)	DA CIN Construction Co Ltd	JP Morgan	97
2.000	Chief Telecom Inc	JP Morgan	1.163	(46.000)	Da-Li Development Co Ltd	Citibank	(1.666)
(2.000)	Chilisin Electronics Corp	Citibank	(574)	(11.000)	Da-Li Development Co Ltd	JP Morgan	195
(7.000)	Chilisin Electronics Corp	JP Morgan	343	8.000	Darwin Precisions Corp	Citibank	220
104.000	China Development Financial Holding Corp	Citibank	2.059	5.000	Darwin Precisions Corp	HSBC	(305)
19.000	China Development Financial Holding Corp	HSBC	(552)	3.000	Darwin Precisions Corp	JP Morgan	(178)
368.000	China Development Financial Holding Corp	JP Morgan	(10.173)	2.000	Delta Electronics Inc	Citibank	1.048
46.000	China General Plastics Corp	Citibank	6.153	3.000	Delta Electronics Inc	HSBC	1.154
2.000	China General Plastics Corp	HSBC	(74)	16.000	Delta Electronics Inc	JP Morgan	6.635
28.000	China General Plastics Corp	JP Morgan	(935)	(6.000)	Dyaco International Inc	Citibank	(735)
(46.000)	China Life Insurance Co Ltd	JP Morgan	2.628	23.000	E Ink Holdings Inc	Citibank	4.000
(11.000)	China Man-Made Fiber Corp	JP Morgan	(438)	2.000	E Ink Holdings Inc	HSBC	170
(127.000)	China Petrochemical Development Corp	JP Morgan	4.080	7.000	E Ink Holdings Inc	JP Morgan	638
20.000	China Steel Chemical Corp	Citibank	1.662	(113.000)	E.Sun Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	3.992
1.000	China Steel Chemical Corp	HSBC	(349)	5.000	Eclat Textile Co Ltd	Citibank	(728)
44.000	China Steel Chemical Corp	JP Morgan	(14.807)	1.000	Eclat Textile Co Ltd	HSBC	1.323
114.000	China Steel Corp	Citibank	7.769	1.000	Eclat Textile Co Ltd	JP Morgan	1.387
18.000	China Steel Corp	HSBC	(5.033)	(24.000)	Egis Technology Inc	Citibank	(6.043)
39.000	China Steel Corp	JP Morgan	(10.721)	24.000	Elan Microelectronics Corp	Citibank	7.382
(24.000)	Chin-Poon Industrial Co Ltd	JP Morgan	1.764	15.000	Elan Microelectronics Corp	HSBC	8.666
152.000	Chipbond Technology Corp	Citibank	21.975	14.000	Elan Microelectronics Corp	JP Morgan	8.376
37.000	Chipbond Technology Corp	HSBC	(2.917)	(1.000)	Elite Material Co Ltd	Citibank	(269)
168.000	Chipbond Technology Corp	JP Morgan	(12.001)	(17.000)	Elite Semiconductor Microelectronics Technology Inc	Citibank	(11.345)
84.000	ChipMOS Technologies Inc	Citibank	9.950	(9.000)	Elite Semiconductor Microelectronics Technology Inc	JP Morgan	681
85.000	ChipMOS Technologies Inc	HSBC	3.173	2.000	eMemory Technology Inc	Citibank	4.050
82.000	ChipMOS Technologies Inc	JP Morgan	6.109	1.000	eMemory Technology Inc	JP Morgan	(726)
12.000	Chilitina Holding Ltd	Citibank	1.324	2.000	Ennoconn Corp	Citibank	1.080
2.000	Chilitina Holding Ltd	HSBC	76	4.000	Ennoconn Corp	JP Morgan	3.166
8.000	Chilitina Holding Ltd	JP Morgan	481	(43.500)	ENNOSTAR Inc	JP Morgan	28
(66.000)	Chong Hong Construction Co Ltd	Citibank	(3.706)	9.000	Eurocharm Holdings Co Ltd	Citibank	1.191
(9.000)	Chong Hong Construction Co Ltd	JP Morgan	182	18.000	Eurocharm Holdings Co Ltd	HSBC	4.980
(1.000)	Chroma ATE Inc	JP Morgan	(339)	5.000	Eurocharm Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.560)
(147.000)	Chun Yuan Steel Industry Co Ltd	Citibank	(9.795)	37.000	Eva Airways Corp	Citibank	2.594
(12.000)	Chun Yuan Steel Industry Co Ltd	JP Morgan	1.805	7.000	Eva Airways Corp	HSBC	(94)
9.000	Chung Hung Steel Corp	Citibank	2.575	57.000	Eva Airways Corp	JP Morgan	(662)
1.000	Chung Hung Steel Corp	HSBC	446	6.000	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	Citibank	2.880
31.000	Chung Hung Steel Corp	JP Morgan	965	1.000	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	HSBC	210
(10.000)	Chung Hwa Pulp Corp	JP Morgan	(507)	19.000	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	JP Morgan	4.170
				38.000	Everlight Electronics Co Ltd	Citibank	1.922

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
27.000	Everlight Electronics Co Ltd	HSBC	1.689	3.000	Getac Technology Corp	JP Morgan	(297)
12.000	Everlight Electronics Co Ltd	JP Morgan	806	3.000	Giant Manufacturing Co Ltd	Citibank	1.188
101.000	Far Eastern New Century Corp	Citibank	5.383	2.000	Giant Manufacturing Co Ltd	HSBC	1.066
22.000	Far Eastern New Century Corp	HSBC	(1.594)	2.000	Giant Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	295
75.000	Far Eastern New Century Corp	JP Morgan	(3.384)	26.000	Gigabyte Technology Co Ltd	Citibank	11.400
7.000	Far EasTone			10.000	Gigabyte Technology Co Ltd	HSBC	(6.179)
1.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Citibank	248	21.000	Gigabyte Technology Co Ltd	JP Morgan	(12.695)
	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	HSBC	(40)	(1.000)	Gigasolar Materials Corp	JP Morgan	175
53.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	JP Morgan	(1.773)	10.000	Ginko International Co Ltd	Citibank	2.551
119.000	Faraday Technology Corp	Citibank	33.391	5.000	Ginko International Co Ltd	HSBC	770
22.000	Faraday Technology Corp	HSBC	2.091	17.000	Ginko International Co Ltd	JP Morgan	3.693
19.000	Faraday Technology Corp	JP Morgan	5.468	(2.000)	Global Lighting Technologies Inc	Citibank	(593)
(19.000)	Farglory Land Development Co Ltd	Citibank	(527)	1.000	Global PMX Co Ltd	Citibank	3
(69.000)	Farglory Land Development Co Ltd	JP Morgan	229	1.000	Global PMX Co Ltd	HSBC	(170)
7.000	Feng Hsin Steel Co Ltd	HSBC	(1.923)	1.000	Global PMX Co Ltd	JP Morgan	(152)
(11.600)	Feng TAY Enterprise Co Ltd	Citibank	(9.117)	1.000	Global Unichip Corp	Citibank	445
(1.000)	Feng TAY Enterprise Co Ltd	JP Morgan	(1.183)	4.000	Global Unichip Corp	HSBC	(982)
(381.970)	First Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	7.835	(4.000)	Globalwafers Co Ltd	Citibank	(15.219)
(35.000)	FLEXium Interconnect Inc	Citibank	(6.217)	(2.000)	Gold Circuit Electronics Ltd	Citibank	(249)
(40.000)	FLEXium Interconnect Inc	JP Morgan	(10.677)	(25.000)	Gold Circuit Electronics Ltd	JP Morgan	(4.277)
(3.501)	FocalTech Systems Co Ltd	JP Morgan	(4.166)	(164.000)	Goldsun Building Materials Co Ltd	Citibank	(10.648)
(5.473)	Formosa Tech Co Ltd	Citibank	(1.340)	(53.107)	Goldsun Building Materials Co Ltd	JP Morgan	2.733
10.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	JP Morgan	1.286	(2.000)	Good Way Technology Co Ltd	Citibank	(69)
1.000	Formosa International Hotels Corp	JP Morgan	(163)	7.000	Gourmet Master Co Ltd	Citibank	4.021
(52.000)	Formosa Petrochemical Corp	JP Morgan	12.051	10.000	Gourmet Master Co Ltd	HSBC	(4.588)
24.000	Formosa Plastics Corp	Citibank	2.267	5.000	Gourmet Master Co Ltd	JP Morgan	(2.200)
3.000	Formosa Plastics Corp	HSBC	862	43.000	Grand Pacific Petrochemical	Citibank	3.047
4.000	Formosa Plastics Corp	JP Morgan	(205)	1.000	Grand Pacific Petrochemical	HSBC	(68)
(5.000)	Formosa Sumco Technology Corp	Citibank	(2.607)	4.000	Grand Pacific Petrochemical	JP Morgan	(261)
(1.000)	Formosa Sumco Technology Corp	JP Morgan	(529)	13.000	Great Wall Enterprise Co Ltd	Citibank	888
(39.000)	Fortune Electric Co Ltd	Citibank	(3.786)	1.000	Great Wall Enterprise Co Ltd	HSBC	47
(36.000)	Fortune Electric Co Ltd	JP Morgan	5.919	10.000	Great Wall Enterprise Co Ltd	JP Morgan	(790)
(50.000)	Foxconn Technology Co Ltd	Citibank	(4.658)	63.000	Greatek Electronics Inc	Citibank	11.144
(48.000)	Foxconn Technology Co Ltd	JP Morgan	(992)	1.000	Greatek Electronics Inc	HSBC	70
(1.000)	Foxsemicon Integrated Technology Inc	JP Morgan	(679)	34.000	Greatek Electronics Inc	JP Morgan	3.270
(38.000)	Fubon Financial Holding Co Ltd	Citibank	(1.617)	(2.000)	Gudeng Precision Industrial Co Ltd	JP Morgan	(4.218)
(39.000)	Fubon Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	4.965	(75.000)	Hannstar Board Corp	JP Morgan	655
6.000	Fulgent Sun International Holding Co Ltd	Citibank	1.181	(25.000)	HannStar Display Corp	Citibank	(3.568)
12.000	Fulgent Sun International Holding Co Ltd	HSBC	11.608	(132.000)	HannStar Display Corp	JP Morgan	(9.624)
13.000	Fulgent Sun International Holding Co Ltd	JP Morgan	10.783	(1.000)	Highwealth Construction Corp	JP Morgan	(9)
(28.000)	Gamania Digital Entertainment Co Ltd	Citibank	910	2.000	Hiwin Technologies Corp	Citibank	1.648
(50.000)	Gamania Digital Entertainment Co Ltd	JP Morgan	(2.092)	3.000	Hiwin Technologies Corp	HSBC	(137)
5.000	General Interface Solution Holding Ltd	Citibank	270	1.000	Hiwin Technologies Corp	JP Morgan	(7)
5.000	General Interface Solution Holding Ltd	JP Morgan	(2.435)	23.000	Holtek Semiconductor Inc	Citibank	4.659
(2.000)	Genius Electronic Optical Co Ltd	JP Morgan	585	27.000	Holtek Semiconductor Inc	HSBC	(1.844)
25.000	Getac Technology Corp	Citibank	2.179	28.000	Holtek Semiconductor Inc	JP Morgan	(419)
27.000	Getac Technology Corp	HSBC	(2.831)	(4.000)	Holy Stone Enterprise Co Ltd	JP Morgan	(2.225)
				5.000	Hota Industrial Manufacturing Co Ltd	HSBC	(846)
				2.000	Hota Industrial Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(317)
				8.000	Hotai Finance Co Ltd	Citibank	1.152
				4.000	Hotai Finance Co Ltd	HSBC	(170)
				4.000	Hotai Finance Co Ltd	JP Morgan	(135)
				(5.000)	Hotai Motor Co Ltd	JP Morgan	5.036
				(17.000)	HTC Corp	Citibank	(1.372)
				(32.000)	HTC Corp	JP Morgan	631
				3.000	Hu Lane Associate Inc	Citibank	245
				5.000	Hu Lane Associate Inc	HSBC	(760)
				6.000	Hu Lane Associate Inc	JP Morgan	2.140

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
(778.811)	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	JP Morgan	18.455	(22.000)	Longchen Paper & Packaging Co Ltd	Citibank	(975)
(15.000)	Huaku Development Co Ltd	JP Morgan	(38)	(83.000)	Longchen Paper & Packaging Co Ltd	JP Morgan	11.924
7.000	Innolux Corp	Citibank	714	(51.000)	LuxNet Corp	Citibank	(1.714)
1.000	Innolux Corp	HSBC	(33)	(21.000)	LuxNet Corp	JP Morgan	714
14.000	Innolux Corp	JP Morgan	(426)	(2.000)	M31 Technology Corp	Citibank	(982)
(37.000)	International CSRC Investment Holdings Co	Citibank	(4.283)	28.000	Macauto Industrial Co Ltd	Citibank	2.199
(12.000)	International CSRC Investment Holdings Co	JP Morgan	933	1.000	Macauto Industrial Co Ltd	HSBC	(152)
2.000	International Games System Co Ltd	Citibank	7.752	27.000	Macauto Industrial Co Ltd	JP Morgan	(3.851)
1.000	International Games System Co Ltd	JP Morgan	6.748	106.000	Macronix International Co Ltd	Citibank	13.917
(128.000)	Inventec Corp	Citibank	(2.372)	5.000	Macronix International Co Ltd	HSBC	1.312
(9.000)	Inventec Corp	HSBC	164	7.000	Macronix International Co Ltd	JP Morgan	1.291
(66.000)	Inventec Corp	JP Morgan	1.023	6.600	Makalot Industrial Co Ltd	Citibank	816
(3.000)	ITEQ Corp	JP Morgan	720	1.300	Makalot Industrial Co Ltd	HSBC	775
(3.000)	Jarlllytec Co Ltd	JP Morgan	68	13.251	Makalot Industrial Co Ltd	JP Morgan	8.272
(3.000)	Jentech Precision Industrial Co Ltd	JP Morgan	(5.320)	(18.000)	Marketech International Corp	JP Morgan	4.800
(115.000)	Jih Sun Financial Holdings Co Ltd	Citibank	(859)	1.000	MediaTek Inc	Citibank	2.299
(2)	Jih Sun Financial Holdings Co Ltd ^{tr}	JP Morgan	—	1.000	MediaTek Inc	HSBC	841
(5.750)	Jinan Acetate Chemical Co Ltd	Citibank	(268)	5.000	MediaTek Inc	JP Morgan	4.716
(40.000)	Johnson Health Tech Co Ltd	Citibank	(3.108)	(94.000)	Mega Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	(1.493)
(12.000)	Johnson Health Tech Co Ltd	JP Morgan	293	12.000	Merida Industry Co Ltd	Citibank	8.789
(24.000)	Kindom Development Co Ltd	Citibank	(525)	10.000	Merida Industry Co Ltd	HSBC	2.479
(70.000)	Kindom Development Co Ltd	JP Morgan	9.853	3.000	Merida Industry Co Ltd	JP Morgan	843
(1.000)	King Slide Works Co Ltd	Citibank	64	(14.000)	Merry Electronics Co Ltd	Citibank	(2.415)
62.000	King Yuan Electronics Co Ltd	Citibank	6.836	(1.000)	Merry Electronics Co Ltd	JP Morgan	(58)
52.000	King Yuan Electronics Co Ltd	HSBC	(7.440)	(9.000)	Microbio Co Ltd	Citibank	(189)
84.000	King Yuan Electronics Co Ltd	JP Morgan	(5.558)	(39.000)	Microbio Co Ltd	JP Morgan	10.237
(14.000)	Kinik Co	JP Morgan	1.522	6.000	Micro-Star International Co Ltd	Citibank	(108)
10.000	Kinsus Interconnect Technology Corp	Citibank	5.313	6.000	Micro-Star International Co Ltd	JP Morgan	360
11.000	Kinsus Interconnect Technology Corp	HSBC	5.582	(36.000)	Mitac Holdings Corp	Citibank	(833)
7.000	Kinsus Interconnect Technology Corp	JP Morgan	3.526	(228.000)	Mitac Holdings Corp	JP Morgan	4.152
2.000	KMC Kuei Meng International Inc	Citibank	708	1.000	momo.com Inc	Citibank	1.261
2.000	KMC Kuei Meng International Inc	HSBC	450	80.000	Namchow Holdings Co Ltd	Citibank	5.725
13.000	KMC Kuei Meng International Inc	JP Morgan	3.233	(9.000)	Nan Liu Enterprise Co Ltd	Citibank	(7)
(11.000)	Kuoyang Construction Co Ltd	Citibank	(325)	10.000	Nan Ya Plastics Corp	Citibank	1.338
(1.000)	Kuoyang Construction Co Ltd	JP Morgan	96	18.000	Nan Ya Plastics Corp	HSBC	(2.572)
(5.000)	LandMark Optoelectronics Corp	Citibank	(3.244)	13.000	Nan Ya Plastics Corp	JP Morgan	(1.737)
(10.000)	LandMark Optoelectronics Corp	JP Morgan	(7.098)	(51.126)	Newmax Technology Co Ltd	Citibank	(6.838)
(100.000)	Lealea Enterprise Co Ltd	JP Morgan	(774)	(23.000)	Newmax Technology Co Ltd	JP Morgan	1.406
(46.000)	Leatec Fine Ceramics Co Ltd	JP Morgan	2.317	(15.000)	Nidec Chaun-Choung Technology Corp	Citibank	5.645
(158.000)	Lien Hwa Industrial Holdings Corp	Citibank	(7.599)	(1.000)	Nidec Chaun-Choung Technology Corp	JP Morgan	427
(43.000)	Lien Hwa Industrial Holdings Corp	JP Morgan	(155)	3.000	Novatek Microelectronics Corp	Citibank	5.697
58.000	Lite-On Technology Corp	Citibank	7.916	1.000	Novatek Microelectronics Corp	HSBC	(253)
1.000	Lite-On Technology Corp	HSBC	25	3.000	Novatek Microelectronics Corp	JP Morgan	(588)
15.000	Lite-On Technology Corp	JP Morgan	476	(2.000)	Oneness Biotech Co Ltd	JP Morgan	1.641
				4.000	Oriental Union Chemical Corp	Citibank	160
				5.000	Oriental Union Chemical Corp	HSBC	315
				30.000	Oriental Union Chemical Corp	JP Morgan	2.651
				(9.000)	Pan-International Industrial Corp	Citibank	(527)
				2.000	Parade Technologies Ltd	Citibank	9.220
				2.000	Parade Technologies Ltd	HSBC	10.526
				4.000	Parade Technologies Ltd	JP Morgan	26.993
				(4.000)	PChome Online Inc	Citibank	1.762

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
(24.000)	Pegatron Corp	Citibank	(1.463)	1.000	Sitronix Technology Corp	JP Morgan	1.057
(6.000)	Pegatron Corp	JP Morgan	(788)	(9.000)	Soft-World International Corp	JP Morgan	1.261
2.000	Pegavision Corp	Citibank	3.066	(1.000)	Solar Applied Materials Technology Corp	Citibank	(146)
1.000	Pegavision Corp	HSBC	1.288	(16.000)	Solar Applied Materials Technology Corp	JP Morgan	1.581
2.000	Pegavision Corp	JP Morgan	5.621	(1.000)	Sonix Technology Co Ltd	JP Morgan	(148)
1.000	Phison Electronics Corp	JP Morgan	1.621	(17.000)	Speed Tech Corp	Citibank	(2.766)
6.000	Pixart Imaging Inc	Citibank	1.332	(17.000)	Speed Tech Corp	JP Morgan	(2.202)
5.000	Pixart Imaging Inc	JP Morgan	4.335	5.000	Sporton International Inc	Citibank	618
(4.000)	Powertech Technology Inc	JP Morgan	(446)	1.000	Sporton International Inc	JP Morgan	(522)
(11.000)	President Chain Store Corp	HSBC	2.190	2.000	St Shine Optical Co Ltd	Citibank	1.296
(6.000)	President Chain Store Corp	JP Morgan	1.024	3.000	St Shine Optical Co Ltd	HSBC	(1.383)
(56.000)	President Securities Corp	Citibank	(3.711)	5.000	St Shine Optical Co Ltd	JP Morgan	(2.144)
(129.000)	President Securities Corp	JP Morgan	7.186	(6.000)	Sunny Friend Environmental Technology Co Ltd	Citibank	(1.423)
108.000	Primax Electronics Ltd	Citibank	9.094	(30.000)	Sunny Friend Environmental Technology Co Ltd	JP Morgan	7.301
6.000	Primax Electronics Ltd	HSBC	(606)	(4.000)	Sunonwealth Electric Machine Industry Co Ltd	Citibank	(191)
114.000	Primax Electronics Ltd	JP Morgan	(10.831)	(13.000)	Sunonwealth Electric Machine Industry Co Ltd	JP Morgan	1.422
3.000	Qisda Corp	Citibank	196	(31.000)	Sunrex Technology Corp	Citibank	(645)
8.000	Qisda Corp	HSBC	(956)	(17.000)	Sunrex Technology Corp	JP Morgan	3.063
22.000	Qisda Corp	JP Morgan	(2.549)	1.000	Supreme Electronics Co Ltd	Citibank	64
5.000	Quanta Computer Inc	Citibank	519	(30.000)	Swancor Holding Co Ltd	Citibank	(2.610)
5.000	Quanta Computer Inc	HSBC	(743)	(3.000)	Swancor Holding Co Ltd	JP Morgan	2.558
59.000	Quanta Computer Inc	JP Morgan	(8.188)	(3.000)	System Corp	Citibank	(255)
(30.000)	Radiant Opto-Electronics Corp	Citibank	(3.705)	(13.000)	System Corp	JP Morgan	1.208
(7.000)	Radiant Opto-Electronics Corp	JP Morgan	(659)	3.000	T3EX Global Holdings Corp	Citibank	3.464
2.000	Realtek Semiconductor Corp	Citibank	3.767	3.000	T3EX Global Holdings Corp	JP Morgan	2.640
4.000	Realtek Semiconductor Corp	HSBC	(186)	18.000	TA Chen Stainless Pipe	Citibank	3.126
5.000	Realtek Semiconductor Corp	JP Morgan	1.708	25.000	TA Chen Stainless Pipe	HSBC	4.391
(2.000)	RichWave Technology Corp	Citibank	(3.283)	(207.000)	Taishin Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	1.831
(1.000)	RichWave Technology Corp	JP Morgan	(2.559)	(164.850)	Taiwan Business Bank	Citibank	(2.113)
16.000	Ritek Corp	Citibank	408	(245.700)	Taiwan Business Bank	JP Morgan	3.880
23.000	Ritek Corp	JP Morgan	(904)	(23.000)	Taiwan Cement Corp	JP Morgan	(1.692)
(25.840)	Ruentex Development Co Ltd	JP Morgan	1.442	(83.000)	Taiwan Cogeneration Corp	Citibank	(2.167)
(17.000)	Ruentex Industries Ltd	JP Morgan	219	(70.000)	Taiwan Cogeneration Corp	JP Morgan	1.998
(26.000)	Savior Lifetec Corp	Citibank	(97)	18.050	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	Citibank	360
(21.000)	Savior Lifetec Corp	JP Morgan	302	1.680	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	HSBC	(39)
(12.000)	ScinoPharm Taiwan Ltd	JP Morgan	(556)	209.090	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	(4.370)
(19.000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	Citibank	(1.060)	(34.000)	Taiwan Fertilizer Co Ltd	Citibank	(1.315)
(161.000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	JP Morgan	(7.910)	(1.000)	Taiwan Fertilizer Co Ltd	HSBC	233
(15.000)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	HSBC	95	(119.000)	Taiwan Fertilizer Co Ltd	JP Morgan	18.822
(785.000)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	4.106	(25.000)	Taiwan Glass Industry Corp	Citibank	(3.359)
(1.000)	ShunSin Technology Holding Ltd	JP Morgan	(274)	(80.000)	Taiwan Glass Industry Corp	JP Morgan	10.144
(15.000)	Silicon Optronics Inc	Citibank	(11.363)	(13.000)	Taiwan High Speed Rail Corp	JP Morgan	697
5.000	Simplo Technology Co Ltd	Citibank	2.861	37.000	Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	Citibank	1.946
8.000	Simplo Technology Co Ltd	HSBC	1.211	25.000	Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	HSBC	(4.382)
16.000	Simplo Technology Co Ltd	JP Morgan	3.030	19.000	Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	JP Morgan	(3.180)
(8.000)	Sinbon Electronics Co Ltd	JP Morgan	(11.075)	(28.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	Citibank	(1.739)
(14.000)	Sincere Navigation Corp	Citibank	114	(1.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	HSBC	(27)
(40.000)	Sincere Navigation Corp	JP Morgan	12.231	(1.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	JP Morgan	(37)
(14.000)	Sino-American Silicon Products Inc	Citibank	(7.301)	18.000	Taiwan Navigation Co Ltd	Citibank	721
(14.000)	Sino-American Silicon Products Inc	JP Morgan	456	1.000	Taiwan Navigation Co Ltd	JP Morgan	(434)
33.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	Citibank	551	74.000	Taiwan Paiho Ltd	Citibank	4.169
5.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	HSBC	(63)	7.000	Taiwan Paiho Ltd	HSBC	(677)
315.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	JP Morgan	(3.497)	32.000	Taiwan Paiho Ltd	JP Morgan	(2.766)
1.000	Sitronix Technology Corp	Citibank	1.111	1.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Citibank	1.301

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
1.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	HSBC	447	7.000	Vanguard International Semiconductor Corp	Citibank	2.868
2.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	1.017	14.000	Vanguard International Semiconductor Corp	HSBC	2.203
10.000	Taiwan Surface Mounting Technology Corp	Citibank	3.208	34.000	Vanguard International Semiconductor Corp	JP Morgan	5.757
21.000	Taiwan Union Technology Corp	Citibank	7.658	(4.000)	Via Technologies Inc	HSBC	652
1.000	Taiwan Union Technology Corp	HSBC	46	41.000	Visual Photonics Epitaxy Co Ltd	Citibank	22.442
17.000	Taiwan Union Technology Corp	JP Morgan	3.660	10.000	Visual Photonics Epitaxy Co Ltd	HSBC	1.382
5.000	Teco Electric and Machinery Co Ltd	Citibank	359	40.000	Visual Photonics Epitaxy Co Ltd	JP Morgan	5.988
27.000	Teco Electric and Machinery Co Ltd	HSBC	(158)	9.000	Wafer Works Corp	Citibank	2.362
3.000	Teco Electric and Machinery Co Ltd	JP Morgan	253	2.000	Wafer Works Corp	JP Morgan	555
(2.000)	Thermaltake Technology Co Ltd	Citibank	(163)	8.000	Wah Lee Industrial Corp	Citibank	818
175.000	Ton Yi Industrial Corp	Citibank	2.265	2.000	Wah Lee Industrial Corp	HSBC	13
159.000	Ton Yi Industrial Corp	JP Morgan	(16.896)	1.000	Wah Lee Industrial Corp	JP Morgan	15
(2.000)	Topkey Corp	JP Morgan	(815)	(51.000)	Walsin Lihwa Corp	JP Morgan	(7.283)
25.000	Topoint Technology Co Ltd	Citibank	1.060	(4.000)	Walsin Technology Corp	JP Morgan	1.409
2.000	Topoint Technology Co Ltd	HSBC	68	(8.000)	Win Semiconductors Corp	Citibank	(5.013)
55.000	Topoint Technology Co Ltd	JP Morgan	2.088	(60.000)	Winbond Electronics Corp	Citibank	(10.027)
32.000	TPK Holding Co Ltd	Citibank	1.508	(12.000)	Winbond Electronics Corp	JP Morgan	(733)
29.000	TPK Holding Co Ltd	HSBC	(5.900)	18.000	Wisdom Marine Lines Co Ltd	Citibank	(1.141)
16.000	TPK Holding Co Ltd	JP Morgan	(3.168)	14.000	Wisdom Marine Lines Co Ltd	HSBC	(3.624)
1.000	Transcend Information Inc	Citibank	71	25.000	Wisdom Marine Lines Co Ltd	JP Morgan	(6.276)
13.000	Transcend Information Inc	JP Morgan	(2.501)	(102.000)	Wistron Corp	Citibank	(6.673)
(5.000)	TrueLight Corp	Citibank	(345)	(51.000)	Wistron Corp	JP Morgan	240
(1.000)	TrueLight Corp	JP Morgan	(162)	(21.000)	Wistron NeWeb Corp	Citibank	(2.490)
(136.000)	TSEC Corp	Citibank	(7.563)	(25.000)	Wistron NeWeb Corp	JP Morgan	1.895
(11.000)	TSEC Corp	JP Morgan	2.113	(1.000)	Wiwynn Corp	JP Morgan	(991)
11.000	TSRC Corp	Citibank	879	2.000	Wowprime Corp	Citibank	1.056
30.000	TSRC Corp	HSBC	(6.763)	1.000	Wowprime Corp	JP Morgan	(413)
7.000	TSRC Corp	JP Morgan	(1.551)	(89.000)	WPG Holdings Ltd	Citibank	(10.314)
(4.000)	TTY Biopharm Co Ltd	JP Morgan	7	(41.000)	WPG Holdings Ltd	JP Morgan	(1.819)
57.000	Tung Ho Steel Enterprise Corp	Citibank	4.273	(37.000)	XinTec Inc	Citibank	(14.399)
31.000	Tung Ho Steel Enterprise Corp	HSBC	(11.917)	(37.000)	XinTec Inc	JP Morgan	(15.142)
179.000	Tung Ho Steel Enterprise Corp	JP Morgan	(67.702)	(1.000)	Yageo Corp	JP Morgan	28
17.000	TURVO International Co Ltd	Citibank	3.238	4.000	Yang Ming Marine Transport Corp	Citibank	1.526
7.000	TURVO International Co Ltd	HSBC	(4.582)	1.000	Yang Ming Marine Transport Corp	HSBC	99
53.000	TURVO International Co Ltd	JP Morgan	(29.927)	3.000	Yang Ming Marine Transport Corp	JP Morgan	329
20.000	TXC Corp	Citibank	12.710	(6.000)	Yen Sun Technology Corp	Citibank	(384)
1.000	TXC Corp	HSBC	299	(9.000)	Yen Sun Technology Corp	JP Morgan	(382)
2.000	TXC Corp	JP Morgan	620	(35.000)	Yieh Phui Enterprise Co Ltd	JP Morgan	4.888
(28.000)	Unimicron Technology Corp	JP Morgan	(12.213)	193.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	Citibank	6.318
1.000	Uni-President Enterprises Corp	Citibank	32	3.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	HSBC	(98)
1.000	Uni-President Enterprises Corp	JP Morgan	(30)	13.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	(389)
(45.000)	Unitech Printed Circuit Board Corp	Citibank	(2.267)	(5.000)	Yulon Finance Corp	JP Morgan	107
(131.320)	Unitech Printed Circuit Board Corp	JP Morgan	4.614	(2.000)	Zhen Ding Technology Holding Ltd	JP Morgan	(51)
(2.000)	United Integrated Services Co Ltd	JP Morgan	(1.785)	(5.000)	Zhong Yang Technology Co Ltd	JP Morgan	608
1.000	United Microelectronics Corp	JP Morgan	38				111.955
(4.000)	Universal Vision Biotechnology Co Ltd	Citibank	(1.967)	Thaïlande			
(3.000)	Universal Vision Biotechnology Co Ltd	JP Morgan	2.404	(18.000)	Advanced Info Service PCL	Citibank	187
7.000	USI Corp	Citibank	1.352	(183.600)	Airports of Thailand PCL	Citibank	(14.649)
6.000	USI Corp	JP Morgan	92	(2.900)	Airports of Thailand PCL	HSBC	(182)
				(4.200)	Airports of Thailand PCL	JP Morgan	(287)
				(26.600)	Amata Corp PCL	Citibank	(914)
				416.200	AP Thailand PCL	Citibank	(1.536)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Thaïlande suite				Thaïlande suite			
17.800	AP Thailand PCL	HSBC	(109)	112.500	Krung Thai Bank PCL	JP Morgan	(1.158)
1.291.400	AP Thailand PCL	JP Morgan	11.722	13.520	Laep Investments Ltd	Citibank	—
(1.400)	B Grimm Power PCL	Citibank	(187)	280	Laep Investments Ltd	HSBC	—
200	Bangkok Bank PCL Reg	Citibank	12	2.040	Laep Investments Ltd	JP Morgan	—
3.400	Bangkok Bank PCL Reg	JP Morgan	(351)	343.900	Land & Houses PCL Reg	Citibank	3.095
91.800	Bangkok Chain Hospital PCL	Citibank	1.995	451.600	Land & Houses PCL Reg	HSBC	165
30.600	Bangkok Chain Hospital PCL	HSBC	2.069	402.200	Land & Houses PCL Reg	JP Morgan	446
188.200	Bangkok Chain Hospital PCL	JP Morgan	6.959	(247.700)	LPN Development PCL	Citibank	(184)
(96.700)	Bangkok Dusit Medical Services PCL 'F'	Citibank	(2.117)	(14.900)	Major Cineplex Group PCL	Citibank	(407)
(20.200)	Bangkok Dusit Medical Services PCL 'F'	JP Morgan	(218)	(3.900)	Major Cineplex Group PCL	JP Morgan	(231)
(277.100)	Bangkok Expressway & Metro PCL	Citibank	(5.592)	(89.000)	Minor International PCL	Citibank	(4.620)
16.300	Bangkok Ranch PCL	Citibank	16	(2.781)	Minor International PCL	Citibank	(374)
2.500	Berli Jucker PCL	Citibank	71	(3.068)	Minor International PCL	Citibank	(479)
4.900	Berli Jucker PCL	HSBC	(145)	(12.800)	Minor International PCL	HSBC	(966)
800	Berli Jucker PCL	JP Morgan	(21)	(581)	Minor International PCL	HSBC	(12)
(375.300)	BTS Group Holdings PCL	Citibank	(7.020)	(400)	Minor International PCL	HSBC	(54)
(52.900)	Bumrungrad Hospital PCL	Citibank	(2.578)	(441)	Minor International PCL	HSBC	(69)
(1.200)	Bumrungrad Hospital PCL	HSBC	(111)	(1.400)	Minor International PCL	JP Morgan	(110)
(4.100)	Carabao Group PCL 'F'	Citibank	(788)	(43)	Minor International PCL	JP Morgan	(6)
(55.200)	Central Pattana PCL	JP Morgan	2.298	(48)	Minor International PCL	JP Morgan	(8)
(90.400)	Central Plaza Hotel PCL	Citibank	(1.825)	75.000	Ngern Tid Lor PCL	JP Morgan	15.098
(69.900)	Central Retail Corp PCL	Citibank	30.909	4.100	Osotspa PCL	Citibank	52
(21.800)	Central Retail Corp PCL	JP Morgan	(130)	3.500	Osotspa PCL	HSBC	177
(719.200)	CH Karnchang PCL	Citibank	(38.557)	5.600	Osotspa PCL	JP Morgan	167
(2.400)	CH Karnchang PCL	JP Morgan	(305)	17.100	Precious Shipping PCL	JP Morgan	(238)
(54.700)	Charoen Pokphand Foods PCL	Citibank	(626)	900	PTT Exploration & Production PCL	Citibank	57
92.400	CK Power PCL	Citibank	65	300	PTT Exploration & Production PCL	HSBC	(34)
54.700	CK Power PCL	HSBC	129	30.300	PTT Exploration & Production PCL	JP Morgan	1.237
30.100	CK Power PCL	JP Morgan	86	12.000	PTT Global Chemical PCL	Citibank	(286)
(196.200)	CP ALL PCL	Citibank	(23.418)	3.300	PTT Global Chemical PCL	HSBC	(643)
(5.300)	CP ALL PCL	JP Morgan	3	28.200	PTT Global Chemical PCL	JP Morgan	(5.311)
(2.400)	Delta Electronics Thailand PCL	Citibank	(6.147)	(2.500)	PTT Oil & Retail Business PCL	Citibank	(30)
(100)	Delta Electronics Thailand PCL	HSBC	(390)	(2.900)	PTT Oil & Retail Business PCL	HSBC	(57)
766.500	Dynasty Ceramic PCL	Citibank	47.230	73.200	PTT PCL	Citibank	3.287
73.300	Dynasty Ceramic PCL	JP Morgan	296	81.300	PTT PCL	HSBC	(3.112)
(4.700)	Electricity Generating PCL	Citibank	(1.004)	68.800	PTT PCL	JP Morgan	(2.374)
(2.000)	Energy Absolute PCL	Citibank	(127)	(1.700)	Ratch Group PCL	Citibank	(92)
(500)	Energy Absolute PCL	JP Morgan	14	(1.000)	Ratch Group PCL	HSBC	(24)
(261.800)	Esso Thailand PCL	Citibank	(1.117)	(14.000)	Ratch Group PCL	JP Morgan	(405)
(144.200)	GFPT PCL	Citibank	(197)	(107.600)	Sansiri PCL	Citibank	(466)
(31.200)	Gulf Energy Development PCL	Citibank	(1.129)	(1.700)	SCG Packaging PCL	Citibank	137
(123.200)	Gulf Energy Development PCL	HSBC	1.633	15.000	Siam Cement PCL RegS	Citibank	2.752
(73.700)	Hana Microelectronics PCL	Citibank	(11.685)	1.800	Siam Cement PCL RegS	HSBC	(1.512)
(13.700)	Hana Microelectronics PCL	JP Morgan	(3.953)	8.600	Siam Cement PCL RegS	JP Morgan	(6.155)
10.300	Home Product Center PCL	Citibank	51	1.000	Siam City Cement PCL	Citibank	39
900	Home Product Center PCL	HSBC	(8)	1.000	Siam City Cement PCL	HSBC	149
120.900	Home Product Center PCL	JP Morgan	(3.594)	24.800	Siam City Cement PCL	JP Morgan	(41.645)
30.000	Indorama Ventures PCL	Citibank	1.013	400	Siam Commercial Bank PCL	Citibank	31
2.400	Indorama Ventures PCL	HSBC	36	9.900	Siam Commercial Bank PCL	JP Morgan	255
7.400	Indorama Ventures PCL	JP Morgan	60	(171.000)	Sino-Thai Engineering & Construction PCL	Citibank	(6.893)
(119.300)	Intouch Holdings PCL 'F'	HSBC	225	(72.350)	Sri Trang Agro-Industry PCL	Citibank	4.128
897.400	IRPC PCL	Citibank	463	(9.300)	Sri Trang Agro-Industry PCL	JP Morgan	1.143
590.100	IRPC PCL	HSBC	(3.405)	(400)	Srisawad Corp PCL	Citibank	(26)
580.400	IRPC PCL	JP Morgan	(1.825)	18.800	Supalai PCL	Citibank	651
(2.369.900)	Jasmine International PCL	Citibank	(6.892)	17.500	Supalai PCL	HSBC	618
2.700	Kasikornbank PCL	Citibank	127	116.700	Supalai PCL	JP Morgan	4.339
12.300	Kasikornbank PCL	JP Morgan	(2.458)	(71.800)	Thai Oil PCL	Citibank	(7.409)
92.700	Kiatnakin Phatra Bank PCL	Citibank	8.064	6.900	Thai Union Group PCL 'F'	Citibank	82
139.200	Kiatnakin Phatra Bank PCL	JP Morgan	1.744	4.800	Thai Union Group PCL 'F'	HSBC	141
				169.200	Thai Union Group PCL 'F'	JP Morgan	5.242
				42.100	Thanachart Capital PCL	Citibank	855

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Thaïlande suite				États-Unis suite			
47.700	Thanachart Capital PCL	HSBC	(252)	1.155	HDFC Bank Ltd ADR	JP Morgan	8.120
61.400	Thanachart Capital PCL	JP Morgan	(130)	(1.169)	Himax Technologies Inc ADR	HSBC	(947)
65.400	Tisco Financial Group PCL	Citibank	3.349	1.285	Hollysys Automation Technologies Ltd	JP Morgan	(218)
133.200	Tisco Financial Group PCL	JP Morgan	338	(330)	Huazhu Group Ltd ADR	HSBC	(482)
532.400	TMBThanachart Bank PCL	Citibank	416	413	Hutchmed China Ltd ADR	Citibank	881
2.717.100	TMBThanachart Bank PCL	JP Morgan	(3.674)	125	Hutchmed China Ltd ADR	HSBC	595
(2.397.300)	True Corp PCL	Citibank	(7.082)	1.030	Hutchmed China Ltd ADR	JP Morgan	4.096
(376.500)	True Corp PCL	JP Morgan	798	1.100	HUYA Inc ADR	HSBC	(99)
(523.700)	TTW PCL	Citibank	(2.459)	274	HUYA Inc ADR	JP Morgan	(25)
			(77.863)	449	ICICI Bank Ltd ADR	Citibank	103
				(282)	iClick Interactive Asia Group Ltd ADR	Citibank	161
(1.337)	111 Inc ADR	JP Morgan	1.912	(2.152)	iClick Interactive Asia Group Ltd ADR	HSBC	(1.485)
605	21Vianet Group Inc ADR	JP Morgan	27	(1.664)	iClick Interactive Asia Group Ltd ADR	JP Morgan	(729)
(356)	360 DigiTech Inc ADR	Citibank	(228)	760	iHuman Inc ADR	Citibank	(152)
(4.700)	360 DigiTech Inc ADR	HSBC	(25.239)	1.294	iHuman Inc ADR	HSBC	(2.223)
211	51job Inc ADR	JP Morgan	(23)	621	iHuman Inc ADR	JP Morgan	(1.621)
100	Agora Inc ADR	Citibank	430	47	I-Mab ADR	Citibank	531
252	Agora Inc ADR	JP Morgan	1.020	86	I-Mab ADR	JP Morgan	2.001
92	Alibaba Group Holding Ltd ADR	Citibank	324	618	Infosys Ltd ADR	Citibank	414
42	Alibaba Group Holding Ltd ADR	JP Morgan	(234)	1.061	Infosys Ltd ADR	HSBC	1.040
4.346	Atlas Corp	Citibank	174	9.852	Infosys Ltd ADR	JP Morgan	9.655
1.365	Atlas Corp	HSBC	(642)	168	iQIYI Inc ADR	HSBC	185
2.627	Atlas Corp	JP Morgan	(1.235)	2.848	iQIYI Inc ADR	JP Morgan	3.133
650	Autohome Inc ADR	Citibank	(534)	350	JD.com Inc ADR	JP Morgan	353
152	Autohome Inc ADR	JP Morgan	(2.306)	(498)	JinkoSolar Holding Co Ltd ADR	Citibank	(1.664)
64	Baidu Inc ADR	Citibank	181	(2.147)	JinkoSolar Holding Co Ltd ADR	HSBC	(13.634)
61	Baidu Inc ADR	JP Morgan	783	(427)	JinkoSolar Holding Co Ltd ADR	JP Morgan	(2.711)
165	Baozun Inc ADR	Citibank	(120)	(419)	JOYY Inc ADR	HSBC	3.591
(194)	BeiGene Ltd ADR	HSBC	(10.707)	218	KE Holdings Inc ADR	Citibank	(26)
1.715	Beyondspring Inc	JP Morgan	1.338	622	KE Holdings Inc ADR	HSBC	1.318
(532)	Bilibili Inc ADR	HSBC	(6.671)	(742)	Kingsoft Cloud Holdings Ltd ADR	HSBC	(215)
2.991	BlueCity Holdings Ltd ADR	Citibank	808	(39)	Kingsoft Cloud Holdings Ltd ADR	JP Morgan	(11)
406	BlueCity Holdings Ltd ADR	HSBC	73	28	Legend Biotech Corp ADR	JP Morgan	61
2.814	BlueCity Holdings Ltd ADR	JP Morgan	466	360	LexinFintech Holdings Ltd ADR	JP Morgan	532
2.701	Boqii Holding Ltd ADR	Citibank	594	(225)	Lizhi Inc ADR	HSBC	(96)
2.254	Boqii Holding Ltd ADR	HSBC	(203)	(1.664)	Lufax Holding Ltd ADR	HSBC	(3.128)
1.066	Boqii Holding Ltd ADR	JP Morgan	(102)	(1.878)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	HSBC	2.460
(1.254)	Chindata Group Holdings Ltd ADR	Citibank	(1.116)	188	MINISO Group Holding Ltd ADR	Citibank	(735)
(2.143)	Coupang LLC 'A'	HSBC	(7.972)	1.241	MINISO Group Holding Ltd ADR	JP Morgan	(2.271)
425	Dada Nexus Ltd ADR	Citibank	106	56	NetEase Inc ADR	JP Morgan	694
52	Dada Nexus Ltd ADR	HSBC	217	2.782	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	Citibank	3.227
45	Dada Nexus Ltd ADR	JP Morgan	188	19.709	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	JP Morgan	(57.110)
(367)	Daqo New Energy Corp ADR	HSBC	(818)	318	NIO Inc ADR	JP Morgan	1.364
707	DouYu International Holdings Ltd ADR	Citibank	153	(1.987)	Niu Technologies ADR	HSBC	(5.230)
(23)	Dr Reddy's Laboratories Ltd ADR	HSBC	19	(171)	Niu Technologies ADR	JP Morgan	(679)
3.995	Fanhua Inc ADR	Citibank	(839)	257	Noah Holdings Ltd ADR	Citibank	658
2.356	Fanhua Inc ADR	JP Morgan	(221)	420	Noah Holdings Ltd ADR	HSBC	1.025
(1.791)	FinVolution Group ADR	HSBC	(2.149)	745	Noah Holdings Ltd ADR	JP Morgan	1.818
(315)	FinVolution Group ADR	JP Morgan	(378)	(1.381)	O2Micro International Ltd ADR	JP Morgan	(346)
226	Futu Holdings Ltd ADR	Citibank	4.102				
256	Futu Holdings Ltd ADR	JP Morgan	5.760				
(486)	GDS Holdings Ltd ADR	HSBC	(153)				
(2.098)	Genetron Holdings Ltd ADR	HSBC	(4.941)				
(727)	Genetron Holdings Ltd ADR	JP Morgan	(1.665)				
443	Genpact Ltd	Citibank	482				
1.001	Genpact Ltd	JP Morgan	(1.141)				
390	Gracecell Biotechnologies Inc ADR	JP Morgan	1.552				
1.026	GSX Techedu Inc ADR	Citibank	(523)				
147	GSX Techedu Inc ADR	HSBC	(929)				
37	GSX Techedu Inc ADR	JP Morgan	(234)				
3.010	HDFC Bank Ltd ADR	Citibank	3.040				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite			
(38)	OneConnect Financial Technology Co Ltd ADR	Citibank	147
(1.326)	OneConnect Financial Technology Co Ltd ADR	HSBC	(1.326)
(400)	OneConnect Financial Technology Co Ltd ADR	JP Morgan	(400)
234	PetroChina Co Ltd ADR	Citibank	150
323	PetroChina Co Ltd ADR	JP Morgan	165
(49)	Pinduoduo Inc ADR	Citibank	271
(32)	Pinduoduo Inc ADR	JP Morgan	(105)
(142)	Recon Technology Ltd 'A'	JP Morgan	3
(201)	Sea Ltd ADR	HSBC	(6.148)
593	Silicon Motion Technology Corp ADR	Citibank	878
824	Silicon Motion Technology Corp ADR	JP Morgan	(1.252)
(1.511)	Sohu.com Ltd ADR	HSBC	(488)
(90)	Sohu.com Ltd ADR	JP Morgan	(28)
362	So-Young International Inc ADR	Citibank	239
3.062	So-Young International Inc ADR	HSBC	6.951
3.356	So-Young International Inc ADR	JP Morgan	6.786
2.748	TAL Education Group ADR	Citibank	6.294
332	TAL Education Group ADR	HSBC	(4.728)
2.151	TAL Education Group ADR	JP Morgan	(30.400)
(116)	Tata Motors Ltd ADR	Citibank	(24)
(3.706)	Tata Motors Ltd ADR	HSBC	(2.117)
(249)	Tata Motors Ltd ADR	JP Morgan	(32)
1.652	Tencent Music Entertainment Group ADR	Citibank	809
262	Tencent Music Entertainment Group ADR	JP Morgan	134
(170)	Trip.com Group Ltd ADR	Citibank	(427)
(944)	Trip.com Group Ltd ADR	HSBC	(4.758)
(58)	Trip.com Group Ltd ADR	JP Morgan	(292)
1.115	Viomi Technology Co Ltd ADR	Citibank	948
945	Viomi Technology Co Ltd ADR	JP Morgan	1.172
(232)	Vipshop Holdings Ltd ADR	HSBC	615
645	WNS Holdings Ltd ADR	JP Morgan	2.773
2.539	Yatsen Holding Ltd ADR	Citibank	3.910
722	Yatsen Holding Ltd ADR	HSBC	1.682
622	Yatsen Holding Ltd ADR	JP Morgan	1.449
247	Youdao Inc ADR	Citibank	543
1.717	Youdao Inc ADR	JP Morgan	4.372
928	Yum China Holdings Inc	JP Morgan	6.394
(198)	Zai Lab Ltd ADR	JP Morgan	(5.492)
826	Zepp Health Corp ADR	JP Morgan	595
(895)	ZTO Express Cayman Inc ADR	HSBC	(671)
(120)	ZTO Express Cayman Inc ADR	JP Morgan	(90)
			(106.893)
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 152.500.832)			(33.166)
* Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.			
™ Les montants inférieurs à 0,5 USD ont été arrondis à zéro.			

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Moins-value nette non réalisée USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés					
SWAPS					
TRS	Fund receives 3 Month LIBOR and pays MSCI AC Asia Pacific Small Cap Index	Goldman Sachs	9/7/2021	(13.566)	(13.566)
TRS	Fund receives 3 Month LIBOR and pays MSCI AC Asia Pacific Small Cap Index	Goldman Sachs	3/9/2021	(165.974)	(165.974)
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 6.545.256)				(179.540)	(179.540)

TRS: Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	876.366	USD	1.059.307	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	10.474
USD	40.676	EUR	33.438	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(140)
						10.334
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	8.511.173	USD	11.844.134	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	216.336
USD	903.572	GBP	638.432	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1.096)
						215.240
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 14.075.739)						225.574

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	76,00
Gouvernement	16,19
Technologie	2,98
Biens de consommation cyclique	2,29
Matériaux de base	1,42
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,88
Autres éléments de l'actif net	1,12
<hr/>	
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES & DROITS							
Australie							
64.495	Santos Ltd	276.428	0,02				
18.239	Woodside Petroleum Ltd	251.839	0,02				
		528.267	0,04				
Autriche							
3.592	ANDRITZ AG	169.399	0,02				
2.047	Verbund AG	153.525	0,01				
		322.924	0,03				
Belgique							
3.393	Umicore SA [*]	166.495	0,01				
		166.495	0,01				
Bermudes							
19.327	Axalta Coating Systems Ltd	512.795	0,04				
		512.795	0,04				
Canada							
25.239	Cameco Corp	405.818	0,03				
69.610	Inter Pipeline Ltd	827.073	0,07				
67.655	Pembina Pipeline Corp	1.781.283	0,15				
		3.014.174	0,25				
Curaçao							
100.062	Schlumberger NV	2.564.057	0,21				
		2.564.057	0,21				
Danemark							
34.154	Novo Nordisk A/S 'B'	2.210.249	0,18				
4.558	Orsted A/S	565.543	0,05				
1.731	ROCKWOOL International A/S 'B'	704.520	0,06				
21.155	Vestas Wind Systems A/S	673.564	0,05				
		4.153.876	0,34				
Finlande							
26.835	Kone Oyj 'B'	1.774.867	0,14				
43.024	Neste Oyj	2.318.994	0,19				
		4.093.861	0,33				
France							
13.629	Accor SA [*]	447.849	0,04				
3.343	EssilorLuxottica SA	474.305	0,04				
1.435	Hermes International	1.653.838	0,13				
801	Kering SA	599.388	0,05				
5.093	L'Oreal SA	1.875.752	0,15				
4.644	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	3.027.888	0,24				
2.360	Sartorius Stedim Biotech	836.384	0,07				
962	Schneider Electric SE	124.483	0,01				
24.654	Societe Generale SA	646.058	0,05				
5.905	Sodexo SA	467.676	0,04				
40.871	Suez SA	815.785	0,07				
39.052	Veolia Environnement SA	1.003.636	0,08				
5.158	Vinci SA	479.281	0,04				
		12.452.323	1,01				
Allemagne							
8.510	CTS Eventim AG & Co KGaA	478.092	0,04				
4.995	Evonik Industries AG	146.104	0,01				
15.496	HUGO BOSS AG	720.564	0,06				
50.225	Nordex SE	953.773	0,08				
1.441	Rational AG	1.059.135	0,09				
6.671	SAP SE	757.292	0,06				
14.122	Siemens Energy AG	367.172	0,03				
				Allemagne suite			
12.344	SMA Solar Technology AG [*]	564.861	0,04				
14.522	Symrise AG	1.575.637	0,13				
192.594	TUI AG [*]	967.547	0,08				
		7.590.177	0,62				
				Irlande			
180.787	C&C Group Plc	507.399	0,04				
47.161	C&C Group Plc (Right)	30.705	0,00				
1.177	Eaton Corp Plc	139.827	0,01				
20.532	Kingspan Group Plc (traded in Ireland)	1.578.089	0,13				
8.053	Kingspan Group Plc (traded in United Kingdom)	628.939	0,05				
14.340	Pentair Plc	808.924	0,07				
8.537	Seagate Technology Holdings Plc	668.563	0,06				
		4.362.446	0,36				
				Italie			
14.132	Enel SpA	113.848	0,01				
53.618	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	335.005	0,03				
		448.853	0,04				
				Japon			
367.400	ENEOS Holdings Inc	1.242.963	0,10				
31.800	Idemitsu Kosan Co Ltd [*]	614.594	0,05				
		1.857.557	0,15				
				Jersey			
22.009	WPP Plc	249.232	0,02				
		249.232	0,02				
				Pays-Bas			
9.052	ASML Holding NV	4.953.254	0,40				
13.849	CNH Industrial NV	195.617	0,01				
10.595	Ferrari NV	1.832.405	0,15				
734	Koninklijke DSM NV	110.614	0,01				
21.089	Koninklijke Vopak NV	815.723	0,07				
		7.907.613	0,64				
				Norvège			
58.411	Equinor ASA	1.031.715	0,08				
17.770	Tomra Systems ASA	748.080	0,06				
		1.779.795	0,14				
				Papouasie-Nouvelle-Guinée			
439.123	Oil Search Ltd	1.011.940	0,08				
		1.011.940	0,08				
				Pologne			
253	LPP SA	632.677	0,05				
		632.677	0,05				
				Portugal			
63.785	Galp Energia SGPS SA	649.331	0,05				
		649.331	0,05				
				Espagne			
12.959	EDP Renovaveis SA [*]	249.979	0,02				
10.067	Iberdrola SA	110.687	0,01				
256.258	International Consolidated Airlines Group SA	603.618	0,05				
25.405	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	682.632	0,05				
		1.646.916	0,13				
				Suède			
19.081	Alfa Laval AB	588.891	0,05				
90.676	Assa Abloy AB 'B'	2.279.767	0,19				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Suède suite				Royaume-Uni suite			
163.709	Hexagon AB 'B'	1.908.615	0,15	13.786	Whitbread Plc	510.016	0,04
12.503	Lundin Energy AB	351.593	0,03	13.148	Wickes Group Plc	39.133	0,00
110.712	Nibe Industrier AB 'B'	985.203	0,08	24.367	Workspace Group Plc (REIT)	256.670	0,02
		6.114.069	0,50			33.760.000	2,75
Suisse				États-Unis			
2.836	Lonza Group AG Reg	1.493.324	0,12	2.372	A O Smith Corp	137.879	0,01
18.492	Nestle SA Reg	1.861.662	0,15	1.853	Adobe Inc	764.722	0,06
48	SGS SA Reg	122.359	0,01	2.813	AECOM	149.571	0,01
1.190	Swatch Group AG*	352.588	0,03	1.427	AGCO Corp	161.497	0,01
		3.829.933	0,31	6.221	Alaska Air Group Inc	352.099	0,03
Royaume-Uni				591 Alphabet Inc 'A'			
221.728	Auto Trader Group Plc	1.447.747	0,12	230	Amazon.com Inc	1.139.246	0,09
137.032	Barclays Plc	291.713	0,02	3.010	Ameresco Inc 'A'	132.350	0,01
32.842	Barratt Developments Plc	288.819	0,02	30.749	American Airlines Group Inc*	609.623	0,05
6.655	Bellway Plc	276.843	0,02	51.325	American Axle & Manufacturing Holdings Inc*	470.159	0,04
85.616	Biffa Plc	291.156	0,02	4.175	American Express Co	546.798	0,04
1.480.798	BP Plc	5.270.784	0,43	4.819	American Water Works Co Inc	611.002	0,05
22.474	Burberry Group Plc	558.119	0,05	4.661	Analog Devices Inc	627.490	0,05
406.194	Capita Plc	190.131	0,02	5.762	ANSYS Inc	1.592.616	0,13
30.170	Carnival Plc	619.246	0,05	12.515	Apple Inc	1.275.504	0,10
980.280	Cineworld Group Plc*	1.056.969	0,09	1.524	Arista Networks Inc*	423.028	0,03
62.101	Compass Group Plc	1.161.354	0,09	3.349	Aspen Technology Inc	373.810	0,03
67.947	Crest Nicholson Holdings Plc	361.968	0,03	12.372	Avis Budget Group Inc	888.651	0,07
5.699	Derwent London Plc (REIT)	228.991	0,02	1.744	Badger Meter Inc	136.322	0,01
13.509	Diageo Plc	534.636	0,04	16.232	Bank of America Corp	562.773	0,05
40.586	Go-Ahead Group Plc	584.646	0,05	7.562	Booz Allen Hamilton Holding Corp	525.286	0,04
70.137	Grainger Plc	232.727	0,02	1.992	Broadcom Inc	769.543	0,06
28.108	Great Portland Estates Plc (REIT)	235.619	0,02	8.887	Cadence Design Systems Inc	923.045	0,08
29.267	Greggs Plc	847.612	0,07	7.456	California Water Service Group*	346.624	0,03
3.889	Halma Plc	117.740	0,01	4.551	Capital One Financial Corp	598.463	0,05
864.972	Hammerson Plc (REIT)	401.757	0,03	11.336	CECO Environmental Corp	70.743	0,01
59.197	Hargreaves Lansdown Plc	1.140.427	0,09	26.631	Cheniere Energy Inc	1.849.240	0,15
34.398	Informa Plc	217.559	0,02	5.787	Chevron Corp	491.255	0,04
7.904	InterContinental Hotels Group Plc	452.215	0,04	25.689	Cinemark Holdings Inc*	476.108	0,04
428.822	ITV Plc	640.158	0,05	12.158	Cisco Systems Inc	526.037	0,04
37.405	J D Wetherspoon Plc	572.744	0,05	8.416	Citigroup Inc	541.793	0,04
22.502	JD Sports Fashion Plc	247.281	0,02	13.261	Citizens Financial Group Inc	541.221	0,04
17.457	Johnson Matthey Plc	618.222	0,05	12.731	CommScope Holding Co Inc*	211.481	0,02
27.668	Land Securities Group Plc (REIT)	226.205	0,02	16.971	Conduent Inc	105.214	0,01
32.382	London Stock Exchange Group Plc	2.851.505	0,23	7.554	ConocoPhillips	344.383	0,03
130.493	Marks & Spencer Group Plc	250.939	0,02	23.042	Corteva Inc	857.491	0,07
496.132	Marston's Plc	526.928	0,04	1.532	Credit Acceptance Corp	560.675	0,05
43.007	Meggitt Plc	254.508	0,02	3.136	Deere & Co	926.193	0,08
150.400	Melrose Industries Plc	301.985	0,02	12.478	Delta Air Lines Inc	486.608	0,04
154.960	Mitchells & Butlers Plc	549.496	0,04	11.877	Discovery Inc 'A'	311.921	0,03
160.484	National Express Group Plc	564.233	0,05	15.295	Donaldson Co Inc	770.474	0,06
103.063	On the Beach Group Plc	488.886	0,04	1.112	Dover Corp	136.880	0,01
9.686	Pennon Group Plc	119.032	0,01	3.894	Ecolab Inc	685.006	0,06
7.148	Persimmon Plc	262.613	0,02	1.715	EnerSys	132.190	0,01
34.806	Redrow Plc	274.932	0,02	56.832	EOG Resources Inc	3.734.417	0,30
439.079	Restaurant Group Plc	619.736	0,05	18.033	Essential Utilities Inc	705.008	0,06
31.504	Rightmove Plc	220.866	0,02	5.058	Euronet Worldwide Inc	619.048	0,05
170.380	Rolls-Royce Holdings Plc	211.996	0,02	32.180	Evoqua Water Technologies Corp	819.075	0,07
127.274	Saga Plc	561.708	0,05	2.090	F5 Networks Inc	316.975	0,03
30.304	Shaftesbury Plc (REIT)*	218.971	0,02	4.153	Facebook Inc 'A'	1.116.604	0,09
12.677	Smiths Group Plc	228.377	0,02	1.652	Fair Isaac Corp	683.770	0,06
16.926	Spirax-Sarco Engineering Plc	2.499.212	0,20	4.014	Fidelity National Information Services Inc	489.106	0,04
7.408	SSE Plc	132.810	0,01	16.416	Fifth Third Bancorp	565.796	0,05
258.189	SSP Group Plc	882.832	0,07	8.797	First Solar Inc	547.614	0,04
340.306	Stagecoach Group Plc	344.218	0,03	8.562	FirstCash Inc	558.265	0,05
116.873	Taylor Wimpey Plc	232.900	0,02	4.620	Fiserv Inc	435.304	0,04
92.856	Trainline Plc*	306.601	0,03	4.364	Fortinet Inc	780.034	0,06
11.733	Travis Perkins Plc	223.989	0,02	15.997	General Electric Co	183.959	0,02
19.178	UNITE Group Plc (REIT)	253.072	0,02	2.648	Global Payments Inc	419.535	0,03
11.317	United Utilities Group Plc	129.418	0,01	1.087	Global Water Resources Inc	15.185	0,00
16.368	WH Smith Plc*	329.030	0,03				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	
Luxembourg suite				Guernesey suite				
189.640	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Systematic ESG World Equity Fund X2 (GBP) ⁻	50.450.912	4,10	6.741.359	Schiehallion Fund Ltd 'C'	6.892.163	0,56	
56.373	Schroder International Selection Fund - Frontier Markets Equity I	10.000.912	0,82	2.695.158	SME Credit Realisation Fund Ltd	2.362.657	0,19	
		427.523.278	34,77	4.164.849	Starwood European Real Estate Finance Ltd	4.328.943	0,35	
Royaume-Uni				Total des organismes de placement collectif				
1.055.354	BlackRock Frontiers Investment Trust Plc ⁻	1.460.126	0,12	Portefeuille de titres à la valeur de marché			853.737.923	69,43
4.582.376	Schroder UK Public Private	1.856.686	0,15	Autres éléments de l'actif net			58.524.142	4,76
2.184.539	Scottish Mortgage Investment Trust Plc	30.350.986	2,47	Total de l'actif net (EUR)			1.229.637.507	100,00
		33.667.798	2,74	[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt. ⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.				
Irlande								
2.294.158	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ⁻	226.755.927	18,44					
149.987	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) ⁻	17.439.899	1,42					
108.830	BlackRock ICS Ultra Short Bond Fund (Acc) ⁻	11.979.885	0,98					
276.954	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) ⁻	22.661.994	1,84					
967.568	iShares Developed World Index Fund ⁻	33.693.620	2,74					
72.620	iShares MSCI EM Asia UCITS ETF (Acc) ⁻	12.445.535	1,01					
		324.976.860	26,43					
Jersey								
16.261.248	Blackstone Loan Financing Ltd	12.602.467	1,03					
18.065.000	Foresight Solar Fund Ltd	20.583.022	1,67					
		33.185.489	2,70					
Guernesey								
14.244.393	Bluefield Solar Income Fund Ltd	20.800.735	1,69					

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
TRS	USD 17.516.267	Fund receives Dow Jones US Selectet Home and pays 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	22/4/2022	192.883	192.883
TRS	USD 13.544.026	Fund receives PHLX Semiconductor SectorSM and pays 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	16/2/2022	869.555	869.555
TRS	USD 60.955	Fund receives Volatility Carry Strategy and pays Fixed 0,600%	Barclays Bank Plc	4/3/2022	9.776	9.776
TRS	USD 33.120	Fund receives Volatility Carry Strategy Index and pays Fixed 0,600%	Barclays Bank Plc	8/9/2021	169.074	169.074
TRS	USD 44.885	Fund receives Volatility Carry Strategy Index and pays Fixed 0,600%	Barclays Bank Plc	13/9/2021	23.143	23.143
TRS	USD 31.125.349	Fund receives Cyber Security Basket and pays 3 Month LIBOR	BNP Paribas	22/4/2022	(103.191)	(103.191)
TRS	USD 4.170.907	Fund receives Global Brands Basket and pays 6 Month LIBOR	Citibank	3/9/2021	575.401	575.401
TRS	USD 31.731.715	Fund receives Global Brands Basket Index and pays 6 Month LIBOR	Citibank	3/9/2021	6.946.748	6.946.748
TRS	USD 79.830	Fund receives 12 Month FEDL and pays GS US NonProfit Tech GTR	Goldman Sachs	20/5/2022	(1.702.146)	(1.702.146)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
TRS	USD 50.867	Fund receives Goldman Sachs Vvol Carry Series 80 and pays Fixed 0,000%	Goldman Sachs	25/2/2022	9.985	9.985
TRS	USD 30.922	Fund receives Goldman Sachs VVol Carry Series 80 and pays Fixed 0,000%	Goldman Sachs	25/2/2022	6.070	6.070
TRS	USD 92.437	Fund receives Volatility PremiaStrategy Index and pays Fixed 0,000%	Goldman Sachs	3/11/2021	(126.446)	(126.446)
TRS	EUR 355.659	Fund receives 12 Month EONIA and pays MS EU China Exposure Baske	Morgan Stanley	21/3/2022	(1.451.089)	(1.451.089)
TRS	USD 34.000	Fund receives FX Volatility Strategy and pays Fixed 0,200%	Morgan Stanley	13/4/2022	(278)	(278)
TRS	USD 223.306	Fund receives MS Intraday Momentum Strategy and pays Fixed 0,000%	Morgan Stanley	13/4/2022	(94.973)	(94.973)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 219.418.314)					5.324.512	5.324.512

TRS: Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(182)	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	31.277.848	(2.347.104)
270	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	25.762.804	2.346.439
422	EUR	EURO STOXX 50 Index Futures June 2021	Juin 2021	17.027.700	1.065.920
2.343	EUR	EURO STOXX Bank Index Futures June 2021	Juin 2021	11.480.700	1.364.797
(110)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures June 2021	Juin 2021	24.627.094	(1.702.205)
(330)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	35.576.942	(17.910)
Total				145.753.088	709.937

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
486	Call	MSCI Emerging Markets	Exchange Traded	USD 1.450,00	18/06/2021	(1.939.786)	23.850
2.560.000	Call	Topix Index	Goldman Sachs	JPY 2.050,00	12/11/2021	(74.360)	555.651
2.560.000	Call	Topix Index	Goldman Sachs	JPY 2.100,00	12/11/2021	(57.557)	357.906
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 20.948.884)						(2.071.703)	937.407

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	116.500.000	GBP	101.096.720	Toronto Dominion Bank	27/7/2021	(922.162)
EUR	320.819.000	USD	386.882.690	Toronto Dominion Bank	27/7/2021	4.720.788
INR	37.047.700	USD	500.000	BNP Paribas	27/7/2021	5.126

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
INR	645.540.000	USD	8.700.000	Citibank	27/7/2021	99.343
INR	70.284.920	USD	948.642	Deutsche Bank	27/7/2021	9.667
INR	430.228.675	USD	5.801.358	JP Morgan	27/7/2021	63.653
INR	646.801.500	USD	8.700.000	Morgan Stanley	27/7/2021	113.428

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
INR	322.291.500	USD	4.350.000	UBS	27/7/2021	44.329
USD	1.390.000	IDR	20.003.490.000	Bank of America Merrill Lynch	27/7/2021	(4.873)
USD	8.555.000	IDR	123.534.200.000	HSBC	27/7/2021	(53.890)
USD	5.860.000	IDR	84.501.200.000	Morgan Stanley	27/7/2021	(30.231)
USD	13.195.000	IDR	190.233.910.000	Standard Chartered Bank	27/7/2021	(65.906)
USD	38.925.000	ZAR	564.455.317	Citibank	27/7/2021	(1.566.347)
						2.412.925
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	9.129	EUR	6.207	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(28)
EUR	41	CAD	60	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
						(28)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
EUR	607.157	JPY	80.255.177	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	7.218
JPY	4.537.692.766	EUR	34.419.120	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(498.078)
						(490.860)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
EUR	325.436	SEK	3.298.257	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	162
SEK	202.852.010	EUR	19.992.292	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	13.018
						13.180
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	92	USD	113	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1
USD	5.839	EUR	4.832	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(59)
						(58)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 648.822.813)						1.935.159

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Organismes de placement collectif	68,42
Fonds négociés en bourse	8,28
Énergie	3,21
Gouvernement	2,93
Finance	2,62
Biens de consommation cyclique	2,27
Valeurs industrielles	2,11
Technologie	2,03
Biens de consommation non cyclique	1,56
Communications	0,94
Services aux collectivités	0,53
Matériaux de base	0,34
Portefeuille de titres à la valeur de marché	95,24
Autres éléments de l'actif net	4,76
<hr/>	
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché GBP	% de l'actif net			Valeur de marché GBP	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Royaume-Uni suite			
				GBP 23.000.000	Goldman Sachs International RegS 9/8/2021 (Zero Coupon)	22.996.596	2,80
				GBP 18.000.000	Handelsbanken Plc 0,07% 10/8/2021	18.000.000	2,19
				GBP 20.000.000	National Bank of Canada 0,03% 8/10/2021	20.000.000	2,43
				GBP 4.000.000	Nationwide Building Society 0,05% 1/6/2021	4.000.000	0,49
				GBP 10.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0,10% 24/9/2021	10.000.000	1,22
				GBP 24.000.000	Standard Chartered Bank 12/8/2021 (Zero Coupon)	23.995.032	2,92
				GBP 5.000.000	Standard Chartered Bank 10/9/2021 (Zero Coupon)	4.997.788	0,61
				GBP 10.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0,05% 17/6/2021	10.000.000	1,22
				GBP 9.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0,10% 20/9/2021	9.000.000	1,10
				GBP 7.000.000	Toronto-Dominion Bank 12/7/2021 (Zero Coupon)	6.999.528	0,85
		49.050.628	5,98			160.988.944	19,61
Total des actions ordinaires		49.050.628	5,98	Total des Certificats de dépôts		388.765.219	47,35
CERTIFICAT DE DÉPÔTS				BILLET DE TRÉSORERIE			
Belgique				Belgique			
GBP 18.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 6/7/2021 (Zero Coupon)	17.998.750	2,19	GBP 4.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 14/6/2021 (Zero Coupon)	3.999.929	0,49
		17.998.750	2,19			3.999.929	0,49
Japon				Finlande			
GBP 27.000.000	Mitsubishi Ufj Trust And Banking Corp 1/7/2021 (Zero Coupon)	26.998.290	3,29	GBP 5.000.000	Nordea Bank Abp RegS 16/8/2021 (Zero Coupon)	4.999.167	0,61
GBP 22.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,08% 8/6/2021	22.000.000	2,68	GBP 28.000.000	Nordea Bank Abp RegS 14/10/2021 (Zero Coupon)	27.990.166	3,41
GBP 30.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,09% 19/7/2021	30.000.000	3,65	GBP 4.500.000	OP Corporate Bank Plc RegS 2/6/2021 (Zero Coupon)	4.499.993	0,55
GBP 7.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,09% 21/7/2021	7.000.000	0,85	GBP 7.000.000	OP Corporate Bank Plc RegS 5/1/2022 (Zero Coupon)	6.997.911	0,85
GBP 14.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 11/6/2021 (Zero Coupon)	13.999.651	1,71	GBP 5.000.000	OP Corporate Bank Plc RegS 14/1/2022 (Zero Coupon)	4.998.446	0,61
GBP 20.000.000	The Norinchukin Bank 24/8/2021 (Zero Coupon)	19.996.577	2,44			49.485.683	6,03
		119.994.518	14,62	France			
Luxembourg				GBP 33.000.000	Agence Centrale Des Organismes De RegS 8/6/2021 (Zero Coupon)	32.999.494	4,02
GBP 5.000.000	UBS AG 0,01% 17/6/2021	5.000.000	0,61	GBP 4.000.000	Agence Centrale Des Organismes De RegS 6/8/2021 (Zero Coupon)	3.999.386	0,49
		5.000.000	0,61	GBP 12.000.000	Agence Centrale Des Organismes De RegS 10/8/2021 (Zero Coupon)	11.998.274	1,46
Pays-Bas				GBP 25.000.000	BRED Banque Populaire RegS 11/8/2021 (Zero Coupon)	24.993.700	3,04
GBP 29.000.000	ABN Amro Bank NV 6/8/2021 (Zero Coupon)	28.996.497	3,53	GBP 5.000.000	Dexia Credit Local RegS 5/7/2021 (Zero Coupon)	4.999.697	0,61
GBP 30.800.000	Cooperatieve Rabobank UA RegS 9/8/2021 (Zero Coupon)	30.795.750	3,75	GBP 10.000.000	Dexia Credit Local RegS 26/8/2021 (Zero Coupon)	9.998.116	1,22
		59.792.247	7,28	GBP 20.000.000	LMA SA RegS 3/6/2021 (Zero Coupon)	19.999.956	2,44
Singapour				GBP 12.000.000	LMA SA RegS 14/6/2021 (Zero Coupon)	11.999.701	1,46
GBP 19.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp 19/11/2021 (Zero Coupon)	18.990.986	2,31			120.988.324	14,74
		18.990.986	2,31	Suisse			
Suisse				GBP 6.000.000	Zuercher Kantonalbank 22/6/2021 (Zero Coupon)	5.999.774	0,73
		5.999.774	0,73	Royaume-Uni			
GBP 15.000.000	Bank of America NA 0,03% 19/7/2021	15.000.000	1,83	GBP 15.000.000	Bank of America NA 0,03% 19/7/2021	15.000.000	1,83
GBP 16.000.000	Bank of America NA 0,04% 3/8/2021	16.000.000	1,95	GBP 16.000.000	Bank of America NA 0,04% 3/8/2021	16.000.000	1,95

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché GBP	% de l'actif net
Irlande			
GBP 3.000.000	Matchpoint Finance Plc RegS 12/7/2021 (Zero Coupon)	2.999.663	0,37
GBP 13.000.000	Matchpoint Finance Plc RegS 6/8/2021 (Zero Coupon)	12.997.415	1,58
		15.997.078	1,95
Pays-Bas			
GBP 25.000.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 29/6/2021 (Zero Coupon)	24.999.185	3,04
		24.999.185	3,04
Singapour			
GBP 11.000.000	DBS Bank Ltd 22/6/2021 (Zero Coupon)	10.999.652	1,34
		10.999.652	1,34
Suède			
GBP 15.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 21/10/2021 (Zero Coupon)	14.995.042	1,83
GBP 15.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 29/10/2021 (Zero Coupon)	14.994.454	1,82
GBP 12.000.000	Swedbank AB RegS 10/11/2021 (Zero Coupon)	11.994.677	1,46
		41.984.173	5,11
États-Unis			
GBP 6.596.000	Mont Blanc Capital Corp RegS 16/8/2021 (Zero Coupon)	6.594.901	0,80
GBP 4.000.000	Sheffield Receivables Co LLC 1/9/2021 (Zero Coupon)	3.999.194	0,49
		10.594.095	1,29
Total des billets de trésorerie		279.048.119	33,99
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		716.863.966	87,32
Organismes de placement collectif			
Irlande			
808.619	BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund (Dist)^-	80.870.034	9,85
		80.870.034	9,85
Total des organismes de placement collectif		80.870.034	9,85
Portefeuille de titres à la valeur de marché		797.734.000	97,17
Autres éléments de l'actif net		23.263.763	2,83
Total de l'actif net (GBP)		820.997.763	100,00
^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.			
^- Investissement dans un fonds de partie liée.			

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées GBP	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées GBP
Instruments financiers dérivés				Royaume-Uni suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				815.564	Bytes Technology Group Plc	HSBC	172.900
Australie				(620.239)	C&C Group Plc	Goldman Sachs	137.732
45.687	Xero Ltd	HSBC	(83.595)	(161.801)	C&C Group Plc	Goldman Sachs	(90.609)
10.382	Xero Ltd	JP Morgan	(18.996)	(80.601)	Carnival Plc	Goldman Sachs	(139.279)
			(102.591)	2.316.663	Chrysalis Investments Ltd	HSBC	162.166
Danemark				(333.988)	Clinigen Group Plc	Goldman Sachs	18.413
143.120	Vestas Wind Systems A/S	JP Morgan	21.548	665.585	Clipper Logistics Plc	Goldman Sachs	479.221
			21.548	(227.724)	Compass Group Plc	HSBC	(18.218)
Allemagne				293.272	Computacenter Plc	JP Morgan	199.425
(99.110)	Deutsche EuroShop AG	HSBC	34.144	(498.261)	Countryside Properties Plc	HSBC	87.196
			34.144	111.116	Cranwick Plc	Goldman Sachs	56.307
Irlande				226.962	CRH Plc	JP Morgan	133.908
(40.860)	Kerry Group Plc 'A'	HSBC	(66.863)	466.257	CVS Group Plc	JP Morgan	(116.564)
(8.210)	Kerry Group Plc 'A'	JP Morgan	(13.435)	197.679	Dechra Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	43.489
			(80.298)	(81.481)	Deliveroo Plc	Goldman Sachs	(13.444)
Italie				(767.249)	Deliveroo Plc	JP Morgan	(12.547)
28.119	Ferrari NV	Goldman Sachs	202.217	(215.814)	Diageo Plc	Goldman Sachs	(92.800)
			202.217	(74.106)	Dignity Plc	HSBC	44.464
Pays-Bas				230.048	Diploma Plc	JP Morgan	82.644
11.223	ASML Holding NV	Goldman Sachs	312.208	(2.413.928)	Dixons Carphone Plc	JP Morgan	58.487
74.196	Euronext NV	JP Morgan	720.765	(986.831)	Domino's Pizza Group Plc	HSBC	270.392
(39.518)	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	HSBC	70.112	865.895	Dr. Martens Plc	Goldman Sachs	58.881
			1.103.085	469.456	Draper Esprit Plc	Goldman Sachs	328.619
Norvège				(988.997)	DS Smith Plc	HSBC	59.958
657.863	NEL ASA	Goldman Sachs	54.519	611.666	Dunelm Group Plc	HSBC	87.878
			54.519	(342.915)	easyJet Plc	JP Morgan	(85.065)
Espagne				2.149.620	Electrocomponents Plc	Goldman Sachs	(365.435)
139.210	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	JP Morgan	64.743	200.848	Experian Plc	Goldman Sachs	111.821
			64.743	(330.486)	FDM Group Holdings Plc	Goldman Sachs	(66.097)
Suède				92.473	Future Plc	HSBC	(62.670)
516.019	Desenio Group AB	HSBC	(142.732)	81.272	Games Workshop Group Plc	HSBC	934.628
225.527	Hemnet Group AB	HSBC	623.814	1.211.739	Gamma Communications Plc	HSBC	2.496.182
			481.082	469.512	GB Group Plc	JP Morgan	281.707
Suisse				(310.246)	Glanbia Plc	HSBC	(77.488)
(64.912)	Nestle SA Reg	HSBC	(100.731)	(599.588)	GlaxoSmithKline Plc	Goldman Sachs	212.254
(32.098)	Temenos AG Reg	Goldman Sachs	(164.774)	705.649	Grafton Group Plc (Unit)	HSBC	(465.728)
			(265.505)	(1.305.639)	Greencore Group Plc	HSBC	239.001
Royaume-Uni				225.149	Greggs Plc	HSBC	(216.433)
(198.689)	3i Group Plc	HSBC	(18.875)	(33.198)	Hammerson Plc (REIT)	Goldman Sachs	(13.263)
215.334	4imprint Group Plc	JP Morgan	1.005.210	265.075	Hargreaves Lansdown Plc	HSBC	(304.836)
101.772	888 Holdings Plc	JP Morgan	(6.513)	(2.265.814)	Hipgnosis Songs Fund Ltd	JP Morgan	(24.907)
799.985	AJ Bell Plc	HSBC	(82.376)	783.188	Howden Joinery Group Plc	HSBC	(97.115)
345.412	Ashtead Group Plc	HSBC	1.157.130	(1.343.300)	HSBC Holdings Plc	Goldman Sachs	(159.853)
(169.416)	Associated British Foods Plc	JP Morgan	81.320	859.003	Impax Asset Management Group Plc	Goldman Sachs	979.263
72.716	AstraZeneca Plc	Goldman Sachs	109.801	(203.954)	Imperial Tobacco Group Plc	HSBC	27.534
451.990	Auction Technology Group Plc	Goldman Sachs	994.378	1.715.035	IntegraFin Holdings Plc	JP Morgan	(85.389)
(544.845)	Auto Trader Group Plc	Goldman Sachs	22.257	(81.101)	InterContinental Hotels Group Plc	Goldman Sachs	(36.495)
184.779	AVEVA Group Plc	HSBC	451.418	363.630	Intermediate Capital Group Plc	Goldman Sachs	316.358
(585.874)	Babcock International Group Plc	Goldman Sachs	(63.274)	(83.224)	Intertek Group Plc	HSBC	439.716
(1.282.472)	BAE Systems Plc	Goldman Sachs	(48.734)	325.735	ITM Power Plc	Goldman Sachs	237.787
1.592.313	Balfour Beatty Plc	Goldman Sachs	28.662	(598.132)	IWG Plc	Goldman Sachs	(2.991)
388.099	BHP Group Plc	JP Morgan	(974.792)	(2.415.890)	J Sainsbury Plc	JP Morgan	(229.510)
478.641	Bovis Homes Group Plc	HSBC	131.454	1.957.923	JD Sports Fashion Plc	JP Morgan	584.133
(1.354.069)	BP Plc	HSBC	60.837	494.900	JET2 Plc	HSBC	(878.448)
11.543.156	Breedon Group Plc	JP Morgan	115.432	(564.960)	John Wood Group Plc	Goldman Sachs	146.890
(172.919)	British American Tobacco Plc	Goldman Sachs	178.971	252.009	Kainos Group Plc	Goldman Sachs	63.002
(883.106)	British Land Co Plc (REIT)	HSBC	307.321	(379.633)	Kier Group Plc	Goldman Sachs	6.561
518.548	Bunzl Plc	JP Morgan	(160.750)	(647.931)	Land Securities Group Plc (REIT)	HSBC	307.119
				3.474.825	Learning Technologies Group Plc	HSBC	271.036
				(1.758.614)	Legal & General Group Plc	JP Morgan	72.103
				320.187	Liontrust Asset Management Plc	HSBC	(256.150)
				(7.341.408)	Lloyds Banking Group Plc	HSBC	(149.765)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente GBP	Moins-value nette non réalisée GBP
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(517)	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	76.721.746	(5.074.223)
(415)	EUR	EURO STOXX 50 Index Futures June 2021	Juin 2021	14.486.288	(1.002.567)
(2.159)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2021	Juin 2021	151.637.365	(7.742.713)
(1.872)	GBP	FTSE 250 Index Futures June 2021	Juin 2021	84.962.592	(5.189.184)
Total				327.807.991	(19.008.687)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées GBP
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	45.002.840	GBP	35.602.453	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(320.665)
GBP	1.389.511	CHF	1.772.091	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	212
						(320.453)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNH	36.762	GBP	4.087	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(18)
GBP	162	CNH	1.474	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
						(18)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	460.747.604	GBP	399.904.032	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(2.987.975)
GBP	24.036.340	EUR	27.910.028	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(7.058)
						(2.995.033)
Catégorie d'Actions couverte en USD						
GBP	5.906.777	USD	8.334.660	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	24.941
USD	148.102.164	GBP	106.345.183	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1.828.272)
						(1.803.331)
Total (Exposition brute sous-jacente - GBP 568.033.530)						(5.118.835)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	74,18
Organismes de placement collectif	9,85
Gouvernement	5,97
Biens de consommation cyclique	3,97
Technologie	2,67
Énergie	0,53
Portefeuille de titres à la valeur de marché	97,17
Autres éléments de l'actif net	2,83
<hr/>	
	100,00

BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché USD	% de l'actif net			Valeur de marché USD	% de l'actif net	
Nombre	Description			Nombre	Description			
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé								
ACTIONS ORDINAIRES & DROITS								
Argentine								
17.368	YPF SA ADR	81.630	0,65					
		81.630	0,65					
Brésil								
67.041	Banco Bradesco SA ADR	340.568	2,70					
42.651	Ultrapar Participacoes SA	155.878	1,23					
		496.446	3,93					
Îles Caïmans								
2.750	Baidu Inc 'A'	68.209	0,54					
1.748	Baidu Inc ADR [*]	343.080	2,72					
27.000	CK Hutchison Holdings Ltd	211.344	1,68					
1.750	JD.com Inc 'A'	65.661	0,52					
36.000	Sunac China Holdings Ltd	132.895	1,05					
		821.189	6,51					
Chine								
525.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	344.992	2,73					
21.400	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A'	136.041	1,08					
50.925	Jinyu Bio-Technology Co Ltd 'A'	161.427	1,28					
71.000	Suzhou Basecare Medical Corp Ltd 'H'	257.980	2,04					
		900.440	7,13					
Chypre								
5.182	Ozon Holdings Plc ADR	275.009	2,18					
		275.009	2,18					
Grèce								
101.942	National Bank of Greece SA	321.476	2,55					
129.251	Piraeus Financial Holdings SA [*]	239.762	1,90					
		561.238	4,45					
Hong Kong								
34.000	Hua Hong Semiconductor Ltd	182.462	1,45					
		182.462	1,45					
Inde								
38.313	Bandhan Bank Ltd	162.120	1,28					
22.754	ICICI Bank Ltd ADR [*]	409.800	3,25					
55.162	Zee Entertainment Enterprises Ltd	159.282	1,26					
		731.202	5,79					
Indonésie								
721.200	Astra International Tbk PT	265.147	2,10					
		265.147	2,10					
Italie								
33.300	PRADA SpA	231.910	1,84					
		231.910	1,84					
Luxembourg								
4.679	Allegro.eu SA	73.801	0,58					
		73.801	0,58					
Malaisie								
2.460.300	Sapura Energy Bhd	71.581	0,56					
162.600	Top Glove Corp Bhd	204.211	1,62					
		275.792	2,18					
Mexique								
22.080	Cemex SAB de CV ADR	182.822	1,45					
		182.822	1,45					
				Pologne				
				14.067	Polski Koncern Naftowy OR LEN SA	315.739	2,50	
						315.739	2,50	
				Portugal				
				1.002.932	Banco Comercial Portugues SA 'R'	195.102	1,55	
						195.102	1,55	
				Qatar				
				24.638	Qatar National Bank QPSC	117.943	0,93	
						117.943	0,93	
				Russie				
				7.107	LUKOIL PJSC ADR	578.936	4,59	
				2.657	Magnit PJSC	197.973	1,57	
						776.909	6,16	
				Corée du Sud				
				2.781	Eoflow Co Ltd	141.422	1,12	
				435	HYBE Co Ltd	103.753	0,82	
				27	HYBE Co Ltd (Right)	1.579	0,01	
				255	NCSOFT Corp	199.217	1,58	
				647	SK Holdings Co Ltd	154.318	1,23	
						600.289	4,76	
				Émirats arabes unis				
				617.861	Air Arabia PJSC	230.463	1,82	
				504.393	Emaar Properties PJSC	542.447	4,30	
						772.910	6,12	
				Total des actions ordinaires et droits			7.857.980	62,26
				OBLIGATIONS				
				États-Unis				
				USD 486.100	United States Treasury Bill 17/6/2021 (Zero Coupon)	486.075	3,85	
				USD 400.000	United States Treasury Bill 8/7/2021 (Zero Coupon)	399.981	3,17	
				USD 400.000	United States Treasury Bill 19/8/2021 (Zero Coupon)	399.983	3,17	
				USD 400.000	United States Treasury Bill 23/9/2021 (Zero Coupon)	399.978	3,17	
				USD 400.000	United States Treasury Bill 21/10/2021 (Zero Coupon)	399.966	3,17	
				USD 400.000	United States Treasury Bill 26/11/2021 (Zero Coupon)	399.943	3,16	
				USD 400.000	United States Treasury Bill - WI Post Auction 5/8/2021 (Zero Coupon)	399.965	3,17	
						2.885.891	22,86	
				Total des obligations			2.885.891	22,86
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				
						10.743.871	85,12	
				Organismes de placement collectif				
				Irlande				
				11.626	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) ⁻	1.163.135	9,22	
						1.163.135	9,22	
				Total des organismes de placement collectif			1.163.135	9,22
				Portefeuille de titres à la valeur de marché			11.907.006	94,34
				Autres éléments de l'actif net			714.631	5,66
				Total de l'actif net (USD)			12.621.637	100,00
				[*] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.				
				⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				Royaume-Uni			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(9.628)	MMC Norilsk Nickel PJSC ADR	Goldman Sachs	11.457
Australie				(3.817)	TCS Group Holding Plc Reg GDR	Goldman Sachs	(51.453)
(33.259)	Fortescue Metals Group Ltd	HSBC	71.219				(39.996)
			71.219	États-Unis			
Brésil				(17.288)	Himax Technologies Inc ADR	Credit Suisse	(37.798)
(21.714)	Banco Inter SA (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(27.635)	(7.231)	Jumia Technologies AG ADR	Citibank	(13.667)
(82.503)	Magazine Luiza SA	HSBC	(14.392)	(123)	MercadoLibre Inc	HSBC	3.172
(70.119)	Raia Drogasil SA	HSBC	(2.069)	(6.793)	MINISO Group Holding Ltd ADR	Citibank	26.561
62.915	Via Varejo S/A	Goldman Sachs	10.413	29.640	Petroleo Brasileiro SA ADR	HSBC	29.344
(42.396)	WEG SA	HSBC	(13.222)	(3.032)	Pinduoduo Inc ADR	HSBC	(9.510)
			(46.905)	(692)	Sea Ltd ADR	HSBC	(21.238)
Îles Caïmans				(2.735)	StoneCo Ltd 'A'	Citibank	(8.150)
(8.257)	NIO Inc ADR	HSBC	(35.422)	(2.334)	Tencent Holdings Ltd ADR	Goldman Sachs	(141)
			(35.422)	(4.799)	XP Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	15.501
Hong Kong				(7.211)	ZTO Express Cayman Inc ADR	Credit Suisse	(5.408)
(43.000)	BYD Electronic International Co Ltd	Citibank	(5.946)				(21.334)
430.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H'	HSBC	4.537	Total (Exposition brute sous-jacente - USD 9.746.736)			
(21.200)	China Literature Ltd	HSBC	(18.415)				(255.211)
(137.000)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(40.492)				
(51.000)	Kingdee International Software Group Co Ltd	Citibank	(5.501)				
(9.400)	Shenzhen International Group Holdings Ltd	HSBC	(21.803)				
			(87.620)				
Malaisie							
(344.700)	Top Glove Corp Bhd	Citibank	8.524				
			8.524				
Mexique							
(96.580)	Becele SAB de CV	Morgan Stanley	(7.004)				
			(7.004)				
Norvège							
(781)	Scatec ASA	Goldman Sachs	(1.152)				
			(1.152)				
Philippines							
16.800	GT Capital Holdings Inc	Credit Suisse	22.519				
			22.519				
Pologne							
(5.856)	Dino Polska SA	HSBC	(50.125)				
			(50.125)				
Arabie Saoudite							
(10.673)	Al Rajhi Bank	HSBC	(11.391)				
(77.433)	Saudi Kayan Petrochemical Co	HSBC	(9.507)				
			(20.898)				
Afrique du Sud							
(1.002)	Naspers Ltd 'N'	Goldman Sachs	(4.195)				
			(4.195)				
Corée du Sud							
3.254	Fila Holdings Corp	Citibank	4.878				
			4.878				
Taiwan							
(212.000)	Acer Inc	Citibank	(11.843)				
			(11.843)				
Thaïlande							
(14.000)	Delta Electronics Thailand PCL NVDR	Morgan Stanley	(35.857)				
			(35.857)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Moins-value nette non réalisée USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(8)	USD	MSCI Emerging Markets Index Futures June 2021	Juin 2021	549.760	(10.607)
(9)	INR	UPL Ltd Futures June 2021	Juin 2021	132.019	(2.611)
Total				681.779	(13.218)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	150.122	INR	11.084.600	Bank of America Merrill Lynch	13/8/2021	(938)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	3.735.371	USD	4.514.375	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	45.408
USD	218.704	EUR	179.315	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(187)
						45.221
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	25.063	USD	34.893	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	618
USD	1.250	GBP	885	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1)
						617
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 4.966.500)						44.900

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	22,86
Finance	22,24
Énergie	10,76
Communications	9,38
Organismes de placement collectif	9,22
Biens de consommation non cyclique	7,09
Biens de consommation cyclique	6,59
Valeurs industrielles	3,07
Diversifiés	1,68
Technologie	1,45
Portefeuille de titres à la valeur de marché	94,34
Autres éléments de l'actif net	5,66
<hr/>	
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Argentine							
1.436.305	Grupo Financiero Galicia SA ADR	12.754.389	1,41				
2.083.669	YPF SA ADR	9.793.244	1,08				
		22.547.633	2,49				
Brésil							
2.594.487	Banco do Brasil SA	16.730.602	1,85				
3.124.608	BB Seguridade Participacoes SA	13.977.950	1,54				
1.308.686	Gol Linhas Aereas Inteligentes SA ADR	13.400.945	1,48				
578.483	Petroleo Brasileiro SA ADR	5.906.311	0,65				
1.220.765	Suzano SA	14.314.023	1,58				
		64.329.831	7,10				
Îles Caïmans							
697.000	Baidu Inc 'A'	17.287.931	1,91				
865.000	CK Hutchison Holdings Ltd	6.770.830	0,75				
4.664.000	Geely Automobile Holdings Ltd	11.862.745	1,31				
127.050	JD.com Inc 'A'	4.767.004	0,53				
56.350	JD.com Inc ADR	4.166.519	0,46				
677.173	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	11.640.604	1,29				
3.004.000	Sunac China Holdings Ltd	11.089.299	1,22				
9.540.000	Topsports International Holdings Ltd	14.529.323	1,60				
6.510.000	Wynn Macau Ltd^	10.988.333	1,21				
		93.102.588	10,28				
Chili							
227.842	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	9.881.507	1,09				
		9.881.507	1,09				
Chine							
35.356.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H''	15.944.492	1,76				
9.523.000	China Molybdenum Co Ltd 'A'	8.686.768	0,96				
8.313.000	China Molybdenum Co Ltd 'H''	5.730.481	0,63				
38.398.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	20.433.284	2,26				
2.833.300	Haier Smart Home Co Ltd 'A'	13.420.731	1,48				
2.604.300	Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd 'A'	15.333.121	1,69				
8.671.118	Infocore Environment Technology Group Co Ltd 'A'	10.850.299	1,20				
2.612.884	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd 'A'	16.610.251	1,84				
3.864.546	Jinyu Bio-Technology Co Ltd 'A'	12.250.198	1,35				
2.099.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H''	22.839.764	2,52				
8.628.853	Zhejiang Huace Film & TV Co Ltd 'A'	8.291.112	0,92				
		150.390.501	16,61				
Chypre							
437.401	Ozon Holdings Plc ADR	23.212.871	2,56				
		23.212.871	2,56				
				République tchèque			
				608.302	CEZ AS	18.258.875	2,02
						18.258.875	2,02
				Grèce			
				5.763.111	National Bank of Greece SA	18.174.059	2,01
				8.952.390	Piraeus Financial Holdings SA^	16.606.765	1,83
						34.780.824	3,84
				Hong Kong			
				2.496.000	Hua Hong Semiconductor Ltd^	13.394.889	1,48
						13.394.889	1,48
				Inde			
				3.064.221	Bandhan Bank Ltd	12.966.162	1,43
				2.289.773	ICICI Bank Ltd	20.883.764	2,31
				197.554	ICICI Bank Ltd ADR^	3.557.948	0,39
				7.167.305	Indiabulls Housing Finance Ltd	22.013.389	2,43
				498.150	InterGlobe Aviation Ltd	12.004.028	1,32
				1.639.767	Tech Mahindra Ltd	23.143.808	2,56
						94.569.099	10,44
				Indonésie			
				50.511.300	Astra International Tbk PT	18.570.331	2,05
				46.991.800	XL Axiata Tbk PT	8.095.226	0,90
						26.665.557	2,95
				Luxembourg			
				321.487	Allegro.eu SA^	5.070.723	0,56
						5.070.723	0,56
				Malaisie			
				111.083.800	Sapura Energy Bhd	3.231.920	0,36
						3.231.920	0,36
				Mexique			
				10.599.648	Fibra Uno Administracion SA de CV (REIT)	12.451.378	1,38
						12.451.378	1,38
				Philippines			
				712.100	Ayala Corp	11.854.647	1,31
				5.923.620	BDO Unibank Inc	12.879.325	1,42
						24.733.972	2,73
				Pologne			
				419.832	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	9.423.284	1,04
						9.423.284	1,04
				Qatar			
				1.957.460	Qatar National Bank QPSC	9.370.397	1,04
						9.370.397	1,04
				Russie			
				456.656	LUKOIL PJSC ADR	37.199.198	4,11
				198.986	Magnit PJSC	14.826.434	1,64
						52.025.632	5,75
				Afrique du Sud			
				2.628.300	Sibanye Stillwater Ltd	12.396.019	1,37
						12.396.019	1,37
				Corée du Sud			
				30.404	Korea Zinc Co Ltd	12.355.345	1,36

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Corée du Sud suite			
862.068	Samsung Electronics Co Ltd	62.460.262	6,90
56.941	SK Holdings Co Ltd	13.581.175	1,50
		88.396.782	9,76
Taiwan			
1.608.000	Catcher Technology Co Ltd	10.718.058	1,18
4.074.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	16.750.553	1,85
287.000	Wiwynn Corp	9.679.297	1,07
		37.147.908	4,10
Émirats arabes unis			
31.148.493	Emaar Properties PJSC	33.498.475	3,70
		33.498.475	3,70
Royaume-Uni			
2.665.234	Mediclinic International Plc (traded in South Africa)	12.479.110	1,38
540.997	Mediclinic International Plc (traded in United Kingdom)	2.502.160	0,27
		14.981.270	1,65
États-Unis			
119.216	Cree Inc	11.922.792	1,32
		11.922.792	1,32
Total des actions ordinaires		865.784.727	95,62
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		865.784.727	95,62
Organismes de placement collectif			
Irlande			
391.501	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist) [^]	39.167.483	4,33
		39.167.483	4,33
Total des organismes de placement collectif		39.167.483	4,33
Portefeuille de titres à la valeur de marché		904.952.210	99,95
Autres éléments de l'actif net		482.617	0,05
Total de l'actif net (USD)		905.434.827	100,00

[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

[~] Investissement dans un fonds de partie liée.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				Taiwan			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				290.000	Wiwynn Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.679.800
Australie							
(1.416.909)	Fortescue Metals Group Ltd	HSBC	3.034.110				
			3.034.110	Thaïlande			
Brésil				(68.000)	Delta Electronics Thailand		
(504.901)	B2W Cia Digital	Bank of America Merrill Lynch	(131.205)	(933.200)	PCL NVDR	Goldman Sachs	(161.385)
(1.569.708)	Banco Inter SA (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(1.776.536)		PCL NVDR	UBS	(2.188.318)
22.662.126	Cielo SA	Credit Suisse	3.092.971				
(918.058)	Magazine Luiza SA	Bank of America Merrill Lynch	(244.121)	Turquie			
(3.763.277)	Magazine Luiza SA	Credit Suisse	(656.480)	(20.000.000)	Emlak Konut Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS (REIT)	Goldman Sachs	19.067
(1.456.168)	Magazine Luiza SA	HSBC	(254.019)	(28.190.800)	Emlak Konut Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS (REIT)	HSBC	45.505
524.154	Suzano SA	Credit Suisse	(732.209)	(10.130.198)	Haci Omer Sabanci Holding AS	HSBC	171.962
7.284.946	Via Varejo S/A	Goldman Sachs	1.205.821				
(1.817.082)	WEG SA	Bank of America Merrill Lynch	(696.963)	Royaume-Uni			
(1.246.370)	WEG SA	HSBC	(388.696)	(553.445)	MMC Norilsk Nickel PJSC ADR	Goldman Sachs	658.599
			(581.437)				
Îles Caimans				États-Unis			
(576.425)	NIO Inc ADR	UBS	(2.772.604)	43.400	Baidu Inc ADR	Goldman Sachs	306.838
			(2.772.604)	1.083.288	Cemex SAB de CV ADR	Credit Suisse	(216.658)
Grèce				108.192	Credicorp Ltd	Goldman Sachs	(735.706)
885.236	National Bank of Greece SA	HSBC	(154.632)	82.663	Cree Inc	Credit Suisse	626.305
			(154.632)	165.218	JD.com Inc ADR	Credit Suisse	419.654
Hong Kong				(386.534)	Jumia Technologies AG ADR	Bank of America Merrill Lynch	(1.186.659)
35.619.000	China Construction Bank Corp 'H'	HSBC	383.167	(89.383)	Jumia Technologies AG ADR	Credit Suisse	(513.058)
2.625.000	CK Hutchison Holdings Ltd	Credit Suisse	(1.678.824)	(253.192)	Lattice Semiconductor Corp	Credit Suisse	(1.615.365)
(8.490.000)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(2.819.233)	(8.857)	MercadoLibre Inc	HSBC	228.422
(239.300)	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.269.487)	13.996	Petroleo Brasileiro SA ADR	Credit Suisse	13.856
42.642.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Credit Suisse	344.999	1.548.762	Petroleo Brasileiro SA ADR	HSBC	1.533.274
109.600	JD.com Inc 'A'	HSBC	58.733	(202.463)	Pinduoduo Inc ADR	HSBC	(633.361)
267.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Credit Suisse	94.444	(53.815)	Sea Ltd ADR	HSBC	(1.651.582)
2.440.000	Sunac China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(55.288)	222.232	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	Credit Suisse	(1.493.207)
			(4.941.489)	(289.327)	StoneCo Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.897.985)
Indonésie				422.203	Trip.com Group Ltd ADR	Credit Suisse	2.127.903
1.201.700	Astra International Tbk PT	HSBC	(13.148)				
			(13.148)	Total (Exposition brute sous-jacente - USD 649.349.837)			
Malaisie							
55.823.800	Sapura Energy Bhd	HSBC	(278.536)				
			(278.536)				
Pologne							
4.871.736	PGE Polska Grupa Energetyczna SA	HSBC	693.760				
182.272	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	HSBC	602.280				
			1.296.040				
Arabie Saoudite							
927.150	Saudi Arabian Mining Co	HSBC	964.522				
			964.522				
Corée du Sud							
232.764	Fila Holdings Corp	Credit Suisse	(284.757)				
450.939	Korea Electric Power Corp	Credit Suisse	572.867				
296.871	Samsung Electronics Co Ltd	HSBC	(665.552)				
26.731	Samsung SDI Co Ltd	HSBC	(850.758)				
			(1.228.200)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(8.400)	TRY	Bist 30 Index Futures June 2021	Juin 2021	15.085.795	(549.135)
461	USD	FTSE Taiwan Index Future June 2021	Juin 2021	27.623.120	677.670
Total				42.708.915	128.535

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	3.757.445	USD	4.140.250	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	33.996
USD	241.523	CHF	217.955	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(607)
						33.389
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	31.571.823	USD	38.161.883	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	377.971
USD	1.489.866	EUR	1.226.832	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(7.732)
						370.239
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 44.453.832)						403.628

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	27,79
Biens de consommation cyclique	13,50
Technologie	13,33
Énergie	11,00
Communications	7,84
Matériaux de base	6,99
Biens de consommation non cyclique	6,48
Valeurs industrielles	5,92
Organismes de placement collectif	4,33
Services aux collectivités	2,02
Diversifiés	0,75
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,95
Autres éléments de l'actif net	0,05
100,00	

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché USD	% de l'actif net			Valeur de marché USD	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
Angola							
USD 1.780.000	Angolan Government International Bond RegS 9,50% 12/11/2025	1.962.779	0,13	USD 8.275.000	Costa Rica Government International Bond RegS 7,00% 4/4/2044	8.684.437	0,57
USD 8.545.000	Angolan Government International Bond RegS 8,25% 9/5/2028	8.891.372	0,58	USD 22.886.000	Costa Rica Government International Bond RegS 7,158% 12/3/2045	24.204.863	1,58
USD 43.769.000	Angolan Government International Bond RegS 9,375% 8/5/2048	45.493.499	2,97			39.378.964	2,57
USD 15.349.000	Angolan Government International Bond RegS 9,125% 26/11/2049	15.694.007	1,02				
		72.041.657	4,70				
Argentine							
USD 10.907.072	Argentine Republic Government International Bond 1,00% 9/7/2029 [^]	4.267.556	0,28	République dominicaine			
USD 13.441.648	Argentine Republic Government International Bond 0,125% 9/7/2030	4.978.114	0,32	DOP 932.450.000	Dominican Republic International Bond RegS 9,75% 5/6/2026	18.368.189	1,20
USD 19.763.905	Argentine Republic Government International Bond 0,125% 9/1/2038	7.845.677	0,51	USD 10.381.000	Dominican Republic International Bond RegS 4,875% 23/9/2032	10.702.162	0,70
USD 8.107.811	Province of Salta Argentina RegS 5,00% 1/12/2027	5.349.372	0,35	USD 11.654.000	Dominican Republic International Bond RegS 5,30% 21/1/2041 [^]	11.710.784	0,76
ARS 103.197.000	Provincia de Buenos Aires FRN 31/5/2022	608.722	0,04	USD 5.070.000	Dominican Republic International Bond RegS 7,45% 30/4/2044	6.123.914	0,40
USD 4.865.000	Provincia de Buenos Aires RegS 6,50% 15/2/2023	2.102.592	0,14	USD 4.917.000	Dominican Republic International Bond RegS 6,85% 27/1/2045	5.589.424	0,36
USD 17.227.000	Provincia de Buenos Aires RegS 9,125% 16/3/2024	7.337.625	0,48	USD 6.257.000	Dominican Republic International Bond RegS 6,50% 15/2/2048	6.851.572	0,45
ARS 389.865.000	Provincia de Buenos Aires RegS FRN 12/4/2025	2.067.809	0,14	USD 5.578.000	Dominican Republic International Bond RegS 5,875% 30/1/2060	5.511.761	0,36
USD 6.243.000	Provincia de Buenos Aires RegS 9,625% 18/4/2028 [^]	2.753.038	0,18			64.857.806	4,23
USD 2.009.466	Tarjeta Naranja SA RegS FRN 11/4/2022 [^]	156.095	0,01	Ecuador			
		37.466.600	2,45	USD 13.887.069	Ecuador Government International Bond RegS 31/7/2030 (Zero Coupon)	7.885.252	0,52
Chine				USD 13.200.921	Ecuador Government International Bond RegS 0,50% 31/7/2030 [^]	11.484.801	0,75
CNY 243.020.000	China Government Bond 3,03% 11/3/2026	38.372.000	2,50	USD 15.754.328	Ecuador Government International Bond RegS 0,50% 31/7/2035	11.087.108	0,72
CNY 241.410.000	China Government Bond 3,27% 19/11/2030	38.516.139	2,51			30.457.161	1,99
CNY 96.420.000	China Government Bond 3,81% 14/9/2050	15.728.784	1,03	Égypte			
		92.616.923	6,04	EGP 225.710.000	Egypt Government Bond 14,85% 10/4/2023	14.642.720	0,96
Colombie				EGP 124.588.000	Egypt Government Bond 14,425% 14/7/2030	7.801.335	0,51
USD 2.641.000	Colombia Government International Bond 4,50% 15/3/2029	2.861.820	0,19	EGP 124.458.000	Egypt Government Bond 15,433% 28/7/2035	8.014.762	0,52
USD 3.671.000	Ecopetrol SA 6,875% 29/4/2030	4.363.718	0,28	USD 6.450.000	Egypt Government International Bond RegS 5,25% 6/10/2025 [^]	6.855.447	0,45
		7.225.538	0,47	USD 1.983.000	Egypt Government International Bond RegS 5,875% 16/2/2031	1.955.114	0,13
Costa Rica				EUR 4.103.000	Egypt Government International Bond RegS 6,375% 11/4/2031	5.326.144	0,35
USD 6.061.000	Costa Rica Government International Bond RegS 6,125% 19/2/2031 [^]	6.489.664	0,42	USD 22.627.000	Egypt Government International Bond RegS 7,625% 29/5/2032	24.550.974	1,60

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Égypte suite				Ghana suite			
USD 3.512.000	Egypt Government International Bond RegS 8,50% 31/1/2047	3.739.560	0,24	USD 6.049.000	Ghana Government International Bond RegS 8,75% 11/3/2061	5.885.314	0,38
USD 8.651.000	Egypt Government International Bond RegS 7,903% 21/2/2048	8.787.967	0,57	GHS 47.907.000	Republic of Ghana Government Bonds 20,75% 16/1/2023	8.674.179	0,57
USD 6.499.000	Egypt Government International Bond RegS 8,70% 1/3/2049	7.016.304	0,46	GHS 50.649.000	Republic of Ghana Government Bonds 17,60% 20/2/2023	8.784.657	0,57
USD 2.254.000	Egypt Government International Bond RegS 8,875% 29/5/2050	2.481.496	0,16			91.093.135	5,95
USD 25.109.000	Egypt Government International Bond RegS 7,50% 16/2/2061	24.228.679	1,58	Indonésie			
		115.400.502	7,53	IDR 120.548.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,00% 15/9/2030	8.787.848	0,58
El Salvador				IDR 106.795.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,50% 15/2/2031	7.530.992	0,49
USD 1.661.000	El Salvador Government International Bond RegS 7,75% 24/1/2023	1.705.640	0,11			16.318.840	1,07
USD 4.096.000	El Salvador Government International Bond RegS 8,25% 10/4/2032	4.298.240	0,28	Côte d'Ivoire			
USD 99.000	El Salvador Government International Bond RegS 7,65% 15/6/2035	99.866	0,01	EUR 11.171.000	Ivory Coast Government International Bond RegS 4,875% 30/1/2032	13.822.869	0,90
USD 6.234.000	El Salvador Government International Bond RegS 7,625% 1/2/2041^	6.175.556	0,40	USD 800.000	Ivory Coast Government International Bond RegS 6,125% 15/6/2033	854.466	0,06
USD 3.243.000	El Salvador Government International Bond RegS 9,50% 15/7/2052^	3.502.440	0,23	EUR 1.946.000	Ivory Coast Government International Bond RegS 6,875% 17/10/2040^	2.596.715	0,17
		15.781.742	1,03			17.274.050	1,13
Gabon				Kazakhstan			
USD 21.641.338	Gabon Government International Bond RegS 6,375% 12/12/2024	22.938.358	1,50	KZT 7.045.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC RegS 8,95% 4/5/2023	16.296.507	1,06
USD 28.506.000	Gabon Government International Bond RegS 6,95% 16/6/2025	30.702.245	2,00	USD 6.680.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 5,75% 19/4/2047	8.247.712	0,54
USD 9.347.000	Gabon Government International Bond RegS 6,625% 6/2/2031	9.347.654	0,61	USD 7.489.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 6,375% 24/10/2048	9.854.026	0,64
		62.988.257	4,11			34.398.245	2,24
Ghana				Kenya			
USD 3.418.000	Ghana Government International Bond RegS 6,375% 11/2/2027	3.451.189	0,23	USD 4.488.000	Kenya Government International Bond RegS 8,00% 22/5/2032^	5.072.854	0,33
USD 9.546.000	Ghana Government International Bond RegS 7,625% 16/5/2029^	9.791.332	0,64			5.072.854	0,33
USD 8.555.000	Ghana Government International Bond RegS 8,125% 26/3/2032^	8.800.122	0,57	Liban			
USD 10.785.000	Ghana Government International Bond RegS 8,625% 7/4/2034	11.265.256	0,73	USD 17.084.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 6,375% 9/3/2020	2.314.455	0,15
USD 19.386.000	Ghana Government International Bond RegS 8,875% 7/5/2042	19.693.074	1,29	USD 11.282.000	Lebanon Government International Bond RegS (Defaulted) 5,80% 14/4/2020	1.533.647	0,10
USD 7.753.000	Ghana Government International Bond RegS 8,627% 16/6/2049	7.591.040	0,50			3.848.102	0,25
USD 7.161.000	Ghana Government International Bond RegS 8,95% 26/3/2051	7.156.972	0,47	Mexique			
				USD 2.800.000	Cemex SAB de CV RegS 7,375% 5/6/2027^	3.157.252	0,21
				MXN 161.942.100	Mexican Bonos 8,00% 7/12/2023	8.652.731	0,57
				USD 533.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	520.132	0,03
				USD 6.283.000	Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047	5.575.848	0,36
				USD 26.645.000	Petroleos Mexicanos 7,69% 23/1/2050	25.619.168	1,67

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Mexique suite				Roumanie			
USD 8.314.000	Petroleos Mexicanos 6,95% 28/1/2060	7.374.892	0,48	EUR 3.602.000	Romanian Government International Bond RegS 3,624% 26/5/2030	5.066.256	0,33
EUR 6.872.000	Petroleos Mexicanos RegS 3,75% 21/2/2024	8.598.041	0,56	EUR 4.470.000	Romanian Government International Bond RegS 2,00% 14/4/2033 [^]	5.400.039	0,35
USD 11.793.000	Petroleos Mexicanos RegS 6,875% 16/10/2025	13.133.628	0,86			10.466.295	0,68
		72.631.692	4,74	Russie			
Mozambique				RUB 540.591.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,05% 19/1/2028	7.482.577	0,49
USD 7.340.000	Mozambique International Bond RegS 5,00% 15/9/2031 [^]	6.001.257	0,39	RUB 521.601.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,70% 23/3/2033	7.443.355	0,48
		6.001.257	0,39			14.925.932	0,97
Pays-Bas				Sénégal			
USD 8.308.000	Kazakhstan Temir Zholy Finance BV RegS 6,95% 10/7/2042	11.219.788	0,73	EUR 2.586.000	Senegal Government International Bond RegS 4,75% 13/3/2028	3.305.864	0,22
USD 66.312.000	Petrobras Global Finance BV 6,85% 5/6/2115 [^]	74.545.961	4,87	USD 4.816.000	Senegal Government International Bond RegS 6,25% 23/5/2033 [^]	5.104.852	0,33
		85.765.749	5,60			8.410.716	0,55
Nigéria				Afrique du Sud			
USD 2.153.000	Nigeria Government International Bond RegS 7,143% 23/2/2030	2.300.109	0,15	USD 7.139.000	Eskom Holdings SOC Ltd RegS 7,125% 11/2/2025	7.594.111	0,49
USD 15.994.000	Nigeria Government International Bond RegS 8,747% 21/1/2031	18.321.167	1,20	ZAR 361.940.332	Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035	23.700.302	1,55
USD 14.981.000	Nigeria Government International Bond RegS 7,875% 16/2/2032	16.272.100	1,06	ZAR 390.091.858	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048	23.750.677	1,55
USD 5.000.000	Nigeria Government International Bond RegS 7,625% 28/11/2047	5.060.312	0,33	USD 4.863.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 22/6/2030 [^]	5.536.331	0,36
USD 10.486.000	Nigeria Government International Bond RegS 9,248% 21/1/2049	12.093.242	0,79			60.581.421	3,95
		54.046.930	3,53	Suède			
Oman				EUR 5.000.000	East Renewable AB 13,50% 21/11/2021	6.126.351	0,40
USD 8.040.000	Oman Government International Bond RegS 6,75% 28/10/2027	9.010.750	0,59			6.126.351	0,40
USD 17.494.000	Oman Government International Bond RegS 7,375% 28/10/2032 [^]	19.814.229	1,29	Turquie			
USD 6.884.000	Oman Government International Bond RegS 6,50% 8/3/2047	6.612.529	0,43	TRY 171.057.028	Turkey Government Bond 11,70% 13/11/2030	14.592.290	0,95
USD 37.432.000	Oman Government International Bond RegS 6,75% 17/1/2048	36.636.196	2,39	USD 4.817.000	Turkey Government International Bond 7,625% 26/4/2029	5.198.723	0,34
USD 16.602.000	Oman Government International Bond RegS 7,00% 25/1/2051 [^]	16.620.262	1,09	USD 5.573.000	Türkiye Vakıflar Bankası TAO RegS 6,50% 8/1/2026	5.671.252	0,37
		88.693.966	5,79			25.462.265	1,66
Panama				Ukraine			
USD 459.000	Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030	482.294	0,03	USD 3.678.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2024	4.058.728	0,27
		482.294	0,03	EUR 8.700.000	Ukraine Government International Bond RegS 6,75% 20/6/2026	11.687.198	0,76
Pérou				USD 3.805.000	Ukraine Government International Bond RegS 9,75% 1/11/2028 [^]	4.565.715	0,30
USD 459.000	Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031	460.595	0,03	EUR 15.697.000	Ukraine Government International Bond RegS 4,375% 27/1/2030	17.970.068	1,17
		460.595	0,03	USD 3.566.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,375% 25/9/2032	3.796.560	0,25

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre		Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre		Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Ukraine suite					Zambie				
USD 10.319.000		Ukraine Government International Bond RegS 7,253% 15/3/2033	10.870.963	0,71	USD 10.031.000		Zambia Government International Bond RegS 5,375% 20/9/2022	6.590.317	0,43
USD 35.653.000		Ukraine Government International Bond RegS FRN 31/5/2040	39.606.561	2,58	USD 2.632.000		Zambia Government International Bond RegS 8,50% 14/4/2024	1.746.167	0,12
			92.555.793	6,04	USD 8.690.000		Zambia Government International Bond RegS 8,97% 30/7/2027	5.721.105	0,37
Royaume-Uni					Total des obligations				
USD 1.500.600		State Savings Bank of Ukraine/SSB #1 Plc RegS 9,375% 10/3/2023	1.576.320	0,10	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				
USD 1.697.500		Ukreximbank/Biz Finance Plc RegS 9,625% 27/4/2022	1.759.922	0,12	1.329.980.312 86,80				
			3.336.242	0,22	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				
États-Unis					OBLIGATIONS				
USD 7.841.000		CITGO Petroleum Corp 7,00% 15/6/2025	8.164.598	0,53	Ukraine				
USD 19.372.500		United States Treasury Note/Bond 2,125% 15/8/2021	19.508.621	1,28	UAH 280.857.000		Ukraine Government International Bond RegS 16,00% 24/5/2023	10.961.850	0,71
			27.673.219	1,81	10.961.850 0,71				
Uruguay					Total des obligations				
USD 1.249.552		Uruguay Government International Bond 4,375% 23/1/2031	1.453.101	0,09	10.961.850 0,71				
UYU 488.010.000		Uruguay Government International Bond RegS 9,875% 20/6/2022	11.500.624	0,75	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				
UYU 194.721.000		Uruguay Government International Bond RegS 8,50% 15/3/2028	4.537.707	0,30	10.961.850 0,71				
			17.491.432	1,14	Organismes de placement collectif				
Venezuela					Luxembourg				
USD 298.810.114		Petroleos de Venezuela SA RegS 9,75% 17/5/2035	14.044.075	0,92	4.030.000		BlackRock Global Funds - Emerging Markets Corporate Bond Fund X2 (USD)~	65.245.700	4,26
USD 49.187.000		Petroleos de Venezuela SA RegS (Defaulted) 8,50% 27/10/2020	13.403.457	0,87	65.245.700 4,26				
USD 9.827.000		Venezuela Government International Bond 9,25% 15/9/2027	1.031.835	0,07	Total des organismes de placement collectif				
USD 9.983.500		Venezuela Government International Bond RegS 11,75% 21/10/2026	1.060.747	0,07	65.245.700 4,26				
USD 2.832.800		Venezuela Government International Bond RegS 9,25% 7/5/2028	300.985	0,02	Portefeuille de titres à la valeur de marché				
USD 44.697.400		Venezuela Government International Bond RegS 11,95% 5/8/2031	4.749.099	0,31	1.406.187.862 91,77				
			34.590.198	2,26	Autres éléments de l'actif net				
					126.099.267 8,23				
					Total de l'actif net (USD)				
					1.532.287.129 100,00				
					^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.				
					- Investissement dans un fonds de partie liée.				

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	USD 61.299.822	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.25 Version 8 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(165.854)	(5.936.561)
CCCDs	EUR 260.211.048	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2024	(1.585.973)	(35.314.731)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCDS	EUR 197.177.214	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	1.609.525	28.511.413
CCIRS	HUF 9.303.727.505	Fund receives Fixed 2,398% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(16.682)	(16.213)
CCIRS	MXN 825.147.621	Fund receives Fixed 6,120% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2028	(761.437)	(760.841)
CCIRS	MXN 661.836.614	Fund receives Fixed 6,880% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	185.879	186.518
CCIRS	EUR 29.580.723	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,080%	Bank of America Merrill Lynch	19/4/2031	158.277	158.957
CCIRS	EUR 37.506.089	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,104%	Bank of America Merrill Lynch	21/4/2031	85.829	86.694
CCIRS	EUR 14.043.028	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,160%	Bank of America Merrill Lynch	26/5/2031	(53.236)	(52.908)
CCIRS	EUR 62.194.771	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,197%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2031	(519.362)	(517.903)
CCIRS	EUR 10.367.552	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,493%	Bank of America Merrill Lynch	19/4/2051	107.896	108.368
CCIRS	EUR 10.875.576	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,538%	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2051	(57.308)	(56.808)
CCIRS	EUR 10.904.128	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,576%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2051	(207.378)	(206.872)
CCIRS	USD 13.096.439	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,581%	Bank of America Merrill Lynch	13/5/2031	(42.703)	(42.452)
CCIRS	USD 40.950.677	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,583%	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	(140.863)	(140.077)
CCIRS	USD 19.850.491	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,602%	Bank of America Merrill Lynch	22/4/2031	(130.327)	(110.946)
CCIRS	USD 41.029.772	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,625%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2031	(294.219)	(293.431)
CCIRS	USD 19.743.004	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,630%	Bank of America Merrill Lynch	9/3/2031	(182.352)	(181.973)
CCIRS	USD 19.662.641	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,690%	Bank of America Merrill Lynch	9/3/2031	(290.831)	(290.453)
CCIRS	USD 21.712.766	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,730%	Bank of America Merrill Lynch	8/4/2031	(390.878)	(390.461)
CCIRS	USD 24.795.715	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,048%	Bank of America Merrill Lynch	13/5/2051	(368.231)	(391.479)
CDS	USD 18.188.037	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Turkey Government International Bond	Barclays Bank Plc	20/6/2026	500.041	(2.497.379)
CDS	USD 21.760.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond	Citibank	20/6/2026	(239.659)	(8.519.339)
CDS	USD 23.684.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond	Citibank	20/6/2026	(260.849)	(9.272.611)
CDS	USD 4.190.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond	Citibank	20/6/2026	(12.627)	(1.640.442)
CDS	USD 4.190.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond	Deutsche Bank	20/6/2026	4.133	(1.640.442)
CDS	USD 308.003.303	Fund receives default protection on Markit CDX.EM.30 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(2.343.477)	8.898.644
CDS	USD 39.182.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond	Goldman Sachs	20/6/2026	(641.599)	(15.340.291)
CDS	USD 16.521.958	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Turkey Government International Bond	JP Morgan	20/6/2026	402.442	(2.268.612)
CDS	USD 4.060.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond	JP Morgan	20/6/2026	18.214	(1.589.546)
CDS	USD 4.870.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond	JP Morgan	20/6/2026	4.803	(1.906.672)
CDS	USD 4.250.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Argentine Republic Government International Bond	Morgan Stanley	20/6/2026	(58)	(1.663.933)
IRS	USD 500.000	Fund receives Fixed 0,781% and pays Floating USD 3 Month JIBAR SOFR FEDL	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2035	(54.943)	(54.943)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
IRS	USD 1.000.000	Fund receives Fixed 0,902% and pays Floating USD 3 Month JIBAR SOFR FEDL	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2040	(142.125)	(142.125)
IRS	GBP 28.671.629	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,699%	Bank of America Merrill Lynch	25/3/2031	252.595	253.350
IRS	GBP 28.455.965	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,763%	Bank of America Merrill Lynch	14/3/2031	(721)	38
IRS	GBP 10.535.715	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,934%	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2051	(22.702)	(22.146)
IRS	GBP 30.985.378	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 1,016%	Bank of America Merrill Lynch	19/5/2051	(1.069.755)	(1.017.539)
IRS	USD 500.000	Fund receives Floating USD 3 Month JIBAR SOFR and pays Fixed 0,740%	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2035	53.417	53.417
IRS	USD 1.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month JIBAR SOFR FEDL and pays Fixed 0,843%	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2040	139.958	139.958
IRS	BRL 365.388.566	Fund receives Fixed 8,040% and pays Floating BRL 3 Month BRCDI	JP Morgan	2/1/2025	615.145	615.145
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 1.820.873.637)					(5.857.995)	(53.267.627)

CCCDs : Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)
 CCIRS : Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)
 CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)
 IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Moins-value nette non réalisée USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(410)	EUR	Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	73.693.653	(353.244)
723	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	95.300.437	(141.270)
3.775	USD	US Treasury 5 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	467.362.697	(342.608)
(225)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	41.568.750	(82.657)
Total				677.925.537	(919.779)

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
135.900.000	Call	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1,22	18/06/2021	59.164	935.408
98.150.000	Put	OTC USD/HUF	Deutsche Bank	USD 286,50	18/06/2021	144.771	1.135.890
125.750.000	Put	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0,75	19/08/2021	(122.954)	645.941
38.700.000	Put	OTC AUD/JPY	UBS	AUD 82,00	18/08/2021	(49.284)	181.748
36.400.000	Put	OTC CAD/JPY	UBS	CAD 88,00	18/08/2021	(43.148)	164.352
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 134.398.562)						(11.451)	3.063.339

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	8.545.875	USD	6.674.713	Barclays Bank	4/6/2021	(60.583)
AUD	69.134.578	USD	53.253.488	BNP Paribas	4/6/2021	253.620
AUD	235.951.150	USD	183.096.576	JP Morgan	4/6/2021	(480.817)
AUD	10.601.993	USD	8.236.237	Morgan Stanley	4/6/2021	(30.763)
AUD	98.739.565	USD	77.236.149	Westpac	4/6/2021	(816.091)
AUD	10.601.993	USD	8.167.644	BNP Paribas	2/7/2021	38.936
AUD	49.231.960	USD	37.933.914	Deutsche Bank	2/7/2021	174.580
BRL	165.290.549	USD	31.406.146	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	283.296
BRL	56.599.282	USD	10.776.710	Barclays Bank	4/6/2021	74.483
BRL	101.010.991	USD	19.089.870	Citibank	4/6/2021	275.920
BRL	40.406.353	USD	7.367.775	JP Morgan	4/6/2021	378.916
BRL	148.519.863	USD	27.668.665	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	805.508
BRL	258.190.049	USD	49.226.187	Barclays Bank	2/7/2021	146.600
CAD	11.661.197	USD	9.613.910	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	38.132
CAD	56.246.890	USD	46.625.603	JP Morgan	4/6/2021	(69.720)
CAD	146.435.799	USD	120.305.997	Morgan Stanley	4/6/2021	899.781
CAD	112.495.484	USD	92.873.665	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	235.549
CHF	110.627.726	USD	122.868.814	BNP Paribas	4/6/2021	(4.310)
CHF	95.807.732	USD	106.169.946	JP Morgan	4/6/2021	235.292
CHF	58.770.080	USD	64.737.891	Morgan Stanley	4/6/2021	532.878
CHF	54.775.955	USD	60.855.005	BNP Paribas	2/7/2021	24.078
CLP	13.436.123.403	USD	19.026.847	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(397.833)
CLP	31.696.638.567	USD	45.606.005	Citibank	4/6/2021	(1.659.019)
CLP	21.739.629.349	USD	29.951.196	Deutsche Bank	4/6/2021	190.523
CLP	11.394.499.395	USD	16.133.348	Goldman Sachs	4/6/2021	(335.019)
CLP	27.801.208.951	USD	38.162.263	Natwest Markets	4/6/2021	383.759
CNH	133.660.409	USD	20.566.209	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	416.399
CNH	758.304.443	USD	116.968.283	Goldman Sachs	4/6/2021	2.073.733
CNH	610.789.200	USD	95.915.389	Nomura International	4/6/2021	(30.975)
CNH	11.472.426	USD	1.765.195	Westpac	4/6/2021	35.798
CNH	903.437.278	USD	141.617.242	Nomura International	2/7/2021	(68.118)
COP	145.204.347.831	USD	38.992.808	Citibank	4/6/2021	162.384
COP	102.058.045.248	USD	27.441.181	Deutsche Bank	4/6/2021	79.361
COP	73.298.604.566	USD	19.666.918	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	98.475
COP	16.621.589.932	USD	4.452.967	Toronto Dominion Bank	2/7/2021	21.059
CZK	1.982.648.596	USD	92.760.009	Barclays Bank	4/6/2021	2.306.006
CZK	1.822.245.565	USD	87.094.023	Citibank	4/6/2021	280.827
CZK	2.070.582.396	USD	98.927.034	Toronto Dominion Bank	2/7/2021	353.761
EGP	321.455.217	USD	19.768.478	Goldman Sachs	12/7/2021	532.273
EGP	246.434.034	USD	15.100.125	Barclays Bank	11/8/2021	348.596
EGP	246.435.000	USD	15.118.712	JP Morgan	11/8/2021	330.070
EGP	301.455.000	USD	18.423.529	Goldman Sachs	12/10/2021	155.477
EGP	301.457.782	USD	18.426.515	Standard Chartered Bank	12/10/2021	152.663
EUR	150.963.890	USD	183.763.210	Barclays Bank	4/6/2021	480.128
EUR	25.018.576	USD	30.300.248	BNP Paribas	4/6/2021	233.584
EUR	24.918.901	USD	30.071.138	Citibank	4/6/2021	341.045
EUR	11.924.160	USD	14.557.050	Credit Suisse	4/6/2021	(4.252)
EUR	24.882.614	USD	30.296.573	Goldman Sachs	4/6/2021	71.324
EUR	42.565.771	USD	52.094.868	HSBC	4/6/2021	(145.625)
EUR	24.961.371	USD	30.422.844	JP Morgan	4/6/2021	41.172
EUR	65.094.214	USD	78.873.819	Morgan Stanley	4/6/2021	570.181

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	6.174.228	USD	7.405.338	Westpac	4/6/2021	129.976
EUR	37.510.307	USD	45.647.981	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	156.257
EUR	119.176.413	USD	145.147.635	Barclays Bank	2/7/2021	379.959
GBP	15.907.213	USD	22.600.857	Deutsche Bank	4/6/2021	(60.326)
GBP	1.747.677	USD	2.432.480	HSBC	4/6/2021	43.979
GBP	11.116.819	USD	15.751.754	Morgan Stanley	4/6/2021	785
GBP	26.895.887	USD	37.527.401	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	584.087
GBP	53.836.437	USD	75.349.690	Westpac	4/6/2021	936.574
GBP	41.424.588	USD	58.697.780	Morgan Stanley	2/7/2021	3.372
HUF	36.606.763.589	USD	125.244.501	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	3.270.703
HUF	23.628.183.079	USD	81.019.722	BNP Paribas	4/6/2021	1.931.636
HUF	1.410.769.449	USD	4.750.237	JP Morgan	4/6/2021	202.546
HUF	2.179.729.070	USD	7.593.063	UBS	4/6/2021	59.303
HUF	30.336.318.606	USD	105.929.521	BNP Paribas	2/7/2021	526.309
IDR	326.603.685.710	USD	22.823.458	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	59.853
IDR	57.157.699.579	USD	3.986.143	BNP Paribas	4/6/2021	18.581
IDR	418.085.393.614	USD	29.177.569	Citibank	4/6/2021	115.357
IDR	1.094.834.030.688	USD	75.494.341	Deutsche Bank	4/6/2021	1.214.613
IDR	939.941.868.885	USD	65.854.541	Standard Chartered Bank	4/6/2021	1.977
IDR	1.263.836.606.328	USD	87.968.024	Citibank	2/7/2021	474.006
INR	4.217.998.782	USD	56.640.242	Credit Suisse	4/6/2021	1.439.201
INR	2.781.901.682	USD	37.856.728	HSBC	4/6/2021	448.475
INR	3.202.370.813	USD	43.745.903	Standard Chartered Bank	4/6/2021	348.919
INR	1.389.298.213	USD	18.743.905	UBS	4/6/2021	385.941
INR	5.984.272.495	USD	82.122.581	Standard Chartered Bank	2/7/2021	(40.551)
JPY	16.750.560.568	USD	152.305.792	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	474.062
JPY	1.660.466.639	USD	15.251.297	Standard Chartered Bank	4/6/2021	(106.380)
KRW	34.305.542.205	USD	30.458.619	Credit Suisse	4/6/2021	440.077
KRW	51.698.846.629	USD	46.366.679	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	198.012
KZT	10.194.336.838	USD	23.551.117	Citibank	4/6/2021	239.871
KZT	10.194.345.000	USD	23.576.191	Goldman Sachs	4/6/2021	214.817
KZT	8.454.380.000	USD	19.643.076	JP Morgan	30/6/2021	(556)
KZT	8.454.377.368	USD	19.700.285	Natwest Markets	30/6/2021	(57.771)
KZT	10.194.336.838	USD	23.637.398	Citibank	2/7/2021	39.527
KZT	10.194.345.000	USD	23.630.841	Goldman Sachs	2/7/2021	46.103
KZT	10.194.340.918	USD	23.565.282	Natwest Markets	12/7/2021	75.343
MXN	1.976.223.282	USD	98.738.282	Citibank	4/6/2021	529.941
MXN	4.169.957.450	USD	207.506.562	Goldman Sachs	4/6/2021	1.955.736
MXN	379.300.287	USD	19.082.586	JP Morgan	4/6/2021	(29.847)
MXN	1.425.307.247	USD	71.382.575	Morgan Stanley	4/6/2021	212.432
MXN	302.948.800	USD	15.270.921	Natwest Markets	4/6/2021	(53.415)
MXN	739.291.560	USD	36.712.846	Goldman Sachs	2/7/2021	302.999
MYR	60.241.331	USD	14.682.264	Goldman Sachs	4/6/2021	(77.294)
MYR	93.689.239	USD	22.649.399	Morgan Stanley	4/6/2021	64.717
MYR	249.046	USD	60.178	Morgan Stanley	2/7/2021	186
NZD	50.890.259	USD	36.644.549	Barclays Bank	4/6/2021	344.882
NZD	65.623.660	USD	47.482.511	Goldman Sachs	4/6/2021	215.848
NZD	119.153.496	USD	86.031.282	Morgan Stanley	4/6/2021	575.076
NZD	42.480.579	USD	30.981.299	Standard Chartered Bank	4/6/2021	(104.418)
NZD	20.818.845	USD	15.020.047	Westpac	4/6/2021	112.067
NZD	13.291.717	USD	9.614.005	Morgan Stanley	2/7/2021	46.412

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
PEN	148.158.187	USD	39.143.510	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(93.590)
PEN	1.969.447	USD	519.780	Deutsche Bank	4/6/2021	(695)
PEN	57.635.549	USD	15.072.058	Goldman Sachs	4/6/2021	118.892
PEN	1.969.447	USD	521.432	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(689)
PHP	900.902.362	USD	18.729.779	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	159.609
PHP	955.247.073	USD	19.736.510	JP Morgan	4/6/2021	292.334
PHP	43.199.945	USD	902.481	Standard Chartered Bank	4/6/2021	3.301
PHP	1.856.149.435	USD	38.675.420	Standard Chartered Bank	2/7/2021	176.478
PLN	155.410.431	USD	41.397.520	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	894.912
PLN	29.840.485	USD	8.075.363	Barclays Bank	4/6/2021	45.242
PLN	153.143.013	USD	41.379.491	Goldman Sachs	4/6/2021	295.901
PLN	118.842.834	USD	31.557.199	Morgan Stanley	4/6/2021	783.954
PLN	286.514.695	USD	77.044.896	Societe Generale	4/6/2021	925.440
PLN	372.074.119	USD	100.706.461	Barclays Bank	2/7/2021	564.101
RON	189.947.943	USD	46.577.844	Barclays Bank	4/6/2021	540.825
RON	31.346.862	USD	7.734.659	BNP Paribas	4/6/2021	41.274
RON	189.947.943	USD	46.824.663	BNP Paribas	2/7/2021	245.867
RUB	2.305.806.543	USD	31.331.022	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	103.793
RUB	1.336.541.479	USD	18.147.794	Barclays Bank	4/6/2021	73.134
RUB	5.800.657.496	USD	77.340.553	Citibank	4/6/2021	1.739.192
RUB	7.544.752.595	USD	102.057.277	Barclays Bank	2/7/2021	418.140
THB	22.389.026	USD	715.551	BNP Paribas	4/6/2021	1.231
THB	1.152.127.904	USD	36.903.520	Morgan Stanley	4/6/2021	(18.262)
TRY	128.828.156	USD	15.302.619	Deutsche Bank	4/6/2021	(166.444)
TRY	17.497.102	USD	2.030.651	Goldman Sachs	4/6/2021	25.105
TRY	387.286.148	USD	46.309.476	JP Morgan	4/6/2021	(806.762)
TRY	128.828.156	USD	14.725.742	Goldman Sachs	2/7/2021	181.986
UAH	725.003.079	USD	25.955.538	BNP Paribas	4/6/2021	415.710
UAH	725.005.000	USD	25.976.532	Goldman Sachs	4/6/2021	394.787
UAH	725.003.079	USD	26.154.512	BNP Paribas	2/7/2021	7.078
UAH	725.005.000	USD	26.154.582	Goldman Sachs	2/7/2021	7.078
UAH	725.004.039	USD	26.126.272	Goldman Sachs	12/7/2021	(31.017)
USD	45.458.368	AUD	58.707.470	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	21.382
USD	8.166.581	AUD	10.601.993	BNP Paribas	4/6/2021	(38.893)
USD	3.233.037	AUD	4.174.861	JP Morgan	4/6/2021	1.879
USD	186.736.742	AUD	241.130.971	Morgan Stanley	4/6/2021	112.030
USD	83.842.019	AUD	108.357.866	Westpac	4/6/2021	(22.179)
USD	53.260.422	AUD	69.134.578	BNP Paribas	2/7/2021	(253.895)
USD	43.478.211	BRL	232.043.211	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(1.009.028)
USD	42.148.993	BRL	223.184.545	Barclays Bank	4/6/2021	(639.865)
USD	10.544.223	BRL	56.599.282	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	(306.970)
USD	10.743.979	BRL	56.599.282	Barclays Bank	2/7/2021	(79.305)
USD	92.877.139	CAD	112.495.484	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(236.039)
USD	75.206.686	CAD	91.381.583	Morgan Stanley	4/6/2021	(430.391)
USD	8.521.794	CAD	10.466.819	Standard Chartered Bank	4/6/2021	(141.654)
USD	8.641.163	CAD	10.466.819	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(21.916)
USD	20.680.967	CHF	18.727.158	Barclays Bank	4/6/2021	(117.643)
USD	30.490.674	CHF	27.356.736	Goldman Sachs	4/6/2021	107.949
USD	242.189.708	CHF	219.121.644	JP Morgan	4/6/2021	(1.169.468)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	122.957.648	CHF	110.627.726	BNP Paribas	2/7/2021	3.799
USD	55.790.359	CLP	40.649.956.539	Citibank	4/6/2021	(570.289)
USD	29.043.133	CLP	20.943.662.821	Credit Suisse	4/6/2021	5.011
USD	32.147.292	CLP	22.725.283.679	Goldman Sachs	4/6/2021	638.974
USD	30.937.691	CLP	21.749.196.626	Natwest Markets	4/6/2021	782.706
USD	38.154.407	CLP	27.801.208.951	Natwest Markets	2/7/2021	(379.175)
USD	94.214.091	CNH	610.789.200	Goldman Sachs	4/6/2021	(1.670.324)
USD	141.871.432	CNH	903.437.278	Nomura International	4/6/2021	45.817
USD	95.743.538	CNH	610.789.200	Nomura International	2/7/2021	46.053
USD	19.221.986	COP	72.101.670.562	Citibank	4/6/2021	(220.647)
USD	62.234.143	COP	231.837.737.151	Credit Suisse	4/6/2021	(282.246)
USD	4.459.777	COP	16.621.589.932	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	(22.331)
USD	19.636.886	COP	73.298.604.566	Toronto Dominion Bank	2/7/2021	(92.869)
USD	36.453.332	CZK	784.087.103	BNP Paribas	4/6/2021	(1.142.860)
USD	41.369.092	CZK	862.299.842	Citibank	4/6/2021	22.678
USD	4.217.538	CZK	87.924.820	Deutsche Bank	4/6/2021	1.631
USD	98.928.925	CZK	2.070.582.396	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	(353.428)
USD	68.114.659	EUR	56.193.422	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(466.402)
USD	148.296.778	EUR	121.822.183	Barclays Bank	4/6/2021	(380.670)
USD	240.516.428	EUR	198.488.120	Morgan Stanley	4/6/2021	(1.727.686)
USD	183.862.318	EUR	150.963.890	Barclays Bank	2/7/2021	(481.304)
USD	7.652.383	GBP	5.436.546	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(51.206)
USD	35.667.209	GBP	25.616.435	Deutsche Bank	4/6/2021	(631.295)
USD	42.389.782	GBP	30.456.011	HSBC	4/6/2021	(766.404)
USD	58.695.741	GBP	41.424.588	Morgan Stanley	4/6/2021	(2.924)
USD	9.100.406	GBP	6.570.453	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	(209.930)
USD	15.752.301	GBP	11.116.819	Morgan Stanley	2/7/2021	(905)
USD	143.678.635	HUF	41.133.927.957	BNP Paribas	4/6/2021	(730.065)
USD	53.229.932	HUF	15.516.861.929	Citibank	4/6/2021	(1.245.047)
USD	24.157.958	HUF	7.174.655.301	JP Morgan	4/6/2021	(1.030.073)
USD	12.711.689	HUF	3.640.399.996	BNP Paribas	2/7/2021	(63.158)
USD	30.129.004	IDR	432.290.942.519	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(159.228)
USD	88.201.313	IDR	1.263.836.606.328	Citibank	4/6/2021	(348.716)
USD	30.648.757	IDR	440.269.393.742	Credit Suisse	4/6/2021	(198.480)
USD	28.829.102	IDR	418.085.393.614	Deutsche Bank	4/6/2021	(463.825)
USD	19.654.500	IDR	282.140.342.273	UBS	4/6/2021	(113.511)
USD	29.100.396	IDR	418.085.393.614	Citibank	2/7/2021	(156.804)
USD	7.019.529	INR	521.117.402	Citibank	4/6/2021	(155.961)
USD	7.942.857	INR	589.697.550	Deutsche Bank	4/6/2021	(176.943)
USD	82.496.174	INR	5.984.272.495	Standard Chartered Bank	4/6/2021	96.148
USD	60.874.325	INR	4.496.482.043	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	(1.039.673)
USD	13.431.744	INR	978.771.159	Standard Chartered Bank	2/7/2021	6.632
USD	34.992.960	JPY	3.846.461.122	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(90.151)
USD	133.829.924	JPY	14.564.566.085	Morgan Stanley	4/6/2021	988.264
USD	152.340.227	JPY	16.750.560.568	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(473.485)
USD	18.716.145	KRW	20.834.813.250	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(49.585)
USD	57.468.762	KRW	65.169.575.584	HSBC	4/6/2021	(1.228.894)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	46.369.589	KRW	51.698.846.629	Toronto Dominion Bank	2/7/2021	(279.283)
USD	23.763.023	KZT	10.194.336.838	Citibank	4/6/2021	(27.966)
USD	23.757.504	KZT	10.194.345.000	Goldman Sachs	4/6/2021	(33.504)
USD	34.179.421	MXN	682.885.026	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(122.768)
USD	1.820.554	MXN	36.470.357	Barclays Bank	4/6/2021	(11.399)
USD	75.596.473	MXN	1.528.509.931	Citibank	4/6/2021	(1.182.537)
USD	51.390.551	MXN	1.032.260.029	Goldman Sachs	4/6/2021	(461.188)
USD	18.473.075	MXN	369.792.656	JP Morgan	4/6/2021	(102.083)
USD	229.097.531	MXN	4.603.819.067	Morgan Stanley	4/6/2021	(2.158.189)
USD	112.430.415	MXN	2.264.026.562	Goldman Sachs	2/7/2021	(927.914)
USD	60.207	MYR	249.046	Morgan Stanley	4/6/2021	(172)
USD	14.166.087	MYR	58.768.011	Natwest Markets	4/6/2021	(81.691)
USD	22.923.201	MYR	94.913.513	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	(87.729)
USD	22.638.453	MYR	93.689.239	Morgan Stanley	2/7/2021	(69.961)
USD	37.657.345	NZD	52.364.400	Barclays Bank	4/6/2021	(403.561)
USD	1.642.035	NZD	2.286.464	Citibank	4/6/2021	(19.874)
USD	9.509.292	NZD	13.142.408	Goldman Sachs	4/6/2021	(43.228)
USD	90.275.925	NZD	125.951.887	Morgan Stanley	4/6/2021	(1.271.822)
USD	75.506.463	NZD	105.221.680	Westpac	4/6/2021	(973.597)
USD	9.506.009	NZD	13.142.408	Morgan Stanley	2/7/2021	(45.891)
USD	520.329	PEN	1.969.447	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	1.244
USD	24.472.326	PEN	93.408.714	Citibank	4/6/2021	(147.325)
USD	1.319.615	PEN	5.000.022	Deutsche Bank	4/6/2021	1.764
USD	28.491.642	PEN	107.385.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	188.274
USD	39.226.420	PEN	148.158.187	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	51.859
USD	892.561	PHP	43.199.945	JP Morgan	4/6/2021	(13.220)
USD	38.776.415	PHP	1.856.149.435	Standard Chartered Bank	4/6/2021	(141.816)
USD	900.130	PHP	43.199.945	Standard Chartered Bank	2/7/2021	(4.107)
USD	37.662.500	PLN	142.098.731	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(1.007.368)
USD	100.689.837	PLN	372.074.119	Barclays Bank	4/6/2021	(564.111)
USD	31.274.428	PLN	117.777.933	Morgan Stanley	4/6/2021	(776.930)
USD	30.372.249	PLN	111.800.675	Societe Generale	4/6/2021	(52.494)
USD	8.076.696	PLN	29.840.485	Barclays Bank	2/7/2021	(45.241)
USD	7.686.681	RON	31.346.862	Barclays Bank	4/6/2021	(89.252)
USD	46.868.567	RON	189.947.943	BNP Paribas	4/6/2021	(250.102)
USD	7.727.413	RON	31.346.862	BNP Paribas	2/7/2021	(40.575)
USD	7.573.297	RUB	561.711.444	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(84.455)
USD	102.443.971	RUB	7.544.752.595	Barclays Bank	4/6/2021	(412.837)
USD	17.820.197	RUB	1.336.541.479	Citibank	4/6/2021	(400.731)
USD	18.079.292	RUB	1.336.541.479	Barclays Bank	2/7/2021	(74.073)
USD	37.632.711	THB	1.174.516.930	HSBC	4/6/2021	30.671
USD	714.776	THB	22.389.026	BNP Paribas	2/7/2021	(1.949)
USD	14.951.332	TRY	128.828.156	Goldman Sachs	4/6/2021	(184.842)
USD	14.828.316	TRY	125.810.702	Standard Chartered Bank	4/6/2021	46.666
USD	33.272.961	TRY	278.972.548	UBS	4/6/2021	496.141
USD	2.000.012	TRY	17.497.102	Goldman Sachs	2/7/2021	(24.717)
USD	26.325.457	UAH	725.003.079	BNP Paribas	4/6/2021	(45.792)
USD	26.325.527	UAH	725.005.000	Goldman Sachs	4/6/2021	(45.792)
USD	134.209.006	ZAR	1.888.302.682	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(3.085.296)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	60.275.721	ZAR	872.317.145	BNP Paribas	4/6/2021	(3.148.526)
USD	172.857.998	ZAR	2.420.990.726	Citibank	4/6/2021	(3.166.872)
USD	60.825.757	ZAR	855.197.976	Goldman Sachs	4/6/2021	(1.353.792)
USD	13.667.052	ZAR	198.736.759	HSBC	4/6/2021	(782.657)
USD	122.521.323	ZAR	1.690.403.501	JP Morgan	4/6/2021	(384.169)
USD	37.983.643	ZAR	525.724.006	Morgan Stanley	4/6/2021	(240.584)
USD	21.157.789	ZAR	301.335.573	Standard Chartered Bank	4/6/2021	(751.653)
USD	64.772.123	ZAR	897.621.602	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(247.949)
ZAR	2.465.655.104	USD	174.151.384	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	5.120.934
ZAR	2.981.685.629	USD	215.656.088	Barclays Bank	4/6/2021	1.135.665
ZAR	971.199.606	USD	69.152.403	Citibank	4/6/2021	1.461.368
ZAR	405.624.238	USD	28.910.151	JP Morgan	4/6/2021	581.887
ZAR	848.653.529	USD	60.747.089	Morgan Stanley	4/6/2021	956.628
ZAR	1.067.447.831	USD	76.064.540	Standard Chartered Bank	4/6/2021	1.547.225
ZAR	12.742.431	USD	891.321	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	35.153
ZAR	1.089.243.333	USD	78.599.494	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	300.881
ZAR	568.606.785	USD	41.209.422	Citibank	2/7/2021	(21.851)
ZAR	47.755.765	USD	3.459.743	Natwest Markets	2/7/2021	(509)
						<u>2.878.535</u>
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	853.582.363	USD	663.921.103	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(3.253.856)
USD	4.837.014	AUD	6.213.465	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	27.833
						<u>(3.226.023)</u>
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	247.045.966	USD	202.923.439	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1.554.060
USD	1.477.692	CAD	1.790.107	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(3.962)
						<u>1.550.098</u>
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	91.044	USD	100.271	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	873
USD	749	CHF	675	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1)
						<u>872</u>
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	76.696.606	USD	92.666.161	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	957.702
USD	1.954.267	EUR	1.605.948	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(6.119)
						<u>951.583</u>
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	5.383.506	USD	7.491.904	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	136.611
USD	218.027	GBP	154.363	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(708)
						<u>135.903</u>

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées	USD
Instruments financiers dérivés							
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS							
Catégorie d'Actions couverte en SEK							
SEK	616.062	USD	73.367	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021		937
USD	6.972	SEK	57.808	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(—)	
							937
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 13.802.809.979)							2.291.905

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	71,56
Énergie	12,98
Organismes de placement collectif	4,26
Finance	1,54
Valeurs industrielles	0,94
Services aux collectivités	0,49
Portefeuille de titres à la valeur de marché	91,77
Autres éléments de l'actif net	8,23
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché USD	% de l'actif net			Valeur de marché USD	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
Angola							
USD 1.311.000	Angolan Government International Bond RegS 9,50% 12/11/2025	1.445.620	1,86				
		1.445.620	1,86				
Argentine							
EUR 48.278	Argentine Republic Government International Bond 0,50% 9/7/2029	21.520	0,03				
EUR 802.870	Argentine Republic Government International Bond 0,125% 9/7/2030	349.307	0,45				
USD 975.000	Argentine Republic Government International Bond FRN 9/7/2035	323.215	0,42				
USD 1.710.294	Argentine Republic Government International Bond 0,125% 9/1/2038	678.935	0,87				
		1.372.977	1,77				
Bahreïn							
USD 400.000	Bahrain Government International Bond RegS 6,125% 1/8/2023	433.308	0,56				
		433.308	0,56				
Brésil							
BRL 7.164.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,00% 1/1/2025	1.515.482	1,95				
USD 249.000	Caixa Economica Federal RegS 3,50% 7/11/2022	257.236	0,33				
		1.772.718	2,28				
Îles Vierges britanniques							
USD 200.000	Chinalco Capital Holdings Ltd RegS 4,00% 25/8/2021	200.910	0,26				
USD 200.000	SPIC 2016 US dollar Bond Co Ltd RegS 3,00% 6/12/2021	202.216	0,26				
		403.126	0,52				
Canada							
USD 1.015.000	MEGlobal Canada ULC RegS 5,00% 18/5/2025	1.142.648	1,47				
		1.142.648	1,47				
Îles Caïmans							
USD 735.000	QNB Finance Ltd RegS 2,625% 12/5/2025	767.524	0,99				
USD 200.000	Sharjah Sukuk Ltd RegS 3,764% 17/9/2024	214.845	0,28				
		982.369	1,27				
				Chine			
				USD 200.000	China Development Bank Corp RegS FRN 6/3/2022	200.444	0,26
				USD 697.000	China Development Bank RegS FRN 12/12/2023 [^]	701.334	0,90
						901.778	1,16
				Colombie			
				USD 200.000	Bancolombia SA 5,125% 11/9/2022	208.500	0,27
				USD 200.000	Ecopetrol SA 4,125% 16/1/2025	210.000	0,27
						418.500	0,54
				Costa Rica			
				USD 600.000	Costa Rica Government International Bond RegS 4,25% 26/1/2023	613.262	0,79
						613.262	0,79
				République tchèque			
				CZK 2.190.000	Czech Republic Government Bond RegS 0,45% 25/10/2023	103.433	0,13
						103.433	0,13
				République dominicaine			
				USD 340.000	Dominican Republic International Bond RegS 5,875% 18/4/2024	364.500	0,47
				USD 769.000	Dominican Republic International Bond RegS 5,50% 27/1/2025	849.637	1,09
						1.214.137	1,56
				Ecuador			
				USD 1.105.386	Ecuador Government International Bond RegS 31/7/2030 (Zero Coupon)	627.652	0,81
						627.652	0,81
				Égypte			
				EGP 5.331.000	Egypt Government Bond 14,425% 14/7/2030	333.811	0,43
				EGP 5.326.000	Egypt Government Bond 15,433% 28/7/2035	342.980	0,44
				USD 501.000	Egypt Government International Bond RegS 6,20% 1/3/2024	540.250	0,70
				USD 1.430.000	Egypt Government International Bond RegS 5,75% 29/5/2024	1.531.373	1,97
				USD 755.000	Egypt Government International Bond RegS 5,25% 6/10/2025 [^]	802.459	1,04
						3.550.873	4,58

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
El Salvador				Indonésie suite			
USD 1.079.000	El Salvador Government International Bond RegS 7,75% 24/11/2023	1.107.998	1,43	IDR 2.240.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/4/2039	175.686	0,23
USD 350.000	El Salvador Government International Bond RegS 5,875% 30/11/2025	344.531	0,44	USD 341.000	Pertamina Persero PT RegS 4,875% 3/5/2022	354.461	0,46
		1.452.529	1,87	USD 623.000	Pertamina Persero PT RegS 4,30% 20/5/2023 [^]	664.118	0,85
Éthiopie				Iraq			
USD 300.000	Ethiopia International Bond RegS 6,625% 11/12/2024	278.615	0,36	USD 1.069.000	Iraq International Bond RegS 6,752% 9/3/2023	1.100.081	1,42
		278.615	0,36			1.100.081	1,42
Gabon				Kazakhstan			
USD 1.421.440	Gabon Government International Bond RegS 6,375% 12/12/2024	1.506.630	1,94	KZT 145.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC RegS 8,95% 4/5/2023	335.414	0,43
USD 433.000	Gabon Government International Bond RegS 6,95% 16/6/2025	466.361	0,60			335.414	0,43
		1.972.991	2,54	Liban			
Géorgie				USD 1.496.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,10% 4/10/2022	204.425	0,26
USD 472.000	Georgian Railway JSC RegS 7,75% 11/7/2022	504.745	0,65	USD 1.100.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,00% 27/1/2023 [^]	150.904	0,19
		504.745	0,65	USD 1.000.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,65% 22/4/2024	136.915	0,18
Ghana				USD 1.055.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,60% 27/11/2026	145.041	0,19
USD 200.000	Ghana Government International Bond RegS 7,875% 26/3/2027	212.006	0,27			637.285	0,82
GHS 3.454.000	Republic of Ghana Government Bonds 20,75% 16/1/2023	625.391	0,81	Malaisie			
		837.397	1,08	USD 200.000	Petronas Capital Ltd RegS 7,875% 22/5/2022	214.088	0,28
Guatemala						214.088	0,28
USD 200.000	Guatemala Government Bond RegS 5,75% 6/6/2022	209.846	0,27	Mexique			
		209.846	0,27	USD 270.000	Cemex SAB de CV RegS 7,375% 5/6/2027	304.449	0,39
Hong Kong				MXN 7.139.700	Mexican Bonos 6,50% 10/6/2021	358.936	0,46
USD 859.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd RegS 4,625% 14/3/2023	895.069	1,15	MXN 6.515.500	Mexican Bonos 8,00% 7/11/2047	342.708	0,44
		895.069	1,15	USD 205.000	Mexico Government International Bond 3,90% 27/4/2025	229.934	0,30
Hongrie				USD 400.000	Petroleos Mexicanos 4,625% 21/9/2023	418.904	0,54
HUF 632.360.000	Hungary Government Bond 1,75% 26/10/2022	2.248.605	2,90	EUR 419.000	Petroleos Mexicanos RegS 1,875% 21/4/2022	512.798	0,66
USD 204.000	Hungary Government International Bond 5,375% 21/2/2023	221.586	0,28	EUR 497.000	Petroleos Mexicanos RegS 5,125% 15/3/2023	636.886	0,82
		2.470.191	3,18	EUR 812.000	Petroleos Mexicanos RegS 3,75% 21/2/2024	1.015.950	1,31
Inde				USD 1.340.000	Petroleos Mexicanos RegS 6,875% 16/10/2025	1.492.331	1,93
USD 284.000	Export-Import Bank of India RegS 3,125% 20/7/2021 [^]	285.265	0,37			5.312.896	6,85
USD 515.000	Export-Import Bank of India RegS 4,00% 14/1/2023	539.682	0,69	Indonésie			
		824.947	1,06	USD 273.000	Indonesia Government International Bond 2,95% 11/1/2023	283.831	0,37
Indonésie				USD 550.000	Indonesia Government International Bond RegS 3,75% 25/4/2022	566.169	0,73
USD 273.000	Indonesia Government International Bond 2,95% 11/1/2023	283.831	0,37	IDR 2.197.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029	172.314	0,22
USD 550.000	Indonesia Government International Bond RegS 3,75% 25/4/2022	566.169	0,73				
IDR 2.197.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029	172.314	0,22				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Mongolie				Russie			
USD 611.000	Mongolia Government International Bond RegS 5,125% 5/12/2022	637.175	0,82	USD 800.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,50% 4/4/2022	824.828	1,06
USD 342.000	Mongolia Government International Bond RegS 5,625% 1/5/2023	360.555	0,47	USD 400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,875% 16/9/2023	435.275	0,56
		997.730	1,29			1.260.103	1,62
Oman				Arabie Saoudite			
USD 679.000	Oman Government International Bond RegS 4,875% 1/2/2025	711.775	0,92	USD 347.000	Saudi Government International Bond RegS 2,90% 22/10/2025	370.645	0,48
USD 500.000	Oman Government International Bond RegS 6,75% 28/10/2027	560.370	0,72			370.645	0,48
		1.272.145	1,64	Serbie			
Pakistan				USD 1.055.000	Serbia International Bond RegS 7,25% 28/9/2021	1.077.089	1,39
USD 500.000	Third Pakistan International Sukuk Co Ltd RegS 5,50% 13/10/2021	505.625	0,65			1.077.089	1,39
		505.625	0,65	Afrique du Sud			
Panama				USD 400.000	Eskom Holdings SOC Ltd RegS 7,125% 11/2/2025	425.500	0,55
USD 673.000	Panama Government International Bond 4,00% 22/9/2024	733.099	0,95	ZAR 9.894.335	Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035	647.893	0,83
		733.099	0,95	ZAR 6.833.636	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048	416.065	0,54
Paraguay				USD 417.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 30/5/2022 [^]	438.499	0,56
USD 738.000	Paraguay Government International Bond RegS 4,625% 25/1/2023	781.404	1,01	USD 351.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,665% 17/1/2024	378.992	0,49
		781.404	1,01	USD 560.000	Transnet SOC Ltd RegS 4,00% 26/7/2022	573.888	0,74
Pérou						2.880.837	3,71
USD 472.000	Corp Financiera de Desarrollo SA RegS 4,75% 8/2/2022	483.593	0,62	Sri Lanka			
USD 325.000	Fondo MIVIVIENDA SA RegS 3,50% 31/1/2023	336.233	0,44	USD 921.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,875% 25/7/2022 [^]	811.620	1,04
		819.826	1,06	USD 473.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 6,85% 14/3/2024	353.794	0,46
Pologne				USD 419.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 6,35% 28/6/2024	312.434	0,40
USD 204.000	Republic of Poland Government International Bond 5,00% 23/3/2022	211.862	0,28			1.477.848	1,90
USD 200.000	Republic of Poland Government International Bond 4,00% 22/1/2024	218.602	0,28	Suède			
		430.464	0,56	EUR 125.000	East Renewable AB 13,50% 21/11/2021	153.159	0,20
Qatar						153.159	0,20
USD 491.000	Qatar Government International Bond RegS 3,875% 23/4/2023	523.989	0,67	Turquie			
USD 625.000	Qatar Government International Bond RegS 3,375% 14/3/2024	674.027	0,87	USD 700.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S RegS 5,80% 21/2/2022	716.137	0,92
		1.198.016	1,54	USD 703.000	Turkey Government International Bond 5,125% 25/3/2022 [^]	720.320	0,93
Roumanie				USD 750.000	Turkey Government International Bond 4,25% 13/3/2025	729.998	0,94
USD 326.000	Romanian Government International Bond RegS 6,75% 7/2/2022	340.531	0,44	USD 836.000	Turkey Government International Bond 6,375% 14/10/2025 [^]	871.187	1,12
USD 310.000	Romanian Government International Bond RegS 4,375% 22/8/2023	335.344	0,43			3.037.642	3,91
EUR 865.000	Romanian Government International Bond RegS 2,75% 14/4/2041	1.046.779	1,35				
		1.722.654	2,22				

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Ukraine				Venezuela suite			
USD 290.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2021	293.824	0,38	USD 700.000	Petroleos de Venezuela SA RegS 6,00% 16/5/2024	32.725	0,04
USD 2.526.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2022^	2.665.404	3,43	USD 1.466.217	Petroleos de Venezuela SA RegS 9,75% 17/5/2035	68.912	0,09
USD 977.000	Ukraine Government International Bond RegS 8,994% 1/2/2024	1.098.575	1,42	USD 471.500	Petroleos de Venezuela SA RegS (Defaulted) 8,50% 27/10/2020	128.484	0,17
EUR 331.000	Ukraine Government International Bond RegS 6,75% 20/6/2026	444.651	0,57	USD 985.800	Venezuela Government International Bond RegS 7,75% 13/10/2019	103.509	0,13
USD 1.014.000	Ukraine Government International Bond RegS FRN 31/5/2040	1.126.443	1,45	USD 602.900	Venezuela Government International Bond RegS 12,75% 23/8/2022	63.305	0,08
		5.628.897	7,25	USD 1.473.500	Venezuela Government International Bond RegS 9,00% 7/5/2023	154.717	0,20
						630.527	0,81
Émirats arabes unis				Zambie			
USD 1.785.000	Abu Dhabi Government International Bond RegS 2,50% 16/4/2025	1.894.456	2,44	USD 736.000	Zambia Government International Bond RegS 5,375% 20/9/2022	483.548	0,62
		1.894.456	2,44	USD 749.000	Zambia Government International Bond RegS 8,50% 14/4/2024	496.915	0,64
Royaume-Uni						980.463	1,26
USD 92.200	State Savings Bank of Ukraine/SSB #1 Plc RegS 9,375% 10/3/2023	96.852	0,12	Total des obligations		69.524.269	89,58
USD 132.167	Ukreximbank/Biz Finance Plc RegS 9,625% 27/4/2022	137.027	0,18	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		69.524.269	89,58
		233.879	0,30	Portefeuille de titres à la valeur de marché		69.524.269	89,58
États-Unis						8.091.465	10,42
USD 7.142.500	United States Treasury Note/Bond 2,125% 15/8/2021	7.192.687	9,27	Total de l'actif net (USD)		77.615.734	100,00
		7.192.687	9,27				
Venezuela							
USD 1.678.200	Petroleos de Venezuela SA RegS 12,75% 17/2/2022	78.875	0,10				

^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	USD 7.630.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.25 Version 8 and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	(82.428)	(743.026)
CCIRS	GBP 520.239	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,762%	Morgan Stanley	10/11/2050	83.310	83.346
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 9.026.859)					882	(659.680)

CCCDs : Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)

CCIRS : Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(4)	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	981.397	35.928

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(3)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	Jun 2021	4.144.290	(16.417)
(12)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	Septembre 2021	2.163.760	5.101
(49)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	6.458.813	9.947
(19)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	3.510.250	29.539
Total				17.258.510	64.098

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
4.810.000	Put	OTC AUD/JPY	UBS	AUD 82,00	18/08/2021	(6.126)	22.590
4.500.000	Put	OTC CAD/JPY	UBS	CAD 88,00	18/08/2021	(5.334)	20.318
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 1.771.655)						(11.460)	42.908

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	640.000	USD	494.078	Citibank	4/6/2021	1.254
AUD	647.317	USD	499.046	JP Morgan	4/6/2021	1.949
AUD	607.317	USD	467.869	BNP Paribas	2/7/2021	2.230
BRL	7.606.207	USD	1.448.250	Barclays Bank	4/6/2021	10.009
BRL	1.988.695	USD	362.623	JP Morgan	4/6/2021	18.649
BRL	1.605.747	USD	299.144	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	8.709
BRL	1.605.747	USD	304.812	Barclays Bank	2/7/2021	2.250
CAD	475.145	USD	392.283	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	997
CAD	440.000	USD	358.212	BNP Paribas	4/6/2021	5.978
CAD	39.432	USD	32.014	JP Morgan	4/6/2021	624
CHF	796.448	USD	879.043	BNP Paribas	4/6/2021	5.502
CLP	136.024.378	USD	186.744	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	1.852
CLP	368.531.067	USD	505.877	Natwest Markets	4/6/2021	5.087
CNH	958.916	USD	150.520	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	15
CNH	450.000	USD	69.240	BNP Paribas	4/6/2021	1.403
CNH	50.000	USD	7.713	Goldman Sachs	4/6/2021	137
CNH	510.676	USD	78.552	JP Morgan	4/6/2021	1.616
CNH	560.676	USD	87.851	Morgan Stanley	2/7/2021	(5)
COP	706.952.043	USD	187.819	Deutsche Bank	4/6/2021	2.814
COP	2.512.871.218	USD	674.234	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	3.376
CZK	1.380.000	USD	64.055	BNP Paribas	4/6/2021	2.115
CZK	1.367.645	USD	65.344	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	233
EUR	5.574.403	USD	6.785.531	Barclays Bank	4/6/2021	17.729
EUR	5.270.000	USD	6.325.063	BNP Paribas	4/6/2021	106.690
EUR	747.746	USD	899.248	JP Morgan	4/6/2021	13.336
EUR	1.499.031	USD	1.817.389	Morgan Stanley	4/6/2021	12.097
EUR	20.000	USD	24.243	Standard Chartered Bank	4/6/2021	166

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	304.606	USD	365.343	Westpac	4/6/2021	6.412
EUR	2.126.777	USD	2.590.250	Barclays Bank	2/7/2021	6.781
GBP	20.000	USD	28.254	Barclays Bank	4/6/2021	86
GBP	18.133	USD	25.141	JP Morgan	4/6/2021	553
GBP	494.899	USD	701.237	Morgan Stanley	4/6/2021	35
HUF	109.262.255	USD	382.183	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	1.404
HUF	1.868.221.152	USD	6.386.091	BNP Paribas	4/6/2021	172.665
HUF	207.540.975	USD	698.816	JP Morgan	4/6/2021	29.797
HUF	109.262.255	USD	380.511	Standard Chartered Bank	4/6/2021	3.075
HUF	207.540.975	USD	724.700	BNP Paribas	2/7/2021	3.601
IDR	10.724.248.774	USD	748.429	Citibank	4/6/2021	2.959
INR	54.386.385	USD	749.743	Standard Chartered Bank	4/6/2021	(874)
JPY	77.708.709	USD	706.573	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	2.199
JPY	78.460.000	USD	717.492	BNP Paribas	4/6/2021	(1.868)
KRW	844.330.660	USD	758.472	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	2.009
KRW	844.330.660	USD	757.247	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	3.234
KRW	844.330.660	USD	757.295	Toronto Dominion Bank	2/7/2021	4.561
MXN	21.380.000	USD	1.053.953	BNP Paribas	4/6/2021	19.992
MXN	7.473.118	USD	368.103	Citibank	4/6/2021	7.281
MXN	68.159.044	USD	3.395.747	Goldman Sachs	4/6/2021	27.970
MXN	39.314.910	USD	1.936.492	JP Morgan	4/6/2021	38.346
MXN	31.578.335	USD	1.568.164	Goldman Sachs	2/7/2021	12.942
MYR	126.509	USD	30.584	Morgan Stanley	4/6/2021	87
NZD	510.000	USD	365.717	BNP Paribas	4/6/2021	4.975
NZD	909.864	USD	650.457	JP Morgan	4/6/2021	10.875
NZD	1.416.386	USD	1.024.551	Morgan Stanley	4/6/2021	4.945
NZD	909.864	USD	658.112	Morgan Stanley	2/7/2021	3.177

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
PEN	1.114.003	USD	294.321	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(704)
PEN	1.139.566	USD	300.757	Deutsche Bank	4/6/2021	(402)
PEN	1.139.566	USD	301.712	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(399)
PHP	8.510.217	USD	177.785	Chartered Bank	4/6/2021	650
PLN	6.043.834	USD	1.635.568	Barclays Bank	4/6/2021	9.163
PLN	6.030.000	USD	1.581.708	BNP Paribas	4/6/2021	59.259
PLN	5.793.185	USD	1.538.306	Morgan Stanley	4/6/2021	38.215
PLN	5.793.185	USD	1.567.997	Barclays Bank	2/7/2021	8.783
RUB	82.628.623	USD	1.101.693	Citibank	4/6/2021	24.774
RUB	54.936.903	USD	743.127	Barclays Bank	2/7/2021	3.045
UAH	1.041.592	USD	37.290	BNP Paribas	4/6/2021	597
UAH	1.045.000	USD	37.442	Goldman Sachs	4/6/2021	569
UAH	1.041.592	USD	37.575	BNP Paribas	2/7/2021	10
UAH	1.045.000	USD	37.698	Goldman Sachs	2/7/2021	10
UAH	1.043.295	USD	37.596	Goldman Sachs	12/7/2021	(45)
USD	962.095	AUD	1.247.317	BNP Paribas	4/6/2021	(3.272)
USD	31.207	AUD	40.000	Citibank	4/6/2021	249
USD	305.740	BRL	1.605.747	Barclays Bank	4/6/2021	(2.113)
USD	644.437	BRL	3.500.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	(26.582)
USD	1.135.457	BRL	6.094.902	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	(33.056)
USD	1.443.851	BRL	7.606.207	Barclays Bank	2/7/2021	(10.657)
USD	357.336	CAD	440.000	Citibank	4/6/2021	(6.854)
USD	33.237	CAD	40.000	HSBC	4/6/2021	129
USD	385.299	CAD	474.577	JP Morgan	4/6/2021	(7.511)
USD	392.269	CAD	475.145	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(995)
USD	339.106	CHF	310.000	Citibank	4/6/2021	(5.184)
USD	534.170	CHF	486.448	JP Morgan	4/6/2021	(6.085)
USD	540.664	CHF	486.448	BNP Paribas	2/7/2021	16
USD	714.395	CLP	504.555.445	Goldman Sachs	4/6/2021	14.835
USD	505.772	CLP	368.531.067	Natwest Markets	2/7/2021	(5.026)
USD	69.242	CNH	450.000	Citibank	4/6/2021	(1.401)
USD	147.500	CNH	958.916	JP Morgan	4/6/2021	(3.035)
USD	88.012	CNH	560.676	Morgan Stanley	4/6/2021	(5)
USD	150.253	CNH	958.916	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	12
USD	864.324	COP	3.219.823.261	Credit Suisse	4/6/2021	(3.920)
USD	673.205	COP	2.512.871.218	Toronto Dominion Bank	2/7/2021	(3.184)
USD	63.688	CZK	1.370.000	Citibank	4/6/2021	(2.002)
USD	64.085	CZK	1.377.645	JP Morgan	4/6/2021	(1.972)
USD	65.342	CZK	1.367.645	Toronto Dominion Bank	2/7/2021	(234)
USD	2.588.854	EUR	2.126.777	Barclays Bank	4/6/2021	(6.764)
USD	7.238.532	EUR	6.019.009	JP Morgan	4/6/2021	(107.345)
USD	6.334.672	EUR	5.270.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	(97.081)
USD	6.789.191	EUR	5.574.403	Barclays Bank	2/7/2021	(17.772)
USD	753.570	GBP	533.032	Chartered Bank	4/6/2021	(1.737)
USD	701.262	GBP	494.899	Morgan Stanley	2/7/2021	(40)
USD	725.010	HUF	207.540.975	BNP Paribas	4/6/2021	(3.604)
USD	1.134.135	HUF	330.324.158	Citibank	4/6/2021	(25.532)
USD	2.929.362	HUF	878.211.504	JP Morgan	4/6/2021	(153.772)
USD	2.927.886	HUF	878.210.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	(155.242)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	3.456.959	HUF	990.011.152	BNP Paribas	2/7/2021	(17.176)
USD	739.491	IDR	10.724.248.774	Deutsche Bank	4/6/2021	(11.897)
USD	746.450	IDR	10.724.248.774	Citibank	2/7/2021	(4.022)
USD	343.682	INR	25.514.323	Citibank	4/6/2021	(7.636)
USD	388.889	INR	28.872.062	Deutsche Bank	4/6/2021	(8.663)
USD	746.348	INR	54.386.385	Chartered Bank	2/7/2021	369
USD	718.161	JPY	78.458.709	JP Morgan	4/6/2021	2.548
USD	710.172	JPY	77.710.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	1.388
USD	706.732	JPY	77.708.709	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(2.197)
USD	758.472	KRW	844.330.660	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(2.009)
USD	757.247	KRW	844.330.660	Toronto Dominion Bank	4/6/2021	(3.234)
USD	757.295	KRW	844.330.660	Toronto Dominion Bank	2/7/2021	(4.561)
USD	374.322	MXN	7.473.118	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(1.062)
USD	383.189	MXN	7.648.711	Citibank	4/6/2021	(1.016)
USD	1.573.262	MXN	31.578.335	Goldman Sachs	4/6/2021	(12.958)
USD	2.989.141	MXN	60.685.926	JP Morgan	4/6/2021	(59.190)
USD	1.433.570	MXN	28.940.982	State Street Bank & Trust Company	4/6/2021	(20.171)
USD	3.384.743	MXN	68.159.044	Goldman Sachs	2/7/2021	(27.935)
USD	30.833	MYR	126.509	Goldman Sachs	4/6/2021	162
USD	30.569	MYR	126.509	Morgan Stanley	2/7/2021	(94)
USD	363.977	NZD	510.000	Citibank	4/6/2021	(6.715)
USD	1.012.567	NZD	1.416.386	JP Morgan	4/6/2021	(16.929)
USD	658.156	NZD	909.864	Morgan Stanley	4/6/2021	(3.176)
USD	1.024.483	NZD	1.416.386	Morgan Stanley	2/7/2021	(4.946)
USD	301.074	PEN	1.139.566	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	720
USD	294.010	PEN	1.114.003	Deutsche Bank	4/6/2021	393
USD	294.944	PEN	1.114.003	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	390
USD	175.831	PHP	8.510.217	JP Morgan	4/6/2021	(2.604)
USD	177.322	PHP	8.510.217	Chartered Bank	2/7/2021	(809)
USD	1.567.738	PLN	5.793.185	Barclays Bank	4/6/2021	(8.783)
USD	1.592.063	PLN	6.040.000	Citibank	4/6/2021	(51.625)
USD	1.591.370	PLN	6.033.834	JP Morgan	4/6/2021	(50.640)
USD	1.635.839	PLN	6.043.834	Barclays Bank	2/7/2021	(9.163)
USD	373.355	RUB	27.691.720	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(4.164)
USD	745.943	RUB	54.936.903	Barclays Bank	4/6/2021	(3.006)
USD	37.821	UAH	1.041.592	BNP Paribas	4/6/2021	(66)
USD	37.945	UAH	1.045.000	Goldman Sachs	4/6/2021	(66)
USD	307.855	ZAR	4.250.366	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	(1.180)
USD	1.680.418	ZAR	24.186.403	Citibank	4/6/2021	(78.122)
USD	1.337.368	ZAR	19.440.487	JP Morgan	4/6/2021	(76.106)
USD	1.745.440	ZAR	24.188.565	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(6.682)
ZAR	28.438.931	USD	2.046.215	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2021	21.516
ZAR	18.050.000	USD	1.243.766	BNP Paribas	4/6/2021	68.610
ZAR	1.388.325	USD	95.507	JP Morgan	4/6/2021	5.435

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
ZAR	4.250.366	USD	306.705	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	1.174 (345.078)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	30.330.431	USD	36.647.565	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	376.919
USD	19.598	EUR	16.069	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(18)
						376.901
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 184.795.195)						31.823

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	72,03
Énergie	7,72
Finance	4,36
Matériaux de base	2,88
Valeurs industrielles	1,78
Services aux collectivités	0,81
Portefeuille de titres à la valeur de marché	89,58
Autres éléments de l'actif net	10,42
<hr/>	
	100,00

BlackRock ESG Euro Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Autriche suite			
				EUR 96.000	Republic of Austria Government Bond RegS 2,10% 20/9/2117	154.854	0,02
				EUR 125.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,85% 30/6/2120	110.804	0,02
						20.423.589	3,18
OBLIGATIONS				Belgique			
	Australie			EUR 300.000	Ageas SA RegS FRN 24/11/2051	298.545	0,05
EUR 800.000	APT Pipelines Ltd RegS 0,75% 15/3/2029	791.944	0,12	EUR 200.000	Anheuser-Busch InBev SA RegS 1,125% 1/7/2027	210.836	0,03
EUR 325.000	APT Pipelines Ltd RegS 2,00% 15/7/2030	349.811	0,06	EUR 124.000	Anheuser-Busch InBev SA RegS 2,00% 17/3/2028	138.212	0,02
EUR 675.000	Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028	663.525	0,10	EUR 100.000	Belfius Bank SA RegS 1,00% 12/6/2028	107.605	0,02
EUR 425.000	Telstra Corp Ltd RegS 1,00% 23/4/2030	443.351	0,07	EUR 300.000	BNP Paribas Fortis SA RegS 24/10/2023 (Zero Coupon)	303.162	0,05
		2.248.631	0,35	EUR 600.000	ING Belgium SA RegS 0,75% 28/9/2026	631.890	0,10
	Autriche			EUR 1.000.000	KBC Bank NV RegS 0,75% 24/10/2027	1.057.550	0,16
EUR 500.000	BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029	521.780	0,08	EUR 1.460.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 4,25% 28/9/2021	1.483.272	0,23
EUR 600.000	Erste Group Bank AG RegS 0,05% 16/9/2025	601.980	0,09	EUR 1.090.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 4,25% 28/9/2022	1.161.689	0,18
EUR 400.000	Raiffeisen Bank International AG RegS 0,25% 5/7/2021	400.240	0,06	EUR 3.114.029	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,50% 22/10/2024	3.229.902	0,50
EUR 930.000	Republic of Austria Government Bond RegS 3,65% 20/4/2022	965.182	0,15	EUR 2.165.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2025	2.282.906	0,36
EUR 1.370.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/4/2023 (Zero Coupon)	1.386.714	0,22	EUR 585.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 4,50% 28/3/2026	726.903	0,11
EUR 2.585.000	Republic of Austria Government Bond RegS 1,65% 21/10/2024	2.783.114	0,43	EUR 575.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2027 (Zero Coupon)	585.235	0,09
EUR 3.148.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/4/2025 (Zero Coupon)	3.212.503	0,50	EUR 1.400.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2028	1.500.786	0,23
EUR 755.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,75% 20/10/2026	802.331	0,13	EUR 1.207.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,90% 22/6/2029	1.304.332	0,20
EUR 1.410.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,50% 20/4/2027	1.481.769	0,23	EUR 2.250.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,10% 22/6/2030	2.269.777	0,35
EUR 456.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,50% 20/2/2029	478.800	0,07	EUR 340.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,00% 22/6/2031	371.025	0,06
EUR 965.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/2/2030 (Zero Coupon)	968.628	0,15	EUR 430.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2031 (Zero Coupon)	423.374	0,07
EUR 750.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/2/2031 (Zero Coupon)	746.167	0,12	EUR 1.645.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,25% 22/4/2033	1.843.502	0,29
EUR 110.000	Republic of Austria Government Bond RegS 2,40% 23/5/2034	140.720	0,02	EUR 263.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,45% 22/6/2037	300.604	0,05
EUR 865.000	Republic of Austria Government Bond RegS 4,15% 15/3/2037	1.375.765	0,21	EUR 1.072.397	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,90% 22/6/2038	1.306.126	0,20
EUR 180.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/10/2040 (Zero Coupon)	163.114	0,03	EUR 1.585.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,40% 22/6/2040	1.509.808	0,24
EUR 430.000	Republic of Austria Government Bond RegS 3,15% 20/6/2044^	676.227	0,11	EUR 75.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 4,25% 28/3/2041	124.958	0,02
EUR 664.000	Republic of Austria Government Bond RegS 1,50% 20/2/2047	803.467	0,13				
EUR 1.140.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,75% 20/3/2051	1.158.856	0,18				
EUR 158.000	Republic of Austria Government Bond RegS 3,80% 26/1/2062	323.612	0,05				
EUR 1.250.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,70% 20/4/2071	1.166.962	0,18				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Belgique suite				Finlande suite			
EUR 115.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,75% 22/6/2045	189.097	0,03	EUR 475.000	Finland Government Bond RegS 0,50% 15/9/2029	499.268	0,08
EUR 1.205.477	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,60% 22/6/2047	1.406.141	0,22	EUR 605.000	Finland Government Bond RegS 15/9/2030 (Zero Coupon)	605.950	0,09
EUR 372.957	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,70% 22/6/2050	445.191	0,07	EUR 310.000	Finland Government Bond RegS 0,75% 15/4/2031	332.348	0,05
EUR 95.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 2,15% 22/6/2066	130.701	0,02	EUR 380.000	Finland Government Bond RegS 1,125% 15/4/2034	423.620	0,07
EUR 807.509	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,65% 22/6/2071	656.545	0,10	EUR 105.000	Finland Government Bond RegS 0,125% 15/4/2036	101.741	0,02
		25.999.674	4,05	EUR 300.000	Finland Government Bond RegS 0,25% 15/9/2040	287.790	0,04
Canada				EUR 65.000	Finland Government Bond RegS 2,625% 4/7/2042	93.406	0,01
EUR 495.000	Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,25% 24/1/2023	500.742	0,08	EUR 256.000	Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047	307.333	0,05
EUR 2.416.000	CPPIB Capital Inc RegS 0,875% 6/2/2029	2.569.875	0,40	EUR 250.000	Finland Government Bond RegS 0,125% 15/4/2052	214.138	0,03
		3.070.617	0,48	EUR 1.125.000	OP Corporate Bank Plc 0,60% 18/1/2027	1.140.930	0,18
Colombie				EUR 800.000	OP Corporate Bank Plc RegS 0,125% 1/7/2024	807.464	0,13
USD 2.045.000	Colombia Government International Bond 3,25% 22/4/2032	1.621.052	0,25	EUR 850.000	OP Corporate Bank Plc RegS 0,50% 12/8/2025	869.983	0,13
		1.621.052	0,25			8.058.087	1,25
Chypre				France			
EUR 41.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,875% 6/5/2022	42.644	0,01	EUR 100.000	Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 0,375% 30/4/2024	102.311	0,02
EUR 84.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023	91.560	0,01	EUR 300.000	Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,00% 31/1/2028	321.039	0,05
EUR 480.000	Cyprus Government International Bond RegS 1,50% 16/4/2027*	520.613	0,08	EUR 3.500.000	Agence France Locale RegS 20/9/2027 (Zero Coupon)	3.501.505	0,54
		654.817	0,10	EUR 1.000.000	Air Liquide Finance SA RegS 0,375% 27/5/2031	1.002.210	0,16
République tchèque				EUR 600.000	AXA Bank Europe SCF RegS 0,125% 14/3/2022	603.072	0,09
EUR 594.000	Komerční banka as RegS 0,01% 20/1/2026	599.197	0,09	EUR 800.000	AXA SA RegS FRN 6/7/2047	914.480	0,14
		599.197	0,09	EUR 1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,75% 15/6/2023	1.021.690	0,16
Danemark				EUR 300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,125% 5/2/2024	302.388	0,05
DKK 4.986.548	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,50% 1/10/2050	615.231	0,10	EUR 1.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,10% 8/10/2027	1.091.222	0,17
DKK 9.083.046	Nykredit Realkredit A/S RegS 0,50% 1/10/2050	1.119.757	0,17	EUR 100.000	BNP Paribas SA RegS 1,00% 17/4/2024	103.084	0,02
DKK 11.189.624	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2050	1.440.606	0,22	EUR 200.000	BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025	202.466	0,03
DKK 12.460.000	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2053	1.583.015	0,25	EUR 750.000	BNP Paribas SA RegS 1,125% 11/6/2026	780.315	0,12
EUR 350.000	Orsted A/S RegS FRN 24/11/3017	366.583	0,06	EUR 300.000	BNP Paribas SA RegS FRN 23/1/2027	323.433	0,05
EUR 250.000	Orsted A/S RegS FRN 9/12/3019	256.325	0,04	EUR 900.000	BNP Paribas SA RegS FRN 14/10/2027	898.767	0,14
		5.381.517	0,84	EUR 700.000	BNP Paribas SA RegS FRN 17/4/2029	721.238	0,11
Finlande				EUR 1.100.000	BNP Paribas SA RegS FRN 15/1/2032*	1.103.762	0,17
EUR 246.000	Finland Government Bond RegS 15/4/2022 (Zero Coupon)	247.341	0,04	EUR 700.000	BPCE SA RegS 0,625% 26/9/2023	714.994	0,11
EUR 1.700.000	Finland Government Bond RegS 15/9/2024 (Zero Coupon)	1.734.051	0,27	EUR 400.000	BPCE SA RegS 0,375% 5/10/2023	406.204	0,06
EUR 373.000	Finland Government Bond RegS 0,50% 15/9/2027	392.724	0,06	EUR 500.000	BPCE SA RegS 1,00% 15/7/2024	517.645	0,08

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				France suite			
EUR 700.000	BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024	706.629	0,11	EUR 3.400.000	Engie SA RegS 0,375% 21/6/2027	3.448.858	0,54
EUR 200.000	BPCE SA RegS 1,00% 1/4/2025	206.514	0,03	EUR 200.000	Engie SA RegS 1,375% 22/6/2028	214.738	0,03
EUR 1.000.000	BPCE SFH SA RegS 0,01% 23/3/2028	1.007.150	0,16	EUR 100.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	101.480	0,02
EUR 200.000	BPCE SFH SA RegS 0,01% 27/5/2030	198.708	0,03	EUR 1.534.286	France Government Bond OAT RegS 3,00% 25/4/2022	1.584.841	0,25
EUR 2.100.000	BPCE SFH SA RegS 0,125% 3/12/2030	2.098.635	0,33	EUR 276.000	France Government Bond OAT RegS 25/5/2022 (Zero Coupon)	277.744	0,04
EUR 400.000	Bpifrance SACA RegS 0,125% 25/11/2023	405.956	0,06	EUR 41.877	France Government Bond OAT RegS 2,25% 25/10/2022	43.597	0,01
EUR 600.000	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA RegS 0,125% 26/10/2022	604.896	0,09	EUR 9.515.000	France Government Bond OAT RegS 25/2/2023 (Zero Coupon)	9.623.281	1,50
EUR 300.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA RegS 0,25% 7/2/2035	295.551	0,05	EUR 77.445	France Government Bond OAT RegS 25/3/2023 (Zero Coupon)	78.367	0,01
EUR 300.000	Caisse Francaise de Financement Local RegS 0,625% 26/11/2023	305.535	0,05	EUR 3.000.000	France Government Bond OAT RegS 4,25% 25/10/2023	3.355.230	0,52
EUR 600.000	Caisse Francaise de Financement Local RegS 0,375% 11/5/2024	613.962	0,10	EUR 6.230.000	France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/11/2024	6.733.260	1,05
EUR 600.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,25% 11/4/2023	608.220	0,09	EUR 6.255.000	France Government Bond OAT RegS 25/3/2025 (Zero Coupon)	6.377.661	0,99
EUR 100.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026	105.073	0,02	EUR 4.490.000	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2025	4.670.004	0,73
EUR 500.000	Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023	512.460	0,08	EUR 1.835.000	France Government Bond OAT RegS 1,00% 25/11/2025	1.955.761	0,30
EUR 600.000	Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024	612.954	0,10	EUR 4.220.000	France Government Bond OAT RegS 25/2/2026 (Zero Coupon)	4.301.066	0,67
EUR 200.000	Cie de Saint-Gobain RegS 2,375% 4/10/2027	226.432	0,04	EUR 2.760.000	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2026	2.885.276	0,45
EUR 2.800.000	Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 0,875% 29/9/2024	2.876.412	0,45	EUR 3.370.000	France Government Bond OAT RegS 25/11/2029 (Zero Coupon)	3.373.539	0,52
EUR 400.000	Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 2,125% 29/7/2032	456.516	0,07	EUR 2.405.554	France Government Bond OAT RegS 2,50% 25/5/2030	2.943.219	0,46
EUR 500.000	Credit Agricole Assurances SA RegS 2,00% 17/7/2030	520.220	0,08	EUR 3.620.000	France Government Bond OAT RegS 25/11/2030 (Zero Coupon)	3.589.954	0,56
EUR 200.000	Credit Agricole Assurances SA RegS FRN 27/9/2048	243.686	0,04	EUR 940.000	France Government Bond OAT RegS 1,50% 25/5/2031^	1.069.288	0,17
EUR 800.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 0,05% 6/12/2029	802.024	0,12	EUR 610.000	France Government Bond OAT RegS 25/11/2031 (Zero Coupon)	598.508	0,09
EUR 200.000	Credit Agricole Public Sector SCF SA 0,01% 13/9/2028	200.720	0,03	EUR 691.196	France Government Bond OAT RegS 5,75% 25/10/2032	1.125.689	0,18
EUR 400.000	Credit Agricole SA FRN 5/6/2030	414.192	0,06	EUR 1.093.013	France Government Bond OAT RegS 1,25% 25/5/2034	1.217.442	0,19
EUR 700.000	Credit Agricole SA RegS 0,75% 5/12/2023	718.207	0,11	EUR 5.047.573	France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/6/2039	6.074.603	0,95
EUR 200.000	Credit Agricole SA RegS 1,375% 13/3/2025	209.364	0,03	EUR 1.525.127	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2040	1.480.090	0,23
EUR 700.000	Credit Agricole SA RegS FRN 22/4/2026	721.539	0,11	EUR 420.000	France Government Bond OAT RegS 4,50% 25/4/2041	723.731	0,11
EUR 400.000	Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA RegS 0,25% 30/4/2024	407.868	0,06	EUR 3.118.064	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/6/2044	2.946.165	0,46
EUR 600.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 5/10/2023	615.612	0,10	EUR 405.000	France Government Bond OAT RegS 3,25% 25/5/2045	625.138	0,10
EUR 100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,375% 17/1/2025	105.211	0,02	EUR 320.000	France Government Bond OAT RegS 1,50% 25/5/2050	366.774	0,06
EUR 300.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 7/5/2027	310.941	0,05	EUR 8.760.000	France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/5/2052	8.235.451	1,28
EUR 200.000	Danone SA RegS 0,424% 3/11/2022	201.910	0,03	EUR 368.727	France Government Bond OAT RegS 4,00% 25/4/2060	719.755	0,11
EUR 700.000	Danone SA RegS 1/12/2025 (Zero Coupon)	699.629	0,11	EUR 545.000	France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/5/2066	675.484	0,10

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				Allemagne suite			
EUR 1.501.940	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2072	1.137.524	0,18	EUR 2.000.000	Berlin Hyp AG RegS 0,01% 24/1/2028	2.020.960	0,31
EUR 1.200.000	HSBC Continental Europe SA RegS 0,60% 20/3/2023	1.220.964	0,19	EUR 1.975.000	Berlin Hyp AG RegS 0,01% 7/7/2028 [^]	1.991.156	0,31
EUR 700.000	La Poste SA RegS 1,375% 21/4/2032	752.325	0,12	EUR 1.075.000	Berlin Hyp AG RegS 0,01% 2/9/2030	1.069.915	0,17
EUR 300.000	Orange SA RegS 1,00% 12/5/2025	312.213	0,05	EUR 1.370.000	Bundesobligation 11/4/2025 (Zero Coupon)	1.403.729	0,22
EUR 200.000	Orange SA RegS 1,00% 12/9/2025	208.886	0,03	EUR 8.300.000	Bundesobligation 10/10/2025 (Zero Coupon) [^]	8.521.610	1,33
EUR 200.000	Orange SA RegS 1,25% 7/7/2027	213.310	0,03	EUR 2.695.759	Bundesobligation RegS 13/10/2023 (Zero Coupon) [^]	2.740.886	0,43
EUR 500.000	Orange SA RegS 1,375% 20/3/2028	538.600	0,08	EUR 2.200.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,75% 15/2/2024	2.346.762	0,36
EUR 100.000	Orange SA RegS FRN (Perpetual)	119.290	0,02	EUR 1.457.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,50% 15/5/2024	1.551.982	0,24
EUR 1.300.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 1,625% 8/10/2024	1.372.436	0,21	EUR 200.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 0,50% 15/2/2026 [^]	210.398	0,03
EUR 200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 9/9/2027 (Zero Coupon)	197.330	0,03	EUR 784.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 0,25% 15/2/2027	818.567	0,13
EUR 400.000	Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon)	402.756	0,06	EUR 57.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 0,50% 15/2/2028	60.640	0,01
EUR 400.000	Societe Generale SA FRN 24/11/2030	397.972	0,06	EUR 1.082.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 4,75% 4/7/2028	1.488.075	0,23
EUR 200.000	Societe Generale SA RegS 0,125% 24/2/2026	200.526	0,03	EUR 1.100.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 0,25% 15/2/2029 [^]	1.151.843	0,18
EUR 800.000	Societe Generale SA RegS FRN 21/4/2026	824.232	0,13	EUR 1.775.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/2/2030 (Zero Coupon) [^]	1.816.695	0,28
EUR 200.000	Societe Generale SA RegS 0,875% 1/7/2026	204.116	0,03	EUR 1.995.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2030 (Zero Coupon) [^]	2.035.997	0,32
EUR 1.100.000	Societe Generale SA RegS FRN 22/9/2028	1.113.948	0,17	EUR 5.705.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2030 (Zero Coupon) [^]	5.850.306	0,91
EUR 400.000	Societe Generale SA RegS 1,75% 22/3/2029	426.620	0,07	EUR 2.900.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 4,25% 4/7/2039 [^]	5.053.163	0,79
EUR 300.000	Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 2/6/2025	310.275	0,05	EUR 7.616.755	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 4,75% 4/7/2040 [^]	14.261.155	2,22
EUR 300.000	Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 28/1/2026	311.010	0,05	EUR 740.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 3,25% 4/7/2042 [^]	1.209.271	0,19
EUR 800.000	Societe Generale SFH SA RegS 0,125% 18/7/2029	808.168	0,13	EUR 412.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 2,50% 4/7/2044 [^]	621.749	0,10
EUR 900.000	Societe Generale SFH SA RegS 0,01% 11/2/2030	897.597	0,14	EUR 158.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 2,50% 15/8/2046 [^]	242.843	0,04
EUR 900.000	Suez SA RegS 9/6/2026 (Zero Coupon)	896.076	0,14	EUR 50.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,25% 15/8/2048	61.711	0,01
EUR 100.000	Suez SA RegS FRN (Perpetual)	99.984	0,02	EUR 2.230.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2050 (Zero Coupon) [^]	1.993.352	0,31
EUR 800.000	Suez SA RegS FRN (Perpetual) [^]	841.368	0,13	EUR 4.557.147	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2050 (Zero Coupon)	4.116.881	0,64
EUR 900.000	Total Capital International SA RegS 0,696% 31/5/2028	930.582	0,14	EUR 6.000.000	Bundesschatzanweisungen RegS 16/9/2022 (Zero Coupon)	6.051.960	0,94
EUR 2.300.000	UNEDIC ASSEO RegS 0,875% 25/5/2028	2.450.972	0,38	EUR 154.000	Commerzbank AG RegS 0,125% 23/2/2023	155.683	0,02
EUR 900.000	Veolia Environnement SA RegS 0,892% 14/1/2024	921.933	0,14				
EUR 1.000.000	Veolia Environnement SA RegS 0,664% 15/1/2031	1.005.160	0,16				
EUR 300.000	Veolia Environnement SA RegS 0,80% 15/1/2032	300.654	0,05				
EUR 1.400.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual)	1.436.302	0,22				
EUR 600.000	Vinci SA RegS 27/11/2028 (Zero Coupon) [^]	588.720	0,09				
		135.502.394	21,09				
Allemagne							
EUR 700.000	Allianz SE RegS FRN 8/7/2050	745.969	0,12				
EUR 604.000	Berlin Hyp AG RegS 0,625% 22/10/2025	629.833	0,10				

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Allemagne suite				Allemagne suite			
EUR 100.000	Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023	103.027	0,02	EUR 26.000	NRW Bank 18/2/2030 (Zero Coupon)	25.925	0,00
EUR 435.000	Commerzbank AG RegS 0,50% 4/12/2026	440.655	0,07	EUR 316.000	NRW Bank RegS 0,875% 10/11/2025	333.061	0,05
EUR 800.000	Daimler AG RegS 0,75% 11/3/2033	792.712	0,12	EUR 405.000	NRW Bank RegS 0,625% 2/2/2029	425.825	0,07
EUR 1.050.000	Deutsche Bahn Finance GmbH RegS 0,625% 15/4/2036	1.011.927	0,16	EUR 300.000	Santander Consumer Bank AG RegS 0,25% 5/12/2024	306.534	0,05
EUR 150.000	Deutsche Bank AG RegS FRN 10/6/2026	157.466	0,02	EUR 1.128.000	State of Hesse RegS 25/4/2025 (Zero Coupon)	1.144.751	0,18
EUR 300.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,75% 7/2/2023	304.857	0,05	EUR 637.000	State of Lower Saxony 0,125% 8/4/2027	651.001	0,10
EUR 1.100.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024	1.104.994	0,17	EUR 776.000	State of Lower Saxony RegS 0,125% 7/3/2025	791.668	0,12
EUR 543.000	DZ HYP AG RegS 0,50% 30/9/2026	564.948	0,09	EUR 3.967.000	State of Lower Saxony RegS 0,01% 16/6/2028	4.009.923	0,62
EUR 720.000	DZ HYP AG RegS 0,01% 15/1/2027	729.986	0,11	EUR 840.000	State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,50% 16/2/2027	876.691	0,14
EUR 1.100.000	DZ HYP AG RegS 0,01% 27/10/2028	1.106.952	0,17	EUR 600.000	State of North Rhine- Westphalia Germany RegS 0,375% 2/9/2050	556.812	0,09
EUR 600.000	Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023	624.318	0,10	EUR 1.100.000	Vonovia SE RegS 0,625% 24/3/2031	1.083.401	0,17
EUR 1.100.000	Eurogrid GmbH RegS 1,113% 15/5/2032	1.150.534	0,18			101.831.898	15,85
EUR 12.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,05% 30/5/2024	12.214	0,00	Grèce			
EUR 60.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,50% 15/9/2027	62.789	0,01	EUR 4.575.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 12/2/2026 (Zero Coupon)	4.552.582	0,71
EUR 153.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 30/9/2026 (Zero Coupon)	155.699	0,02			4.552.582	0,71
EUR 7.210.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 15/6/2029 (Zero Coupon)	7.264.868	1,13	Islande			
EUR 536.000	Land Berlin RegS 0,125% 4/6/2035	518.130	0,08	EUR 325.000	Iceland Government International Bond RegS 0,10% 20/6/2024	326.554	0,05
EUR 218.000	Land Berlin RegS 0,625% 15/7/2039	222.101	0,03			326.554	0,05
EUR 303.000	Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,05% 11/11/2021	303.797	0,05	Irlande			
EUR 600.000	Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 0,125% 27/6/2023*	607.938	0,09	EUR 575.000	CRH SMW Finance DAC RegS 1,25% 5/11/2026	608.017	0,09
EUR 600.000	Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029	630.702	0,10	EUR 1.700.000	Ireland Government Bond 5,40% 13/3/2025	2.080.222	0,32
EUR 100.000	Landesbank Hessen- Thueringen Girozentrale 0,01% 26/9/2029	100.177	0,02	EUR 300.000	Ireland Government Bond RegS 3,40% 18/3/2024	333.285	0,05
EUR 300.000	Landesbank Hessen- Thueringen Girozentrale RegS 12/1/2022 (Zero Coupon)	301.002	0,05	EUR 674.000	Ireland Government Bond RegS 1,35% 18/3/2031	754.759	0,12
EUR 304.000	Landwirtschaftliche Rentenbank RegS 0,05% 12/6/2023	307.815	0,05	EUR 1.907.046	Ireland Government Bond RegS 18/10/2031 (Zero Coupon)	1.865.434	0,29
EUR 300.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,125% 16/7/2025	302.652	0,05	EUR 318.195	Ireland Government Bond RegS 1,30% 15/5/2033	355.672	0,06
EUR 700.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,375% 5/7/2027	710.346	0,11	EUR 370.000	Ireland Government Bond RegS 0,40% 15/5/2035	368.109	0,06
EUR 300.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,875% 5/7/2031	312.537	0,05	EUR 300.000	Ireland Government Bond RegS 1,70% 15/5/2037	354.294	0,06
EUR 400.000	Muenchener Hypothekbank eG RegS 2,50% 4/7/2028	474.132	0,07	EUR 230.000	Ireland Government Bond RegS 0,55% 22/4/2041	223.337	0,03
EUR 27.000	Muenchener Hypothekbank eG RegS 0,01% 2/11/2040	24.470	0,00	EUR 65.000	Ireland Government Bond RegS 2,00% 18/2/2045	82.555	0,01
EUR 1.000.000	NRW Bank 15/10/2029 (Zero Coupon)	999.470	0,15	EUR 540.000	Ireland Government Bond RegS 1,50% 15/5/2050	619.607	0,10
						7.645.291	1,19
				Italie			
				EUR 600.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA RegS 0,75% 21/11/2022	608.748	0,09
				EUR 100.000	Credit Agricole Italia SpA RegS 1,00% 25/3/2027	106.616	0,02
				EUR 1.800.000	Credit Agricole Italia SpA RegS 0,125% 15/3/2033*	1.764.126	0,27

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Italie suite				Italie suite			
EUR 450.000	Credito Emiliano SpA RegS 1,125% 17/1/2024	466.898	0,07	EUR 845.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,35% 1/3/2035	1.070.176	0,17
EUR 300.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024	307.812	0,05	EUR 248.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,25% 1/9/2036	279.776	0,04
EUR 175.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,75% 4/12/2024	179.176	0,03	EUR 1.559.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,95% 1/9/2038	1.913.532	0,30
EUR 1.150.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,35% 24/2/2031	1.125.930	0,18	EUR 920.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,00% 1/8/2039	1.434.584	0,22
EUR 207.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,35% 1/11/2021	207.776	0,03	EUR 3.460.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,10% 1/3/2040	4.333.858	0,67
EUR 4.410.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,15% 15/12/2021	4.474.474	0,70	EUR 440.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,00% 1/9/2040	691.838	0,11
EUR 1.900.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,35% 15/4/2022	1.930.210	0,30	EUR 2.005.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,80% 1/3/2041	2.070.102	0,32
EUR 1.179.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,45% 15/9/2022	1.206.931	0,19	EUR 425.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,75% 1/9/2044	673.162	0,11
EUR 2.631.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,95% 1/3/2023	2.690.066	0,42	EUR 2.932.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045	2.813.078	0,44
EUR 1.741.462	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,45% 22/5/2023	1.790.101	0,28	EUR 369.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,70% 1/3/2047	437.468	0,07
EUR 768.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,65% 15/10/2023^	784.927	0,12	EUR 1.012.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,85% 1/9/2049	1.459.324	0,23
EUR 1.408.449	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,25% 20/11/2023	1.449.534	0,23	EUR 1.330.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,45% 1/9/2050	1.505.041	0,23
EUR 1.855.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,75% 1/7/2024	1.963.499	0,31	EUR 1.040.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,70% 1/9/2051	997.433	0,16
EUR 4.072.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,45% 15/11/2024	4.288.264	0,67	EUR 8.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,80% 1/3/2067	9.424	0,00
EUR 1.865.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,50% 1/12/2024	2.033.223	0,32	EUR 350.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,15% 1/3/2072	340.018	0,05
EUR 825.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,35% 1/2/2025	837.284	0,13	EUR 500.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,00% 8/9/2027	513.805	0,08
EUR 2.852.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,45% 15/5/2025	3.016.218	0,47	EUR 200.000	UniCredit SpA RegS FRN 25/6/2025	205.802	0,03
EUR 5.395.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,85% 1/7/2025	5.795.147	0,90	EUR 485.000	UniCredit SpA RegS FRN 23/9/2029	485.897	0,08
EUR 410.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,50% 15/11/2025	454.149	0,07	EUR 1.275.000	UniCredit SpA RegS 0,85% 19/1/2031^	1.242.105	0,19
EUR 4.370.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,50% 1/2/2026^	4.446.737	0,69			84.937.856	13,22
EUR 2.575.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,50% 1/3/2026	3.108.205	0,48	Japon			
EUR 210.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,85% 15/1/2027	216.470	0,03	EUR 755.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040	791.127	0,12
EUR 137.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,05% 1/8/2027	150.925	0,02			791.127	0,12
EUR 600.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,00% 1/2/2028	660.630	0,10	Luxembourg			
EUR 3.438.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,75% 1/9/2028	4.463.349	0,69	EUR 168.000	European Financial Stability Facility RegS 0,20% 28/4/2025	172.099	0,03
EUR 1.505.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,00% 1/8/2029	1.785.171	0,28	EUR 687.000	European Financial Stability Facility RegS 0,40% 31/5/2026	712.433	0,11
EUR 1.075.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,50% 1/3/2030	1.326.464	0,21	EUR 418.000	European Financial Stability Facility RegS 0,75% 3/5/2027	442.758	0,07
EUR 750.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,35% 1/4/2030	788.235	0,12	EUR 2.306.000	European Financial Stability Facility RegS 0,05% 17/10/2029	2.322.280	0,36
EUR 1.645.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,95% 1/8/2030	1.667.191	0,26	EUR 2.927.000	European Financial Stability Facility RegS 20/1/2031 (Zero Coupon)	2.912.336	0,45
EUR 1.140.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 1/12/2030	1.224.178	0,19	EUR 15.000	European Financial Stability Facility RegS 1,20% 17/2/2045	16.814	0,00
EUR 1.290.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,90% 1/4/2031	1.293.586	0,20	EUR 1.010.000	European Financial Stability Facility RegS 1,375% 31/5/2047	1.173.802	0,18
EUR 1.580.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 1/3/2032	1.688.546	0,26	EUR 878.000	European Financial Stability Facility RegS 0,70% 20/1/2050	884.058	0,14
EUR 1.875.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,45% 1/9/2033	2.160.637	0,34				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Luxembourg suite				Pays-Bas suite			
EUR 460.000	European Financial Stability Facility RegS 0,05% 18/1/2052	381.759	0,06	EUR 300.000	ING Groep NV RegS 1,00% 20/9/2023	308.550	0,05
EUR 1.250.000	Holcim Finance Luxembourg SA RegS 0,50% 23/4/2031	1.206.437	0,19	EUR 700.000	ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025	700.714	0,11
EUR 125.000	Richemont International Holding SA RegS 1,50% 26/3/2030	137.031	0,02	EUR 1.100.000	ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029	1.074.403	0,17
EUR 1.355.000	State of the Grand-Duchy of Luxembourg RegS 14/9/2032 (Zero Coupon)	1.335.556	0,21	EUR 700.000	ING Groep NV RegS FRN 13/11/2030	706.251	0,11
		11.697.363	1,82	EUR 500.000	Koninklijke DSM NV RegS 0,625% 23/6/2032	503.690	0,08
Pays-Bas				EUR 100.000	Koninklijke Philips NV RegS 2,00% 30/3/2030	112.744	0,02
EUR 350.000	ABN AMRO Bank NV RegS 0,25% 3/12/2021	351.358	0,05	EUR 200.000	Nationale-Nederlanden Bank NV/The Netherlands RegS 0,625% 11/9/2025	207.622	0,03
EUR 320.000	ABN AMRO Bank NV RegS 0,50% 17/7/2023	325.485	0,05	EUR 707.000	Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV RegS 0,125% 20/4/2022	711.588	0,11
EUR 200.000	ABN AMRO Bank NV RegS 1,375% 10/1/2034	226.690	0,04	EUR 617.000	Nederlandse Waterschapsbank NV RegS 1,50% 15/6/2039	721.859	0,11
EUR 200.000	Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025	202.286	0,03	EUR 1.669.040	Netherlands Government Bond RegS 15/1/2022 (Zero Coupon)	1.675.850	0,26
EUR 600.000	Aegon Bank NV RegS 0,01% 16/11/2025	606.558	0,09	EUR 420.000	Netherlands Government Bond RegS 2,00% 15/7/2024	455.188	0,07
EUR 325.000	ASML Holding NV RegS 1,375% 7/7/2026	347.555	0,05	EUR 1.356.422	Netherlands Government Bond RegS 0,25% 15/7/2025	1.402.662	0,22
EUR 250.000	ASML Holding NV RegS 1,625% 28/5/2027	272.310	0,04	EUR 1.205.845	Netherlands Government Bond RegS 0,50% 15/7/2026	1.267.415	0,20
EUR 870.000	BMW Finance NV RegS 24/3/2023 (Zero Coupon)	874.950	0,14	EUR 1.470.000	Netherlands Government Bond RegS 15/1/2027 (Zero Coupon)	1.504.516	0,23
EUR 300.000	Cooperatieve Rabobank UA RegS 0,875% 8/2/2028	319.992	0,05	EUR 184.050	Netherlands Government Bond RegS 0,75% 15/7/2027	197.151	0,03
EUR 1.700.000	Cooperatieve Rabobank UA RegS 0,01% 2/7/2030*	1.690.599	0,26	EUR 155.904	Netherlands Government Bond RegS 5,50% 15/1/2028	217.241	0,03
EUR 220.000	Daimler International Finance BV RegS 0,625% 27/2/2023	223.443	0,03	EUR 625.000	Netherlands Government Bond RegS 0,25% 15/7/2029	648.331	0,10
EUR 500.000	de Volksbank NV RegS 0,75% 25/6/2023	509.925	0,08	EUR 2.465.000	Netherlands Government Bond RegS 15/7/2030 (Zero Coupon)	2.491.302	0,39
EUR 200.000	de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024	201.232	0,03	EUR 975.000	Netherlands Government Bond RegS 2,50% 15/1/2033	1.256.434	0,20
EUR 415.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 0,625% 13/12/2024	425.719	0,07	EUR 360.000	Netherlands Government Bond RegS 15/1/2038 (Zero Coupon)	343.782	0,05
EUR 631.000	Domi 2021-1 BV '2021-1 A' RegS FRN 15/6/2053	633.297	0,10	EUR 2.231.000	Netherlands Government Bond RegS 0,50% 15/1/2040	2.317.930	0,36
EUR 200.000	EDP Finance BV RegS 2,375% 23/3/2023	209.418	0,03	EUR 1.594.070	Netherlands Government Bond RegS 15/1/2052 (Zero Coupon)	1.381.340	0,22
EUR 770.000	EDP Finance BV RegS 1,875% 29/9/2023	806.398	0,13	EUR 600.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	670.434	0,10
EUR 2.000.000	EDP Finance BV RegS 1,125% 12/2/2024	2.067.340	0,32	EUR 600.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 20/2/2023 (Zero Coupon)	603.606	0,09
EUR 600.000	EDP Finance BV RegS 2,00% 22/4/2025	646.404	0,10	EUR 400.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,375% 5/6/2026	408.676	0,06
USD 910.000	Enel Finance International NV 2,65% 10/9/2024	785.336	0,12	EUR 227.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,90% 28/2/2028	238.815	0,04
EUR 1.000.000	Enel Finance International NV RegS 17/6/2024 (Zero Coupon)	1.006.600	0,16	EUR 900.000	Silver Arrow Athlon NL 2021-1 BV '2021-1 A' RegS FRN 26/4/2031	908.311	0,14
EUR 2.325.000	Enel Finance International NV RegS 1,966% 27/1/2025	2.496.190	0,39	EUR 100.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	101.984	0,02
EUR 150.000	Enel Finance International NV RegS 1,50% 21/7/2025	159.227	0,03	EUR 200.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	205.890	0,03
EUR 325.000	Enxsis Holding NV RegS 1,50% 20/10/2023	337.409	0,05				
EUR 125.000	Heineken NV RegS 2,25% 30/3/2030	143.629	0,02				
EUR 800.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	804.120	0,13				
EUR 1.800.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	1.844.244	0,29				
EUR 1.300.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	1.415.687	0,22				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Portugal suite			
EUR 500.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	535.685	0,08	EUR 1.085.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 2,875% 15/10/2025	1.240.263	0,19
EUR 1.525.000	TenneT Holding BV RegS 0,50% 9/6/2031	1.516.948	0,24	EUR 729.737	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,125% 14/4/2027	914.120	0,14
EUR 2.100.000	TenneT Holding BV RegS FRN (Perpetual)	2.168.754	0,34	EUR 757.064	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,70% 15/10/2027	793.630	0,12
EUR 600.000	Vonovia Finance BV RegS 1,80% 29/6/2025	641.112	0,10	EUR 172.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 2,125% 17/10/2028	198.063	0,03
EUR 100.000	Vonovia Finance BV RegS 2,25% 7/4/2030	113.001	0,02	EUR 671.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,95% 15/6/2029	766.483	0,12
		48.253.180	7,51	EUR 180.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 3,875% 15/2/2030	236.090	0,04
Nouvelle-Zélande				EUR 861.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,475% 18/10/2030	871.582	0,14
EUR 495.000	ANZ New Zealand International Ltd RegS 0,125% 22/9/2023	500.994	0,08	EUR 400.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,30% 17/10/2031	393.156	0,06
EUR 1.970.000	ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031	1.968.956	0,31	EUR 280.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,90% 12/10/2035	284.284	0,04
NZD 726.000	Auckland Council RegS 2,95% 28/9/2050	373.709	0,06	EUR 685.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,10% 15/4/2037	1.018.664	0,16
EUR 807.000	Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023	828.741	0,13	EUR 182.400	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,10% 15/2/2045	291.915	0,05
EUR 600.000	Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026*	616.464	0,09	EUR 210.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052	188.324	0,03
NZD 3.010.000	New Zealand Government Bond 1,75% 15/5/2041	1.543.949	0,24			9.892.030	1,54
		5.832.813	0,91	Singapour			
Norvège				EUR 516.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd RegS 0,625% 18/4/2025	534.272	0,09
EUR 1.400.000	DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023	1.410.570	0,22	EUR 1.300.000	United Overseas Bank Ltd RegS 0,01% 1/12/2027	1.305.148	0,20
EUR 1.452.000	DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 19/6/2025	1.508.497	0,23			1.839.420	0,29
EUR 1.113.000	DNB Boligkreditt AS RegS 0,01% 21/1/2031	1.100.145	0,17	Slovaquie			
EUR 873.000	SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025	900.718	0,14	EUR 100.000	Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024	101.633	0,02
EUR 3.673.000	SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,01% 22/9/2027*	3.706.424	0,58	EUR 500.000	Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 23/6/2025	504.760	0,08
EUR 150.000	Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon)	150.861	0,02	EUR 700.000	Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 24/3/2026	706.062	0,11
EUR 330.000	Telenor ASA RegS 2,50% 22/5/2025	364.211	0,06			1.312.455	0,21
		9.141.426	1,42	Slovénie			
Pologne				EUR 400.000	Slovenia Government Bond RegS 0,275% 14/1/2030	406.672	0,06
EUR 300.000	mBank Hipoteczny SA RegS 1,073% 5/3/2025	313.959	0,05	EUR 470.000	Slovenia Government Bond RegS 0,875% 15/7/2030*	501.476	0,08
EUR 633.000	Republic of Poland Government International Bond RegS 0,50% 20/12/2021	636.380	0,10	EUR 241.000	Slovenia Government Bond RegS 0,488% 20/10/2050	209.745	0,03
EUR 98.000	Republic of Poland Government International Bond RegS 1,00% 25/10/2028	104.995	0,02			1.117.893	0,17
		1.055.334	0,17	Espagne			
Portugal				EUR 300.000	Adif Alta Velocidad RegS 1,25% 4/5/2026	319.488	0,05
EUR 300.000	Banco Santander Totta SA RegS 1,25% 26/9/2027	326.376	0,05	EUR 527.000	Autonomous Community of Madrid Spain RegS 0,747% 30/4/2022	532.544	0,08
EUR 200.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS 1,625% 15/4/2027	214.984	0,03				
EUR 300.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 30/4/2079	326.361	0,05				
EUR 300.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 20/7/2080*	300.033	0,05				
EUR 435.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,95% 25/10/2023	493.146	0,08				
EUR 885.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 5,65% 15/2/2024	1.034.556	0,16				

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Espagne suite				Espagne suite			
EUR 808.000	Autonomous Community of Madrid Spain RegS 1,773% 30/4/2028	894.715	0,14	EUR 500.000	Spain Government Bond RegS 1,40% 30/4/2028	545.625	0,08
EUR 1.795.000	Autonomous Community of Madrid Spain RegS 0,419% 30/4/2030	1.794.803	0,28	EUR 226.000	Spain Government Bond RegS 1,40% 30/7/2028	246.943	0,04
EUR 600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 1,00% 21/6/2026	622.842	0,10	EUR 200.000	Spain Government Bond RegS 1,45% 30/4/2029	219.520	0,03
EUR 1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,375% 15/11/2026	1.009.400	0,16	EUR 1.641.000	Spain Government Bond RegS 0,60% 31/10/2029	1.685.931	0,26
EUR 2.500.000	Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027	2.575.475	0,40	EUR 2.631.000	Spain Government Bond RegS 0,50% 30/4/2030	2.668.729	0,42
EUR 400.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,125% 10/2/2028	404.168	0,06	EUR 1.538.000	Spain Government Bond RegS 1,95% 30/7/2030	1.758.795	0,27
EUR 400.000	Banco Santander SA RegS 1,375% 14/12/2022	410.232	0,06	EUR 2.415.000	Spain Government Bond RegS 1,25% 31/10/2030 [*]	2.603.925	0,41
EUR 500.000	Banco Santander SA RegS 0,875% 9/5/2031	535.950	0,08	EUR 900.000	Spain Government Bond RegS 0,10% 30/4/2031	867.600	0,14
EUR 500.000	Bankia SA RegS 0,75% 9/7/2026	511.540	0,08	EUR 2.409.000	Spain Government Bond RegS 2,35% 30/7/2033	2.882.031	0,45
EUR 600.000	CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025	605.604	0,09	EUR 670.000	Spain Government Bond RegS 1,85% 30/7/2035	760.658	0,12
EUR 800.000	CaixaBank SA RegS 1,125% 27/3/2026	833.976	0,13	EUR 325.000	Spain Government Bond RegS 4,20% 31/1/2037	481.702	0,08
EUR 1.500.000	CaixaBank SA RegS FRN 10/7/2026	1.532.055	0,24	EUR 430.000	Spain Government Bond RegS 0,85% 30/7/2037	419.753	0,07
EUR 500.000	CaixaBank SA RegS FRN 18/11/2026	498.660	0,08	EUR 1.490.000	Spain Government Bond RegS 4,90% 30/7/2040	2.478.600	0,39
EUR 600.000	Iberdrola Finanzas SA RegS 0,875% 16/6/2025	622.320	0,10	EUR 2.250.000	Spain Government Bond RegS 1,20% 31/10/2040	2.262.105	0,35
EUR 200.000	Iberdrola Finanzas SA RegS 1,25% 28/10/2026	212.906	0,03	EUR 567.000	Spain Government Bond RegS 4,70% 30/7/2041	930.073	0,14
EUR 400.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,50% 4/10/2021	401.304	0,06	EUR 155.000	Spain Government Bond RegS 5,15% 31/10/2044	277.882	0,04
EUR 200.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024	202.414	0,03	EUR 225.000	Spain Government Bond RegS 2,90% 31/10/2046	301.073	0,05
EUR 2.730.000	Spain Government Bond 0,40% 30/4/2022	2.754.215	0,43	EUR 1.886.000	Spain Government Bond RegS 1,00% 31/10/2050	1.684.104	0,26
EUR 1.060.000	Spain Government Bond 30/4/2023 (Zero Coupon)	1.070.430	0,17	EUR 1.237.000	Spain Government Bond RegS 3,45% 30/7/2066	1.895.938	0,30
EUR 1.650.000	Spain Government Bond 31/1/2025 (Zero Coupon)	1.670.938	0,26	EUR 240.000	Spain Government Bond RegS 1,45% 31/10/2071	209.455	0,03
EUR 2.265.000	Spain Government Bond 31/1/2026 (Zero Coupon)	2.288.035	0,36			64.786.661	10,08
EUR 505.000	Spain Government Bond 5,75% 30/7/2032	789.901	0,12	Supranational			
EUR 705.000	Spain Government Bond RegS 4,40% 31/10/2023	788.761	0,12	EUR 400.000	African Development Bank 0,50% 21/3/2029	415.178	0,07
EUR 1.065.000	Spain Government Bond RegS 4,80% 31/1/2024	1.215.250	0,19	EUR 433.000	European Investment Bank 0,10% 15/10/2026	443.544	0,07
EUR 1.635.000	Spain Government Bond RegS 0,25% 30/7/2024	1.669.646	0,26	EUR 965.000	European Investment Bank 0,20% 17/3/2036	939.756	0,15
EUR 2.316.000	Spain Government Bond RegS 2,75% 31/10/2024	2.567.749	0,40	EUR 764.000	European Investment Bank 1,50% 15/11/2047	928.298	0,14
EUR 1.455.000	Spain Government Bond RegS 1,60% 30/4/2025	1.566.642	0,24	EUR 45.000	European Investment Bank RegS 0,375% 15/5/2026	46.701	0,01
EUR 1.330.000	Spain Government Bond RegS 4,65% 30/7/2025	1.607.199	0,25	EUR 56.000	European Investment Bank RegS 0,875% 14/1/2028	60.132	0,01
EUR 755.000	Spain Government Bond RegS 2,15% 31/10/2025	836.766	0,13	EUR 3.135.000	European Investment Bank RegS 28/3/2028 (Zero Coupon)	3.176.758	0,49
EUR 2.054.000	Spain Government Bond RegS 1,95% 30/4/2026	2.273.490	0,35	EUR 2.729.000	European Investment Bank RegS 0,25% 15/6/2040	2.608.078	0,41
EUR 1.923.000	Spain Government Bond RegS 1,30% 31/10/2026	2.074.552	0,32	EUR 343.000	European Stability Mechanism RegS 17/1/2022 (Zero Coupon)	344.228	0,05
EUR 240.000	Spain Government Bond RegS 1,50% 30/4/2027	262.524	0,04	EUR 5.200.000	European Stability Mechanism RegS 14/3/2025 (Zero Coupon)	5.284.500	0,82
EUR 1.570.000	Spain Government Bond RegS 0,80% 30/7/2027	1.649.725	0,26	EUR 114.000	European Stability Mechanism RegS 0,75% 15/3/2027	120.791	0,02
				EUR 559.000	European Union RegS 4/7/2035 (Zero Coupon)	532.755	0,08

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Supranational suite				Royaume-Uni suite			
EUR 2.457.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,625% 22/11/2027 ^a	2.587.403	0,40	EUR 425.000	Motability Operations Group Plc RegS 0,125% 20/7/2028	420.198	0,07
EUR 419.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,125% 3/1/2051	358.689	0,06	EUR 527.000	National Grid Electricity Transmission Plc RegS 0,823% 7/7/2032	527.126	0,08
		17.846.811	2,78	EUR 550.000	Nationwide Building Society RegS 0,50% 5/5/2041	536.134	0,08
Suède				EUR 125.000	Santander UK Plc 0,10% 12/5/2024	126.658	0,02
EUR 100.000	Lansforsakringar Hypotek AB RegS 0,625% 29/1/2026	103.988	0,02	EUR 325.000	Sky Ltd RegS 1,50% 15/9/2021	326.843	0,05
EUR 945.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024	952.617	0,15	EUR 452.000	Sky Ltd RegS 1,875% 24/11/2023	475.549	0,07
EUR 325.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 0,375% 3/7/2023	330.012	0,05	EUR 327.000	Sky Ltd RegS 2,25% 17/11/2025	359.582	0,06
EUR 845.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 0,125% 18/6/2024	854.303	0,13	EUR 100.000	Sky Ltd RegS 2,50% 15/9/2026	112.678	0,02
SEK 17.600.000	Sweden Government International Bond RegS 0,125% 9/9/2030	1.702.953	0,26	EUR 1.000.000	SSE Plc RegS 1,25% 16/4/2025	1.046.150	0,16
		3.943.873	0,61	USD 660.000	Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025	545.441	0,09
Suisse				EUR 400.000	Swiss Re Finance UK Plc RegS FRN 4/6/2052	437.644	0,07
EUR 160.000	Credit Suisse AG RegS 1,375% 31/1/2022	161.957	0,02	EUR 200.000	Yorkshire Building Society RegS 0,01% 13/10/2027	200.656	0,03
EUR 630.000	Credit Suisse AG RegS 1,00% 7/6/2023	645.189	0,10			13.013.466	2,03
EUR 1.100.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 24/6/2027	1.119.855	0,17	États-Unis			
EUR 600.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028	597.840	0,09	EUR 2.475.000	Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032	2.508.759	0,39
EUR 325.000	Credit Suisse Group AG RegS 0,625% 18/1/2033	301.451	0,05	USD 1.500.000	Apple Inc 2,80% 8/2/2061	1.124.583	0,17
EUR 227.000	UBS AG RegS 0,25% 10/1/2022	227.919	0,04	EUR 500.000	AT&T Inc 2,45% 15/3/2035	553.425	0,09
EUR 300.000	UBS AG RegS 0,625% 23/1/2023	304.413	0,05	EUR 1.025.000	Bank of America Corp RegS FRN 26/10/2031	1.005.295	0,16
EUR 200.000	UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026	200.506	0,03	EUR 1.225.000	Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032	1.240.092	0,19
EUR 575.000	UBS Group AG RegS 0,625% 24/2/2033	557.750	0,09	EUR 625.000	Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025	626.337	0,10
		4.116.880	0,64	EUR 600.000	Citigroup Inc RegS FRN 6/7/2026	625.596	0,10
Royaume-Uni				EUR 1.025.000	Coca-Cola Co 0,40% 6/5/2030	1.018.317	0,16
EUR 1.250.000	AstraZeneca Plc RegS 0,375% 3/6/2029	1.243.125	0,19	EUR 1.103.000	Coca-Cola Co 0,375% 15/3/2033	1.053.357	0,16
EUR 700.000	Barclays Plc RegS FRN 24/1/2026	727.902	0,11	EUR 225.000	Comcast Corp 0,75% 20/2/2032	224.735	0,03
EUR 150.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,231% 8/5/2031	155.853	0,03	EUR 100.000	Danaher Corp 2,50% 30/3/2030	115.635	0,02
EUR 795.000	British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024	821.267	0,13	EUR 1.420.000	Fiserv Inc 0,375% 1/7/2023	1.433.504	0,22
EUR 1.225.000	Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030	1.222.072	0,19	EUR 600.000	Fiserv Inc 1,125% 1/7/2027	625.412	0,10
EUR 410.000	Cadent Finance Plc RegS 0,75% 11/3/2032	404.699	0,06	EUR 135.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 0,125% 19/8/2024	135.186	0,02
EUR 800.000	Diageo Finance Plc RegS 0,125% 12/10/2023	805.984	0,13	EUR 150.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 3,375% 27/3/2025	168.258	0,03
EUR 158.000	DS Smith Plc RegS 0,875% 12/9/2026	161.261	0,03	EUR 1.050.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 0,25% 26/1/2028	1.026.301	0,16
EUR 250.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon)	251.340	0,04	EUR 400.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 2,00% 22/3/2028	438.062	0,07
EUR 206.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 2/12/2024	217.124	0,03	EUR 900.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 1,00% 18/3/2033	890.901	0,14
EUR 625.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,25% 21/5/2026	662.344	0,10	EUR 776.000	International Business Machines Corp 0,375% 31/1/2023	784.901	0,12
EUR 725.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2031	717.329	0,11	EUR 150.000	International Business Machines Corp 1,25% 29/1/2027	158.997	0,02
GBP 436.000	London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051	508.507	0,08	EUR 411.000	International Business Machines Corp 1,75% 7/3/2028	452.019	0,07
				EUR 400.000	International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026	428.668	0,07
				EUR 135.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 11/3/2027	140.237	0,02

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				Organismes de placement collectif			
EUR 800.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 18/5/2028	857.266	0,13	Irlande			
EUR 225.000	Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027	232.934	0,04	229.640	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ⁻	22.698.388	3,53
EUR 620.000	Morgan Stanley 1,875% 30/3/2023	644.062	0,10	<hr/>			
EUR 200.000	Morgan Stanley FRN 26/7/2024	203.138	0,03	Total des organismes de placement collectif			
EUR 325.000	National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023	331.087	0,05	Portefeuille de titres à la valeur de marché			
EUR 150.000	PepsiCo Inc 1,05% 9/10/2050	139.854	0,02	Autres éléments de l'actif net			
EUR 600.000	Verizon Communications Inc 0,875% 8/4/2027	620.484	0,10	Total de l'actif net (EUR)			
EUR 741.000	Verizon Communications Inc 1,25% 8/4/2030	778.532	0,12	<hr/>			
		20.585.934	3,20	^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.			
Total des obligations		618.080.422	96,20	- Investissement dans un fonds de partie liée.			
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		618.080.422	96,20	<hr/>			
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire							
OBLIGATIONS							
Nouvelle-Zélande							
NZD 974.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040	793.997	0,12				
		793.997	0,12				
Total des obligations		793.997	0,12				
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		793.997	0,12				

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	EUR 2.830.000	Fund receives Fixed 1,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFE	Credit Suisse	15/4/2031	(48.080)	(48.021)
CCILS	USD 860.000	Fund receives Fixed 2,338% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	11/3/2031	(21.851)	(21.836)
CCILS	USD 857.500	Fund receives Fixed 2,350% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	5/3/2031	(20.908)	(20.893)
CCILS	USD 857.500	Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	5/3/2031	(20.603)	(20.589)
CCILS	USD 1.715.000	Fund receives Fixed 2,358% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	5/3/2031	(40.674)	(40.644)
CCILS	USD 1.780.000	Fund receives Fixed 2,388% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	17/2/2031	(38.583)	(38.553)
CCILS	USD 542.500	Fund receives Fixed 2,432% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	6/5/2051	(6.555)	(6.539)
CCILS	USD 542.500	Fund receives Fixed 2,438% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	7/5/2051	(5.712)	(5.695)
CCILS	USD 542.500	Fund receives Fixed 2,484% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	4/5/2051	1.670	1.687
CCILS	USD 542.500	Fund receives Fixed 2,488% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	4/5/2051	2.312	2.329

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	USD 410.000	Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	30/3/2031	(4.179)	(4.172)
CCILS	USD 2.330.000	Fund receives Fixed 2,669% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	14/5/2031	16.609	16.649
CCILS	GBP 400.000	Fund receives Fixed 3,202% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(18.895)	(18.886)
CCILS	GBP 505.000	Fund receives Fixed 3,270% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(18.870)	(18.858)
CCILS	GBP 430.000	Fund receives Fixed 3,285% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(15.128)	(15.117)
CCILS	GBP 505.000	Fund receives Fixed 3,290% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(17.398)	(17.386)
CCILS	GBP 430.000	Fund receives Fixed 3,293% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(14.626)	(14.615)
CCILS	GBP 2.510.000	Fund receives Fixed 3,315% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/5/2030	(91.200)	(91.141)
CCILS	GBP 355.000	Fund receives Fixed 3,340% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(9.635)	(9.627)
CCILS	GBP 390.000	Fund receives Fixed 3,391% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/12/2029	(6.066)	(6.056)
CCILS	GBP 1.170.000	Fund receives Fixed 3,410% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/12/2029	(14.913)	(14.884)
CCILS	GBP 950.000	Fund receives Fixed 3,455% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/2/2030	(10.132)	(10.108)
CCILS	GBP 700.000	Fund receives Fixed 3,495% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/12/2029	(93)	(76)
CCILS	GBP 700.000	Fund receives Fixed 3,510% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/12/2029	1.471	1.489
CCILS	GBP 1.000.000	Fund receives Fixed 3,625% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/2/2031	(20.071)	(20.047)
CCILS	GBP 2.210.000	Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/4/2031	(37.146)	(37.093)
CCILS	GBP 2.250.000	Fund receives Fixed 3,658% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/4/2031	(35.311)	(35.257)
CCILS	GBP 1.108.269	Fund receives Fixed 3,756% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/4/2031	(1.096)	(1.070)
CCILS	GBP 120.000	Fund receives Fixed 3,773% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/9/2029	6.274	6.277
CCIRS	EUR 550.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,473%	Credit Suisse	29/4/2041	3.914	3.927
CCIRS	EUR 1.010.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,568%	Credit Suisse	31/5/2047	(8.368)	(8.340)
CCIRS	EUR 217.600	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,663%	Credit Suisse	15/7/2039	(7.173)	(7.167)
CCIRS	SEK 20.000.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,824%	Credit Suisse	6/4/2031	1.718	1.752
CCIRS	USD 1.010.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,570%	Credit Suisse	11/3/2031	(2.914)	(2.900)
CCIRS	USD 2.930.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,650%	Credit Suisse	14/5/2031	(25.835)	(23.479)
CCIRS	USD 480.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,680%	Credit Suisse	30/3/2031	(5.287)	(5.280)
IRS	EUR 1.040.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,204%	Credit Suisse	20/1/2031	31.507	31.525
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 38.031.831)					(501.827)	(498.694)

CCILS : Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)

CCIRS : Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
5	EUR	Euro BOBL Futures June 2021	Juin 2021	673.400	1.200
66	EUR	Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	9.720.480	11.283
(95)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	16.131.950	(37.250)
(2)	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	402.080	(2.743)
254	EUR	Euro Schatz Futures June 2021	Juin 2021	28.458.160	(15.850)
29	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	Juin 2021	4.649.280	29.034
(11)	EUR	Euro-OAT Futures September 2021	Septembre 2021	1.739.760	1.210
(8)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	9.055.584	(149)
33	EUR	Short Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	3.732.960	3.500
(102)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	12.096.770	28.531
(33)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	3.564.249	8.211
(6)	USD	US Treasury 5 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	608.676	496
(44)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	6.660.927	26.833
Total				97.494.276	54.306

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
5.620.000	Call	OTC USD/CAD	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,28	23/06/2021	(37.086)	313
1.620.000	Call	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0,89	06/08/2021	(21.431)	2.529
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 7.322)						(58.517)	2.842

Valeur nominale	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(1.932.421)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0,11% Fixed annually from 14/1/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	(41.328)	(70.265)
(1.932.421)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022; and pays -0,11% Fixed annually from 14/1/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	22.448	(6.490)
(3.860.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/10/2021; and pays 0,92% Fixed semi-annually from 26/7/2021	BNP Paribas	USD 0,92	26/07/2021	20.940	(477)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(3.750.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021; and pays 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021	JP Morgan	USD 1,12	08/09/2021	(468)	(32.908)
(3.750.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021	JP Morgan	USD 1,13	08/09/2021	20.982	(11.459)
(7.785.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023; and pays 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	14.378	(243.047)
(7.785.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	7.811	(247.125)
(31.955.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,45% Fixed annually from 19/5/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 23/11/2022	Citibank	EUR 0,00	19/05/2022	20.940	(69.493)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 15.840.248)						65.703	(681.264)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	1.700.000	EUR	1.092.715	Natwest Markets	15/7/2021	(15.289)
EUR	1.490.588	AUD	2.330.000	HSBC	15/7/2021	13.881
EUR	1.610.547	DKK	11.980.000	JP Morgan	15/7/2021	(163)
EUR	3.058.205	DKK	22.750.000	Toronto Dominion Bank	15/7/2021	(532)
EUR	57.715	GBP	50.000	Natwest Markets	15/7/2021	(295)
EUR	34.556	GBP	30.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	(250)
EUR	1.003.591	GBP	870.000	UBS	15/7/2021	(5.773)
EUR	948.490	NOK	9.700.000	JP Morgan	16/6/2021	(3.690)
EUR	3.315.957	NZD	5.620.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(28.081)
EUR	3.450.623	SEK	35.220.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(28.106)
EUR	1.930.000	USD	2.333.273	UBS	16/6/2021	18.621
EUR	5.416.410	USD	6.490.000	Morgan Stanley	15/7/2021	102.891
EUR	66.480	USD	80.000	Standard Chartered Bank	15/7/2021	982

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
KRW	530.000.000	USD	472.348	BNP Paribas	16/6/2021	4.812
KRW	795.000.000	USD	712.110	HSBC	16/6/2021	4.278
NOK	12.250.000	EUR	1.204.493	HSBC	16/6/2021	(1.998)
NOK	9.700.000	EUR	958.714	Societe Generale	16/6/2021	(6.534)
NOK	2.450.000	USD	292.702	Citibank	16/6/2021	723
NOK	13.350.000	USD	1.603.396	JP Morgan	16/6/2021	(2.999)
NOK	3.170.000	USD	383.101	Morgan Stanley	16/6/2021	(2.654)
NOK	1.580.000	USD	190.138	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	(661)
SEK	16.500.000	EUR	1.632.909	Morgan Stanley	15/7/2021	(3.181)
SEK	1.225.000	USD	146.641	Barclays Bank	16/6/2021	909
SEK	610.000	USD	73.121	Standard Chartered Bank	16/6/2021	370
USD	2.358.286	EUR	1.930.000	BNP Paribas	16/6/2021	1.869
USD	145.414	NOK	1.200.000	Barclays Bank	16/6/2021	1.325
USD	72.815	NOK	600.000	Citibank	16/6/2021	751
USD	289.862	SEK	2.450.000	Citibank	16/6/2021	(4.619)

BlackRock ESG Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées	EUR
Instruments financiers dérivés							
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS							
USD	1.602.572	SEK	13.430.000	JP Morgan	16/6/2021	(14.135)	
USD	389.772	SEK	3.240.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(829)	
USD	194.375	SEK	1.610.000	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	155	
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 39.890.896)							31.778

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	63,80
Finance	19,84
Services aux collectivités	6,12
Organismes de placement collectif	3,53
Communications	1,55
Biens de consommation non cyclique	1,53
Valeurs industrielles	1,15
Technologie	0,79
Matériaux de base	0,70
Biens de consommation cyclique	0,35
Titres hypothécaires	0,18
Énergie	0,17
Titres adossés à des actifs	0,14
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,85
Autres éléments de l'actif net	0,15
	100,00

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Finlande suite			
				EUR 750.000	OP Corporate Bank Plc RegS 0,50% 12/8/2025	767.632	0,28
				EUR 375.000	OP Corporate Bank Plc RegS FRN 9/6/2030	387.165	0,14
						2.024.918	0,74
OBLIGATIONS				France			
Australie				EUR 100.000	Air Liquide Finance SA RegS 1,375% 2/4/2030	109.232	0,04
EUR 675.000	APT Pipelines Ltd RegS 0,75% 15/3/2029	668.203	0,25	EUR 600.000	Air Liquide Finance SA RegS 0,375% 27/5/2031	601.326	0,22
EUR 850.000	APT Pipelines Ltd RegS 2,00% 15/7/2030	914.889	0,34	EUR 300.000	AXA SA RegS FRN 4/7/2043	331.149	0,12
EUR 875.000	Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028	860.125	0,32	EUR 400.000	AXA SA RegS FRN 6/7/2047	457.240	0,17
EUR 136.000	Telstra Corp Ltd RegS 1,375% 26/3/2029	146.316	0,05	EUR 850.000	AXA SA RegS FRN 28/5/2049	969.612	0,36
EUR 425.000	Telstra Corp Ltd RegS 1,00% 23/4/2030	443.351	0,16	EUR 1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,125% 5/2/2024	1.007.960	0,37
		3.032.884	1,12	EUR 200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 2,625% 18/3/2024	215.590	0,08
Autriche				EUR 200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,75% 17/7/2025	206.212	0,08
EUR 1.100.000	BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029	1.147.916	0,42	EUR 200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1,625% 19/1/2026	214.702	0,08
EUR 300.000	Erste Group Bank AG RegS 0,05% 16/9/2025	300.990	0,11	EUR 1.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,10% 8/10/2027	1.388.828	0,51
EUR 200.000	Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024	199.850	0,07	EUR 300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,625% 21/2/2031	294.138	0,11
EUR 100.000	Raiffeisen Bank International AG RegS 1,00% 4/12/2023	102.898	0,04	EUR 300.000	BNP Paribas Cardif SA RegS FRN (Perpetual)	339.030	0,12
EUR 800.000	Raiffeisen Bank International AG RegS 0,25% 22/1/2025	808.296	0,30	EUR 900.000	BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025	911.097	0,34
EUR 400.000	Raiffeisen Bank International AG RegS 0,375% 25/9/2026	406.160	0,15	EUR 1.100.000	BNP Paribas SA RegS FRN 14/10/2027	1.098.493	0,40
		2.966.110	1,09	EUR 400.000	BNP Paribas SA RegS FRN 19/2/2028	399.112	0,15
Belgique				EUR 700.000	BNP Paribas SA RegS FRN 15/1/2032	702.394	0,26
EUR 900.000	Ageas SA RegS FRN 24/11/2051	895.635	0,33	EUR 600.000	BNP Paribas SA RegS 0,625% 3/12/2032	575.106	0,21
EUR 600.000	Ageas SA RegS FRN (Perpetual)	636.162	0,23	EUR 900.000	BPCE SA RegS 0,625% 26/9/2023	919.278	0,34
EUR 120.000	Anheuser-Busch InBev SA RegS 1,125% 1/7/2027	126.501	0,05	EUR 200.000	BPCE SA RegS 0,375% 5/10/2023	203.102	0,07
EUR 70.000	Anheuser-Busch InBev SA RegS 2,00% 17/3/2028	78.023	0,03	EUR 800.000	BPCE SA RegS 1,00% 15/7/2024	828.232	0,30
EUR 600.000	Belfius Bank SA RegS 28/8/2026 (Zero Coupon)	596.058	0,22	EUR 1.000.000	BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024	1.009.470	0,37
EUR 100.000	Elia Transmission Belgium SA RegS 1,375% 14/1/2026	105.983	0,04	EUR 600.000	BPCE SA RegS FRN 15/9/2027	600.498	0,22
EUR 200.000	Elia Transmission Belgium SA RegS 1,375% 7/4/2027	210.786	0,08	EUR 900.000	Capgemini SE RegS 2,50% 1/7/2023	945.099	0,35
EUR 300.000	KBC Group NV RegS 0,75% 18/10/2023	307.065	0,11	EUR 800.000	Capgemini SE RegS 1,00% 18/10/2024	827.792	0,30
EUR 1.700.000	KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026	1.695.444	0,62	EUR 100.000	Capgemini SE RegS 2,00% 15/4/2029	111.937	0,04
EUR 700.000	KBC Group NV RegS FRN 11/3/2027	709.758	0,26	EUR 200.000	Capgemini SE RegS 1,125% 23/6/2030	209.346	0,08
EUR 400.000	KBC Group NV RegS FRN (Perpetual)	423.536	0,16	EUR 136.000	Carrefour SA RegS 1,75% 15/7/2022	138.447	0,05
		5.784.951	2,13	EUR 1.100.000	Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024	1.123.749	0,41
Canada				EUR 400.000	Cie de Saint-Gobain RegS 2,375% 4/10/2027	452.864	0,17
EUR 400.000	Royal Bank of Canada RegS 0,125% 23/7/2024	402.628	0,15	EUR 2.700.000	Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 0,875% 29/9/2024	2.773.683	1,02
		402.628	0,15				
Danemark							
DKK 571.108	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,50% 1/10/2050	70.462	0,03				
EUR 1.700.000	Orsted A/S RegS FRN 24/11/3017	1.780.546	0,65				
		1.851.008	0,68				
Finlande							
EUR 857.000	OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 29/8/2023	870.121	0,32				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				France suite			
EUR 900.000	Credit Agricole Assurances SA RegS FRN 27/9/2048	1.096.587	0,40	EUR 400.000	Societe Generale SA RegS FRN 12/6/2029	389.172	0,14
EUR 600.000	Credit Agricole SA FRN 5/6/2030	621.288	0,23	EUR 100.000	Societe Generale SA RegS 0,875% 24/9/2029	99.606	0,04
EUR 1.100.000	Credit Agricole SA RegS 0,75% 5/12/2023	1.128.611	0,42	EUR 700.000	Suez SA RegS 9/6/2026 (Zero Coupon)	696.948	0,26
EUR 400.000	Credit Agricole SA RegS FRN 22/4/2026	412.308	0,15	EUR 400.000	Suez SA RegS 1,25% 14/5/2035 [^]	413.708	0,15
EUR 1.100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 5/10/2023	1.128.622	0,42	EUR 800.000	Suez SA RegS FRN (Perpetual)	811.616	0,30
EUR 300.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,375% 17/1/2025	315.633	0,12	EUR 500.000	Suez SA RegS FRN (Perpetual) [^]	525.855	0,19
EUR 300.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 7/5/2027	310.941	0,11	EUR 500.000	Terega SA RegS 0,875% 17/9/2030	501.345	0,18
EUR 1.100.000	Danone SA RegS 1/12/2025 (Zero Coupon)	1.099.417	0,40	EUR 518.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	543.993	0,20
EUR 200.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	223.976	0,08	EUR 197.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	216.605	0,08
EUR 600.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	671.520	0,25	EUR 800.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	795.720	0,29
EUR 600.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	624.828	0,23	EUR 600.000	Valeo SA RegS 1,625% 18/3/2026 [^]	621.384	0,23
EUR 700.000	Elis SA RegS 1,75% 11/4/2024	715.274	0,26	EUR 100.000	Veolia Environnement SA RegS 0,892% 14/1/2024	102.437	0,04
EUR 200.000	Engie SA RegS 0,875% 27/3/2024	205.758	0,08	EUR 500.000	Veolia Environnement SA RegS 0,664% 15/1/2031	502.580	0,18
EUR 2.100.000	Engie SA RegS 0,375% 21/6/2027	2.130.177	0,78	EUR 500.000	Veolia Environnement SA RegS 0,80% 15/1/2032	501.090	0,18
EUR 300.000	Engie SA RegS 1,75% 27/3/2028	329.379	0,12	EUR 1.500.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual)	1.538.895	0,57
EUR 300.000	Engie SA RegS 0,50% 24/10/2030	300.561	0,11	EUR 400.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual)	397.360	0,15
EUR 500.000	Icade Sante SAS RegS 1,375% 17/9/2030	522.325	0,19	EUR 500.000	Vinci SA RegS 27/11/2028 (Zero Coupon)	490.600	0,18
EUR 152.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE RegS 0,375% 26/5/2022	152.879	0,06	EUR 900.000	Vinci SA RegS 1,625% 18/1/2029	986.274	0,36
EUR 700.000	Orange SA RegS 1,00% 12/5/2025	728.497	0,27			50.894.877	18,72
EUR 800.000	Orange SA RegS 1,00% 12/9/2025	835.544	0,31	Allemagne			
EUR 200.000	Orange SA RegS 1,25% 7/7/2027	213.310	0,08	EUR 1.000.000	Allianz SE RegS FRN 25/9/2049	1.005.450	0,37
EUR 300.000	Orange SA RegS 1,875% 12/9/2030	338.688	0,12	EUR 200.000	Allianz SE RegS FRN 8/7/2050	213.134	0,08
EUR 200.000	Orange SA RegS 0,50% 4/9/2032	197.356	0,07	EUR 200.000	Allianz SE RegS FRN (Perpetual)	201.426	0,07
EUR 500.000	Orange SA RegS FRN (Perpetual)	561.490	0,21	EUR 1.000.000	BASF SE RegS 0,101% 5/6/2023	1.006.980	0,37
EUR 50.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 3,875% 28/6/2022	52.290	0,02	EUR 900.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	932.868	0,34
EUR 700.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 1,625% 8/10/2024	739.004	0,27	EUR 500.000	Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023	515.135	0,19
EUR 200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 1,00% 19/10/2026	209.386	0,08	EUR 1.325.000	Commerzbank AG RegS 0,375% 1/9/2027	1.324.019	0,49
EUR 300.000	Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon)	302.067	0,11	EUR 416.000	Daimler AG RegS 0,75% 8/2/2030	421.870	0,16
EUR 400.000	Societe Generale SA FRN 24/11/2030	397.972	0,15	EUR 675.000	Daimler AG RegS 0,75% 11/3/2033	668.851	0,25
EUR 1.000.000	Societe Generale SA RegS 0,875% 1/7/2026	1.020.580	0,38	EUR 156.000	Deutsche Bahn Finance GmbH RegS 1,375% 28/3/2031	170.931	0,06
EUR 600.000	Societe Generale SA RegS 0,75% 25/1/2027	604.152	0,22	EUR 475.000	Deutsche Bahn Finance GmbH RegS 0,625% 15/4/2036	457.776	0,17
EUR 1.100.000	Societe Generale SA RegS 0,125% 18/2/2028	1.083.731	0,40	EUR 100.000	Deutsche Bahn Finance GmbH RegS 0,625% 8/12/2050	86.929	0,03
EUR 600.000	Societe Generale SA RegS FRN 23/2/2028	609.408	0,22	EUR 150.000	Deutsche Bank AG RegS FRN 10/6/2026	157.466	0,06
EUR 900.000	Societe Generale SA RegS FRN 22/9/2028	911.412	0,34	EUR 500.000	Deutsche Bank AG RegS FRN 19/11/2030	520.280	0,19
				EUR 600.000	Deutsche Bank AG RegS FRN 17/2/2032	598.092	0,22

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Allemagne suite				Irlande			
EUR 700.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,75% 7/2/2023	711.333	0,26	EUR 300.000	AIB Group Plc RegS 1,25% 28/5/2024	310.674	0,12
EUR 900.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024	904.086	0,33	EUR 400.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 25/11/2025	410.788	0,15
EUR 800.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,10% 2/2/2026	798.216	0,29	EUR 575.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 10/5/2027	570.296	0,21
EUR 900.000	Deutsche Telekom AG RegS 0,50% 5/7/2027	918.576	0,34	EUR 525.000	CRH SMW Finance DAC RegS 1,25% 5/11/2026	555.145	0,20
EUR 473.000	Deutsche Telekom AG RegS 1,75% 25/3/2031	527.078	0,19	EUR 975.000	Eaton Capital Unlimited Co RegS 0,128% 8/3/2026	974.971	0,36
EUR 326.000	E.ON SE RegS 0,375% 23/8/2021	326.052	0,12	EUR 669.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC RegS 2,375% 1/2/2024	708.692	0,26
EUR 150.000	E.ON SE RegS 1,00% 7/10/2025	156.122	0,06	EUR 570.000	Smurfit Kappa Treasury ULC RegS 1,50% 15/9/2027	599.127	0,22
EUR 800.000	Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023	832.424	0,31	EUR 700.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co RegS FRN 17/9/2050	730.709	0,27
EUR 300.000	Eurogrid GmbH RegS 1,875% 10/6/2025	321.681	0,12			4.860.402	1,79
EUR 800.000	Eurogrid GmbH RegS 1,113% 15/5/2032	836.752	0,31	Italie			
EUR 300.000	Eurogrid GmbH RegS 0,741% 21/4/2033	298.752	0,11	EUR 300.000	Assicurazioni Generali SpA RegS 3,875% 29/1/2029	351.336	0,13
EUR 500.000	Evonik Industries AG RegS 0,625% 18/9/2025	511.770	0,19	EUR 200.000	Assicurazioni Generali SpA RegS 2,124% 1/10/2030	208.802	0,08
EUR 1.975.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028	2.043.552	0,75	EUR 921.000	ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028	949.477	0,35
EUR 267.000	HeidelbergCement AG RegS 2,25% 3/6/2024	284.181	0,10	EUR 300.000	Enel SpA RegS FRN (Perpetual)	330.750	0,12
EUR 357.000	HeidelbergCement AG RegS 1,50% 7/2/2025	375.082	0,14	EUR 325.000	Enel SpA RegS FRN (Perpetual)	338.185	0,13
EUR 1.100.000	KION Group AG RegS 1,625% 24/9/2025	1.145.485	0,42	EUR 1.023.000	Hera SpA RegS 0,25% 3/12/2030	986.295	0,36
EUR 400.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 2,875% 28/9/2026	439.000	0,16	EUR 200.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,75% 4/12/2024	204.772	0,08
EUR 1.100.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029	1.156.287	0,43	EUR 805.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,00% 19/11/2026	824.875	0,30
EUR 500.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,005% 15/12/2023	502.440	0,18	EUR 1.066.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,925% 14/10/2030	1.121.699	0,41
EUR 400.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,125% 16/7/2025	403.536	0,15	EUR 950.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,35% 24/2/2031	930.117	0,34
EUR 500.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,875% 5/7/2031	520.895	0,19	EUR 300.000	Iren SpA RegS 1,00% 1/7/2030	306.771	0,11
EUR 800.000	Merck KGaA RegS FRN 25/6/2079	867.008	0,32	EUR 400.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,00% 8/9/2027	411.044	0,15
EUR 200.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen RegS FRN 26/5/2042	212.152	0,08	EUR 450.000	Snam SpA RegS 15/8/2025 (Zero Coupon)	449.375	0,17
EUR 600.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen RegS FRN 26/5/2049	696.900	0,26	EUR 2.264.000	Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030	2.289.628	0,84
EUR 300.000	SAP SE RegS 0,375% 18/5/2029	303.234	0,11	EUR 1.115.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA RegS 0,75% 24/7/2032	1.106.136	0,41
EUR 800.000	Vonovia SE RegS 0,625% 24/3/2031	787.928	0,29	EUR 717.000	UniCredit SpA RegS FRN 25/6/2025	737.800	0,27
		25.161.729	9,26	EUR 800.000	UniCredit SpA RegS 1,80% 20/1/2030^	822.024	0,30
						12.369.086	4,55
Grèce				Japon			
EUR 100.000	Alpha Bank SA RegS 2,50% 5/2/2023	103.956	0,04	EUR 1.802.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040	1.888.226	0,69
		103.956	0,04			1.888.226	0,69
				Luxembourg			
				EUR 325.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1,213% 12/2/2036	316.875	0,12
				EUR 974.000	GELF Bond Issuer I SA RegS 1,125% 18/7/2029	999.470	0,37

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Luxembourg suite				Pays-Bas suite			
EUR 495.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,625% 7/4/2026	527.611	0,19	EUR 242.000	EDP Finance BV RegS 1,625% 26/1/2026	258.974	0,10
EUR 83.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,50% 14/6/2027	88.659	0,03	EUR 823.000	EDP Finance BV RegS 0,375% 16/9/2026	830.695	0,31
EUR 281.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,125% 1/12/2027	294.244	0,11	EUR 305.000	EDP Finance BV RegS 1,50% 22/11/2027	327.665	0,12
EUR 459.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,75% 24/4/2028	497.285	0,18	USD 1.248.000	Enel Finance International NV 2,65% 10/9/2024	1.077.032	0,40
EUR 380.000	Holcim Finance Luxembourg SA RegS 0,50% 23/4/2031	366.757	0,14	EUR 300.000	Enel Finance International NV RegS 1,966% 27/1/2025	322.089	0,12
EUR 450.000	SES SA RegS FRN (Perpetual)	452.250	0,17	EUR 1.016.000	Enel Finance International NV RegS 0,375% 17/6/2027	1.029.645	0,38
EUR 365.000	SIG Combibloc PurchaseCo Sarl RegS 2,125% 18/6/2025	385.852	0,14	EUR 100.000	Heineken NV RegS 2,25% 30/3/2030	114.903	0,04
		3.929.003	1,45	EUR 600.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	603.090	0,22
Pays-Bas				EUR 1.100.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	1.127.038	0,41
EUR 200.000	Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025	202.286	0,07	EUR 600.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	635.328	0,23
EUR 200.000	Allianz Finance II BV FRN 8/7/2041	201.190	0,07	EUR 700.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	762.293	0,28
EUR 947.000	ASML Holding NV RegS 3,375% 19/9/2023	1.027.656	0,38	EUR 1.000.000	ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025	1.001.020	0,37
EUR 141.000	ASML Holding NV RegS 1,375% 7/7/2026	150.785	0,06	EUR 1.300.000	ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029	1.269.749	0,47
EUR 274.000	ASML Holding NV RegS 1,625% 28/5/2027	298.452	0,11	EUR 300.000	ING Groep NV RegS FRN 13/11/2030	302.679	0,11
EUR 475.000	ASML Holding NV RegS 0,625% 7/5/2029	488.096	0,18	EUR 1.200.000	ING Groep NV RegS FRN 26/5/2031	1.272.336	0,47
EUR 169.000	BMW Finance NV RegS 0,50% 22/11/2022	171.253	0,06	EUR 224.000	Koninklijke Ahold Delhaize NV RegS 1,125% 19/3/2026	234.922	0,09
EUR 554.000	BMW Finance NV RegS 24/3/2023 (Zero Coupon)	557.152	0,20	EUR 300.000	Koninklijke DSM NV RegS 0,625% 23/6/2032	302.214	0,11
EUR 715.000	BMW Finance NV RegS 1,00% 14/11/2024	742.914	0,27	GBP 685.000	LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV RegS 3,00% 12/5/2032^	859.161	0,32
EUR 278.000	BMW Finance NV RegS 1,00% 29/8/2025	290.849	0,11	EUR 310.000	Nederlandse Gasunie NV RegS 1,00% 11/5/2026	325.162	0,12
EUR 1.000.000	BMW Finance NV RegS 0,75% 13/7/2026	1.037.960	0,38	EUR 107.000	NN Group NV RegS 1,00% 18/3/2022	108.158	0,04
EUR 991.000	BMW Finance NV RegS 0,375% 14/1/2027^	1.006.876	0,37	EUR 2.078.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	2.321.936	0,85
EUR 543.000	Daimler International Finance BV RegS 0,25% 9/8/2021	543.733	0,20	EUR 225.000	RELX Finance BV RegS 0,50% 10/3/2028	227.007	0,08
EUR 257.000	Daimler International Finance BV RegS 0,25% 11/5/2022	258.575	0,10	EUR 325.000	Sagax Euro Mtn NL BV RegS 0,75% 26/1/2028	321.835	0,12
EUR 508.000	Daimler International Finance BV RegS 0,85% 28/2/2025	525.648	0,19	EUR 600.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 20/2/2023 (Zero Coupon)	603.606	0,22
EUR 260.000	Daimler International Finance BV RegS 1,00% 11/11/2025	271.445	0,10	EUR 200.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,375% 5/6/2026	204.338	0,08
EUR 623.000	Daimler International Finance BV RegS 1,375% 26/6/2026	664.087	0,24	EUR 1.402.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,90% 28/2/2028	1.474.974	0,54
EUR 300.000	de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024	301.848	0,11	EUR 200.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,25% 20/2/2029	200.480	0,07
EUR 294.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 0,625% 1/12/2022	298.251	0,11	EUR 100.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	101.984	0,04
EUR 97.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 0,625% 3/4/2023	98.605	0,04	EUR 1.100.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	1.132.395	0,42
EUR 500.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 0,625% 13/12/2024	512.915	0,19	EUR 1.000.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	1.071.370	0,39
EUR 400.000	Diageo Capital BV RegS 0,125% 28/9/2028^	395.224	0,15	EUR 950.000	TenneT Holding BV RegS 0,50% 9/6/2031	944.984	0,35
EUR 880.000	EDP Finance BV RegS 2,625% 18/1/2022	896.861	0,33	EUR 2.225.000	TenneT Holding BV RegS FRN (Perpetual)	2.297.846	0,85
EUR 1.000.000	EDP Finance BV RegS 1,125% 12/2/2024	1.033.670	0,38	EUR 114.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 0,25% 10/1/2022	114.522	0,04

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Espagne suite			
EUR 100.000	Vonovia Finance BV RegS 2,25% 7/4/2030	113.001	0,04	EUR 600.000	Santander Consumer Finance SA RegS 1,00% 27/2/2024	617.718	0,23
EUR 300.000	Vonovia Finance BV RegS 1,00% 9/7/2030	306.777	0,11	EUR 400.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024	404.828	0,15
EUR 400.000	Vonovia Finance BV RegS 1,125% 14/9/2034	399.300	0,15	EUR 600.000	Telefonica Emisiones SA RegS 1,477% 14/9/2021	603.180	0,22
		36.576.839	13,46			10.832.890	3,99
Nouvelle-Zélande				Supranational			
EUR 2.114.000	Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023	2.170.951	0,80	EUR 936.000	European Union RegS 4/11/2025 (Zero Coupon)	953.316	0,35
EUR 535.000	Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026	549.681	0,20			953.316	0,35
NZD 1.345.000	New Zealand Government Bond 1,75% 15/5/2041	689.904	0,25	Suède			
		3.410.536	1,25	EUR 620.000	Lansforsakringar Bank AB RegS 0,125% 19/2/2025	623.410	0,23
Norvège				EUR 1.300.000	Nordea Bank AB RegS FRN 18/8/2031	1.296.087	0,48
EUR 873.000	DNB Bank ASA RegS 0,25% 9/4/2024	884.960	0,33	EUR 994.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024	1.002.012	0,37
EUR 250.000	Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon)	251.435	0,09	EUR 1.600.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028	1.643.520	0,60
		1.136.395	0,42			4.565.029	1,68
Pologne				Suisse			
EUR 150.000	Santander Bank Polska SA RegS 0,75% 20/9/2021	150.511	0,06	EUR 200.000	Credit Suisse AG RegS 1,00% 7/6/2023	204.822	0,08
		150.511	0,06	EUR 100.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2026	110.352	0,04
Portugal				EUR 953.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 24/6/2027	970.202	0,36
EUR 100.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS 1,625% 15/4/2027	107.492	0,04	EUR 925.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028	921.670	0,34
EUR 500.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 20/7/2080	500.055	0,18	EUR 350.000	Credit Suisse Group AG RegS 0,625% 18/1/2033	324.639	0,12
		607.547	0,22	EUR 200.000	UBS Group AG RegS FRN 20/9/2022	200.354	0,07
Singapour				EUR 400.000	UBS Group AG RegS 1,50% 30/11/2024	415.368	0,15
EUR 2.400.000	DBS Group Holdings Ltd RegS FRN 11/4/2028*	2.455.464	0,90	EUR 502.000	UBS Group AG RegS FRN 17/4/2025	519.068	0,19
		2.455.464	0,90	EUR 500.000	UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026	501.265	0,18
Espagne				EUR 675.000	UBS Group AG RegS FRN 5/11/2028	665.591	0,24
EUR 100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,625% 17/1/2022	100.680	0,04	EUR 450.000	UBS Group AG RegS 0,625% 24/2/2033	436.500	0,16
EUR 800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,375% 15/11/2026	807.520	0,30	USD 300.000	UBS Group AG RegS FRN (Perpetual)	265.319	0,10
EUR 1.500.000	Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027	1.545.285	0,57	USD 261.000	UBS Group AG RegS FRN (Perpetual)	235.801	0,09
EUR 200.000	Banco de Sabadell SA RegS 2,50% 15/4/2031	200.694	0,07			5.770.951	2,12
EUR 300.000	Banco Santander SA RegS 1,375% 14/12/2022	307.674	0,11	Royaume-Uni			
EUR 1.400.000	Bankia SA RegS 0,75% 9/7/2026	1.432.312	0,53	EUR 825.000	AstraZeneca Plc RegS 0,375% 3/6/2029	820.462	0,30
EUR 300.000	Bankia SA RegS 1,125% 12/11/2026	308.058	0,11	EUR 800.000	Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025	813.008	0,30
EUR 300.000	CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025	302.802	0,11	EUR 500.000	Barclays Plc RegS FRN 24/1/2026	519.930	0,19
EUR 600.000	CaixaBank SA RegS 1,125% 27/3/2026	625.482	0,23	GBP 149.000	Barclays Plc RegS 3,00% 8/5/2026	185.788	0,07
EUR 1.700.000	CaixaBank SA RegS FRN 10/7/2026	1.736.329	0,64	EUR 586.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,231% 8/5/2031	608.866	0,22
EUR 800.000	CaixaBank SA RegS FRN 18/11/2026	797.856	0,29	EUR 1.000.000	BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual)	1.065.600	0,39
GBP 200.000	CaixaBank SA RegS FRN 3/12/2026	232.398	0,09	EUR 300.000	BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual)	321.801	0,12
EUR 300.000	Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033	291.474	0,11				
EUR 500.000	Iberdrola Finanzas SA RegS 0,875% 16/6/2025	518.600	0,19				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché EUR	% de l'actif net			Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Royaume-Uni suite				États-Unis suite			
EUR 228.000	British Telecommunications Plc RegS 0,50% 23/6/2022	229.573	0,08	EUR 200.000	Bank of America Corp RegS FRN 4/5/2027	214.648	0,08
EUR 100.000	British Telecommunications Plc RegS 1,00% 23/6/2024	103.044	0,04	EUR 200.000	Bank of America Corp RegS FRN 31/3/2029	241.032	0,09
EUR 783.000	British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024	808.870	0,30	EUR 600.000	Bank of America Corp RegS FRN 22/3/2031	592.008	0,22
EUR 1.475.000	Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030	1.471.475	0,54	EUR 775.000	Bank of America Corp RegS FRN 26/10/2031	760.101	0,28
EUR 800.000	Cadent Finance Plc RegS 0,75% 11/3/2032	789.656	0,29	EUR 1.125.000	Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032	1.138.860	0,42
GBP 570.000	Crh Finance UK Plc RegS 4,125% 2/12/2029	785.870	0,29	EUR 2.202.000	Becton Dickinson and Co 1,401% 24/5/2023	2.264.449	0,83
EUR 100.000	Diageo Finance Plc RegS 0,125% 12/10/2023	100.748	0,04	EUR 525.000	Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025	526.123	0,19
EUR 164.000	Diageo Finance Plc RegS 1,00% 22/4/2025	170.567	0,06	EUR 400.000	Citigroup Inc RegS 0,75% 26/10/2023	407.924	0,15
EUR 911.000	DS Smith Plc RegS 0,875% 12/9/2026	929.803	0,34	EUR 1.225.000	Citigroup Inc RegS FRN 6/7/2026	1.277.258	0,47
EUR 874.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 0,125% 12/5/2023	881.184	0,32	EUR 732.000	Citigroup Inc RegS FRN 24/7/2026	769.837	0,28
EUR 787.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon)	791.218	0,29	EUR 350.000	Citigroup Inc RegS FRN 8/10/2027	351.406	0,13
EUR 444.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 12/9/2029	482.908	0,18	EUR 300.000	Coca-Cola Co 0,125% 9/3/2029	294.984	0,11
EUR 925.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2031	915.213	0,34	EUR 375.000	Coca-Cola Co 0,40% 6/5/2030	372.555	0,14
EUR 225.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc RegS 0,25% 4/10/2022	226.760	0,08	EUR 1.625.000	Coca-Cola Co 0,375% 15/3/2033	1.551.864	0,57
EUR 525.000	Motability Operations Group Plc RegS 0,125% 20/7/2028	519.068	0,19	EUR 575.000	Comcast Corp 0,75% 20/2/2032	574.321	0,21
EUR 734.000	National Grid Electricity Transmission Plc RegS 0,823% 7/7/2032	734.176	0,27	EUR 100.000	Danaher Corp 2,50% 30/3/2030	115.635	0,04
EUR 1.400.000	Natwest Group Plc RegS FRN 8/3/2023	1.423.016	0,52	EUR 314.000	Eli Lilly & Co 0,625% 1/11/2031	316.638	0,12
EUR 400.000	NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079	403.136	0,15	EUR 600.000	Equinix Inc 0,25% 15/3/2027	594.834	0,22
EUR 390.000	NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082	392.964	0,15	EUR 191.000	Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023	194.111	0,07
EUR 575.000	OTE Plc RegS 0,875% 24/9/2026^	588.691	0,22	EUR 400.000	Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025	408.352	0,15
EUR 228.000	Sky Ltd RegS 2,50% 15/9/2026	256.906	0,09	EUR 550.000	Fidelity National Information Services Inc 1,00% 3/12/2028	564.049	0,21
EUR 400.000	SSE Plc RegS 1,375% 4/9/2027	426.352	0,16	EUR 1.257.000	Fidelity National Information Services Inc 2,00% 21/5/2030^	1.382.059	0,51
EUR 600.000	SSE Plc RegS 1,75% 16/4/2030	653.544	0,24	EUR 193.000	Fiserv Inc 1,125% 1/7/2027	201.174	0,07
USD 610.000	Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025	504.119	0,19	EUR 343.000	Fiserv Inc 1,625% 1/7/2030	366.758	0,13
EUR 700.000	Swiss Re Finance UK Plc RegS FRN 4/6/2052	765.877	0,28	EUR 432.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 9/9/2022	432.531	0,16
GBP 1.552.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc RegS 2,75% 27/4/2030	1.917.510	0,71	EUR 400.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 3,25% 1/2/2023	423.000	0,16
		21.607.703	7,95	EUR 254.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 2,00% 27/7/2023	265.519	0,10
				EUR 950.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024	950.731	0,35
				EUR 690.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 1,375% 15/5/2024	708.913	0,26
				EUR 125.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 0,125% 19/8/2024	125.173	0,05
				EUR 19.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 2,125% 30/9/2024	20.264	0,01
				EUR 200.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 3,375% 27/3/2025	224.344	0,08
				EUR 116.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 1,625% 27/7/2026	123.552	0,05
				EUR 1.125.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 0,25% 26/1/2028	1.099.609	0,40
États-Unis							
EUR 472.000	AbbVie Inc 1,50% 15/11/2023	490.323	0,18				
EUR 705.000	AbbVie Inc 1,375% 17/5/2024	732.065	0,27				
EUR 1.000.000	AbbVie Inc 1,25% 1/6/2024	1.035.020	0,38				
EUR 1.850.000	Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032	1.875.234	0,69				
USD 1.306.000	Amazon.com Inc 2,70% 3/6/2060	955.621	0,35				
USD 1.206.000	Apple Inc 2,55% 20/8/2060	867.069	0,32				
USD 1.100.000	Apple Inc 2,80% 8/2/2061	824.694	0,30				
EUR 300.000	AT&T Inc 2,45% 15/3/2035	332.055	0,12				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				États-Unis suite			
EUR 675.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 1,00% 18/3/2033	668.176	0,25	EUR 275.000	PepsiCo Inc 1,05% 9/10/2050	256.399	0,09
EUR 100.000	International Business Machines Corp 0,375% 31/1/2023	101.139	0,04	EUR 1.100.000	Prologis Euro Finance LLC 0,50% 16/2/2032	1.061.500	0,39
EUR 852.000	International Business Machines Corp 0,95% 23/5/2025	885.866	0,33	EUR 751.000	RELX Capital Inc 1,30% 12/5/2025	788.415	0,29
EUR 816.000	International Business Machines Corp 1,25% 29/1/2027	864.944	0,32	EUR 125.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0,125% 1/3/2025	125.456	0,05
EUR 766.000	International Business Machines Corp 0,65% 11/2/2032	759.596	0,28	EUR 400.000	Thermo Fisher Scientific Inc 2,375% 15/4/2032	459.830	0,17
EUR 207.000	International Flavors & Fragrances Inc 0,50% 25/9/2021	207.381	0,08	EUR 875.000	Toyota Motor Credit Corp RegS 0,125% 5/11/2027	870.231	0,32
EUR 1.163.000	International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026	1.246.352	0,46	EUR 192.000	Verizon Communications Inc 0,875% 2/4/2025	198.411	0,07
EUR 183.000	JPMorgan Chase & Co RegS 1,50% 26/10/2022	187.848	0,07	EUR 200.000	Verizon Communications Inc 1,25% 8/4/2030	210.130	0,08
EUR 300.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 25/7/2031	306.837	0,11	EUR 186.000	Verizon Communications Inc 2,625% 1/12/2031	219.800	0,08
EUR 4.087.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 4/11/2032	4.167.800	1,53	EUR 200.000	Verizon Communications Inc 0,875% 19/3/2032	199.410	0,07
EUR 863.000	Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027	893.429	0,33	EUR 1.075.000	Verizon Communications Inc 1,30% 18/5/2033	1.098.263	0,40
USD 621.000	Microsoft Corp 2,675% 1/6/2060	474.603	0,17	EUR 452.000	Verizon Communications Inc 2,875% 15/1/2038	543.598	0,20
EUR 174.000	Morgan Stanley 1,00% 2/12/2022	177.341	0,06			50.262.530	18,49
EUR 800.000	Morgan Stanley 1,875% 30/3/2023	831.048	0,31	Total des obligations		253.599.489	93,30
EUR 625.000	Morgan Stanley 1,75% 11/3/2024	656.625	0,24	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		253.599.489	93,30
EUR 1.388.000	Morgan Stanley FRN 26/7/2024	1.409.778	0,52	Organismes de placement collectif			
EUR 530.000	Morgan Stanley FRN 23/10/2026	555.583	0,20	Irlande			
EUR 1.200.000	Morgan Stanley FRN 29/10/2027	1.198.344	0,44	193.079	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund [^]	19.084.623	7,02
EUR 346.000	Morgan Stanley FRN 26/10/2029	342.076	0,13			19.084.623	7,02
EUR 329.000	National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023	335.162	0,12	Total des organismes de placement collectif		19.084.623	7,02
USD 1.185.000	Oracle Corp 2,875% 25/3/2031	994.462	0,37	Portefeuille de titres à la valeur de marché		272.684.112	100,32
				Autres éléments du passif net		(866.972)	(0,32)
				Total de l'actif net (EUR)		271.817.140	100,00
				[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.			
				[^] Investissement dans un fonds de partie liée.			

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	EUR 3.550.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	7.338	89.897
CCCDs	EUR 1.078.377	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	16.085	132.689
CCILS	EUR 590.000	Fund receives Fixed 1,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFE	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(10.025)	(10.011)
CCILS	USD 185.000	Fund receives Fixed 2,350% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(4.511)	(4.508)
CCILS	USD 185.000	Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(4.445)	(4.442)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	USD 370.000	Fund receives Fixed 2,358% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(8.776)	(8.769)
CCILS	USD 370.000	Fund receives Fixed 2,388% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2031	(8.021)	(8.014)
CCILS	USD 115.000	Fund receives Fixed 2,432% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	6/5/2051	(1.398)	(1.394)
CCILS	USD 115.000	Fund receives Fixed 2,438% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	7/5/2051	(1.212)	(1.207)
CCILS	USD 115.000	Fund receives Fixed 2,484% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2051	353	358
CCILS	USD 115.000	Fund receives Fixed 2,488% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2051	489	494
CCILS	GBP 215.000	Fund receives Fixed 3,202% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(10.157)	(10.151)
CCILS	GBP 270.000	Fund receives Fixed 3,270% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(10.089)	(10.082)
CCILS	GBP 690.000	Fund receives Fixed 3,315% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2030	(25.072)	(25.055)
CCILS	GBP 790.000	Fund receives Fixed 3,440% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/10/2029	3.255	3.276
CCILS	GBP 210.000	Fund receives Fixed 3,625% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2031	(4.215)	(4.210)
CCILS	GBP 470.000	Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(7.901)	(7.889)
CCILS	GBP 440.000	Fund receives Fixed 3,658% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(6.906)	(6.895)
CCILS	GBP 251.246	Fund receives Fixed 3,756% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(249)	(242)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Peugeot SA and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2025	(12.554)	(24.337)
CDS	EUR 161.000	Fund receives default protection on CNH Industrial NV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	(8.551)	(28.314)
CDS	EUR 170.000	Fund receives default protection on CNH Industrial Finance Europe SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2025	(9.029)	(29.896)
CDS	EUR 169.000	Fund receives default protection on CNH Industrial NV and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2025	(9.474)	(29.720)
IRS	CNY 18.500.000	Fund receives Fixed 2,716% and pays Floating CNY 12 Month UKRPI CNRR	BNP Paribas	26/8/2025	1.207	1.207
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 13.645.860)					(113.858)	12.785

CCCDs: Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)

CCILS: Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)

CDS: Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
97	EUR	Euro BOBL Futures June 2021	Juin 2021	13.063.960	(13.521)
(15)	EUR	Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	2.209.200	3.559
42	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	7.132.020	(6.792)
9	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	1.809.360	11.153
7	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	Juin 2021	1.122.240	(12.996)
(25)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	Septembre 2021	3.693.732	(8.149)
(1)	USD	US Long Bond Futures September 2021	Septembre 2021	128.032	557
(59)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	6.997.151	16.767

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(90)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	9.720.680	23.752
7	USD	US Treasury 5 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	710.121	(454)
(32)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	4.844.311	19.470
Total				51.430.807	33.346

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
2.390.000	Call	OTC USD/CAD	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,28	23/06/2021	(15.772)	133
665.000	Call	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0,89	06/08/2021	(8.797)	1.038
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 3.113)						(24.569)	1.171

Valeur nominale	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(848.867)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0,11% Fixed annually from 14/1/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	(18.154)	(30.866)
(848.867)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022; and pays -0,11% Fixed annually from 14/1/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	9.861	(2.851)
(1.675.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/10/2021; and pays 0,92% Fixed semi-annually from 26/7/2021	BNP Paribas	USD 0,92	26/07/2021	9.086	(207)
(1.590.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021; and pays 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021	JP Morgan	USD 1,12	08/09/2021	(198)	(13.953)
(1.590.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021	JP Morgan	USD 1,13	08/09/2021	8.896	(4.858)

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(1.645.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023; and pays 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	3.038	(51.357)
(1.645.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	1.650	(52.218)
(13.535.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,45% Fixed annually from 19/5/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 23/11/2022	Citibank	EUR 0,00	19/05/2022	8.870	(29.435)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 5.391.853)						23.049	(185.745)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	750.000	EUR	481.999	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	(6.664)
EUR	620.545	AUD	970.000	HSBC	15/7/2021	5.779
EUR	77.967	DKK	580.000	Toronto Dominion Bank	15/7/2021	(14)
EUR	3.747.681	GBP	3.250.000	Goldman Sachs	15/7/2021	(22.932)
EUR	400.908	NOK	4.100.000	JP Morgan	16/6/2021	(1.560)
EUR	861.441	NZD	1.460.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(7.295)
EUR	820.000	USD	991.409	Goldman Sachs	16/6/2021	7.854
EUR	7.959.364	USD	9.500.000	Morgan Stanley	15/7/2021	181.484
NOK	9.300.000	EUR	916.706	HSBC	16/6/2021	(3.791)
USD	1.001.966	EUR	820.000	BNP Paribas	16/6/2021	794
USD	1.700.000	EUR	1.410.161	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	(18.330)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 17.925.463)						135.325

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	41,56
Services aux collectivités	16,70
Biens de consommation non cyclique	8,40
Communications	7,39
Organismes de placement collectif	7,02
Valeurs industrielles	6,44
Technologie	4,88
Biens de consommation cyclique	3,61
Matériaux de base	2,42
Énergie	1,30
Gouvernement	0,60
Portefeuille de titres à la valeur de marché	100,32
Autres éléments du passif net	(0,32)
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché EUR	% de l'actif net			Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
Australie							
EUR 450.000	Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028	442.350	0,19	EUR 1.376.000	Chypre suite Cyprus Government International Bond RegS 0,625% 3/12/2024	1.412.491	0,59
		442.350	0,19	EUR 180.000	Cyprus Government International Bond RegS 9/2/2026 (Zero Coupon)	180.346	0,08
						1.829.632	0,77
Autriche				Danemark			
EUR 400.000	Raiffeisen Bank International AG RegS 0,25% 5/7/2021	400.240	0,17	DKK 4.099.866	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2040	545.374	0,23
EUR 400.000	Raiffeisen Bank International AG RegS 0,25% 22/1/2025	404.148	0,17	DKK 3.823.095	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2050	492.204	0,21
EUR 1.700.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/9/2022 (Zero Coupon)	1.714.518	0,72	DKK 4.525.000	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2053	574.891	0,24
EUR 1.480.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/4/2023 (Zero Coupon)	1.498.056	0,63	DKK 1.992.766	Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050	245.660	0,10
EUR 1.100.000	Republic of Austria Government Bond RegS 1,75% 20/10/2023	1.162.931	0,49	DKK 3.487.144	Realkredit Danmark A/S RegS 1,00% 1/10/2050	447.582	0,19
EUR 1.157.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/4/2025 (Zero Coupon)	1.180.707	0,49			2.305.711	0,97
EUR 400.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,70% 20/4/2071	373.428	0,16	Finlande			
		6.734.028	2,83	EUR 230.000	CRH Finland Services Oyj RegS 0,875% 5/11/2023	235.635	0,10
Belgique				EUR 440.000	Finland Government Bond RegS 1,625% 15/9/2022	453.015	0,19
EUR 600.000	Belfius Bank SA RegS 28/8/2026 (Zero Coupon)	596.058	0,25	EUR 870.000	Finland Government Bond RegS 15/9/2023 (Zero Coupon)	883.128	0,37
EUR 600.000	Elia Transmission Belgium SA RegS 1,375% 14/1/2026	635.898	0,27	EUR 660.000	OP Corporate Bank Plc RegS 0,50% 12/8/2025	675.517	0,28
EUR 1.000.000	KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026	997.320	0,42			2.247.295	0,94
EUR 400.000	KBC Group NV RegS FRN 11/3/2027	405.576	0,17	France			
EUR 2.500.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 4,25% 28/9/2022	2.664.425	1,12	GBP 400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1,375% 20/12/2021	467.512	0,20
EUR 1.380.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,20% 22/10/2023	1.408.345	0,59	EUR 500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,375% 13/1/2022	502.765	0,21
		6.707.622	2,82	EUR 500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,75% 15/6/2023	510.845	0,21
Canada				EUR 600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,75% 17/7/2025	618.636	0,26
EUR 646.000	National Bank of Canada RegS 0,25% 24/7/2023	655.748	0,27	EUR 500.000	BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024	504.735	0,21
EUR 450.000	Royal Bank of Canada RegS 0,125% 23/7/2024	452.957	0,19	EUR 600.000	BPCE SA RegS 0,25% 15/1/2026	604.392	0,25
EUR 540.000	Toronto-Dominion Bank RegS 9/2/2024 (Zero Coupon)	545.659	0,23	EUR 600.000	Capgemini SE RegS 0,625% 23/6/2025	614.856	0,26
		1.654.364	0,69	EUR 300.000	Capgemini SE RegS 1,625% 15/4/2026	321.615	0,13
Colombie				EUR 700.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,25% 11/4/2023	709.590	0,30
USD 765.000	Colombia Government International Bond 3,25% 22/4/2032	606.408	0,25	EUR 600.000	Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024	612.954	0,26
		606.408	0,25	EUR 700.000	Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA RegS 0,25% 30/4/2024	713.769	0,30
Chypre				EUR 600.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 7/5/2027	621.882	0,26
EUR 60.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,875% 6/5/2022	62.395	0,03	EUR 500.000	Danone SA RegS 1/12/2025 (Zero Coupon)	499.735	0,21
EUR 160.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023	174.400	0,07	EUR 400.000	Dassault Systemes SE RegS 16/9/2024 (Zero Coupon)	401.952	0,17
				EUR 600.000	Engie SA RegS 1,375% 27/3/2025	631.626	0,27

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				Allemagne suite			
EUR 400.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	405.920	0,17	EUR 900.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,75% 15/2/2024	960.039	0,40
EUR 7.000.000	France Government Bond OAT RegS 25/5/2022 (Zero Coupon)	7.044.240	2,96	EUR 3.100.000	Bundesschatzanweisungen RegS 10/6/2022 (Zero Coupon)	3.121.049	1,31
EUR 7.700.000	France Government Bond OAT RegS 25/2/2023 (Zero Coupon)	7.787.626	3,27	EUR 7.000.000	Bundesschatzanweisungen RegS 16/9/2022 (Zero Coupon)	7.060.620	2,97
EUR 3.700.000	France Government Bond OAT RegS 25/3/2023 (Zero Coupon)	3.744.067	1,57	EUR 7.000.000	Bundesschatzanweisungen RegS 15/12/2022 (Zero Coupon)	7.072.660	2,97
EUR 1.900.000	France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/5/2023	1.990.858	0,84	EUR 7.500.000	Bundesschatzanweisungen RegS 10/3/2023 (Zero Coupon)	7.589.700	3,19
EUR 2.400.000	France Government Bond OAT RegS 4,25% 25/10/2023	2.684.184	1,13	EUR 600.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024	602.724	0,25
EUR 2.030.000	France Government Bond OAT RegS 25/2/2024 (Zero Coupon)	2.062.034	0,87	EUR 500.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,10% 2/2/2026	498.885	0,21
EUR 4.350.000	France Government Bond OAT RegS 25/3/2024 (Zero Coupon)	4.423.254	1,86	EUR 225.000	E.ON SE RegS 1,00% 7/10/2025	234.182	0,10
EUR 400.000	France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/5/2052	376.048	0,16	EUR 300.000	Eurogrid GmbH RegS 1,625% 3/11/2023	312.159	0,13
EUR 270.000	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2072	204.490	0,09	EUR 875.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,625% 9/7/2024	905.415	0,38
EUR 600.000	Gecina SA RegS FRN 30/6/2022	602.154	0,25	EUR 2.523.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625% 4/7/2022	2.557.944	1,08
EUR 500.000	La Poste SA RegS 0,625% 21/10/2026	513.605	0,22	EUR 959.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125% 7/11/2023	975.639	0,41
EUR 400.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE RegS 0,125% 28/2/2023	402.884	0,17	EUR 2.947.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 30/6/2022 (Zero Coupon)	2.967.098	1,25
EUR 400.000	Orange SA RegS 1,125% 15/7/2024	415.160	0,17	EUR 1.424.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau RegS 15/6/2029 (Zero Coupon)	1.434.837	0,60
EUR 400.000	Pernod Ricard SA RegS 24/10/2023 (Zero Coupon)	401.880	0,17	EUR 900.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 0,125% 27/6/2023	911.907	0,38
EUR 600.000	Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon)	604.134	0,25	EUR 700.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 2,875% 28/9/2026	768.250	0,32
EUR 600.000	Societe Generale SA RegS 0,25% 18/1/2022	602.814	0,25	EUR 600.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,125% 16/7/2025	605.304	0,25
EUR 500.000	Societe Generale SA RegS FRN 1/4/2022	503.150	0,21	EUR 1.276.000	Muenchener Hypothekenbank eG RegS 0,25% 13/12/2023	1.299.402	0,55
EUR 600.000	Societe Generale SA RegS 27/5/2022 (Zero Coupon)	602.802	0,25	EUR 667.000	State of Lower Saxony RegS 0,01% 17/3/2026	678.045	0,29
EUR 500.000	Societe Generale SA RegS 0,125% 18/2/2028	492.605	0,21			52.313.261	21,98
EUR 500.000	Societe Generale SFH SA RegS 0,125% 18/7/2029	505.105	0,21	Grèce			
EUR 400.000	Suez SA RegS FRN (Perpetual)	405.808	0,17	EUR 2.675.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 12/2/2026 (Zero Coupon)	2.661.893	1,12
EUR 230.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	241.541	0,10			2.661.893	1,12
EUR 230.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	234.572	0,10	Islande			
EUR 600.000	Veolia Environnement SA RegS 0,672% 30/3/2022	603.594	0,25	EUR 400.000	Iceland Government International Bond RegS 0,10% 20/6/2024	401.912	0,17
EUR 300.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual)	307.779	0,13	EUR 210.000	Iceland Government International Bond RegS 0,625% 3/6/2026	216.353	0,09
		46.499.172	19,53			618.265	0,26
Allemagne							
EUR 681.000	Berlin Hyp AG 0,125% 23/10/2023	691.399	0,29				
EUR 400.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	414.608	0,17				
EUR 6.500.000	Bundesobligation RegS 14/4/2023 (Zero Coupon)	6.584.435	2,77				
EUR 4.000.000	Bundesobligation RegS 13/10/2023 (Zero Coupon)	4.066.960	1,71				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Irlande				Pays-Bas suite			
EUR 970.000	Ireland Government Bond RegS 3,90% 20/3/2023	1.049.045	0,44	EUR 500.000	de Volksbank NV RegS 0,75% 25/6/2023	509.925	0,21
EUR 750.000	Ireland Government Bond RegS 3,40% 18/3/2024	833.213	0,35	EUR 500.000	de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024	503.080	0,21
		1.882.258	0,79	EUR 225.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 0,625% 13/12/2024	230.812	0,10
Italie				EUR 376.000	Domi 2021-1 BV '2021-1 A' RegS FRN 15/6/2053	377.369	0,16
EUR 450.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,875% 27/6/2022	455.274	0,19	EUR 150.000	Heineken NV RegS 1,625% 30/3/2025	159.558	0,07
EUR 500.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024	513.020	0,21	EUR 400.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	402.060	0,17
EUR 540.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,00% 4/7/2024	555.628	0,23	EUR 300.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	307.374	0,13
EUR 500.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,625% 24/2/2026	496.860	0,21	EUR 500.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	529.440	0,22
EUR 3.900.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,30% 15/8/2023	3.949.569	1,66	EUR 600.000	ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025	600.612	0,25
EUR 5.100.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,00% 15/7/2022	5.181.855	2,18	EUR 300.000	ING Groep NV RegS FRN 15/2/2029	316.785	0,13
EUR 4.900.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,45% 15/9/2022	5.016.081	2,11	EUR 300.000	ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029	293.019	0,12
EUR 2.300.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,50% 1/11/2022	2.490.923	1,05	EUR 3.705.000	Netherlands Government Bond RegS 2,25% 15/7/2022	3.826.857	1,61
EUR 2.900.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,05% 15/1/2023	2.919.546	1,23	EUR 2.250.000	Netherlands Government Bond RegS 15/1/2024 (Zero Coupon)	2.290.747	0,96
EUR 2.650.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,95% 1/3/2023	2.709.492	1,14	EUR 355.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	396.673	0,17
EUR 900.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,60% 15/6/2023	917.001	0,38	EUR 230.000	RELX Finance BV RegS 18/3/2024 (Zero Coupon)	230.948	0,10
EUR 875.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,65% 15/10/2023	894.285	0,37	EUR 500.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 20/2/2023 (Zero Coupon)	503.005	0,21
EUR 4.400.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 15/1/2024 (Zero Coupon)	4.424.024	1,86	EUR 600.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,25% 5/6/2024	608.460	0,26
EUR 1.700.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,50% 1/3/2024	1.919.368	0,81	EUR 500.000	Silver Arrow Athlon NL 2021-1 BV '2021-1 A' RegS FRN 26/4/2031	504.618	0,21
EUR 495.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045	474.923	0,20	EUR 400.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	407.936	0,17
EUR 230.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,00% 8/9/2027	236.350	0,10	EUR 300.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	308.835	0,13
EUR 450.000	Snam SpA RegS 12/5/2024 (Zero Coupon)	451.787	0,19	EUR 300.000	Vonovia Finance BV RegS 0,125% 6/4/2023	301.569	0,13
EUR 450.000	UniCredit SpA RegS 6,95% 31/10/2022	492.552	0,21			15.417.744	6,48
EUR 450.000	UniCredit SpA RegS FRN 25/6/2025	463.054	0,19	Nouvelle-Zélande			
EUR 990.000	UniCredit SpA RegS 0,325% 19/1/2026	985.258	0,41	EUR 230.000	Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026	236.311	0,10
		35.546.850	14,93	NZD 1.603.000	New Zealand Government Bond 0,50% 15/5/2026	929.228	0,39
Luxembourg				NZD 1.050.000	New Zealand Government Bond 1,75% 15/5/2041	538.587	0,23
EUR 450.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0,632% 4/6/2023	456.372	0,19			1.704.126	0,72
EUR 450.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 0,50% 9/8/2022	453.402	0,19	Norvège			
		909.774	0,38	EUR 660.000	DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023	664.983	0,28
Monténégro				EUR 750.000	DNB Boligkreditt AS RegS 0,625% 19/6/2025	779.183	0,33
EUR 751.000	Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027	697.446	0,29	EUR 731.000	SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025	754.209	0,31
		697.446	0,29			2.198.375	0,92
Pays-Bas							
EUR 890.000	ABN AMRO Bank NV RegS 0,625% 31/5/2022	899.808	0,38				
EUR 890.000	BMW Finance NV RegS 0,625% 6/10/2023	908.254	0,38				

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pologne				Supranational suite			
EUR 230.000	Santander Bank Polska SA RegS 0,75% 20/9/2021	230.715	0,10	EUR 720.000	European Stability Mechanism RegS 18/10/2022 (Zero Coupon)	725.739	0,30
		230.715	0,10	EUR 580.000	European Stability Mechanism RegS 0,10% 31/7/2023	588.085	0,25
Portugal				Suède			
EUR 1.000.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 2,20% 17/10/2022	1.039.510	0,44	EUR 575.000	Nordea Bank AB RegS FRN 18/8/2031	573.269	0,24
EUR 950.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,95% 25/10/2023	1.076.986	0,45	EUR 540.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024	544.352	0,23
EUR 1.100.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 5,65% 15/2/2024	1.285.889	0,54	EUR 450.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 0,25% 28/2/2022	452.538	0,19
		3.402.385	1,43	EUR 230.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 0,375% 3/7/2023	233.547	0,10
Singapour				EUR 450.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 0,125% 18/6/2024	454.955	0,19
EUR 540.000	DBS Group Holdings Ltd RegS FRN 11/4/2028	552.479	0,23	SEK 4.050.000	Sweden Government International Bond RegS 0,125% 9/9/2030	391.873	0,16
		552.479	0,23			2.650.534	1,11
Slovaquie				Suisse			
EUR 400.000	Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024	406.532	0,17	EUR 990.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 16/1/2026	995.811	0,42
EUR 200.000	Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 24/3/2026	201.732	0,09	EUR 710.000	UBS AG RegS 0,25% 10/1/2022	712.875	0,30
		608.264	0,26	EUR 475.000	UBS AG RegS 0,625% 23/1/2023	481.987	0,20
Slovénie				EUR 325.000	UBS AG RegS 0,01% 31/3/2026	324.087	0,14
EUR 123.000	Slovenia Government Bond RegS 0,488% 20/10/2050	107.048	0,04	EUR 710.000	UBS Group AG RegS 0,25% 24/2/2028	700.025	0,29
		107.048	0,04			3.214.785	1,35
Espagne				Royaume-Uni			
EUR 600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,625% 17/1/2022	604.080	0,25	EUR 450.000	Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025	457.317	0,19
EUR 300.000	Banco de Sabadell SA RegS 1,625% 7/3/2024	312.639	0,13	EUR 990.000	British Telecommunications Plc RegS 1,125% 10/3/2023	1.014.314	0,43
EUR 700.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 22/7/2025	715.204	0,30	EUR 540.000	Diageo Finance Plc RegS 0,125% 12/10/2023	544.039	0,23
EUR 300.000	Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027	309.057	0,13	EUR 230.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 2/12/2024	242.420	0,10
EUR 600.000	Banco Santander SA 0,01% 27/2/2025	607.368	0,26	EUR 450.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2031	445.239	0,19
EUR 600.000	CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025	605.604	0,25	EUR 230.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc RegS 0,25% 4/10/2022	231.799	0,10
EUR 500.000	CaixaBank SA RegS FRN 10/7/2026	510.685	0,22	GBP 259.000	London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051	302.072	0,13
EUR 400.000	CaixaBank SA RegS FRN 15/3/2027	410.044	0,17	EUR 100.000	NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079	100.784	0,04
EUR 2.015.000	Instituto de Credito Oficial RegS 0,75% 31/10/2023	2.072.891	0,87	USD 210.000	Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025	173.549	0,07
EUR 600.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024	607.242	0,26			3.511.533	1,48
EUR 3.800.000	Spain Government Bond 0,45% 31/10/2022	3.854.682	1,62	États-Unis			
EUR 3.000.000	Spain Government Bond 30/4/2023 (Zero Coupon)	3.029.520	1,27	EUR 230.000	AbbVie Inc 1,25% 1/6/2024	238.055	0,10
EUR 3.704.000	Spain Government Bond RegS 4,40% 31/10/2023	4.144.072	1,74	EUR 450.000	Bank of America Corp RegS FRN 4/5/2023	452.596	0,19
EUR 1.750.000	Spain Government Bond RegS 3,80% 30/4/2024	1.966.983	0,83	EUR 450.000	Bank of America Corp RegS FRN 26/10/2031	441.349	0,18
		19.750.071	8,30	EUR 150.000	Citigroup Inc 1,75% 28/1/2025	159.285	0,07
Supranational							
EUR 3.841.000	European Investment Bank RegS 0,50% 15/11/2023	3.946.512	1,66				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
EUR 230.000	Citigroup Inc RegS 0,75% 26/10/2023	234.556	0,10	OBLIGATIONS			
EUR 450.000	Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023	457.330	0,19	Nouvelle-Zélande			
EUR 450.000	Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025	459.396	0,19	NZD 280.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040	228.254	0,09
EUR 660.000	Fiserv Inc 0,375% 1/7/2023	666.277	0,28			228.254	0,09
EUR 450.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 2,00% 27/7/2023	470.407	0,20	Total des obligations		228.254	0,09
EUR 400.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024	400.308	0,17	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		228.254	0,09
EUR 450.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 0,125% 19/8/2024	450.621	0,19	Organismes de placement collectif			
EUR 230.000	International Business Machines Corp 1,25% 26/5/2023	236.934	0,10	Irlande			
EUR 450.000	International Business Machines Corp 0,875% 31/1/2025	465.912	0,20	64.445	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ⁻	6.369.938	2,68
EUR 450.000	JPMorgan Chase & Co RegS 1,50% 26/10/2022	461.920	0,19	Total des organismes de placement collectif		6.369.938	2,68
EUR 230.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 11/3/2027	238.922	0,10	Portefeuille de titres à la valeur de marché		237.087.606	99,60
EUR 990.000	Morgan Stanley FRN 8/11/2022	992.693	0,42	Autres éléments de l'actif net		952.954	0,40
EUR 540.000	Morgan Stanley FRN 26/7/2024	548.473	0,23	Total de l'actif net (EUR)		238.040.560	100,00
EUR 230.000	National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023	234.308	0,10	⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.			
EUR 230.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0,125% 1/3/2025	230.840	0,10				
USD 465.000	Verizon Communications Inc 1,45% 20/3/2026	384.508	0,16				
		8.224.690	3,46				
	Total des obligations	230.489.414	96,83				
	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	230.489.414	96,83				

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	EUR 1.020.000	Fund receives Fixed 1,3825% and pays Floating EUR 12 Month CPTFE	BNP Paribas	15/4/2031	(17.329)	(17.308)
CCILS	USD 170.000	Fund receives Fixed 2,4010% and pays Floating USD 12 Month US CPI	BNP Paribas	17/3/2031	(3.346)	(3.343)
CCILS	USD 1.595.000	Fund receives Fixed 2,4200% and pays Floating USD 12 Month US CPI	BNP Paribas	17/3/2031	(28.691)	(28.663)
CCILS	USD 202.500	Fund receives Fixed 2,4325% and pays Floating USD 12 Month US CPI	BNP Paribas	6/5/2051	(2.462)	(2.454)
CCILS	USD 202.500	Fund receives Fixed 2,4375% and pays Floating USD 12 Month US CPI	BNP Paribas	7/5/2051	(2.134)	(2.126)
CCILS	USD 202.500	Fund receives Fixed 2,4845% and pays Floating USD 12 Month US CPI	BNP Paribas	4/5/2051	862	869
CCILS	USD 202.500	Fund receives Fixed 2,4845% and pays Floating USD 3 Month US CPI	BNP Paribas	4/5/2051	622	630
CCILS	USD 100.000	Fund receives Fixed 2,5050% and pays Floating USD 12 Month US CPI	BNP Paribas	30/3/2031	(1.019)	(1.018)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	USD 630.000	Fund receives Fixed 2,6694% and pays Floating USD 12 Month USCPI	BNP Paribas	14/5/2031	4.491	4.502
CCILS	GBP 2.800.000	Fund receives Fixed 3,6410% and pays Floating GBP 12 Month USCPI	BNP Paribas	15/3/2031	(39.010)	(38.942)
CCILS	GBP 830.000	Fund receives Fixed 3,6500% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	BNP Paribas	15/4/2031	(13.951)	(13.931)
CCILS	GBP 750.000	Fund receives Fixed 3,6575% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	BNP Paribas	15/4/2031	(11.770)	(11.752)
CCILS	GBP 981.167	Fund receives Fixed 3,7560% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	BNP Paribas	15/4/2031	(971)	(947)
CCIRS	SEK 5.000.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,824%	BNP Paribas	6/4/2031	430	438
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,6165%	BNP Paribas	17/3/2031	(1.276)	(1.273)
CCIRS	USD 790.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,650%	BNP Paribas	14/5/2031	(6.966)	(6.331)
CCIRS	USD 120.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,680%	BNP Paribas	30/3/2031	(1.322)	(1.320)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 11.250.584)					(123.842)	(122.969)
CCILS : Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)						
CCIRS : Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)						

Nombre de contrats	Contrat/ Devise du contrat	Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(109)	EUR	Euro BOBL Futures June 2021	Juin 2021	14.680.120	33.831
(8)	EUR	Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	1.178.240	(7.140)
(16)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	2.716.960	(2.927)
(12)	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	2.412.480	56.520
329	EUR	Euro Schatz Futures June 2021	Juin 2021	36.861.160	(17.965)
(15)	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	Juin 2021	2.404.800	8.427
(4)	EUR	Euro-OAT Futures September 2021	Septembre 2021	632.640	430
(3)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	3.395.844	523
91	EUR	Short Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	10.293.920	13.380
(34)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	4.032.257	9.493
(8)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	864.060	2.122
(4)	USD	US Treasury 5 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	405.784	331
(12)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	1.816.616	7.318
Total				81.694.881	104.343

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
1.870.000	Call	OTC USD/CAD	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,28	23/06/2021	(12.340)	104
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 2.437)						(12.340)	104

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(1.200.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021; and pays 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021	BNP Paribas	USD 1,12	08/09/2021	(1.398)	(10.531)
(1.200.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021	BNP Paribas	USD 1,13	08/09/2021	5.512	(3.667)
(2.825.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023; and pays 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	5.217	(88.196)
(2.825.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	2.834	(89.676)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 3.285.974)						12.165	(192.070)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	500.000	EUR	321.350	Westpac	15/7/2021	(4.461)
EUR	518.206	AUD	810.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	4.844
EUR	584.800	DKK	4.350.000	BNP Paribas	15/7/2021	(58)
EUR	1.789.092	DKK	13.310.000	Westpac	15/7/2021	(437)
EUR	336.378	GBP	290.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	(76)
EUR	449.958	GBP	390.000	UBS	15/7/2021	(2.515)
EUR	322.682	NOK	3.300.000	JP Morgan	16/6/2021	(1.255)
EUR	2.183.943	NZD	3.700.000	Morgan Stanley	15/7/2021	(17.647)
EUR	785.816	SEK	8.020.000	Bank of America	15/7/2021	(6.331)
EUR	700.000	USD	846.265	Merrill Lynch	16/6/2021	6.754
EUR	662.234	USD	800.000	UBS	16/6/2021	7.253
EUR	460.897	USD	550.000	Morgan Stanley	15/7/2021	10.599
EUR	16.620	USD	20.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	246
KRW	325.000.000	USD	290.493	Westpac	16/6/2021	2.258
NOK	4.550.000	EUR	447.298	BNP Paribas	16/6/2021	(657)
NOK	3.300.000	EUR	326.159	JP Morgan	16/6/2021	(2.222)
NOK	3.700.000	USD	444.503	UBS	16/6/2021	(926)
NOK	1.400.000	USD	168.374	JP Morgan	16/6/2021	(501)
NZD	800.000	EUR	477.152	Morgan Stanley	16/6/2021	(1.133)
SEK	3.700.000	EUR	366.167	Morgan Stanley	15/7/2021	(713)
SEK	300.000	USD	35.912	Barclays Bank	16/6/2021	223
SEK	150.000	USD	17.978	Royal Bank of Canada	16/6/2021	93
USD	855.337	EUR	700.000	BNP Paribas	16/6/2021	678
USD	36.353	NOK	300.000	Barclays Bank	16/6/2021	331
USD	18.208	NOK	150.000	BNP Paribas	16/6/2021	191

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	119.289	SEK	1.000.000	Bank of America	16/6/2021	(1.085)
USD	393.793	SEK	3.300.000	Merrill Lynch	16/6/2021	(3.463)
USD	96.240	SEK	800.000	JP Morgan	16/6/2021	(205)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 14.100.271)						(10.215)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	63,04
Finance	23,95
Organismes de placement collectif	2,68
Services aux collectivités	2,34
Valeurs industrielles	1,87
Communications	1,53
Technologie	1,52
Biens de consommation non cyclique	1,42
Biens de consommation cyclique	0,55
Titres hypothécaires	0,29
Titres adossés à des actifs	0,21
Énergie	0,20
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,60
Autres éléments de l'actif net	0,40
	100,00

BlackRock European Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché EUR	% de l'actif net			Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Danemark				Royaume-Uni			
304.771	DSV PANALPINA A/S	60.449.516	3,96	EUR 34.000.000	Credit Agricole SA 1/9/2021 (Zero Coupon)	34.055.848	2,23
615.150	Novo Nordisk A/S 'B'	39.870.826	2,61	EUR 7.000.000	Mizuho International Plc 29/10/2021 (Zero Coupon)	7.016.147	0,46
527.893	Royal Unibrew A/S	55.965.410	3,66			41.071.995	2,69
1.679.206	Tryg A/S	32.256.066	2,11				
		188.541.818	12,34				
Finlande				Total des Certificats de dépôts			
303.951	Neste Oyj	16.346.485	1,07			178.198.043	11,66
		16.346.485	1,07	BILLET DE TRÉSORERIE			
Pays-Bas				France			
24.252	ASML Holding NV	13.365.277	0,88	EUR 70.000.000	Axa Banque S.A. 15/6/2021 (Zero Coupon)	70.014.993	4,58
225.364	IMCD NV	29.962.144	1,96	EUR 66.000.000	Jyske Bank A/S RegS 1/6/2021 (Zero Coupon)	66.000.000	4,32
688.871	QIAGEN NV	27.844.166	1,82	EUR 25.000.000	LMA SA RegS 7/6/2021 (Zero Coupon)	25.002.254	1,63
		71.171.587	4,66	EUR 15.000.000	LMA SA RegS 8/6/2021 (Zero Coupon)	15.001.518	0,98
Suisse				EUR 30.000.000	Oesterreichische Kontrollbank AG 28/9/2021 (Zero Coupon)	30.053.898	1,97
287.569	Logitech International SA Reg	29.348.053	1,92	EUR 20.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 22/6/2021 (Zero Coupon)	20.006.728	1,31
111.459	Lonza Group AG Reg	58.868.164	3,85	EUR 18.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 13/12/2021 (Zero Coupon)	18.049.422	1,18
4.681	Partners Group Holding AG	5.822.977	0,38			244.128.813	15,97
118.112	Sika AG Reg^	31.169.510	2,04	Allemagne			
23.639	Straumann Holding AG Reg	30.449.273	1,99	EUR 20.000.000	Toyota Kreditbank GmbH RegS 30/7/2021 (Zero Coupon)	20.017.906	1,31
		155.657.977	10,18			20.017.906	1,31
Royaume-Uni				Irlande			
3.860.762	Dr. Martens Plc	21.983.208	1,44	EUR 15.500.000	Matchpoint Finance Plc RegS 19/7/2021 (Zero Coupon)	15.510.152	1,01
1.549.833	RELX Plc	33.197.423	2,17			15.510.152	1,01
		55.180.631	3,61	Luxembourg			
Total des actions ordinaires				EUR 25.000.000			
		486.898.498	31,86	EUR 46.000.000	Albion Capital Corp SA RegS 16/6/2021 (Zero Coupon)	25.005.531	1,64
OBLIGATIONS				EUR 24.500.000	Antalis SA 7/6/2021 (Zero Coupon)	46.003.682	3,01
France				EUR 40.000.000	Archer Daniels-Midland Co 4/6/2021 (Zero Coupon)	40.001.868	2,62
EUR 8.100.000	HSBC Continental Europe SA RegS 0,20% 4/9/2021	8.114.904	0,53	EUR 5.000.000	Archer-Daniels-Midland Co 29/6/2021 (Zero Coupon)	5.002.179	0,33
EUR 8.000.000	Societe Generale SA RegS 0,25% 18/1/2022	8.037.520	0,53	EUR 50.000.000	Barclays Bank Plc 7/7/2021 (Zero Coupon)	50.026.034	3,27
		16.152.424	1,06	EUR 24.500.000	Collateralized Commercial Paper III Co LLC RegS 22/6/2021 (Zero Coupon)	24.507.164	1,60
Total des obligations				EUR 20.000.000	Collateralized Commercial Paper III Co LLC RegS 8/7/2021 (Zero Coupon)	20.011.106	1,31
		16.152.424	1,06	EUR 55.000.000	Collateralized Commercial Paper III Co LLC RegS 24/11/2021 (Zero Coupon)	55.132.086	3,61
CERTIFICAT DE DÉPÔTS				EUR 19.500.000	Deutsche Boerse AG RegS 25/8/2021 (Zero Coupon)	19.523.050	1,28
Belgique				EUR 38.000.000	Linde Finance BV 2/8/2021 (Zero Coupon)	38.035.373	2,49
EUR 16.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 2/7/2021 (Zero Coupon)	16.008.870	1,05	EUR 25.000.000	LMA SA RegS 13/7/2021 (Zero Coupon)	25.015.468	1,64
		16.008.870	1,05	EUR 15.000.000	Matchpoint Finance Plc RegS 4/6/2021 (Zero Coupon)	15.000.601	0,98
Japon				EUR 10.000.000	Matchpoint Finance Plc RegS 5/7/2021 (Zero Coupon)	10.004.825	0,65
EUR 22.000.000	Mizuho Bank Ltd 1/6/2021 (Zero Coupon)	22.001.375	1,44				
EUR 20.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp RegS 3/8/2021 (Zero Coupon)	20.020.344	1,31				
EUR 50.000.000	TheNorinchukin Bank 1/9/2021 (Zero Coupon)	50.068.455	3,28				
		92.090.174	6,03				
Luxembourg							
EUR 10.000.000	BPCE SA RegS 7/6/2021 (Zero Coupon)	10.000.919	0,65				
		10.000.919	0,65				
Suisse							
EUR 19.000.000	Zuercher Kantonalbank 16/8/2021 (Zero Coupon)	19.026.085	1,24				
		19.026.085	1,24				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Luxembourg suite			
EUR 30.000.000	Nordea Bank Abp RegS 7/12/2021 (Zero Coupon)	30.082.142	1,97
EUR 22.000.000	OP Corporate Bank Plc RegS 24/1/2022 (Zero Coupon)	22.077.175	1,44
EUR 25.000.000	Sunderland Receivables SA 15/6/2021 (Zero Coupon)	25.005.062	1,63
EUR 20.000.000	Sunderland Receivables SA 14/7/2021 (Zero Coupon)	20.012.439	1,31
EUR 30.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 14/10/2021 (Zero Coupon)	30.056.511	1,97
		500.502.296	32,75
Pays-Bas			
EUR 42.000.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 19/8/2021 (Zero Coupon)	42.048.977	2,75
		42.048.977	2,75
Suède			
EUR 35.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 11/6/2021 (Zero Coupon)	35.005.362	2,29
		35.005.362	2,29
Total des billets de trésorerie		857.213.506	56,08
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		1.538.462.471	100,66
Organismes de placement collectif			
Irlande			
910.558	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund [^]	90.002.728	5,89
		90.002.728	5,89
Total des organismes de placement collectif		90.002.728	5,89
Portefeuille de titres à la valeur de marché		1.628.465.199	106,55
Autres éléments du passif net		(100.093.256)	(6,55)
Total de l'actif net (EUR)		1.528.371.943	100,00
[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt. [~] Investissement dans un fonds de partie liée.			

BlackRock European Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés				Italie			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(1.596.476)	Leonardo SpA	Citibank	(169.226)
Belgique				(719.821)	Saipem SpA	Bank of America Merrill Lynch	23.754
(731.681)	Proximus SADP	Citibank	339.510	(3.586.091)	Saipem SpA	Citibank	(50.205)
(188.294)	Umicore SA	Bank of America Merrill Lynch	154.401	(914.360)	Saipem SpA	JP Morgan	(6.401)
			493.911				(202.078)
Danemark				Pays-Bas			
(202.459)	Novozymes A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	97.339	(308.430)	JDE Peet's NV	Citibank	15.422
			97.339	(1.161.591)	SNS REAAL NV'	Deutsche Bank	10
				(172.919)	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(498.007)
							(482.575)
Finlande				Portugal			
(247.427)	Nokian Renkaat Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(84.125)	(1.657.328)	CTT-Correios de Portugal SA	Citibank	(406.046)
(1.087.209)	Wartsila Oyj Abp	Bank of America Merrill Lynch	(587.093)				(406.046)
			(671.218)				
France				Espagne			
154.613	Alten SA	Bank of America Merrill Lynch	256.659	(1.364.212)	Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(402.443)
(70.224)	Atos SE	Bank of America Merrill Lynch	(32.303)	(7.183.453)	Mapfre SA	JP Morgan	380.723
(261.904)	Casino Guichard Perrachon SA	Bank of America Merrill Lynch	369.285	(1.375.092)	Merlin Properties Socimi SA (REIT)	JP Morgan	(253.017)
(34.112)	Casino Guichard Perrachon SA	Citibank	10.575	(3.102.038)	Telefonica SA	Citibank	378.449
(130.065)	Danone SA	Barclays Bank	103.074				103.712
22.158	Kering SA	Bank of America Merrill Lynch	946.147				
(473.039)	Klepierre SA (REIT)	Citibank	(402.083)				
37.699	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	JP Morgan	1.149.819				
(1.281.238)	Orange SA	Bank of America Merrill Lynch	322.872				
115.960	Pernod Ricard SA	JP Morgan	782.730				
228.368	Safran SA	JP Morgan	(621.161)				
(102.320)	Societe BIC SA	Bank of America Merrill Lynch	368.352				
(1.369.637)	TechnipFMC Plc	Citibank	(512.244)				
119.640	Teleperformance	Citibank	11.964				
(350.068)	Valeo SA	Bank of America Merrill Lynch	(366.891)				
306.451	Worldline SA	Citibank	392.257				
			2.779.052				
Allemagne				Suède			
(168.763)	BASF SE	JP Morgan	651.425	1.297.906	AddTech AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(608.666)
(147.010)	Bayerische Motoren Werke AG	JP Morgan	(274.909)	358.322	Atlas Copco AB 'B'	JP Morgan	(686.936)
(88.195)	Continental AG	JP Morgan	(652.643)	(559.856)	Electrolux AB 'B'	Citibank	(199.168)
(1.097.421)	Deutsche Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	(539.931)	(993.673)	Elektro AB 'B'	JP Morgan	(761.002)
(200.869)	Deutsche EuroShop AG	JP Morgan	80.348	(349.554)	Essity AB 'B'	JP Morgan	66.639
(262.028)	Evonik Industries AG	JP Morgan	196.521	(300.980)	H & M Hennes & Mauritz AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(31.230)
(245.932)	GEA Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(167.234)			Deutsche Bank	613.548
(22.758)	GRENKE AG	Bank of America Merrill Lynch	(118.569)			Bank of America Merrill Lynch	—
(199.705)	GRENKE AG	JP Morgan	(1.332.032)			Bank of America Merrill Lynch	16.261
(126.017)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	JP Morgan	303.384			Deutsche Bank	370.975
(21)	SLM Solutions Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(5.457)			JP Morgan	(140.692)
(18)	SLM Solutions Group AG	Bank of America Merrill Lynch	16.200			Bank of America Merrill Lynch	20.915
(300.174)	TeamViewer AG	Citibank	(203.190)				(1.339.356)
(480.763)	thyssenkrupp AG	Citibank	(60.978)				
			(2.107.065)				
				Suisse			
				(478.441)	ABB Ltd Reg	JP Morgan	(169.797)
				(182.103)	Adecco Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(281.278)
				(620.779)	Clariant AG Reg	Citibank	(84.736)
				(967.531)	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(412.049)
				(134)	Credit Suisse Group Guernsey VII Ltd RegS	Bank of America Merrill Lynch	107.949
				(18.278)	dormakaba Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(8.316)
				(63.194)	Landis+Gyr Group AG	Barclays Bank	(93.015)
				(156.712)	Swiss Prime Site AG Reg	JP Morgan	(213.910)
				(27.312)	Swisscom AG Reg	Citibank	69.590
				(1.004.451)	UBS Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(607.839)
				114.983	VAT Group AG	JP Morgan	2.260.088
				(26.135)	Zur Rose Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(321.066)
							245.621

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Royaume-Uni			
2.746.808	AJ Bell Plc	Bank of America Merrill Lynch	(376.338)
(271.083)	Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc	Barclays Bank	(579.145)
4.182.896	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	679.943
(1.705.723)	British Land Co Plc (REIT)	Citibank	202.012
(1.356.357)	Centrica Plc	Citibank	(21.103)
(2.779.271)	Deliveroo Plc	Citibank	212.982
611.503	Experian Plc	Citibank	(196.285)
(2.267.681)	HSBC Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(313.326)
(5.081.556)	J Sainsbury Plc	Bank of America Merrill Lynch	(64.902)
2.971.565	JD Sports Fashion Plc	Citibank	1.097.185
(1.091.741)	John Wood Group Plc	Barclays Bank	87.441
(291.014)	Johnson Matthey Plc	Bank of America Merrill Lynch	537.253
(3.310.590)	Jupiter Fund Management Plc	Bank of America Merrill Lynch	(256.957)
1.994.153	Rightmove Plc	Bank of America Merrill Lynch	782.605
(7.472.882)	Rolls-Royce Holdings Plc	JP Morgan	230.801
(224.957)	Schroders Plc	Citibank	20.896
108.296	Spirax-Sarco Engineering Plc	Citibank	345.790
(162.137)	St James's Place Plc	JP Morgan	(26.356)
(4.216.003)	Standard Life Aberdeen Plc	Citibank	(293.711)
(1.443.393)	TUI AG	Bank of America Merrill Lynch	(217.869)
(383.987)	TUI AG	JP Morgan	20.955
320.884	Wizz Air Holdings Plc	Citibank	801.008
(7.199.052)	Wm Morrison Supermarkets Plc	JP Morgan	518.244
			3.191.123
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 1.044.492.228)			1.702.420
* Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.			

BlackRock European Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées	EUR
Instruments financiers dérivés							
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS							
EUR	25.004.440	CHF	27.451.250	Barclays Bank	18/6/2021	21.376	
EUR	7.408.914	CHF	8.135.893	Citibank	18/6/2021	4.532	
EUR	47.484.467	CHF	52.128.913	JP Morgan	18/6/2021	42.546	
							68.454
Catégorie d'Actions couverte en CHF							
CHF	29.300.328	EUR	26.707.039	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(41.670)	
EUR	659.454	CHF	722.597	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1.839	
							(39.831)
Catégorie d'Actions couverte en GBP							
EUR	142.869	GBP	122.862	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	250	
GBP	5.882.994	EUR	6.779.125	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	49.964	
							50.214
Catégorie d'Actions couverte en USD							
EUR	2.283.678	USD	2.778.198	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	7.781	
USD	16.038.434	EUR	13.274.319	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(135.646)	
							(127.865)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 129.538.633)							(49.028)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	61,46
Biens de consommation non cyclique	16,10
Biens de consommation cyclique	7,14
Valeurs industrielles	6,00
Organismes de placement collectif	5,89
Matériaux de base	4,45
Technologie	2,80
Titres hypothécaires	1,64
Énergie	1,07
Portefeuille de titres à la valeur de marché	106,55
Autres éléments du passif net	(6,55)
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Opportunities Extension Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché EUR	% de l'actif net			Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Belgique							
70.251	KBC Group NV	4.722.272	0,72	175.855	Logitech International SA Reg [^]	17.947.004	2,72
258.472	Kinepolis Group NV	12.804.703	1,94	59.126	Lonza Group AG Reg	31.227.977	4,73
		17.526.975	2,66	8.852	Partners Group Holding AG	11.011.535	1,67
				96.354	Sika AG Reg [^]	25.427.619	3,85
				13.293	Straumann Holding AG Reg	17.122.644	2,60
				22.245	Tecan Group AG Reg [^]	9.093.061	1,38
				42.033	VAT Group AG [^]	10.618.124	1,61
						129.598.174	19,64
Danemark				Suisse suite			
89.941	Chemometec A/S	9.107.095	1,38	693.588	Alphawave IP Group Plc	2.468.309	0,37
241.736	DSV PANALPINA A/S	47.946.899	7,26	354.364	Computacenter Plc	11.051.550	1,68
27.599	Genmab A/S	9.174.216	1,39	2.283.034	Dr. Martens Plc	12.999.613	1,97
583.384	Novo Nordisk A/S 'B'	37.811.919	5,73	324.353	FDM Group Holdings Plc	3.743.449	0,57
430.147	Royal Unibrew A/S	45.602.713	6,91	1.343.048	JD Sports Fashion Plc	14.739.503	2,23
925.855	Tryg A/S	17.784.858	2,70	447.584	Prudential Plc	7.800.507	1,18
		167.427.700	25,37	884.940	RELX Plc	18.955.415	2,87
						71.758.346	10,87
Finlande				Royaume-Uni			
1.166.117	Metso Outotec Oyj	11.392.963	1,73	Total des actions ordinaires			
220.290	Neste Oyj [^]	11.847.196	1,79	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
		23.240.159	3,52			647.428.544	98,09
France				Organismes de placement collectif			
129.365	Alten SA	13.195.230	2,00	Irlande			
20.234	Sartorius Stedim Biotech	7.221.515	1,10	227.328	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ⁻	22.469.917	3,40
28.484	Teleperformance	8.998.096	1,36			22.469.917	3,40
28.091	Virbac SA	7.542.433	1,14	Total des organismes de placement collectif			
		36.957.274	5,60	Portefeuille de titres à la valeur de marché			
Allemagne							
65.364	Amadeus Fire AG	10.052.983	1,52	Autres éléments du passif net			
146.912	Puma SE	13.871.431	2,10	Total de l'actif net (EUR)			
48.511	Wacker Chemie AG	6.643.582	1,01			(9.856.365)	(1,49)
		30.567.996	4,63			660.042.096	100,00
Irlande							
52.145	DCC Plc	3.625.451	0,55				
898.208	Irish Continental Group Plc (Unit)	3.985.798	0,60				
		7.611.249	1,15				
Italie							
565.129	GVS SpA	8.188.719	1,24				
8.000	Tinexta SpA	219.040	0,03				
		8.407.759	1,27				
Jersey							
228.474	Wizz Air Holdings Plc	12.794.450	1,94				
		12.794.450	1,94				
Luxembourg							
117.269	Stabilus SA	8.115.015	1,23				
		8.115.015	1,23				
Pays-Bas							
9.544	ASML Holding NV	5.259.698	0,80				
128.864	IMCD NV [^]	17.132.469	2,59				
		22.392.167	3,39				
Suède							
697.085	AddLife AB 'B'	16.780.461	2,54				
1.136.966	AddTech AB 'B'	15.392.492	2,33				
473.272	Alfa Laval AB	14.638.481	2,22				
912.968	Assa Abloy AB 'B'	23.141.089	3,51				
237.090	Hemnet Group AB	5.107.526	0,77				
1.168.314	Hexagon AB 'B'	13.744.529	2,08				
178.804	Thule Group AB	6.912.211	1,05				
493.551	Troax Group AB	15.314.491	2,32				
		111.031.280	16,82				
Suisse							
146.049	LafargeHolcim Ltd Reg	7.150.210	1,08				

[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.
⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.

BlackRock European Opportunities Extension Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés				Pays-Bas suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(7.241)	SNS REAAL NV ^{*,**}	Deutsche Bank	—
Belgique				(33.612)	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(96.803)
(117.486)	Proximus SADP	Bank of America Merrill Lynch	66.967				(90.218)
(29.583)	Umicore SA	JP Morgan	69.520	Espagne			
			136.487	(198.742)	Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(58.629)
Finlande				(1.357.004)	Mapfre SA	JP Morgan	71.921
(140.902)	Lassila & Tikanoja Oyj	JP Morgan	95.813	(217.444)	Merlin Properties Socimi SA (REIT)	Citibank	(103.503)
(281.568)	Rovio Entertainment Oyj	JP Morgan	(76.023)	(527.459)	Telefonica SA	Bank of America Merrill Lynch	56.438
(223.353)	Wartsila Oyj Abp	Citibank	(146.296)				(33.773)
			(126.506)	Suède			
France				64.038	Atlas Copco AB 'A'	Citibank	(44.297)
901.598	ALD SA	Bank of America Merrill Lynch	(811.438)	330.372	Atlas Copco AB 'B'	JP Morgan	(633.353)
(90.475)	Bonduelle SCA	Citibank	(45.238)	(85.941)	Electrolux AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	39.915
(29.645)	Casino Guichard Perrachon SA	Bank of America Merrill Lynch	41.799	(190.609)	Elektab AB 'B'	JP Morgan	(145.977)
(70.386)	Casino Guichard Perrachon SA	JP Morgan	147.107	(58.628)	Essity AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	17.950
(39.296)	Danone SA	Bank of America Merrill Lynch	2.775	(52.087)	ICA Gruppen AB	Bank of America Merrill Lynch	—
(111.151)	Klepierre SA (REIT)	Citibank	(94.478)	(485.133)	Scandic Hotels Group AB	Citibank	(18.697)
42.086	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Citibank	757.548	(62.758)	SKF AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	2.481
76.650	Pernod Ricard SA	JP Morgan	517.387	(100.845)	Veoneer Inc SDR	Bank of America Merrill Lynch	(95.668)
111.539	Safran SA	Citibank	145.001	(79.164)	Volvo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	3.520
(34.374)	Societe BIC SA	Citibank	92.810				(874.126)
(283.453)	TechnipFMC Plc	JP Morgan	(2.268)	Suisse			
45.399	Teleperformance	JP Morgan	(86.258)	(73.138)	ABB Ltd Reg	Bank of America Merrill Lynch	(22.629)
(50.335)	Valeo SA	Barclays Bank	(34.731)	(30.030)	Adecco Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(47.003)
			630.016	(114.381)	Clariant AG Reg	JP Morgan	(3.643)
Allemagne				(169.303)	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(72.102)
(27.265)	BASF SE	Citibank	5.726	(24)	Credit Suisse Group Guernsey VII Ltd RegS	Bank of America Merrill Lynch	19.334
(126.576)	Bauer AG	JP Morgan	(151.891)	(3.810)	dormakaba Holding AG	Citibank	(31.204)
(24.524)	Bayerische Motoren Werke AG	JP Morgan	(45.860)	(13.219)	Landis+Gyr Group AG	Barclays Bank	(19.379)
(17.582)	Continental AG	Bank of America Merrill Lynch	(121.316)	53.830	Medartis Holding AG	Citibank	264.519
(218.947)	Deutsche Bank AG	JP Morgan	(135.309)	(80.201)	Softwareone Holding AG	JP Morgan	(54.737)
(90.386)	Deutsche EuroShop AG	Citibank	(49.712)	(6.358)	Stadler Rail AG	JP Morgan	2.199
(101.513)	ElringKlinger AG	Citibank	(47.711)	(24.414)	Swiss Prime Site AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(44.433)
(69.425)	ElringKlinger AG	JP Morgan	(72.202)	(5.019)	Swisscom AG Reg	Citibank	12.788
(61.456)	Evonik Industries AG	JP Morgan	46.092	(14.149)	u-blox Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	37.339
(35.858)	GEA Group AG	JP Morgan	11.833	(149.543)	UBS Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(90.495)
(42.301)	GRENKE AG	JP Morgan	(282.148)	(6.827)	Zur Rose Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(83.869)
(19.618)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	30.996				(133.315)
251.718	QIAGEN NV	Bank of America Merrill Lynch	448.058	Royaume-Uni			
(49.836)	TeamViewer AG	JP Morgan	62.793	2.093.541	AJ Bell Plc	JP Morgan	(379.205)
(115.176)	thyssenkrupp AG	Citibank	(17.276)	117.377	Ashtead Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	234.412
			(317.927)	298.683	Associated British Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	152.592
Irlande				(56.964)	Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc	Barclays Bank	(121.699)
1.432.997	Irish Continental Group Plc (Unit)	Citibank	(89.562)	3.126.627	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	508.243
			(89.562)				
Italie							
(314.891)	Leonardo SpA	Citibank	(33.378)				
(339.672)	Saipem SpA	Bank of America Merrill Lynch	11.209				
(449.582)	Saipem SpA	Citibank	(6.294)				
			(28.463)				
Pays-Bas							
(59.860)	JDE Peet's NV	Bank of America Merrill Lynch	6.585				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Opportunities Extension Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Royaume-Uni suite			
(290.097)	British Land Co Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	28.294
(77.476)	Carnival Plc	JP Morgan	(141.232)
(1.494.738)	Centrica Plc	Citibank	(23.256)
57.823	DCC Plc	JP Morgan	(93.993)
(632.957)	Deliveroo Plc	Citibank	48.505
546.970	Experian Plc	Bank of America Merrill Lynch	425.506
(88.371)	HomeServe Plc	Barclays Bank	15.391
(856.233)	J Sainsbury Plc	JP Morgan	(94.446)
(261.529)	John Wood Group Plc	Barclays Bank	20.550
(53.039)	Johnson Matthey Plc	Citibank	94.838
(534.510)	Jupiter Fund Management Plc	Citibank	14.895
71.592	London Stock Exchange Group Plc	JP Morgan	413.963
(3.528.710)	N Brown Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	251.976
(1.564.850)	Rolls-Royce Holdings Plc	Citibank	(23.620)
70.595	Spirax-Sarco Engineering Plc	Bank of America Merrill Lynch	475.411
(489.992)	Standard Life Aberdeen Plc	Citibank	(34.136)
(235.328)	TUI AG	Citibank	17.214
(252.865)	TUI AG	JP Morgan	13.799
(54.978)	Victrex Plc	Citibank	(7.660)
(1.046.903)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Bank of America Merrill Lynch	83.873
			1.880.215
États-Unis			
(54.632)	Carnival Corp	Citibank	(74.311)
			(74.311)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 333.554.092)			878.517
* Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.			
** Les montants inférieurs à 0,5 USD ont été arrondis à zéro.			

BlackRock European Opportunities Extension Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
GBP	76.811.928	EUR	89.190.810	State Street Bank & Trust Company	18/6/2021	(30.833)
NOK	56.112.980	EUR	5.580.068	State Street Bank & Trust Company	18/6/2021	(72.047)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 94.667.998)						(102.880)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	31,91
Valeurs industrielles	30,11
Biens de consommation cyclique	14,11
Technologie	9,53
Finance	6,27
Matériaux de base	3,60
Organismes de placement collectif	3,40
Énergie	1,79
Communications	0,77
Portefeuille de titres à la valeur de marché	101,49
Autres éléments du passif net	(1,49)
	100,00

BlackRock European Select Strategies Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché EUR	% de l'actif net			Valeur de marché EUR	% de l'actif net		
Nombre	Description			Nombre	Description				
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé									
ACTIONS ORDINAIRES									
Belgique				Suède					
13.000	Solvay SA	1.442.350	0,30	52.025	Alfa Laval AB	1.609.153	0,33		
		1.442.350	0,30	123.032	Assa Abloy AB 'B'	3.118.504	0,64		
				496.962	Tele2 AB 'B'^	5.522.345	1,14		
						10.250.002	2,11		
Danemark				Suisse					
16.667	DSV PANALPINA A/S	3.305.800	0,68	13.510	Cembra Money Bank AG	1.255.218	0,26		
75.390	Novo Nordisk A/S 'B'	4.886.388	1,00	9.513	Lonza Group AG Reg	5.024.384	1,03		
121.145	Tryg A/S	2.327.089	0,48	48.665	Nestle SA Reg^	4.914.727	1,01		
		10.519.277	2,16	4.570	Roche Holding AG^	1.303.326	0,27		
				11.937	Sika AG Reg^	3.150.149	0,65		
				15.371	Zurich Insurance Group AG^	5.264.895	1,08		
						20.912.699	4,30		
Finlande				Royaume-Uni					
53.071	Kone Oyj 'B'	3.518.607	0,72	62.623	AstraZeneca Plc	5.850.345	1,20		
339.361	Nordea Bank Abp	2.998.396	0,62	416.772	Auto Trader Group Plc	2.717.648	0,56		
		6.517.003	1,34	1.138.895	Direct Line Insurance Group Plc	3.931.391	0,81		
				69.153	National Grid Plc	754.113	0,16		
France						120.718	Persimmon Plc	4.429.214	0,91
26.590	BNP Paribas SA	1.491.965	0,31	501.295	Phoenix Group Holdings Plc^	4.281.566	0,88		
88.787	Engie SA	1.083.557	0,22	199.503	RELX Plc	4.259.894	0,88		
4.144	Kering SA	3.106.342	0,64			26.224.171	5,40		
8.014	L'Oreal SA	2.957.166	0,61			154.153.541	31,74		
4.725	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	3.097.238	0,64	Total des actions ordinaires					
72.091	Sanofi	6.307.242	1,30						
21.361	Schneider Electric SE	2.773.939	0,57	OBLIGATIONS					
95.499	SCOR SE^	2.533.588	0,52	Albanie					
9.404	Teleperformance	2.970.724	0,61	EUR 310.000	Albania Government International Bond RegS 3,50% 9/10/2025	329.425	0,07		
48.835	Vinci SA	4.551.910	0,94	EUR 100.000	Albania Government International Bond RegS 3,50% 16/6/2027	106.885	0,02		
		30.873.671	6,36			436.310	0,09		
Allemagne				Australie					
20.487	Allianz SE Reg	4.420.070	0,91	EUR 550.000	APT Pipelines Ltd RegS 2,00% 15/7/2030	591.987	0,12		
25.287	LEG Immobilien AG	3.034.440	0,63	EUR 550.000	Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028	540.650	0,11		
15.504	MTU Aero Engines AG	3.299.251	0,68			1.132.637	0,23		
9.238	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	2.187.559	0,45	Autriche					
1.136	Rational AG	840.186	0,17	EUR 400.000	Erste Group Bank AG RegS 0,05% 16/9/2025	401.320	0,08		
		13.781.506	2,84	EUR 400.000	Erste Group Bank AG RegS FRN (Perpetual)	425.900	0,09		
Italie				EUR 100.000	Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024	99.925	0,02		
83.584	ACEA SpA	1.666.665	0,34	EUR 500.000	Raiffeisen Bank International AG RegS 0,25% 5/7/2021	500.300	0,10		
677.157	Enel SpA	5.474.814	1,13	EUR 1.348.000	Republic of Austria Government Bond RegS 20/4/2025 (Zero Coupon)	1.375.621	0,28		
652.020	Iren SpA	1.676.996	0,35	EUR 1.300.000	Republic of Austria Government Bond RegS 1,20% 20/10/2025	1.397.812	0,29		
46.661	UniCredit SpA	490.407	0,10	EUR 1.240.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,50% 20/4/2027	1.303.116	0,27		
		9.308.882	1,92	EUR 302.000	Republic of Austria Government Bond RegS 4,15% 15/3/2037	480.325	0,10		
Pays-Bas				EUR 249.000	Republic of Austria Government Bond RegS 1,50% 20/2/2047	301.300	0,06		
8.124	ASML Holding NV	4.477.136	0,92						
19.928	Koninklijke DSM NV	3.013.114	0,62						
		7.490.250	1,54						
Norvège									
155.424	Gjensidige Forsikring ASA	2.849.133	0,59						
		2.849.133	0,59						
Portugal									
1.289.702	EDP - Energias de Portugal SA	6.080.945	1,25						
		6.080.945	1,25						
Espagne									
176.063	Endesa SA	3.952.614	0,82						
357.560	Iberdrola SA	3.951.038	0,81						
		7.903.652	1,63						

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Autriche suite				Canada suite			
EUR 86.000	Republic of Austria Government Bond RegS 3,80% 26/1/2062	176.143	0,04	EUR 514.000	CPPIB Capital Inc RegS 0,375% 20/6/2024	526.609	0,11
EUR 715.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,70% 20/4/2071	667.503	0,14	EUR 680.000	CPPIB Capital Inc RegS 0,875% 6/2/2029 [*]	723.309	0,15
EUR 136.000	Republic of Austria Government Bond RegS 2,10% 20/9/2117	219.376	0,04	Chine			
EUR 45.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,85% 30/6/2120	39.889	0,01	EUR 150.000	China Development Bank RegS 27/10/2023 (Zero Coupon)	150.135	0,03
EUR 200.000	Volksbank Wien AG RegS 0,875% 23/3/2026	200.972	0,04	EUR 100.000	China Government International Bond RegS 0,125% 12/11/2026	100.300	0,02
		7.589.502	1,56	EUR 386.000	China Government International Bond RegS 0,50% 12/11/2031	383.877	0,08
Belgique				EUR 150.000	China Government International Bond RegS 0,625% 25/11/2035	146.800	0,03
EUR 300.000	Ageas SA RegS FRN 24/11/2051	298.545	0,06	Colombie			
EUR 800.000	Ageas SA RegS FRN (Perpetual)	848.216	0,18	USD 1.245.000	Colombia Government International Bond 3,25% 22/4/2032	986.900	0,20
EUR 125.000	Anheuser-Busch InBev SA RegS 3,70% 2/4/2040	166.178	0,03			986.900	0,20
EUR 800.000	Argenta Spaarbank NV RegS 1,00% 6/2/2024	822.672	0,17	Chypre			
EUR 200.000	Belfius Bank SA RegS 1,00% 12/6/2028	215.210	0,05	EUR 118.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,875% 6/5/2022	122.733	0,03
EUR 300.000	BNP Paribas Fortis SA RegS 24/10/2023 (Zero Coupon)	303.162	0,06	EUR 277.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023	301.930	0,06
EUR 200.000	Fluxys Belgium SA RegS 1,75% 5/10/2027	209.794	0,04	EUR 725.000	Cyprus Government International Bond RegS 0,625% 3/12/2024	744.227	0,15
EUR 400.000	KBC Group NV RegS FRN 11/3/2027	405.576	0,08	République tchèque			
EUR 585.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,50% 22/10/2024	606.768	0,13	EUR 297.000	Komerční banka a.s. RegS 0,01% 20/1/2026	299.599	0,06
EUR 180.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2027 (Zero Coupon)	183.204	0,04			299.599	0,06
EUR 2.400.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,80% 22/6/2028	2.572.776	0,53	Danemark			
EUR 601.778	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,90% 22/6/2029	650.305	0,13	EUR 600.000	Danske Bank A/S FRN 24/5/2023	608.400	0,12
EUR 160.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 3,00% 22/6/2034	214.856	0,05	EUR 350.000	Danske Bank A/S RegS 0,25% 28/11/2022	352.828	0,07
EUR 341.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,45% 22/6/2037	389.756	0,08	USD 397.000	Danske Bank A/S RegS FRN 12/9/2023	329.283	0,07
EUR 174.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,90% 22/6/2038	211.923	0,04	DKK 3.594.000	Denmark Government Bond 1,75% 15/11/2025	530.297	0,11
EUR 140.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,40% 22/6/2040	133.358	0,03	DKK 3.292.000	Denmark Government Bond 4,50% 15/11/2039	770.630	0,16
EUR 511.264	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,60% 22/6/2047	596.369	0,12	EUR 100.000	Kommunekredit RegS 0,875% 3/11/2036	105.476	0,02
EUR 210.000	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 1,70% 22/6/2050	250.673	0,05	DKK 7.901.729	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,50% 1/10/2050	974.900	0,20
EUR 255.004	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 0,65% 22/6/2071	207.331	0,04	DKK 396.935	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab RegS 1,00% 1/10/2050	51.023	0,01
		9.286.672	1,91	DKK 3.080.583	Nykredit Realkredit A/S RegS 0,50% 1/10/2050	379.774	0,08
Canada				DKK 5.548.188	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2050	714.300	0,15
EUR 1.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,25% 24/1/2023	1.011.600	0,21	DKK 5.240.000	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/10/2053	665.730	0,14

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Danemark suite				France suite			
DKK 2.967.480	Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050	365.819	0,07	EUR 300.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026	315.219	0,07
DKK 5.135.022	Realkredit Danmark A/S RegS 1,00% 1/10/2050	659.091	0,14	EUR 100.000	Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023	102.492	0,02
		6.507.551	1,34	EUR 200.000	Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024	204.318	0,04
Finlande				EUR 600.000	Coentreprise de Transport d'Electricite SA RegS 0,875% 29/9/2024	616.374	0,13
EUR 400.000	Aktia Bank Oyj RegS 0,375% 5/3/2026	413.164	0,09	EUR 300.000	Credit Agricole Assurances SA RegS FRN 27/9/2048	365.529	0,08
EUR 805.000	Finland Government Bond RegS 0,50% 15/9/2027	847.568	0,17	EUR 130.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 0,625% 11/9/2023	133.254	0,03
EUR 691.000	Finland Government Bond RegS 0,50% 15/9/2029	726.303	0,15	EUR 100.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA RegS 0,25% 23/2/2024	101.894	0,02
EUR 75.000	Finland Government Bond RegS 0,25% 15/9/2040	71.948	0,01	EUR 400.000	Credit Agricole Public Sector SCF SA 0,01% 13/9/2028	401.440	0,08
EUR 57.000	Finland Government Bond RegS 1,375% 15/4/2047	68.430	0,01	EUR 200.000	Credit Agricole SA RegS 1,375% 13/3/2025	209.364	0,04
EUR 400.000	Nordea Bank Abp RegS 3,25% 5/7/2022	416.276	0,09	EUR 700.000	Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA RegS 0,25% 30/4/2024	713.769	0,15
EUR 525.000	OP Corporate Bank Plc 0,60% 18/1/2027	532.434	0,11	EUR 200.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,375% 17/1/2025	210.422	0,04
EUR 550.000	OP Corporate Bank Plc RegS 0,375% 29/8/2023	558.420	0,12	EUR 300.000	Danone SA RegS 1/12/2025 (Zero Coupon)	299.841	0,06
		3.634.543	0,75	GBP 1.900.000	Dexia Credit Local SA RegS 1,125% 15/6/2022	2.227.721	0,46
France				GBP 2.800.000	Dexia Credit Local SA RegS 1,625% 8/12/2023	3.354.579	0,69
EUR 1.100.000	Agence Francaise de Developpement EPIC RegS 1,00% 31/1/2028	1.177.143	0,24	GBP 300.000	Dexia Credit Local SA RegS 0,25% 10/12/2026	339.125	0,07
EUR 700.000	AXA Home Loan SFH SA RegS 0,01% 16/10/2029	698.271	0,14	EUR 100.000	Dexia Credit Local SA RegS 21/1/2028 (Zero Coupon)	100.143	0,02
EUR 700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,75% 15/6/2023	715.183	0,15	GBP 200.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	260.550	0,05
EUR 600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,125% 5/2/2024	604.776	0,12	EUR 100.000	Engie SA RegS 0,875% 27/3/2024	102.879	0,02
EUR 700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,75% 17/7/2025	721.742	0,15	EUR 500.000	Engie SA RegS 4/3/2027 (Zero Coupon)	496.025	0,10
EUR 200.000	BNP Paribas Cardif SA RegS FRN (Perpetual)	226.020	0,05	EUR 800.000	Engie SA RegS 0,375% 11/6/2027	810.440	0,17
EUR 1.400.000	BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025	1.417.262	0,29	EUR 200.000	Engie SA RegS 2,00% 28/9/2037	228.582	0,05
EUR 1.000.000	BNP Paribas SA RegS FRN 15/1/2032*	1.003.420	0,21	EUR 100.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	101.480	0,02
EUR 300.000	BNP Paribas SA RegS 0,625% 3/12/2032	287.553	0,06	EUR 210.504	FCT Autonoria '2019-1 B' RegS FRN 25/9/2035	211.025	0,04
GBP 200.000	Bouygues SA RegS 5,50% 6/10/2026	285.056	0,06	EUR 200.000	Firmenich Productions Participations SAS RegS 1,75% 30/4/2030	218.550	0,05
EUR 100.000	BPCE SA RegS 0,625% 26/9/2023	102.142	0,02	EUR 1.620.000	France Government Bond OAT RegS 25/2/2023 (Zero Coupon)	1.638.435	0,34
EUR 500.000	BPCE SA RegS 0,375% 5/10/2023	507.755	0,11	EUR 1.070.000	France Government Bond OAT RegS 25/3/2025 (Zero Coupon)	1.090.983	0,23
EUR 700.000	BPCE SA RegS 1,00% 15/7/2024	724.703	0,15	EUR 490.000	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2025	509.644	0,11
EUR 200.000	BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024	201.894	0,04	EUR 1.080.000	France Government Bond OAT RegS 25/2/2026 (Zero Coupon)	1.100.747	0,23
EUR 200.000	BPCE SA RegS 1,00% 1/4/2025	206.514	0,04	EUR 1.750.192	France Government Bond OAT RegS 25/11/2031 (Zero Coupon)	1.717.218	0,35
EUR 200.000	BPCE SFH SA RegS 0,01% 27/5/2030	198.708	0,04	EUR 46.178	France Government Bond OAT RegS 1,25% 25/5/2034	51.435	0,01
EUR 1.000.000	BPCE SFH SA RegS 0,125% 3/12/2030	999.350	0,21	EUR 2.865.400	France Government Bond OAT RegS 1,75% 25/6/2039	3.448.423	0,71
EUR 500.000	Caisse des Depots et Consignations RegS 0,01% 1/6/2026	507.100	0,10	EUR 200.000	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2040	194.094	0,04
EUR 200.000	Caisse Francaise de Financement Local RegS 1,125% 9/9/2025	212.424	0,04				
EUR 100.000	Cars Alliance Auto Loans France V '2018-1 B' RegS FRN 21/10/2029	99.940	0,02				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Allemagne suite				Irlande suite			
EUR 557.000	State of Lower Saxony RegS 0,01% 16/6/2028	563.027	0,12	EUR 269.000	Last Mile Securities PE '2021-X1 A1' DAC RegS FRN 17/8/2031	269.448	0,06
EUR 10.000	State of North Rhine-Westphalia Germany RegS 1,625% 24/10/2030	11.465	0,00	EUR 98.750	River Green Finance '2020-1 A' DAC RegS FRN 22/1/2032	98.947	0,02
EUR 425.000	Volkswagen Financial Services AG RegS 1,50% 1/10/2024	445.166	0,09	GBP 99.692	Taurus '2019-2 B' UK DAC RegS FRN 17/11/2029	116.122	0,02
EUR 400.000	Volkswagen Leasing GmbH RegS 12/7/2023 (Zero Coupon)	400.656	0,08	GBP 99.691	Taurus '2019-2 C' UK DAC RegS FRN 17/11/2029	115.952	0,02
EUR 200.000	Volkswagen Leasing GmbH RegS 1,375% 20/1/2025	209.172	0,04	GBP 179.444	Taurus 2019-2 UK DAC 'A' RegS FRN 17/11/2029	210.160	0,04
EUR 325.000	Volkswagen Leasing GmbH RegS 1,625% 15/8/2025*	344.650	0,07	GBP 364.705	Taurus '2020-2 A' UK DAC RegS FRN 17/8/2030	426.182	0,09
EUR 725.000	Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,375% 20/7/2026	725.297	0,15	EUR 500.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co RegS FRN 17/9/2050	521.935	0,11
EUR 200.000	ZF Finance GmbH RegS 2,75% 25/5/2027	207.038	0,04			5.797.592	1,19
		21.312.988	4,39	Italie			
Grèce				EUR 300.000	ACEA SpA RegS 1,50% 8/6/2027	320.313	0,07
EUR 175.000	Alpha Bank SA RegS 2,50% 5/2/2023	181.923	0,04	EUR 335.000	ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028	345.358	0,07
EUR 2.575.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 12/2/2026 (Zero Coupon)	2.562.382	0,53	EUR 93.668	AutoFlorence 1 Srl 'A' RegS FRN 25/12/2042	94.231	0,02
		2.744.305	0,57	EUR 69.902	AutoFlorence 1 Srl 'B' RegS FRN 25/12/2042	70.226	0,01
Hongrie				EUR 200.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 1,25% 20/1/2022	202.008	0,04
HUF 359.150.000	Hungary Government Bond 3,25% 22/10/2031	1.085.875	0,22	EUR 1.010.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 0,875% 8/10/2026	1.051.753	0,22
EUR 114.000	Hungary Government International Bond RegS 1,75% 5/6/2035	120.322	0,03	EUR 200.000	Credit Agricole Italia SpA RegS 1,00% 25/3/2027	213.232	0,04
		1.206.197	0,25	EUR 675.000	Credito Emiliano SpA RegS 1,125% 17/1/2024	700.346	0,14
Indonésie				EUR 200.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,00% 18/6/2021	200.220	0,04
IDR 3.396.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,00% 15/9/2030	202.856	0,04	EUR 600.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,125% 4/3/2022	606.342	0,12
USD 375.000	Pertamina Persero PT RegS 1,40% 9/2/2026	301.195	0,06	EUR 500.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,50% 5/3/2024	513.020	0,11
USD 205.000	Pertamina Persero PT RegS 2,30% 9/2/2031	159.579	0,04	EUR 225.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,75% 4/12/2024	230.369	0,05
		663.630	0,14	EUR 300.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,925% 14/10/2030	315.675	0,06
Irlande				EUR 875.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,35% 24/2/2031	856.686	0,18
EUR 425.000	Abbott Ireland Financing DAC RegS 0,10% 19/11/2024	427.951	0,09	EUR 1.473.237	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,45% 22/5/2023	1.514.384	0,31
GBP 100.000	BAMS CMBS 2018-1 DAC 'C' RegS FRN 17/5/2028	116.532	0,02	EUR 674.694	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,25% 20/11/2023	694.375	0,14
EUR 700.000	Bank of Ireland Mortgage Bank RegS 0,625% 14/3/2025	725.053	0,15	EUR 2.911.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,45% 15/11/2024	3.065.603	0,63
SEK 1.990.000	Bluestep Mortgage Securities No 4 DAC 'B' RegS FRN 10/8/2066	196.745	0,04	EUR 750.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,35% 1/2/2025	761.168	0,16
EUR 650.000	CRH SMW Finance DAC RegS 1,25% 5/11/2026	687.323	0,14	EUR 945.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,45% 15/5/2025	999.413	0,21
EUR 159.878	Ireland Government Bond 5,40% 13/3/2025	195.636	0,04	EUR 1.535.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,85% 1/7/2025	1.648.851	0,34
EUR 270.000	Ireland Government Bond RegS 3,40% 18/3/2024	299.956	0,06	EUR 1.989.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,50% 1/2/2026	2.023.927	0,42
EUR 129.293	Ireland Government Bond RegS 1,35% 18/3/2031	144.785	0,03	EUR 400.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 4,50% 1/3/2026	482.828	0,10
EUR 876.959	Ireland Government Bond RegS 18/10/2031 (Zero Coupon)	857.824	0,18	EUR 602.564	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,30% 15/5/2028	689.400	0,14
EUR 50.000	Ireland Government Bond RegS 0,55% 22/4/2041	48.552	0,01				
EUR 295.000	Ireland Government Bond RegS 1,50% 15/5/2050	338.489	0,07				

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Italie suite				Luxembourg suite			
EUR 1.573.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 1/3/2032	1.681.065	0,35	EUR 513.000	European Financial Stability Facility RegS 20/1/2031 (Zero Coupon)	510.430	0,11
EUR 65.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,45% 1/9/2033	74.902	0,02	EUR 420.000	European Financial Stability Facility RegS 1,375% 31/5/2047	488.116	0,10
EUR 1.500.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,35% 1/3/2035	1.899.720	0,39	EUR 250.000	European Financial Stability Facility RegS 0,70% 20/1/2050	251.725	0,05
EUR 660.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,25% 1/9/2036	744.566	0,15	EUR 500.000	European Financial Stability Facility RegS 1,75% 17/7/2053	647.680	0,13
EUR 139.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,95% 1/9/2038	170.610	0,04	EUR 450.000	Medtronic Global Holdings SCA 0,25% 2/7/2025	455.040	0,09
EUR 195.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 5,00% 1/8/2039	304.069	0,06	EUR 400.000	Medtronic Global Holdings SCA 1,00% 2/7/2031	412.028	0,09
EUR 240.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,10% 1/3/2040	300.614	0,06	EUR 150.000	Medtronic Global Holdings SCA 1,50% 2/7/2039	152.225	0,03
EUR 400.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,80% 1/3/2041	412.988	0,09	EUR 100.000	Medtronic Global Holdings SCA 1,75% 2/7/2049	101.372	0,02
EUR 1.817.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045	1.743.302	0,36	EUR 500.000	Novartis Finance SA RegS 23/9/2028 (Zero Coupon)	491.800	0,10
EUR 709.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 3,25% 1/9/2046	921.154	0,19	EUR 200.000	SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 D' RegS FRN 14/11/2034	202.003	0,04
EUR 70.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,70% 1/3/2047	82.989	0,02	EUR 350.000	SES SA RegS FRN (Perpetual)	351.750	0,07
EUR 65.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,80% 1/3/2067	76.572	0,02	EUR 100.000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 'D' RegS FRN 15/3/2027	100.905	0,02
EUR 75.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,15% 1/3/2072	72.861	0,01	EUR 200.000	Swiss Re Finance Luxembourg SA RegS FRN 30/4/2050	220.150	0,05
EUR 500.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,125% 15/7/2025	517.740	0,11	EUR 500.000	Traton Finance Luxembourg SA RegS 1,25% 24/3/2033	498.630	0,10
EUR 350.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 0,50% 1/10/2026*	363.808	0,07			5.246.225	1,08
EUR 144.009	Progetto Quinto SRL 'A' RegS FRN 27/10/2036	144.556	0,03	Macédoine			
EUR 100.000	Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030	101.132	0,02	EUR 195.000	North Macedonia Government International Bond RegS 1,625% 10/3/2028	189.394	0,04
EUR 32.291	Sunrise SPV 40 Srl '2018-1 A' RegS FRN 27/7/2042	32.317	0,01			189.394	0,04
EUR 47.744	Sunrise SPV Z70 Srl '2019-1 A' RegS FRN 27/5/2044	47.887	0,01	Mexique			
EUR 300.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA RegS 0,75% 24/7/2032	297.615	0,06	MXN 5.000.000	Mexican Bonos 8,50% 31/5/2029	231.580	0,05
EUR 1.050.000	UniCredit SpA RegS FRN 25/6/2025	1.080.461	0,22	USD 358.000	Mexico Government International Bond 3,75% 19/4/2071	264.315	0,05
EUR 725.000	UniCredit SpA RegS FRN 23/9/2029*	726.341	0,15			495.895	0,10
EUR 300.000	UniCredit SpA RegS 1,80% 20/1/2030	308.259	0,06	Monténégro			
EUR 600.000	UniCredit SpA RegS 0,85% 19/1/2031*	584.520	0,12	EUR 500.000	Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027	464.345	0,09
		30.289.776	6,24	EUR 100.000	Montenegro Government International Bond RegS 2,55% 3/10/2029	89.752	0,02
Japon						554.097	0,11
EUR 375.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040	392.944	0,08	Maroc			
		392.944	0,08	EUR 154.000	Morocco Government International Bond RegS 1,375% 30/3/2026	156.008	0,03
Jersey						156.008	0,03
GBP 200.000	Heathrow Funding Ltd RegS 2,75% 9/8/2049	227.956	0,04	Pays-Bas			
GBP 200.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP RegS FRN (Perpetual)	327.180	0,07	EUR 850.000	ABN AMRO Bank NV RegS 0,25% 3/12/2021	853.298	0,18
		555.136	0,11	EUR 300.000	ABN AMRO Bank NV RegS 1,375% 10/1/2034	340.035	0,07
Luxembourg				EUR 200.000	Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025	202.286	0,04
EUR 240.000	European Financial Stability Facility RegS 0,20% 28/4/2025	245.856	0,05				
EUR 110.000	European Financial Stability Facility RegS 0,75% 3/5/2027	116.515	0,03				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Pays-Bas suite			
EUR 300.000	Aegon Bank NV RegS 0,01% 16/11/2025	303.279	0,06	EUR 500.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 20/2/2023 (Zero Coupon)	503.005	0,10
EUR 100.000	ASML Holding NV RegS 3,375% 19/9/2023	108.517	0,02	EUR 300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,375% 5/6/2026	306.507	0,06
EUR 750.000	ASML Holding NV RegS 1,375% 7/7/2026	802.050	0,17	EUR 1.100.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	1.132.395	0,23
EUR 250.000	Athora Netherlands NV RegS FRN 15/7/2031	254.458	0,05	EUR 500.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	535.685	0,11
EUR 425.000	BMW Finance NV RegS 24/3/2023 (Zero Coupon)	427.418	0,09	EUR 325.000	TenneT Holding BV RegS 0,50% 9/6/2031	323.284	0,07
EUR 450.000	BMW Finance NV RegS 0,375% 10/7/2023	456.057	0,09	EUR 875.000	TenneT Holding BV RegS FRN (Perpetual)	903.647	0,19
EUR 447.000	BNG Bank NV RegS 0,75% 11/1/2028	474.303	0,10	EUR 300.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	323.490	0,07
EUR 500.000	Daimler International Finance BV RegS 0,25% 11/5/2022	503.065	0,10	EUR 100.000	Vonovia Finance BV RegS 2,25% 7/4/2030	113.001	0,02
EUR 400.000	de Volksbank NV RegS 0,75% 25/6/2023	407.940	0,09			18.373.261	3,78
EUR 300.000	de Volksbank NV RegS 0,01% 16/9/2024	301.848	0,06	Nouvelle-Zélande			
EUR 40.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 0,625% 3/4/2023	40.662	0,01	EUR 400.000	ANZ New Zealand International Ltd RegS 0,125% 22/9/2023	404.844	0,08
EUR 261.870	Dutch Property Finance BV '2020-2 A' RegS FRN 28/1/2058	263.547	0,06	EUR 425.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd RegS 0,50% 17/1/2024	434.499	0,09
EUR 702.000	ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN (Perpetual)	754.131	0,16	EUR 300.000	ASB Finance Ltd RegS 0,625% 18/10/2024	309.384	0,07
EUR 100.000	Heineken NV RegS 2,25% 30/3/2030	114.903	0,02	EUR 940.000	ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031	939.502	0,19
EUR 600.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	603.090	0,13	NZD 115.000	Auckland Council RegS 2,95% 28/9/2050	59.196	0,01
EUR 1.200.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	1.229.496	0,25	EUR 320.000	Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023*	328.621	0,07
EUR 200.000	ING Groep NV RegS 1,00% 20/9/2023	205.700	0,04	NZD 320.000	Housing New Zealand Ltd RegS 1,534% 10/9/2035	162.793	0,03
EUR 600.000	ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025	600.612	0,12	NZD 1.750.000	New Zealand Government Bond 1,75% 15/5/2041	897.645	0,19
EUR 700.000	ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029	683.711	0,14	NZD 596.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,00% 20/9/2025	446.148	0,09
EUR 162.283	Jubilee Place 2020-1 BV 'A' RegS FRN 17/10/2057	164.152	0,03			3.982.632	0,82
EUR 100.000	Koninklijke Philips NV RegS 2,00% 30/3/2030	112.744	0,02	Norvège			
EUR 300.000	Nationale-Nederlanden Bank NV RegS 0,50% 10/10/2024	308.526	0,06	EUR 750.000	DNB Bank ASA RegS 0,60% 25/9/2023	764.910	0,16
EUR 150.000	Netherlands Government Bond RegS 0,25% 15/7/2025	155.114	0,03	EUR 575.000	DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023	579.342	0,12
EUR 310.000	Netherlands Government Bond RegS 0,25% 15/7/2029	321.572	0,07	EUR 225.000	Eika Boligkreditt AS RegS 0,50% 28/8/2025	232.542	0,05
EUR 1.000.000	Netherlands Government Bond RegS 15/7/2030 (Zero Coupon)*	1.010.670	0,21	NOK 2.833.000	Norway Government Bond RegS 1,75% 13/3/2025	286.445	0,06
EUR 80.000	Netherlands Government Bond RegS 15/1/2038 (Zero Coupon)	76.396	0,02	NOK 3.300.000	Norway Government Bond RegS 1,75% 6/9/2029	332.539	0,07
EUR 75.000	Netherlands Government Bond RegS 0,50% 15/1/2040	77.922	0,02	EUR 325.000	Sbanken Boligkreditt AS RegS 0,375% 26/4/2023	330.385	0,07
EUR 2.975	Netherlands Government Bond RegS 2,75% 15/1/2047	4.708	0,00	EUR 500.000	SpareBank 1 Boligkreditt AS RegS 0,50% 30/1/2025	515.875	0,10
EUR 960.451	Netherlands Government Bond RegS 15/1/2052 (Zero Coupon)	832.278	0,17	EUR 300.000	Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon)	301.722	0,06
EUR 200.000	NN Group NV RegS 1,00% 18/3/2022	202.164	0,04			3.343.760	0,69
EUR 700.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	782.173	0,16	Pologne			
EUR 225.000	Shell International Finance BV RegS 1,875% 7/4/2032*	253.422	0,05	PLN 1.000.000	Republic of Poland Government Bond 1,25% 25/10/2030	211.479	0,04
				EUR 275.000	Republic of Poland Government International Bond RegS 0,50% 20/12/2021	276.468	0,06

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pologne suite				Serbie suite			
EUR 300.000	Republic of Poland Government International Bond RegS 10/2/2025 (Zero Coupon)^	302.592	0,06	USD 250.000	Serbia International Bond RegS 2,125% 1/12/2030	191.314	0,04
EUR 171.000	Republic of Poland Government International Bond RegS 1,00% 25/10/2028^	183.206	0,04	EUR 170.000	Serbia International Bond RegS 1,65% 3/3/2033	164.385	0,04
		973.745	0,20			465.562	0,10
Portugal				Singapour			
EUR 400.000	Banco Comercial Portugues SA RegS 0,75% 31/5/2022	404.900	0,08	EUR 1.375.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd RegS 0,625% 18/4/2025	1.423.689	0,29
EUR 200.000	Banco Santander Totta SA RegS 1,25% 26/9/2027	217.584	0,05	EUR 675.000	United Overseas Bank Ltd RegS 0,01% 1/12/2027	677.673	0,14
EUR 200.000	Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria SA RegS 0,875% 17/10/2022	203.214	0,04			2.101.362	0,43
EUR 100.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS 1,625% 15/4/2027	107.492	0,02	Slovaquie			
EUR 533.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,125% 14/4/2027	667.673	0,14	EUR 300.000	Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,25% 26/3/2024	304.899	0,06
EUR 62.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 2,125% 17/10/2028	71.395	0,01	EUR 400.000	Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 23/6/2025	403.808	0,09
EUR 844.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,95% 15/6/2029	964.101	0,20	EUR 400.000	Vseobecna Uverova Banka AS RegS 0,01% 24/3/2026	403.464	0,08
EUR 430.791	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,30% 17/10/2031	423.420	0,09			1.112.171	0,23
EUR 137.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 2,25% 18/4/2034	163.766	0,03	Slovénie			
EUR 120.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,10% 15/4/2037	178.452	0,04	EUR 300.000	Slovenia Government Bond RegS 0,275% 14/1/2030	305.004	0,06
EUR 163.800	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 4,10% 15/2/2045	262.147	0,05	EUR 199.000	Slovenia Government Bond RegS 0,488% 20/10/2050	173.192	0,04
EUR 40.161	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052	36.016	0,01			478.196	0,10
EUR 44.222	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta VI RegS 1,10% 13/2/2023	44.573	0,01	Espagne			
EUR 181.189	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta VII RegS 0,70% 12/2/2024	180.810	0,04	EUR 400.000	Abanca Corp Bancaria SA RegS 0,75% 28/5/2029	421.732	0,09
EUR 37.636	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta V RegS 0,85% 12/2/2022	37.757	0,01	EUR 500.000	Adif Alta Velocidad RegS 1,25% 4/5/2026	532.480	0,11
		3.963.300	0,82	EUR 456	Auto ABS Spanish Loans FT '2016-1 A' RegS FRN 31/12/2032	456	0,00
Roumanie				EUR 700.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,375% 15/11/2026^	706.580	0,15
EUR 123.000	Romanian Government International Bond RegS 3,624% 26/5/2030	141.757	0,03	EUR 1.100.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 22/7/2025	1.123.892	0,23
		141.757	0,03	EUR 300.000	Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027	309.057	0,06
Russie				EUR 400.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,125% 10/2/2028	404.168	0,08
RUB 49.900.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,05% 19/1/2028	565.953	0,12	EUR 100.000	Banco de Sabadell SA RegS 2,50% 15/4/2031	100.347	0,02
		565.953	0,12	EUR 100.000	Banco Santander SA RegS 1,00% 7/4/2025	104.988	0,02
Serbie				EUR 400.000	Banco Santander SA RegS 0,875% 9/5/2031	428.760	0,09
EUR 110.000	Serbia International Bond RegS 1,50% 26/6/2029	109.863	0,02	EUR 300.000	Bankia SA RegS 1,00% 14/3/2023	307.641	0,06
				EUR 200.000	Bankia SA RegS 0,75% 9/7/2026	204.616	0,04
				EUR 200.000	Bankia SA RegS 1,125% 12/11/2026	205.372	0,04
				EUR 300.000	BBVA Consumer Auto '2020-1 A' FTA RegS FRN 20/1/2036	303.352	0,06
				EUR 500.000	CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025	504.670	0,10
				EUR 600.000	CaixaBank SA RegS FRN 10/7/2026	612.822	0,13
				GBP 100.000	CaixaBank SA RegS FRN 3/12/2026	116.199	0,03

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Espagne suite				Supranational suite			
EUR 400.000	Caja Rural de Navarra SCC RegS 0,625% 1/12/2023	408.668	0,09	EUR 59.000	European Investment Bank 0,10% 15/10/2026	60.437	0,01
EUR 200.000	Caja Rural de Navarra SCC RegS 0,875% 8/5/2025	207.994	0,04	EUR 44.000	European Investment Bank 2,625% 15/3/2035	57.629	0,01
EUR 13.645	Driver Espana Five FDT '5A' RegS FRN 21/12/2028	13.666	0,00	EUR 430.000	European Investment Bank 0,20% 17/3/2036	418.751	0,09
EUR 177.299	FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 A' RegS FRN 20/3/2033	179.306	0,04	EUR 128.000	European Investment Bank RegS 0,375% 15/5/2026	132.840	0,03
EUR 200.000	Ibercaja Banco SA RegS 0,25% 18/10/2023	202.644	0,04	EUR 99.000	European Investment Bank RegS 0,875% 14/1/2028	106.305	0,02
EUR 100.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,50% 4/10/2021	100.326	0,02	EUR 1.690.000	European Investment Bank RegS 28/3/2028 (Zero Coupon)	1.712.511	0,35
EUR 400.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,375% 27/6/2024	404.828	0,08	EUR 226.000	European Investment Bank RegS 14/1/2031 (Zero Coupon)	225.100	0,05
EUR 280.000	Spain Government Bond 0,40% 30/4/2022	282.484	0,06	GBP 21.000	European Investment Bank RegS 3,875% 8/6/2037	33.235	0,01
EUR 210.000	Spain Government Bond 31/1/2028 (Zero Coupon)	209.139	0,04	EUR 1.223.000	European Investment Bank RegS 0,25% 15/6/2040	1.168.809	0,24
EUR 487.000	Spain Government Bond RegS 5,40% 31/1/2023	535.525	0,11	EUR 390.336	European Stability Mechanism RegS 0,75% 15/3/2027	413.588	0,08
EUR 390.000	Spain Government Bond RegS 4,40% 31/10/2023	436.336	0,09	EUR 282.000	European Union RegS 4/7/2035 (Zero Coupon)	268.760	0,06
EUR 139.000	Spain Government Bond RegS 4,80% 31/1/2024	158.610	0,03	GBP 700.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,75% 7/12/2021	815.481	0,17
EUR 1.726.000	Spain Government Bond RegS 0,25% 30/7/2024	1.762.574	0,36	EUR 74.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,125% 3/1/2051	63.348	0,01
EUR 1.722.000	Spain Government Bond RegS 2,75% 31/10/2024	1.909.181	0,39	EUR 216.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061	178.230	0,04
EUR 865.000	Spain Government Bond RegS 1,60% 30/4/2025	931.371	0,19			6.296.113	1,30
EUR 421.000	Spain Government Bond RegS 1,95% 30/4/2026	465.988	0,10	Suède			
EUR 737.000	Spain Government Bond RegS 1,30% 31/10/2026	795.083	0,16	SEK 4.700.000	Kommuninvest I Sverige AB RegS 1,00% 12/5/2025	478.509	0,10
EUR 204.000	Spain Government Bond RegS 1,50% 30/4/2027	223.145	0,05	SEK 6.000.000	Landshypotek Bank AB RegS 0,75% 25/5/2023	601.132	0,12
EUR 1.155.000	Spain Government Bond RegS 1,40% 30/7/2028	1.262.034	0,26	EUR 225.000	Lansforsakringar Hypotek AB RegS 0,625% 29/1/2026	233.973	0,05
EUR 1.207.000	Spain Government Bond RegS 1,45% 30/4/2029	1.324.803	0,27	EUR 375.000	Nordea Bank AB RegS FRN 18/8/2031	373.871	0,08
EUR 600.000	Spain Government Bond RegS 0,60% 31/10/2029	616.428	0,13	SEK 5.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 1,50% 21/12/2022	506.171	0,10
EUR 1.451.000	Spain Government Bond RegS 0,50% 30/4/2030	1.471.807	0,30	EUR 145.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,625% 30/1/2023	147.733	0,03
EUR 1.048.000	Spain Government Bond RegS 2,35% 30/7/2033	1.253.785	0,26	EUR 950.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024	957.657	0,20
EUR 170.000	Spain Government Bond RegS 0,85% 30/7/2037	165.949	0,04	SEK 15.000.000	Stadshypotek AB RegS 1,50% 1/6/2023	1.527.778	0,31
EUR 50.000	Spain Government Bond RegS 4,90% 30/7/2040	83.175	0,02	GBP 287.000	Svensk Exportkredit AB RegS 0,125% 15/12/2025	327.046	0,07
EUR 620.000	Spain Government Bond RegS 1,20% 31/10/2040	623.336	0,13	EUR 100.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 1,125% 14/12/2022	102.414	0,02
EUR 127.000	Spain Government Bond RegS 5,15% 31/10/2044	227.684	0,05	EUR 150.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 0,125% 18/6/2024	151.652	0,03
EUR 822.000	Spain Government Bond RegS 2,70% 31/10/2048	1.068.296	0,22	SEK 2.000.000	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB RegS 1,00% 21/6/2023	201.822	0,04
EUR 88.000	Spain Government Bond RegS 1,00% 31/10/2050	78.580	0,02	EUR 800.000	Swedbank AB RegS 0,30% 6/9/2022	807.232	0,17
EUR 528.000	Spain Government Bond RegS 3,45% 30/7/2066	809.260	0,17	SEK 2.375.000	Sweden Government Bond 3,50% 30/3/2039	338.694	0,07
EUR 100.000	Wizink Master Credit Cards FT '2019-2 A' RegS FRN 26/3/2033	99.836	0,02	SEK 6.350.000	Sweden Government International Bond RegS 0,125% 9/9/2030	614.418	0,13
		24.698.973	5,09			7.370.102	1,52
Supranational							
EUR 500.000	African Development Bank 0,50% 21/3/2029	518.973	0,11				
EUR 122.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc RegS 2,00% 1/9/2028	122.116	0,02				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Suisse				Royaume-Uni suite			
EUR 225.000	Credit Suisse AG RegS 0,25% 5/1/2026	225.180	0,05	GBP 100.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	117.043	0,02
EUR 975.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 24/6/2027	992.599	0,20	GBP 152.578	CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057	177.584	0,04
EUR 850.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028	846.940	0,17	GBP 220.000	CMF '2020-1 B' Plc RegS FRN 16/1/2057	255.025	0,05
EUR 250.000	Credit Suisse Group AG RegS 0,625% 18/1/2033	231.885	0,05	GBP 100.000	CMF '2020-1 C' Plc RegS FRN 16/1/2057	115.926	0,02
CHF 999.000	Swiss Confederation Government Bond RegS 4,00% 8/4/2028	1.187.262	0,24	EUR 100.000	Diageo Finance Plc RegS 0,125% 12/10/2023	100.748	0,02
CHF 1.050.000	Swiss Confederation Government Bond RegS 0,50% 27/6/2032	1.019.061	0,21	EUR 300.000	DS Smith Plc RegS 0,875% 12/9/2026	306.192	0,06
CHF 721.000	Swiss Confederation Government Bond RegS 1,50% 30/4/2042	844.912	0,17	GBP 58.028	Feldspar Plc '2016-1 A' RegS FRN 15/9/2045	67.456	0,01
EUR 625.000	UBS AG RegS 0,625% 23/1/2023	634.194	0,13	GBP 120.000	Finsbury Square '2018-2B' Plc RegS FRN 12/9/2068	139.907	0,03
EUR 200.000	UBS Group AG RegS FRN 29/1/2026	200.506	0,04	GBP 136.280	Finsbury Square '2020-1X A' Plc RegS FRN 16/3/2070	158.670	0,03
EUR 225.000	UBS Group AG RegS 0,625% 24/2/2033^	218.250	0,05	GBP 99.982	Finsbury Square '2020-1X C' Plc RegS FRN 16/3/2070	115.606	0,02
USD 200.000	UBS Group AG RegS FRN (Perpetual)	176.880	0,04	GBP 109.000	Finsbury Square Plc '2018-2 C' RegS FRN 12/9/2068	127.319	0,03
		6.577.669	1,35	GBP 91.977	Finsbury Square Plc '2020-2 A' RegS FRN 16/6/2070	107.901	0,02
Royaume-Uni				GBP 234.000	Gemgarto '2021-1 A' Plc RegS FRN 16/12/2067	273.027	0,06
EUR 375.000	AstraZeneca Plc RegS 0,375% 3/6/2029	372.938	0,08	GBP 127.535	Gemgarto Plc '2018-1 A' RegS FRN 16/9/2065	148.967	0,03
GBP 285.416	Azure Finance No 2 Plc 'A' RegS FRN 20/7/2030	333.053	0,07	GBP 99.977	Gemgarto Plc '2018-1 B' RegS FRN 16/9/2065	115.722	0,02
GBP 100.000	Azure Finance Plc 'C' RegS FRN 30/6/2027	116.547	0,02	EUR 475.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon)^	477.546	0,10
GBP 675.000	Barclays Plc RegS FRN 6/10/2023	801.655	0,17	EUR 178.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,375% 2/12/2024	187.612	0,04
EUR 700.000	BAT International Finance Plc RegS 3,625% 9/11/2021	711.977	0,15	EUR 200.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,25% 21/5/2026	211.950	0,04
GBP 164.000	BAT International Finance Plc RegS 4,00% 4/9/2026	209.429	0,04	GBP 32.407	Globaldrive Auto Receivables UK '2019-A A' Plc RegS FRN 20/9/2026	37.657	0,01
EUR 219.000	BAT International Finance Plc RegS 2,25% 16/1/2030	232.773	0,05	GBP 131.000	Globaldrive Auto Receivables 'UK 2019-A B' Plc RegS FRN 20/9/2026	152.873	0,03
GBP 475.000	Bellis Acquisition Co Plc RegS 3,25% 16/2/2026	552.209	0,11	GBP 200.000	Gosforth Funding Plc '2017-1X A2' RegS FRN 19/12/2059	232.987	0,05
EUR 100.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,573% 16/2/2027	107.709	0,02	GBP 99.994	Hops Hill No 1 Plc 'B' RegS FRN 27/5/2054	117.159	0,02
EUR 375.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,231% 8/5/2031	389.633	0,08	EUR 625.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2031	618.387	0,13
EUR 175.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,104% 15/11/2034	174.704	0,04	EUR 200.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc RegS 2,50% 15/1/2026	201.014	0,04
EUR 925.000	BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual)	992.220	0,20	GBP 285.000	Lanark Master Issuer Plc '2017-1X 2A' RegS FRN 22/12/2069	332.560	0,07
GBP 81.855	Brass No 7 Plc 'A' RegS FRN 16/10/2059	95.516	0,02	GBP 75.000	Lanark Master Issuer Plc '2019-1X 1A2' RegS FRN 22/12/2069	87.202	0,02
EUR 350.000	British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024	361.564	0,08	GBP 170.000	Lanebrook Mortgage Transaction Plc '2020-1 B' RegS FRN 12/6/2057	200.537	0,04
GBP 250.000	British Telecommunications Plc RegS 3,125% 21/11/2031	316.047	0,07	GBP 142.000	LCR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028	207.677	0,04
GBP 200.000	Cadent Finance Plc RegS 1,125% 22/9/2021	232.635	0,05	GBP 230.000	Lloyds Bank Plc RegS 7,50% 15/4/2024^	318.443	0,07
EUR 750.000	Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030	748.207	0,15	GBP 157.000	London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051	183.109	0,04
GBP 400.000	Cadent Finance Plc RegS 2,75% 22/9/2046	478.831	0,10	GBP 100.000	Marks & Spencer Plc RegS 4,50% 10/7/2027	123.039	0,03
EUR 150.000	Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031	149.334	0,03				
EUR 125.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	124.694	0,03				
EUR 200.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	203.846	0,04				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
GBP 100.000	Motor Plc '2016-1 C' RegS 3,75% 25/11/2025	116.144	0,02	GBP 90.732	Twin Bridges Plc '2019-1 A' RegS FRN 12/12/2052	105.808	0,02
EUR 350.000	Nationwide Building Society RegS 0,50% 5/5/2041	341.177	0,07	GBP 225.000	Twin Bridges Plc '2020-1 C' RegS FRN 12/12/2054	265.865	0,06
GBP 156.000	Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029	181.888	0,04	GBP 5.020.000	United Kingdom Gilt RegS 0,125% 30/1/2026	5.768.951	1,19
EUR 100.000	NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079	100.784	0,02	GBP 165.000	United Kingdom Gilt RegS 1,25% 22/7/2027	200.516	0,04
GBP 378.208	Oat Hill No 2 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2046	440.235	0,09	GBP 110.000	United Kingdom Gilt RegS 1,75% 7/9/2037	138.121	0,03
EUR 450.000	OTE Plc RegS 0,875% 24/9/2026	460.715	0,10	GBP 2.177.000	United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/9/2039	3.786.120	0,78
EUR 38.302	Paragon Mortgages No 12 Plc '12X B1B' RegS FRN 15/11/2038	37.417	0,01	GBP 620.000	United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2040	1.095.605	0,23
EUR 150.000	Paragon Mortgages No 14 Plc '14X BB' RegS FRN 15/9/2039	146.760	0,03	GBP 270.701	United Kingdom Gilt RegS 3,25% 22/1/2044	435.601	0,09
GBP 76.827	Paragon Mortgages No 25 Plc 'A' RegS FRN 15/5/2050	89.239	0,02	GBP 3.601.662	United Kingdom Gilt RegS 3,50% 22/1/2045	6.064.569	1,25
GBP 212.000	PCL Funding III Plc '2017-2 A' RegS FRN 15/6/2023	246.309	0,05	GBP 1.515.000	United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2046	2.884.398	0,59
GBP 185.000	PCL Funding V Plc '2021-1 A' RegS FRN 15/10/2025	215.109	0,04	GBP 745.000	United Kingdom Gilt RegS 0,625% 22/10/2050	722.262	0,15
GBP 394.454	Prs Finance Plc RegS 1,75% 24/11/2026	483.752	0,10	GBP 277.000	United Kingdom Gilt RegS 4,25% 7/12/2055	589.947	0,12
GBP 100.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'B' RegS FRN 20/12/2046	116.447	0,02	GBP 240.000	United Kingdom Gilt RegS 1,75% 22/7/2057	318.358	0,07
GBP 100.000	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'B' RegS FRN 20/3/2050	116.272	0,02	GBP 821.620	United Kingdom Gilt RegS 4,00% 22/1/2060	1.767.026	0,36
GBP 205.000	Residential Mortgage Securities '32X C' Plc RegS FRN 20/6/2070	242.449	0,05	GBP 55.000	United Kingdom Gilt RegS 0,50% 22/10/2061	49.445	0,01
GBP 179.937	Ripon Mortgages Plc '1X A1' RegS FRN 20/8/2056	209.479	0,04	GBP 300.000	United Kingdom Gilt RegS 2,50% 22/7/2065	502.223	0,10
GBP 600.000	Ripon Mortgages Plc '1X B1' RegS FRN 20/8/2056	698.266	0,14	GBP 240.000	United Kingdom Gilt RegS 3,50% 22/7/2068	511.667	0,11
GBP 450.000	Ripon Mortgages Plc '1X C1' RegS FRN 20/8/2056	523.754	0,11	GBP 50.000	United Kingdom Gilt RegS 1,625% 22/10/2071^	69.268	0,01
GBP 109.196	RMAC Securities No 2 Plc '2018-2 A' RegS FRN 12/6/2046	127.378	0,03	GBP 200.000	WPP Finance 2013 RegS 2,875% 14/9/2046	227.672	0,05
EUR 250.000	Santander UK Plc 0,10% 12/5/2024	253.315	0,05	EUR 100.000	Yorkshire Building Society RegS 0,75% 10/11/2022	101.756	0,02
GBP 92.093	Silk Road Finance Number Six Plc 'A' RegS FRN 21/9/2067	107.838	0,02	EUR 150.000	Yorkshire Building Society RegS 0,375% 11/4/2023	152.153	0,03
GBP 320.000	Silverstone Master Issuer Plc RegS FRN 21/1/2070	373.035	0,08	EUR 125.000	Yorkshire Building Society RegS 0,01% 13/10/2027	125.410	0,03
EUR 300.000	Sky Ltd RegS 1,50% 15/9/2021	301.701	0,06			46.780.067	9,63
GBP 200.000	SSE Plc RegS FRN 16/9/2077	238.480	0,05	États-Unis			
EUR 100.000	Swiss Re Finance UK Plc RegS FRN 4/6/2052	109.411	0,02	EUR 675.000	Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032	684.207	0,14
GBP 47.461	Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040	73.167	0,02	USD 205.000	Amazon.com Inc 2,70% 3/6/2060	150.002	0,03
GBP 150.000	Tower Bridge Funding Plc '2020-1 B' RegS FRN 20/9/2063	176.923	0,04	USD 425.000	Apple Inc 2,55% 20/8/2060	305.559	0,06
GBP 100.000	Tower Bridge Funding Plc '2020-1 C' RegS FRN 20/9/2063	118.002	0,02	USD 800.000	Apple Inc 2,80% 8/2/2061	599.778	0,12
GBP 3.808	Turbo Finance 8 Plc 'A' RegS FRN 20/2/2026	4.423	0,00	EUR 313.000	AT&T Inc 3,15% 4/9/2036	373.731	0,08
GBP 100.000	Twin Bridges 2018-1 Plc 'B' RegS FRN 12/9/2050	116.452	0,02	EUR 150.000	AT&T Inc 2,60% 19/5/2038	168.281	0,04
GBP 250.000	Twin Bridges '2021-1 D' Plc RegS FRN 12/3/2055	291.751	0,06	EUR 875.000	Bank of America Corp RegS FRN 26/10/2031	858.179	0,18
GBP 100.000	Twin Bridges Plc '2018-1 D' RegS FRN 12/9/2050	116.888	0,02	EUR 650.000	Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032	658.008	0,14
				GBP 450.000	BAT Capital Corp RegS 2,125% 15/8/2025	536.631	0,11
				EUR 400.000	Becton Dickinson and Co 1,401% 24/5/2023	411.344	0,09
				EUR 300.000	Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025	300.642	0,06
				EUR 400.000	Citigroup Inc RegS FRN 24/7/2026	420.676	0,09
				EUR 400.000	Citigroup Inc RegS FRN 8/10/2027	401.607	0,08
				EUR 175.000	Coca-Cola Co 0,125% 9/3/2029	172.074	0,04

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
EUR 375.000	Coca-Cola Co 0,40% 6/5/2030	372.555	0,08	Irlande			
EUR 200.000	Comcast Corp 0,75% 20/2/2032	199.764	0,04	EUR 327.378	iShares Euro Dividend UCITS ETF ⁻	6.881.485	1,41
EUR 100.000	Danaher Corp 2,50% 30/3/2030	115.635	0,02	USD 5.000	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻	234.882	0,05
EUR 295.000	Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023	299.806	0,06			7.116.367	1,46
EUR 425.000	Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025	433.874	0,09	Total des Fonds négociés en bourse		7.116.367	1,46
EUR 675.000	Fidelity National Information Services Inc 2,00% 21/5/2030	742.156	0,15	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		453.994.541	93,47
EUR 125.000	Fiserv Inc 1,125% 1/7/2027	130.294	0,03	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
EUR 190.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 27/7/2021	190.281	0,04	OBLIGATIONS			
EUR 200.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 0,125% 19/8/2024	200.276	0,04	Nouvelle-Zélande			
EUR 125.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 3,375% 27/3/2025	140.215	0,03	NZD 573.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040	467.105	0,10
EUR 356.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 1,25% 1/5/2025	367.994	0,08			467.105	0,10
EUR 200.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 1,625% 27/7/2026	213.020	0,04	Total des obligations		467.105	0,10
EUR 500.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 0,25% 26/1/2028	488.715	0,10	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		467.105	0,10
EUR 400.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 1,00% 18/3/2033	395.956	0,08	Organismes de placement collectif			
EUR 475.000	International Business Machines Corp 1,25% 29/1/2027	503.490	0,10	Irlande			
EUR 450.000	International Business Machines Corp 0,65% 11/2/2032	446.235	0,09	130.577	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ⁻	12.906.706	2,66
EUR 425.000	International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026	455.460	0,09			12.906.706	2,66
EUR 200.000	JPMorgan Chase & Co RegS 0,625% 25/1/2024	203.856	0,04	Total des organismes de placement collectif		12.906.706	2,66
EUR 200.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 25/7/2031	204.558	0,04	Portefeuille de titres à la valeur de marché		467.368.352	96,23
EUR 450.000	Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027	465.867	0,10	Autres éléments de l'actif net		18.334.817	3,77
EUR 300.000	Morgan Stanley 1,875% 30/3/2023	311.643	0,06	Total de l'actif net (EUR)		485.703.169	100,00
EUR 450.000	Morgan Stanley FRN 26/7/2024	457.060	0,09	^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt. - Investissement dans un fonds de partie liée.			
EUR 350.000	Morgan Stanley FRN 29/10/2027	349.517	0,07				
EUR 100.000	Morgan Stanley FRN 26/10/2029	98.866	0,02				
EUR 625.000	National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023	636.706	0,13				
USD 300.000	Oracle Corp 2,875% 25/3/2031	251.762	0,05				
EUR 250.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0,125% 1/3/2025	250.912	0,05				
USD 159.150	United States Treasury Inflation Indexed Bond 1,00% 15/2/2048	168.121	0,04				
EUR 115.000	US Bancorp 0,85% 7/6/2024	118.197	0,03				
EUR 300.000	Verizon Communications Inc 0,875% 19/3/2032	299.115	0,06				
		15.552.625	3,20				
Total des obligations		292.724.633	60,27				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-value nette non réalisée EUR
Instruments financiers dérivés			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »			
	Royaume-Uni		
(26.000)	Severn Trent Plc	Bank of America Merrill Lynch	11.472
			<hr/>
			11.472
			<hr/>
	Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 740.523)		11.472

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	EUR 493.330	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	7.359	60.702
CCILS	EUR 550.000	Fund receives Fixed 0,682% and pays Floating EUR 12 Month CPTFE	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(35.918)	(35.906)
CCILS	EUR 1.500.689	Fund receives Fixed 1,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFE	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(25.499)	(25.465)
CCILS	USD 50.000	Fund receives Fixed 2,248% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	8/1/2031	(1.749)	(1.748)
CCILS	USD 297.000	Fund receives Fixed 2,321% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	25/2/2031	(8.162)	(8.156)
CCILS	USD 500.000	Fund receives Fixed 2,338% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	11/3/2031	(12.705)	(12.695)
CCILS	USD 253.000	Fund receives Fixed 2,348% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2031	(6.232)	(6.227)
CCILS	USD 269.125	Fund receives Fixed 2,350% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(6.562)	(6.557)
CCILS	USD 387.500	Fund receives Fixed 2,350% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(9.449)	(9.441)
CCILS	USD 269.125	Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(6.467)	(6.462)
CCILS	USD 387.500	Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(9.311)	(9.304)
CCILS	USD 1.313.250	Fund receives Fixed 2,358% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(31.148)	(31.123)
CCILS	USD 1.270.000	Fund receives Fixed 2,388% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2031	(27.531)	(27.507)
CCILS	USD 350.000	Fund receives Fixed 2,432% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	6/5/2051	(4.256)	(4.242)
CCILS	USD 350.000	Fund receives Fixed 2,438% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	7/5/2051	(3.688)	(3.674)
CCILS	USD 240.000	Fund receives Fixed 2,448% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	29/3/2031	(3.700)	(3.696)
CCILS	USD 120.000	Fund receives Fixed 2,474% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2031	(1.531)	(1.529)
CCILS	USD 350.000	Fund receives Fixed 2,484% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2051	1.075	1.088
CCILS	USD 350.000	Fund receives Fixed 2,488% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2051	1.489	1.502
CCILS	USD 230.000	Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	30/3/2031	(2.345)	(2.340)
CCILS	USD 1.250.000	Fund receives Fixed 2,669% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	8.908	8.932
CCILS	GBP 460.000	Fund receives Fixed 3,202% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(21.731)	(21.719)
CCILS	GBP 575.000	Fund receives Fixed 3,270% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(21.487)	(21.472)
CCILS	GBP 340.000	Fund receives Fixed 3,285% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(11.962)	(11.953)
CCILS	GBP 575.000	Fund receives Fixed 3,290% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(19.811)	(19.796)
CCILS	GBP 340.000	Fund receives Fixed 3,293% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(11.565)	(11.556)
CCILS	GBP 1.680.000	Fund receives Fixed 3,315% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2030	(61.046)	(61.003)
CCILS	GBP 217.000	Fund receives Fixed 3,334% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(6.089)	(6.083)
CCILS	GBP 400.000	Fund receives Fixed 3,340% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(10.857)	(10.847)
CCILS	GBP 383.000	Fund receives Fixed 3,456% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2030	(12.364)	(12.354)
CCILS	GBP 540.000	Fund receives Fixed 3,475% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/10/2029	5.037	5.051

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	GBP 500.000	Fund receives Fixed 3,495% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2029	(68)	(54)
CCILS	GBP 699.000	Fund receives Fixed 3,500% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2030	(13.850)	(13.833)
CCILS	GBP 500.000	Fund receives Fixed 3,510% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2029	1.050	1.063
CCILS	GBP 290.000	Fund receives Fixed 3,625% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2031	(5.821)	(5.814)
CCILS	GBP 273.000	Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2030	(3.328)	(3.321)
CCILS	GBP 1.515.000	Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(25.468)	(25.428)
CCILS	GBP 1.180.000	Fund receives Fixed 3,658% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(18.521)	(18.490)
CCILS	GBP 208.000	Fund receives Fixed 3,700% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(1.312)	(1.968)
CCILS	GBP 365.000	Fund receives Fixed 3,730% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(1.632)	(1.820)
CCILS	GBP 417.916	Fund receives Fixed 3,756% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(415)	(403)
CCILS	GBP 182.500	Fund receives Fixed 3,758% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(151)	(146)
CCILS	GBP 360.000	Fund receives Fixed 3,773% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2029	18.821	18.830
CCILS	GBP 583.000	Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2028	30.130	30.340
CCILS	GBP 60.500	Fund receives Fixed 3,790% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	240	242
CCILS	GBP 96.000	Fund receives Fixed 3,796% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	468	470
CCILS	EUR 1.000.000	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,122%	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2021	(5.529)	(5.520)
CCILS	GBP 699.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,410%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2025	4.423	4.435
CCIRS	NZD 100.000	Fund receives Fixed 1,890% and pays Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate	Bank of America Merrill Lynch	11/5/2031	(581)	(580)
CCIRS	HUF 283.220.000	Fund receives Fixed 2,162% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2026	(5.537)	(5.525)
CCIRS	EUR 320.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,032%	Bank of America Merrill Lynch	9/4/2031	2.840	2.846
CCIRS	EUR 37.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,172%	Bank of America Merrill Lynch	12/4/2052	3.797	3.798
CCIRS	EUR 350.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,473%	Bank of America Merrill Lynch	29/4/2041	2.488	2.499
CCIRS	EUR 182.247	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533%	Bank of America Merrill Lynch	4/12/2049	(256)	(249)
CCIRS	EUR 420.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,568%	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2047	(3.484)	(3.468)
CCIRS	EUR 429.440	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,663%	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2039	(14.157)	(14.145)
CCIRS	SEK 8.000.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,824%	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2031	685	701
CCIRS	USD 590.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,570%	Bank of America Merrill Lynch	11/3/2031	(1.703)	(1.694)
CCIRS	USD 1.570.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,650%	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	(13.846)	(12.581)
CCIRS	USD 280.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,680%	Bank of America Merrill Lynch	30/3/2031	(3.085)	(3.080)
CCIRS	USD 132.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,860%	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2028	(11.993)	(11.991)
CCIRS	USD 1.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,972%	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2027	(91.966)	(91.950)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,974%	Bank of America Merrill Lynch	3/5/2028	(19.507)	(19.504)
CDS	EUR 185.000	Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2021	4.978	(96)
CDS	EUR 185.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Air Liquide SA	Barclays Bank Plc	20/6/2021	(4.512)	94
CDS	EUR 24.500	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas	Barclays Bank Plc	20/6/2022	156	230
CDS	EUR 50.000	Fund receives default protection on Barclays Bank Plc and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2021	(3.371)	(20)
CDS	EUR 295.000	Fund receives default protection on Peugeot SA and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2025	(24.690)	(47.863)
CDS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on ING Bank NV	BNP Paribas	20/6/2021	(1.389)	52
CDS	EUR 92.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas	Citibank	20/6/2022	539	864
CDS	EUR 73.220	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas	Citibank	20/6/2022	466	688
CDS	EUR 85.887	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas	Citibank	20/6/2022	503	807
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1	Deutsche Asset Management Life	20/12/2021	(1.333)	787
CDS	EUR 81.000	Fund receives default protection on CNH Industrial NV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	(4.302)	(14.245)
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Barclays Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(3.070)	(4.319)
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Barclays Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(2.967)	(4.319)
CDS	EUR 85.000	Fund receives default protection on CNH Industrial Finance Europe SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2025	(4.515)	(14.948)
CDS	EUR 84.000	Fund receives default protection on CNH Industrial NV and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2025	(4.709)	(14.772)
CDS	EUR 400.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(6.290)	(10.785)
CDS	EUR 400.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(6.085)	(10.784)
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Royal Bank of Scotland Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(2.928)	(4.597)
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Royal Bank of Scotland Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(2.826)	(4.597)
IRS	EUR 430.143	Fund receives Fixed -0,012% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/3/2031	(5.388)	(5.380)
IRS	GBP 420.000	Fund receives Fixed 0,766% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2031	185	6
IRS	GBP 10.000	Fund receives Fixed 0,786% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	31/3/2031	23	24
IRS	GBP 840.000	Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	7/12/2030	2.006	2.025
IRS	EUR 4.100.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	23/6/2030	78.480	78.559
IRS	EUR 70.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	25/9/2050	10.405	10.408
IRS	EUR 110.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,018%	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2061	20.275	20.279
IRS	EUR 104.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,025%	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2061	19.428	19.432
IRS	EUR 510.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,204%	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2031	15.450	15.459
IRS	EUR 222.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,234%	Bank of America Merrill Lynch	14/1/2031	7.340	7.344

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
IRS	EUR 860.286	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,336%	Bank of America Merrill Lynch	4/3/2026	2.688	2.699
IRS	EUR 134.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,357%	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2028	2.134	2.137
IRS	GBP 295.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed -0,043%	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2025	7.046	7.050
IRS	GBP 253.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,092%	Bank of America Merrill Lynch	10/12/2026	6.948	6.555
IRS	GBP 150.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,933%	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2051	127	(242)
IRS	GBP 10.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,947%	Bank of America Merrill Lynch	31/3/2051	(58)	(58)
IRS	GBP 193.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR SONIO and pays Fixed 0,168%	Bank of America Merrill Lynch	24/11/2026	4.018	3.988
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 44.328.812)					(421.803)	(429.458)

CCCDs: Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)
 CCILS: Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)
 CCIRS: Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)
 CDS: Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)
 IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
29	EUR	3 Month Euribor Futures December 2022	Décembre 2022	7.282.987	725
2.070	EUR	Enel SpA Futures December 2021	Décembre 2021	745.200	62.100
20	EUR	Euro BOBL Futures June 2021	Juin 2021	2.693.600	4.130
35	EUR	Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	5.154.800	(3.120)
(78)	EUR	Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	11.487.840	56.147
6	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	1.018.860	(770)
(79)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	13.414.990	19.961
21	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	4.221.840	(80.823)
(23)	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	4.623.920	133.730
40	EUR	Euro Schatz Futures June 2021	Juin 2021	4.481.600	(2.480)
(11)	EUR	Euro Schatz Futures June 2021	Juin 2021	1.232.440	385
(17)	EUR	EURO STOXX 50 Index Futures June 2021	Juin 2021	689.010	(50.065)
162	EUR	EURO STOXX Bank Index Futures June 2021	Juin 2021	797.040	45.468
45	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	Juin 2021	7.214.400	(41.140)
(35)	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	Juin 2021	5.611.200	1.560
(6)	EUR	Euro-OAT Futures September 2021	Septembre 2021	948.960	730
8	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2021	Juin 2021	652.396	34.090
3.764	EUR	Iberdrola SA Futures December 2021	Décembre 2021	1.562.060	178.790
(6)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	6.791.688	(1.196)
1.703	EUR	Repsol SA Futures December 2021	Décembre 2021	519.415	(902.590)
35	EUR	Short Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	3.959.200	3.720
56	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	Septembre 2021	8.273.960	16.906
(23)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	Septembre 2021	3.398.233	(2.044)
(2)	USD	US Long Bond Futures September 2021	Septembre 2021	256.063	1.116
(102)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	12.096.770	28.645
(33)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	3.564.249	8.753
7	USD	US Treasury 5 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	710.122	(445)
(2)	USD	US Treasury 5 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	202.892	165

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
3	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	454.154	(1.710)
(18)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	2.724.925	10.977
Total				116.784.814	(478.285)

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
4.850.000	Call	OTC USD/CAD	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,28	23/06/2021	(32.005)	270
1.490.000	Call	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0,89	06/08/2021	(19.711)	2.326
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 6.318)						(51.716)	2.596

Valeur nominale	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(1.492.696)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0,11% Fixed annually from 14/1/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	(31.923)	(54.277)
(1.492.696)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022; and pays -0,11% Fixed annually from 14/1/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	17.340	(5.013)
(2.925.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/10/2021; and pays 0,92% Fixed semi-annually from 26/7/2021	BNP Paribas	USD 0,92	26/07/2021	15.867	(361)
(2.570.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021; and pays 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021	JP Morgan	USD 1,12	08/09/2021	(321)	(22.553)
(2.570.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021	JP Morgan	USD 1,13	08/09/2021	14.380	(7.853)
(4.580.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023; and pays 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	8.459	(142.987)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(4.580.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	4.595	(145.386)
(18.180.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,45% Fixed annually from 19/5/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 23/11/2022	Citibank	EUR 0,00	19/05/2022	11.913	(39.536)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 9.884.397)						40.310	(417.966)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	930.000	EUR	597.671	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	(8.255)
BRL	280.000	USD	49.701	Barclays Bank	16/6/2021	3.215
CHF	28.915.000	EUR	26.379.449	Goldman Sachs	2/6/2021	(67.009)
CHF	70.000	EUR	63.515	HSBC	15/7/2021	202
CHF	1.440.000	EUR	1.313.579	Royal Bank of Canada	15/7/2021	(2.828)
CHF	1.750.000	EUR	1.586.939	Chartered Bank	15/7/2021	5.987
CNH	6.540.000	USD	1.000.459	Goldman Sachs	16/6/2021	20.804
CNH	500.000	USD	76.252	Natwest Markets	16/6/2021	1.784
CZK	23.716.000	EUR	932.034	Morgan Stanley	2/6/2021	(241)
CZK	28.920.000	EUR	1.107.751	Chartered Bank	15/7/2021	27.486
DKK	54.980.000	EUR	7.392.976	Goldman Sachs	2/6/2021	214
EUR	742.095	AUD	1.160.000	HSBC	15/7/2021	6.911
EUR	26.237.557	CHF	28.915.000	Goldman Sachs	2/6/2021	(74.884)
EUR	25.709.296	CHF	28.175.000	Goldman Sachs	2/7/2021	65.221
EUR	90.576	CHF	100.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(449)
EUR	1.391.879	CHF	1.530.000	HSBC	15/7/2021	(794)
EUR	917.888	CZK	23.716.000	Morgan Stanley	2/6/2021	(13.905)
EUR	931.478	CZK	23.716.000	Morgan Stanley	2/7/2021	243
EUR	7.393.074	DKK	54.980.000	Morgan Stanley	2/6/2021	(117)
EUR	7.392.051	DKK	54.980.000	Goldman Sachs	2/7/2021	(201)
EUR	744.784	DKK	5.540.000	JP Morgan	15/7/2021	(69)
EUR	2.589.055	DKK	19.260.000	Toronto Dominion Bank	15/7/2021	(451)
EUR	76.169.930	GBP	66.236.000	Goldman Sachs	2/6/2021	(736.329)
EUR	1.859.256	GBP	1.620.000	Chartered Bank	2/6/2021	(21.717)
EUR	77.319.402	GBP	66.436.000	JP Morgan	2/7/2021	222.511
EUR	178.605	GBP	155.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(1.224)
EUR	634.497	GBP	550.000	Barclays Bank	15/7/2021	(3.607)
EUR	126.830	GBP	110.000	BNP Paribas	15/7/2021	(791)
EUR	6.192.399	GBP	5.370.000	Goldman Sachs	15/7/2021	(37.811)
EUR	23.139	GBP	20.000	HSBC	15/7/2021	(65)
EUR	229.937	GBP	200.000	JP Morgan	15/7/2021	(2.101)
EUR	23.092	GBP	20.000	Morgan Stanley	15/7/2021	(111)
EUR	69.464	GBP	60.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	(147)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	347.668	GBP	300.000	Societe Generale	15/7/2021	(389)
EUR	843.992	GBP	730.000	Standard Chartered Bank	15/7/2021	(2.946)
EUR	682.174	HUF	246.305.000	The Bank of New York Mellon	2/6/2021	(26.382)
EUR	1.103.972	HUF	405.640.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(62.408)
EUR	707.411	HUF	246.305.000	Morgan Stanley	2/7/2021	(413)
EUR	214.223	IDR	3.725.980.000	HSBC	16/6/2021	254
EUR	579.167	JPY	75.510.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	15.119
EUR	235.399	MXN	5.930.000	Natwest Markets	16/6/2021	(8.268)
EUR	2.635.566	NOK	26.149.000	Morgan Stanley	2/6/2021	68.095
EUR	811.594	NOK	8.300.000	JP Morgan	16/6/2021	(3.158)
EUR	2.566.052	NOK	26.149.000	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(101)
EUR	599.264	NOK	6.070.000	Barclays Bank	15/7/2021	3.720
EUR	44.782	NOK	450.000	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	631
EUR	2.070.998	NZD	3.510.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(17.538)
EUR	35.827	NZD	60.000	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	125
EUR	2.114.130	PLN	9.661.000	Morgan Stanley	2/6/2021	(40.129)
EUR	2.152.219	PLN	9.661.000	Societe Generale	2/7/2021	(1.161)
EUR	111.170	PLN	500.000	JP Morgan	15/7/2021	(255)
EUR	12.192.354	SEK	123.338.000	Bank of America Merrill Lynch	2/6/2021	4.204
EUR	12.178.366	SEK	123.338.000	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	(5.680)
EUR	1.121.795	SEK	11.450.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(9.137)
EUR	73.870	SEK	750.000	Morgan Stanley	15/7/2021	(208)
EUR	73.806	SEK	750.000	Chartered Bank	15/7/2021	(273)
EUR	238.972	USD	290.000	Morgan Stanley	2/6/2021	1.345
EUR	1.630.000	USD	1.970.727	Goldman Sachs	16/6/2021	15.613
EUR	296.130	USD	355.000	Natwest Markets	16/6/2021	5.320
EUR	238.220	USD	290.000	Bank of America Merrill Lynch	2/7/2021	732
EUR	49.691	USD	60.000	BNP Paribas	15/7/2021	568
EUR	5.567.690	USD	6.660.000	Morgan Stanley	15/7/2021	114.987

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	24.876	USD	30.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	314
EUR	8.272	USD	10.000	Standard Chartered Bank	15/7/2021	85
EUR	16.317	USD	20.000	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	(57)
GBP	600.000	EUR	696.917	Deutsche Bank	2/6/2021	(260)
GBP	66.436.000	EUR	77.360.907	JP Morgan	2/6/2021	(222.430)
GBP	820.000	EUR	943.467	Morgan Stanley	2/6/2021	8.631
GBP	440.000	EUR	505.382	Barclays Bank	15/7/2021	5.100
GBP	1.910.000	EUR	2.206.258	Citibank	15/7/2021	9.703
GBP	80.000	EUR	92.581	Goldman Sachs	15/7/2021	234
GBP	35.000	EUR	40.508	Morgan Stanley	15/7/2021	98
GBP	40.000	EUR	46.305	Standard Chartered Bank	15/7/2021	103
HUF	246.305.000	EUR	708.140	Morgan Stanley	2/6/2021	416
HUF	278.720.000	EUR	779.228	Barclays Bank	15/7/2021	21.321
IDR	441.767.542	USD	30.217	Barclays Bank	16/6/2021	616
IDR	628.800.000	USD	43.691	Citibank	16/6/2021	318
IDR	786.000.000	USD	54.376	HSBC	16/6/2021	593
IDR	8.693.650.000	USD	599.355	JP Morgan	16/6/2021	8.262
IDR	1.006.232.458	USD	68.817	UBS	16/6/2021	1.410
JPY	47.000.000	EUR	357.070	Morgan Stanley	15/7/2021	(5.987)
KRW	146.000.000	USD	130.048	BNP Paribas	16/6/2021	1.383
KRW	146.000.000	USD	130.160	Goldman Sachs	16/6/2021	1.292
KRW	438.000.000	USD	392.332	HSBC	16/6/2021	2.357
MXN	7.100.000	USD	337.625	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	15.166
NOK	26.149.000	EUR	2.567.356	Bank of America Merrill Lynch	2/6/2021	115
NOK	18.450.000	EUR	1.818.719	HSBC	16/6/2021	(7.613)
NOK	2.550.000	EUR	252.261	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(2.073)
NOK	7.040.000	EUR	697.136	Morgan Stanley	15/7/2021	(6.422)
NOK	1.380.000	USD	164.869	Citibank	16/6/2021	407
NOK	7.450.000	USD	894.783	JP Morgan	16/6/2021	(1.678)
NOK	1.770.000	USD	213.908	Morgan Stanley	16/6/2021	(1.482)
NOK	880.000	USD	105.900	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	(368)
NZD	120.000	EUR	71.709	Morgan Stanley	15/7/2021	(307)
PLN	9.661.000	EUR	2.153.080	Societe Generale	2/6/2021	1.178
PLN	5.700.000	EUR	1.249.993	Citibank	15/7/2021	20.249
PLN	2.600.000	EUR	574.247	Goldman Sachs	15/7/2021	5.161
RUB	1.159.480	USD	15.365	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	342
RUB	3.130.474	USD	40.550	Citibank	16/6/2021	1.688
RUB	79.670.851	USD	1.069.970	Goldman Sachs	16/6/2021	11.829
RUB	7.329.195	USD	95.135	UBS	16/6/2021	3.788
SEK	123.338.000	EUR	12.182.320	Bank of America Merrill Lynch	2/6/2021	5.829
SEK	7.400.000	EUR	730.986	Morgan Stanley	15/7/2021	(78)
SEK	700.000	USD	83.795	Barclays Bank	16/6/2021	520
SEK	350.000	USD	41.952	Morgan Stanley	16/6/2021	215
TRY	2.140.000	USD	274.500	HSBC	16/6/2021	(20.137)
USD	290.000	EUR	238.357	Bank of America Merrill Lynch	2/6/2021	(730)
USD	1.991.713	EUR	1.630.000	BNP Paribas	16/6/2021	1.578
USD	230.000	EUR	189.925	Citibank	15/7/2021	(1.619)
USD	160.000	EUR	132.966	HSBC	15/7/2021	(1.970)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	70.000	EUR	57.944	Standard Chartered Bank	15/7/2021	(634)
USD	610.000	EUR	505.999	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	(6.577)
USD	81.795	NOK	675.000	Barclays Bank	16/6/2021	745
USD	41.269	NOK	340.000	JP Morgan	16/6/2021	432
USD	275.842	RUB	20.400.000	Barclays Bank	16/6/2021	(1.494)
USD	922.827	RUB	68.691.898	Goldman Sachs	16/6/2021	(9.951)
USD	163.269	SEK	1.380.000	Citibank	16/6/2021	(2.602)
USD	894.933	SEK	7.500.000	JP Morgan	16/6/2021	(7.915)
USD	216.540	SEK	1.800.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(461)
USD	108.657	SEK	900.000	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	87
USD	82.751	TRY	710.000	Barclays Bank	16/6/2021	(136)
USD	85.167	TRY	720.000	Credit Suisse	16/6/2021	887
						(736.790)
Catégorie d'Actions couverte en CZK						
CZK	44.682.723	EUR	1.735.946	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	19.169
EUR	160.071	CZK	4.075.445	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(10)
						19.159
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	10.340	USD	12.554	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	56
USD	624.184	EUR	516.707	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(5.376)
						(5.320)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 453.927.336)						(722.951)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	28,47
Finance	26,70
Biens de consommation non cyclique	9,30
Services aux collectivités	7,80
Valeurs industrielles	6,16
Biens de consommation cyclique	3,44
Communications	3,02
Organismes de placement collectif	2,66
Technologie	2,47
Titres hypothécaires	2,03
Fonds négociés en bourse	1,46
Matériaux de base	1,40
Énergie	0,66
Titres adossés à des actifs	0,66
Portefeuille de titres à la valeur de marché	96,23
Autres éléments de l'actif net	3,77
<hr/>	
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Unconstrained Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Danemark				Royaume-Uni			
35.360	Novo Nordisk A/S 'B'	2.291.851	4,90	226.397	Auto Trader Group Plc	1.476.268	3,15
		2.291.851	4,90	14.215	Diageo Plc	561.829	1,20
				63.043	Hargreaves Lansdown Plc [^]	1.212.906	2,59
				33.504	London Stock Exchange Group Plc	2.946.385	6,30
				16.679	Spirax-Sarco Engineering Plc	2.459.469	5,26
						8.656.857	18,50
Finlande				États-Unis			
27.815	Kone Oyj 'B'	1.844.135	3,94	3.720	ANSYS Inc	1.030.102	2,20
		1.844.135	3,94	6.289	Mastercard Inc 'A'	1.858.150	3,97
				5.672	S&P Global Inc	1.763.645	3,77
				11.449	VeriSign Inc	2.063.145	4,41
France						6.715.042	14,35
1.517	Hermes International	1.754.411	3,75	Total des actions ordinaires			
5.417	L'Oreal SA [^]	1.998.873	4,27	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
4.942	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	3.239.481	6,92	46.668.522 99,73			
2.429	Sartorius Stedim Biotech	866.910	1,85	Organismes de placement collectif			
		7.859.675	16,79	Irlande			
Allemagne				314 BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ⁻			
1.799	Rational AG	1.330.540	2,85			31.029	0,07
7.075	SAP SE	806.126	1,72	Total des organismes de placement collectif			
15.373	Symrise AG	1.675.657	3,58	31.029 0,07			
		3.812.323	8,15	Total des organismes de placement collectif			
Irlande				Portefeuille de titres à la valeur de marché			
21.081	Kingspan Group Plc	1.623.237	3,47			46.699.551	99,80
		1.623.237	3,47	Autres éléments de l'actif net			
Pays-Bas				94.204 0,20			
8.346	ASML Holding NV	4.599.480	9,83	Total de l'actif net (EUR)			
11.003	Ferrari NV	1.910.121	4,08			46.793.755	100,00
		6.509.601	13,91				
Suède							
73.866	Assa Abloy AB 'B'	1.872.289	4,00				
169.680	Hexagon AB 'B'	1.996.185	4,27				
		3.868.474	8,27				
Suisse							
2.938	Lonza Group AG Reg	1.551.734	3,31				
19.166	Nestlé SA Reg	1.935.593	4,14				
		3.487.327	7,45				

[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	83.824	GBP	72.170	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	50
GBP	1.891.382	EUR	2.179.278	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	16.271
						16.321
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	136.873	USD	166.381	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	575
USD	3.453.719	EUR	2.857.404	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(28.121)
						(27.546)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 5.244.909)						(11.225)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	23,44
Valeurs industrielles	20,94
Biens de consommation cyclique	17,60
Technologie	13,75
Finance	12,86
Communications	7,56
Matériaux de base	3,58
Organismes de placement collectif	0,07
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,80
Autres éléments de l'actif net	0,20
	100,00

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				Allemagne suite			
EUR 540.000	France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/5/2052	507.665	0,13	EUR 1.083.256	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2050 (Zero Coupon)	978.603	0,25
EUR 500.000	La Poste SA RegS 1,375% 21/4/2032	537.375	0,14	EUR 300.000	Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023	309.081	0,08
EUR 600.000	Orange SA RegS 1,25% 7/7/2027	639.930	0,17	EUR 400.000	Deutsche Bahn Finance GmbH RegS FRN (Perpetual)	398.752	0,10
EUR 800.000	Orange SA RegS FRN (Perpetual)	898.384	0,23	GBP 100.000	Deutsche Bank AG RegS 2,625% 16/12/2024	121.311	0,03
EUR 500.000	PSA Banque France SA RegS 22/1/2025 (Zero Coupon)	498.475	0,13	EUR 900.000	Deutsche Bank AG RegS FRN 17/2/2032	897.138	0,23
EUR 600.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 9/9/2027 (Zero Coupon)	591.990	0,15	EUR 300.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,125% 5/9/2024	301.362	0,08
EUR 500.000	Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon)	503.445	0,13	EUR 1.800.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 0,10% 2/2/2026	1.795.986	0,47
EUR 700.000	Societe Generale SA FRN 24/11/2030	696.451	0,18	EUR 1.376.000	E.ON SE RegS 24/10/2022 (Zero Coupon)	1.381.738	0,36
EUR 600.000	Societe Generale SA RegS FRN 1/4/2022	603.780	0,16	EUR 500.000	Eurogrid GmbH RegS 1,113% 15/5/2032	522.970	0,14
EUR 200.000	Societe Generale SA RegS 0,125% 24/2/2026	200.526	0,05	EUR 700.000	Eurogrid GmbH RegS 0,741% 21/4/2033	697.088	0,18
EUR 600.000	Societe Generale SA RegS 0,75% 25/1/2027	604.152	0,16	EUR 800.000	Evonik Industries AG RegS 0,625% 18/9/2025	818.832	0,21
EUR 2.900.000	Societe Generale SA RegS 0,125% 18/2/2028	2.857.109	0,74	EUR 5.600.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028	5.794.376	1,50
EUR 1.800.000	Societe Generale SA RegS FRN 23/2/2028	1.828.224	0,47	EUR 1.500.000	KION Group AG RegS 1,625% 24/9/2025 [^]	1.562.025	0,41
EUR 900.000	Societe Generale SA RegS FRN 22/9/2028	911.412	0,24	EUR 400.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 2,875% 28/9/2026	439.000	0,11
EUR 400.000	Societe Generale SA RegS FRN 12/6/2029	389.172	0,10	EUR 2.100.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029	2.207.457	0,57
EUR 500.000	Societe Generale SA RegS 0,875% 24/9/2029	498.030	0,13	EUR 200.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,005% 15/12/2023	200.976	0,05
EUR 2.000.000	Suez SA RegS 9/6/2026 (Zero Coupon) [^]	1.991.280	0,52	EUR 200.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,125% 16/7/2025	201.768	0,05
EUR 900.000	Suez SA RegS FRN (Perpetual)	899.856	0,23	EUR 1.847.000	Merck KGaA RegS FRN 12/12/2074	2.023.333	0,53
EUR 1.200.000	Terega SA RegS 0,875% 17/9/2030	1.203.228	0,31	EUR 1.450.000	Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,375% 20/7/2026 [^]	1.450.594	0,38
EUR 3.200.000	Thales SA RegS 26/3/2026 (Zero Coupon) [^]	3.187.072	0,83	EUR 2.400.000	ZF Finance GmbH RegS 2,75% 25/5/2027	2.484.456	0,65
EUR 1.500.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	1.649.280	0,43			37.145.322	9,64
EUR 1.150.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	1.143.848	0,30	Grèce			
EUR 600.000	UNEDIC ASSEO RegS 0,10% 25/5/2034	574.878	0,15	EUR 1.700.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 12/2/2026 (Zero Coupon)	1.691.670	0,44
EUR 200.000	Veolia Environnement SA RegS 0,672% 30/3/2022	201.198	0,05			1.691.670	0,44
EUR 300.000	Veolia Environnement SA RegS 0,80% 15/1/2032	300.654	0,08	Irlande			
EUR 4.300.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual)	4.411.499	1,14	EUR 800.000	Abbott Ireland Financing DAC RegS 0,10% 19/11/2024	805.555	0,21
EUR 1.600.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual)	1.589.440	0,41	EUR 600.000	AIB Group Plc RegS 1,50% 29/3/2023	617.496	0,16
		52.337.461	13,58	EUR 200.000	AIB Group Plc RegS FRN (Perpetual)	226.564	0,06
Allemagne				EUR 1.500.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 25/11/2025	1.540.455	0,40
EUR 2.100.000	BASF SE RegS 0,101% 5/6/2023	2.114.658	0,55	EUR 2.900.000	Eaton Capital Unlimited Co RegS 0,128% 8/3/2026	2.899.913	0,75
EUR 1.500.000	Bayer AG RegS 0,05% 12/1/2025	1.494.630	0,39	EUR 251.000	GAS Networks Ireland RegS 0,125% 4/12/2024	252.908	0,07
EUR 1.700.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	1.762.084	0,46				
EUR 1.085.560	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 0,50% 15/2/2025 [^]	1.132.576	0,29				
EUR 5.904.495	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2029 (Zero Coupon) [^]	6.054.528	1,57				

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Irlande suite				Monténégro			
EUR 1.480.000	Smurfit Kappa Treasury ULC RegS 1,50% 15/9/2027	1.555.628	0,40	EUR 601.000	Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027	558.143	0,14
EUR 400.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co RegS FRN 17/9/2050	417.548	0,11			558.143	0,14
		8.316.067	2,16	Pays-Bas			
Italie				EUR 200.000	ABN AMRO Bank NV RegS FRN (Perpetual)	214.846	0,06
EUR 1.660.000	ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028	1.711.327	0,44	EUR 300.000	Achmea Bank NV RegS 0,01% 16/6/2025	303.429	0,08
EUR 800.000	Eni SpA RegS FRN (Perpetual)	796.184	0,21	EUR 600.000	Allianz Finance II BV FRN 8/7/2041	603.570	0,16
EUR 650.000	Hera SpA RegS 0,25% 3/12/2030	626.678	0,16	EUR 1.000.000	Athora Netherlands NV RegS FRN 15/7/2031	1.017.830	0,26
EUR 100.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,75% 4/12/2024	102.386	0,03	EUR 600.000	BMW Finance NV RegS 0,625% 6/10/2023	612.306	0,16
EUR 871.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,925% 14/10/2030	916.510	0,24	EUR 350.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 0,625% 1/12/2022	355.061	0,09
EUR 2.575.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,35% 24/2/2031	2.521.106	0,65	EUR 2.000.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 1,125% 22/5/2026	2.105.920	0,55
EUR 1.225.000	Snam SpA RegS 15/8/2025 (Zero Coupon)	1.223.297	0,32	EUR 300.000	EDP Finance BV RegS 2,625% 18/1/2022	305.748	0,08
EUR 513.000	Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030	518.807	0,14	EUR 2.700.000	EDP Finance BV RegS 1,125% 12/2/2024	2.790.909	0,72
EUR 2.619.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA RegS 0,75% 24/7/2032	2.598.179	0,67	EUR 900.000	EDP Finance BV RegS 2,00% 22/4/2025	969.606	0,25
EUR 200.000	UniCredit SpA RegS FRN 25/6/2025	205.802	0,05	EUR 684.000	EDP Finance BV RegS 1,875% 13/10/2025	738.638	0,19
EUR 1.725.000	UniCredit SpA RegS 1,80% 20/1/2030*	1.772.489	0,46	EUR 2.625.000	ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN (Perpetual)	2.819.932	0,73
		12.992.765	3,37	EUR 1.450.000	Enel Finance International NV RegS 1,966% 27/1/2025	1.556.764	0,40
Japon				EUR 1.200.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	1.206.180	0,31
EUR 1.900.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040	1.990.915	0,52	EUR 3.300.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	3.381.114	0,88
		1.990.915	0,52	EUR 800.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	871.192	0,23
Luxembourg				EUR 1.000.000	ING Groep NV RegS FRN 3/9/2025	1.001.020	0,26
EUR 1.100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0,632% 4/6/2023	1.115.576	0,29	EUR 300.000	ING Groep NV RegS FRN 15/2/2029	316.785	0,08
EUR 600.000	GELF Bond Issuer I SA RegS 1,625% 20/10/2026	639.540	0,17	EUR 1.700.000	ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029	1.660.441	0,43
EUR 600.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 2,50% 9/10/2024*	648.498	0,17	EUR 1.500.000	ING Groep NV RegS FRN 26/5/2031	1.590.420	0,41
EUR 400.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,625% 7/4/2026	426.352	0,11	GBP 210.000	innogy Finance BV RegS 6,25% 3/6/2030	327.985	0,09
EUR 800.000	Medtronic Global Holdings SCA 0,25% 2/7/2025	808.960	0,21	EUR 2.000.000	Koninklijke DSM NV RegS 0,625% 23/6/2032	2.014.760	0,52
EUR 650.000	Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2025 (Zero Coupon)	649.461	0,17	EUR 2.320.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	2.592.345	0,67
EUR 1.300.000	Medtronic Global Holdings SCA 1,00% 2/7/2031	1.339.091	0,35	EUR 400.000	Redexis Gas Finance BV RegS 1,875% 28/5/2025	424.248	0,11
EUR 650.000	Novartis Finance SA RegS 23/9/2028 (Zero Coupon)	639.340	0,17	EUR 247.000	Repsol International Finance BV RegS FRN (Perpetual)	269.872	0,07
EUR 1.550.000	SES SA RegS FRN (Perpetual)	1.557.750	0,40	EUR 300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 20/2/2023 (Zero Coupon)	301.803	0,08
EUR 747.000	SIG Combibloc PurchaseCo Sarl RegS 2,125% 18/6/2025	789.676	0,20	EUR 1.000.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,375% 5/6/2026	1.021.690	0,27
EUR 2.400.000	Traton Finance Luxembourg SA RegS 1,25% 24/3/2033	2.393.424	0,62	EUR 1.900.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 0,90% 28/2/2028	1.998.895	0,52
		11.007.668	2,86	EUR 400.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	407.936	0,11
Mexique							
USD 240.000	Mexico Government International Bond 3,75% 19/4/2071	177.195	0,05				
		177.195	0,05				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Espagne suite			
EUR 1.100.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	1.132.395	0,29	EUR 1.500.000	CaixaBank SA RegS FRN 10/7/2026	1.532.055	0,40
EUR 800.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	857.096	0,22	GBP 500.000	CaixaBank SA RegS FRN 3/12/2026	580.994	0,15
EUR 1.375.000	TenneT Holding BV RegS 0,50% 9/6/2031	1.367.740	0,36	EUR 300.000	Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033	291.474	0,08
EUR 5.240.000	TenneT Holding BV RegS FRN (Perpetual)	5.411.558	1,40	EUR 1.100.000	Iberdrola Finanzas SA RegS 0,875% 16/6/2025	1.140.920	0,30
		42.550.034	11,04	EUR 500.000	Telefonica Emisiones SA RegS 1,477% 14/9/2021	502.650	0,13
Nouvelle-Zélande				Supranational			
EUR 610.000	ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031	609.677	0,16	EUR 900.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc RegS 2,00% 1/9/2028	900.855	0,24
NZD 146.000	Auckland Council RegS 2,95% 28/9/2050	75.154	0,02	EUR 200.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061	165.028	0,04
EUR 2.350.000	Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023	2.413.309	0,63			1.065.883	0,28
EUR 225.000	Chorus Ltd RegS 0,875% 5/12/2026	231.174	0,06	Suède			
NZD 390.000	Housing New Zealand Ltd RegS 1,534% 10/9/2035	198.404	0,05	EUR 700.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024	705.642	0,18
NZD 475.000	New Zealand Government Bond 1,75% 15/5/2041	243.646	0,06	EUR 2.700.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028	2.773.440	0,72
		3.771.364	0,98	EUR 600.000	Swedbank AB RegS 0,30% 6/9/2022	605.424	0,16
Norvège						4.084.506	1,06
EUR 350.000	DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023	352.642	0,09	Suisse			
EUR 200.000	Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon)	201.148	0,05	EUR 1.850.000	Credit Suisse AG RegS 0,25% 5/1/2026	1.851.480	0,48
		553.790	0,14	EUR 600.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 17/7/2025	615.432	0,16
Portugal				EUR 500.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 24/6/2027	509.025	0,13
EUR 500.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 20/7/2080	500.055	0,13	EUR 1.200.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028	1.195.680	0,31
EUR 136.790	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052	122.671	0,03	EUR 875.000	Credit Suisse Group AG RegS 0,625% 18/1/2033	811.598	0,21
EUR 543.566	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VII RegS 0,70% 12/2/2024	542.430	0,14	EUR 600.000	UBS AG RegS 0,75% 21/4/2023	611.502	0,16
		1.165.156	0,30	EUR 600.000	UBS Group AG RegS FRN 20/9/2022	601.062	0,16
Singapour				USD 300.000	UBS Group AG RegS FRN (Perpetual)	265.319	0,07
EUR 2.962.000	DBS Group Holdings Ltd RegS FRN 11/4/2028	3.030.452	0,79			6.461.098	1,68
EUR 3.500.000	Temasek Financial I Ltd RegS 0,50% 20/11/2031^	3.487.750	0,90	Royaume-Uni			
		6.518.202	1,69	EUR 1.075.000	AstraZeneca Plc RegS 0,375% 3/6/2029	1.069.087	0,28
Slovénie				EUR 1.500.000	Barclays Plc RegS FRN 9/6/2025	1.524.390	0,39
EUR 269.000	Slovenia Government Bond RegS 0,488% 20/10/2050	234.113	0,06	GBP 150.000	Barclays Plc RegS 3,00% 8/5/2026	187.035	0,05
		234.113	0,06	EUR 4.806.000	BAT International Finance Plc RegS 0,875% 13/10/2023	4.887.558	1,27
Espagne				GBP 100.000	BAT International Finance Plc RegS 4,00% 4/9/2026	127.701	0,03
EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,625% 17/1/2022	201.360	0,05	GBP 2.425.000	Bellis Acquisition Co Plc RegS 3,25% 16/2/2026	2.819.174	0,73
EUR 800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,375% 15/11/2026	807.520	0,21	EUR 500.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,594% 3/7/2028	540.425	0,14
EUR 1.000.000	Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027	1.030.190	0,27	EUR 1.800.000	BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual)	1.930.806	0,50
EUR 500.000	Banco de Sabadell SA RegS 2,50% 15/4/2031	501.735	0,13	GBP 420.000	BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual)	515.256	0,13
EUR 800.000	Bankia SA RegS 0,75% 9/7/2026	818.464	0,21				
EUR 500.000	CaixaBank SA RegS 0,875% 25/3/2024	513.040	0,13				
EUR 1.000.000	CaixaBank SA RegS 0,375% 3/2/2025	1.009.340	0,26				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché EUR	% de l'actif net			Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
EUR 600.000	British Telecommunications Plc RegS 0,875% 26/9/2023	613.302	0,16	GBP 1.300.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc RegS 2,75% 27/4/2030*	1.606.162	0,42
GBP 400.000	BUPA Finance Plc RegS 5,00% 8/12/2026	541.887	0,14	GBP 94.921	Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040	146.335	0,04
EUR 2.325.000	Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030	2.319.443	0,60	GBP 574.000	Tritax Big Box REIT Plc RegS 1,50% 27/11/2033	635.311	0,16
EUR 1.225.000	Chanel Ceres Plc RegS 0,50% 31/7/2026	1.233.465	0,32	GBP 250.000	United Kingdom Gilt RegS 0,625% 22/10/2050	242.370	0,06
EUR 1.825.000	Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031	1.816.897	0,47	GBP 200.000	Yorkshire Water Finance Plc RegS FRN 22/3/2046	240.203	0,06
EUR 250.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	254.807	0,07			47.378.527	12,29
GBP 100.000	Dignity Finance Plc RegS 4,696% 31/12/2049	108.251	0,03	États-Unis			
EUR 1.050.000	DS Smith Plc RegS 0,875% 12/9/2026	1.071.672	0,28	EUR 1.640.000	AbbVie Inc 1,375% 17/5/2024	1.702.960	0,44
EUR 225.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon)	226.206	0,06	EUR 1.000.000	AbbVie Inc 1,25% 1/6/2024	1.035.020	0,27
EUR 104.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 27/9/2022	104.210	0,03	EUR 1.650.000	Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032	1.672.506	0,43
EUR 800.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2026	800.672	0,21	USD 1.024.000	Amazon.com Inc 2,70% 3/6/2060	749.277	0,19
EUR 1.500.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2031	1.484.130	0,38	USD 2.126.000	Apple Inc 2,55% 20/8/2060	1.528.514	0,40
EUR 775.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc RegS 2,50% 15/1/2026	778.929	0,20	USD 1.200.000	Apple Inc 2,80% 8/2/2061	899.666	0,23
EUR 475.000	Motability Operations Group Plc RegS 0,125% 20/7/2028	469.632	0,12	GBP 200.000	AT&T Inc 4,375% 14/9/2029	276.407	0,07
GBP 393.000	National Grid Electricity Transmission Plc RegS 2,00% 16/9/2038	446.020	0,12	EUR 200.000	AT&T Inc 2,45% 15/3/2035	221.370	0,06
GBP 200.000	National Grid Electricity Transmission Plc RegS 2,00% 17/4/2040	223.678	0,06	GBP 585.000	Bank of America Corp RegS FRN 2/6/2029	681.135	0,18
EUR 725.000	Nationwide Building Society RegS 0,25% 22/7/2025	731.590	0,19	EUR 800.000	Bank of America Corp RegS FRN 9/5/2030	842.650	0,22
EUR 150.000	Nationwide Building Society RegS 0,50% 5/5/2041	146.219	0,04	EUR 1.025.000	Bank of America Corp RegS FRN 26/10/2031	1.005.295	0,26
EUR 500.000	Natwest Group Plc RegS FRN 8/3/2023	508.220	0,13	EUR 3.975.000	Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032	4.023.972	1,04
EUR 800.000	Natwest Group Plc RegS 2,50% 22/3/2023	837.448	0,22	EUR 2.847.000	Becton Dickinson and Co 1,401% 24/5/2023	2.927.741	0,76
EUR 500.000	Natwest Group Plc RegS FRN 2/3/2026	526.835	0,14	USD 2.092.000	Becton Dickinson and Co 2,823% 20/5/2030	1.775.909	0,46
GBP 4.925.000	Natwest Group Plc RegS FRN 28/11/2031	5.718.677	1,48	EUR 1.475.000	Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025	1.478.156	0,38
GBP 563.000	NGG Finance Plc RegS FRN 18/6/2073	731.323	0,19	EUR 650.000	Chubb INA Holdings Inc 0,30% 15/12/2024	655.935	0,17
EUR 1.400.000	NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079	1.410.976	0,37	EUR 810.000	Citigroup Inc RegS 0,50% 29/1/2022	814.795	0,21
EUR 810.000	NGG Finance Plc RegS FRN 5/9/2082	816.156	0,21	EUR 1.050.000	Citigroup Inc RegS 0,75% 26/10/2023	1.070.800	0,28
EUR 1.500.000	OTE Plc RegS 2,375% 18/7/2022^	1.544.235	0,40	EUR 500.000	Citigroup Inc RegS FRN 8/10/2027	502.009	0,13
EUR 2.100.000	OTE Plc RegS 0,875% 24/9/2026^	2.150.001	0,56	EUR 1.475.000	Coca-Cola Co 0,125% 9/3/2029	1.450.338	0,38
GBP 400.000	Rolls-Royce Plc 3,375% 18/6/2026	463.277	0,12	EUR 2.800.000	Coca-Cola Co 0,375% 15/3/2033	2.673.980	0,69
EUR 500.000	Sky Ltd RegS 2,50% 15/9/2026	563.390	0,15	EUR 1.100.000	Comcast Corp 0,75% 20/2/2032	1.098.702	0,29
GBP 200.000	SP Transmission Plc RegS 2,00% 13/11/2031	237.376	0,06	EUR 1.100.000	Equinix Inc 0,25% 15/3/2027	1.090.529	0,28
USD 865.000	Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025	714.858	0,18	EUR 700.000	Fidelity National Information Services Inc 0,125% 3/12/2022	703.241	0,18
EUR 1.200.000	Swiss Re Finance UK Plc RegS FRN 4/6/2052	1.312.932	0,34	EUR 150.000	Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023	152.444	0,04
				EUR 562.000	Fidelity National Information Services Inc 1,10% 15/7/2024	580.091	0,15
				EUR 900.000	Fidelity National Information Services Inc 0,625% 3/12/2025	918.792	0,24
				EUR 1.734.000	Fidelity National Information Services Inc 1,50% 21/5/2027	1.836.913	0,48

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				Irlande suite			
EUR 150.000	Fidelity National Information Services Inc 1,00% 3/12/2028	153.832	0,04	EUR 17.869	iShares EUR Corp Bond Large Cap UCITS ETF ⁻	2.498.466	0,65
EUR 1.000.000	Fiserv Inc 0,375% 1/7/2023	1.009.510	0,26	EUR 12.498	iShares Euro Dividend UCITS ETF ⁻	262.708	0,07
EUR 285.000	Fiserv Inc 1,125% 1/7/2027	297.071	0,08			5.924.188	1,54
GBP 200.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,535% 6/3/2025	247.313	0,06	Total des Fonds négociés en bourse		5.924.188	1,54
EUR 500.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 3,25% 1/2/2023	528.750	0,14	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		343.985.539	89,25
EUR 690.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 21/4/2023	691.577	0,18	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
EUR 1.200.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024	1.200.924	0,31	OBLIGATIONS			
EUR 500.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 1,375% 15/5/2024	513.705	0,13	Nouvelle-Zélande			
EUR 300.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 2,875% 3/6/2026	338.739	0,09	NZD 125.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040	101.899	0,03
EUR 1.150.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 0,25% 26/1/2028	1.124.044	0,29			101.899	0,03
EUR 700.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 2,00% 1/11/2028	769.608	0,20	Total des obligations		101.899	0,03
EUR 275.000	Honeywell International Inc 0,75% 10/3/2032	278.501	0,07	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		101.899	0,03
EUR 500.000	International Business Machines Corp 0,875% 31/1/2025	517.680	0,13	Organismes de placement collectif			
EUR 830.000	International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026	889.486	0,23	Irlande			
EUR 400.000	JPMorgan Chase & Co RegS 2,75% 24/8/2022	415.524	0,11	77.886	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ⁻	7.698.488	2,00
GBP 350.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2026	407.139	0,11			7.698.488	2,00
EUR 800.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 24/2/2028	799.842	0,21	Total des organismes de placement collectif		7.698.488	2,00
EUR 350.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 25/7/2031	357.977	0,09	Portefeuille de titres à la valeur de marché		351.785.926	91,28
EUR 4.000.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 4/11/2032	4.079.080	1,06	Autres éléments de l'actif net		33.614.483	8,72
GBP 215.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2033	250.424	0,07	Total de l'actif net (EUR)		385.400.409	100,00
EUR 1.400.000	Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027	1.449.364	0,38	^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt. - Investissement dans un fonds de partie liée.			
EUR 1.200.000	McDonald's Corp RegS 1,00% 15/11/2023	1.234.848	0,32				
EUR 1.000.000	Morgan Stanley 1,875% 30/3/2023	1.038.810	0,27				
EUR 800.000	Morgan Stanley FRN 23/10/2026	838.616	0,22				
EUR 4.346.000	Morgan Stanley FRN 26/10/2029	4.296.716	1,11				
USD 3.195.000	Oracle Corp 2,875% 25/3/2031	2.681.270	0,70				
USD 1.200.000	United States Treasury Note/Bond 1,125% 15/8/2040	819.601	0,21				
EUR 700.000	Verizon Communications Inc 1,25% 8/4/2030	735.455	0,19				
		62.334.553	16,17				
Total des obligations		336.825.104	87,39				
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE							
Irlande							
EUR 28.331	iShares EUR Corp Bond 1-5yr UCITS ETF ^{-^}	3.163.014	0,82				

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »			
Portugal			
(39.005)	EDP - Energias de Portugal SA	Bank of America Merrill Lynch	(6.397)
			(6.397)
Suède			
(25.671)	Volvo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1.142
			1.142
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 739.211)			(5.255)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	USD 9.000.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Asia HJ IG Series 24 Version 1	Credit Suisse	20/6/2026	20.841	51.985
CCCDs	EUR 2.466.650	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1	Credit Suisse	20/12/2025	36.793	303.510
CCILS	EUR 585.734	Fund receives Fixed 1,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFE	Credit Suisse	15/4/2031	(9.951)	(9.939)
CCILS	USD 478.500	Fund receives Fixed 2,321% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	25/2/2031	(13.149)	(13.141)
CCILS	USD 414.000	Fund receives Fixed 2,348% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	8/3/2031	(10.197)	(10.190)
CCILS	USD 442.062	Fund receives Fixed 2,350% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	5/3/2031	(10.779)	(10.771)
CCILS	USD 442.063	Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	5/3/2031	(10.622)	(10.614)
CCILS	USD 884.125	Fund receives Fixed 2,358% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	5/3/2031	(20.968)	(20.953)
CCILS	USD 830.000	Fund receives Fixed 2,388% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	17/2/2031	(17.991)	(17.977)
CCILS	USD 205.000	Fund receives Fixed 2,432% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	6/5/2051	(2.477)	(2.471)
CCILS	USD 205.000	Fund receives Fixed 2,438% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	7/5/2051	(2.158)	(2.152)
CCILS	USD 390.000	Fund receives Fixed 2,448% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	29/3/2031	(6.012)	(6.006)
CCILS	USD 190.000	Fund receives Fixed 2,474% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	6/4/2031	(2.424)	(2.420)
CCILS	USD 205.000	Fund receives Fixed 2,484% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	4/5/2051	631	637
CCILS	USD 205.000	Fund receives Fixed 2,488% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Credit Suisse	4/5/2051	874	880
CCILS	GBP 70.000	Fund receives Fixed 3,202% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(3.307)	(3.305)
CCILS	GBP 87.500	Fund receives Fixed 3,270% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(3.270)	(3.267)
CCILS	GBP 40.000	Fund receives Fixed 3,285% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(1.407)	(1.406)
CCILS	GBP 87.500	Fund receives Fixed 3,290% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(3.015)	(3.012)
CCILS	GBP 40.000	Fund receives Fixed 3,293% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(1.361)	(1.360)
CCILS	GBP 450.000	Fund receives Fixed 3,315% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/5/2030	(16.351)	(16.340)
CCILS	GBP 60.000	Fund receives Fixed 3,340% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(1.628)	(1.627)
CCILS	GBP 470.000	Fund receives Fixed 3,372% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/3/2030	(10.515)	(10.504)
CCILS	GBP 666.000	Fund receives Fixed 3,500% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/9/2030	(13.195)	(13.180)
CCILS	GBP 860.000	Fund receives Fixed 3,625% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/2/2031	(17.261)	(17.241)
CCILS	GBP 916.000	Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/4/2031	(15.396)	(15.374)
CCILS	GBP 620.000	Fund receives Fixed 3,658% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/4/2031	(9.730)	(9.715)
CCILS	GBP 659.000	Fund receives Fixed 3,730% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/5/2031	(2.923)	(3.286)
CCILS	GBP 164.084	Fund receives Fixed 3,756% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/4/2031	(162)	(158)
CCILS	GBP 295.000	Fund receives Fixed 3,7580% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/5/2031	(243)	(236)
CCILS	GBP 99.000	Fund receives Fixed 3,7900% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/5/2031	393	396

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	GBP 158.000	Fund receives Fixed 3,7960% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Credit Suisse	15/5/2031	770	774
CCILS	GBP 666.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,410%	Credit Suisse	15/9/2025	4.213	4.225
CCIRS	EUR 200.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,014%	Credit Suisse	13/5/2034	7.606	7.610
CCIRS	EUR 2.630.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,214%	Credit Suisse	15/8/2028	(55.697)	(55.652)
CCIRS	EUR 2.500.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,246%	Credit Suisse	18/6/2029	(52.539)	(52.496)
CCIRS	EUR 150.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,473%	Credit Suisse	29/4/2041	1.068	1.071
CCIRS	EUR 421.194	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533%	Credit Suisse	4/12/2049	(588)	(576)
CCIRS	EUR 8.800.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,5750%	Credit Suisse	24/5/2051	(133.253)	(133.006)
CDS	EUR 485.000	Fund receives default protection on Peugeot SA and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2025	(40.592)	(78.690)
CDS	EUR 193.000	Fund receives default protection on CNH Industrial NV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	(10.251)	(33.941)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Barclays Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(15.351)	(21.597)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Barclays Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(14.836)	(21.597)
CDS	EUR 205.000	Fund receives default protection on CNH Industrial Finance Europe SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2025	(10.888)	(36.051)
CDS	EUR 202.000	Fund receives default protection on CNH Industrial NV and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2025	(11.323)	(35.524)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(15.724)	(26.961)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(15.211)	(26.961)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Royal Bank of Scotland Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(14.643)	(22.985)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Royal Bank of Scotland Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(14.129)	(22.985)
IRS	CNY 40.000.000	Fund receives Fixed 2,716% and pays Floating CNY 12 Month UKRPI CNRR	BNP Paribas	26/8/2025	2.610	2.610
IRS	EUR 899.168	Fund receives Fixed -0,012% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Credit Suisse	4/3/2031	(11.261)	(11.246)
IRS	EUR 7.200.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Credit Suisse	23/6/2030	137.833	137.957
IRS	EUR 200.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,018%	Credit Suisse	21/1/2061	36.865	36.871
IRS	EUR 1.898.336	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,336%	Credit Suisse	4/3/2026	5.929	5.956
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 59.522.783)					(366.352)	(232.431)

CCDS: Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (*Centrally Cleared Credit Default Swaps*)
 CCILS: Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (*Centrally Cleared Inflation Linked Swaps*)
 CCIRS: Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (*Centrally Cleared Interest Rate Swaps*)
 CDS: Swaps sur défaillance (*Credit Default Swaps*)
 IRS: Swaps sur taux d'intérêt (*Interest Rate Swaps*)

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
50	EUR	3 Month Euribor Futures December 2022	Décembre 2022	12.556.875	1.206
781	EUR	Enel SpA Futures December 2021	Décembre 2021	281.160	22.118
(555)	EUR	Euro BOBL Futures June 2021	Juin 2021	74.747.400	150.158
(55)	EUR	Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	8.100.400	32.044
(391)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	66.395.710	332.658
24	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	4.824.960	64.179
(64)	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	Juin 2021	10.260.480	46.882
710	EUR	Iberdrola SA Futures December 2021	Décembre 2021	294.650	34.307
(4)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	4.527.792	(981)
(82)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	Septembre 2021	12.115.441	(5.899)
(5)	USD	US Long Bond Futures September 2021	Septembre 2021	640.159	2.784
(97)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	11.503.791	27.277
(92)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	9.936.695	24.279
(2)	USD	US Treasury 2 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	361.728	10
(65)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	9.840.006	39.549
Total				226.387.247	770.571

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
3.210.000	Call	OTC USD/CAD	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,28	23/06/2021	(21.183)	179
905.000	Call	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0,89	06/08/2021	(11.972)	1.413
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 4.182)						(33.155)	1.592

Valeur nominale	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(749.313)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0,11% Fixed annually from 14/1/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	(16.025)	(27.246)
(749.313)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022; and pays -0,11% Fixed annually from 14/1/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	8.705	(2.516)
(1.400.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/10/2021; and pays 0,92% Fixed semi-annually from 26/7/2021	BNP Paribas	USD 0,92	26/07/2021	7.595	(173)
(1.440.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021; and pays 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021	JP Morgan	USD 1,12	08/09/2021	(180)	(12.637)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(1.440.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021	JP Morgan	USD 1,13	08/09/2021	8.057	(4.400)
(2.195.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023; and pays 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	4.054	(68.528)
(2.195.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	2.202	(69.678)
(8.700.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,45% Fixed annually from 19/5/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 23/11/2022	Citibank	EUR 0,00	19/05/2022	5.701	(18.920)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 4.938.780)						20.109	(204.098)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	236.703	AUD	370.000	HSBC	15/7/2021	2.204
EUR	3.919.879	DKK	29.160.000	Toronto Dominion Bank	15/7/2021	(682)
EUR	13.037.722	GBP	11.310.000	Goldman Sachs	15/7/2021	(84.010)
EUR	127.266	GBP	110.000	HSBC	15/7/2021	(355)
EUR	276.756	GBP	240.000	Morgan Stanley	15/7/2021	(1.689)
EUR	312.930	GBP	270.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	(321)
EUR	3.751.659	GBP	3.240.000	Societe Generale	15/7/2021	(7.352)
EUR	470.999	GBP	410.000	Chartered Bank	15/7/2021	(4.679)
EUR	1.232.858	GBP	1.060.000	Westpac	15/7/2021	3.058
EUR	537.803	NOK	5.500.000	JP Morgan	16/6/2021	(2.092)
EUR	1.735.595	NOK	17.580.000	Barclays Bank	15/7/2021	10.774
EUR	743.435	NZD	1.260.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(6.296)
EUR	205.744	SEK	2.100.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(1.676)
EUR	1.090.000	USD	1.317.848	Goldman Sachs	16/6/2021	10.441
EUR	14.492.781	USD	17.300.000	Morgan Stanley	15/7/2021	328.853
EUR	24.835	USD	30.000	Standard Chartered Bank	15/7/2021	273
EUR	149.466	USD	180.000	Westpac	15/7/2021	2.097
NOK	12.850.000	EUR	1.266.540	HSBC	16/6/2021	(5.147)
NOK	4.300.000	EUR	425.381	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(3.496)
NOK	4.100.000	EUR	408.124	Morgan Stanley	15/7/2021	(5.862)
USD	1.331.882	EUR	1.090.000	BNP Paribas	16/6/2021	1.055
USD	4.700.000	EUR	3.898.680	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	(50.677)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 49.122.483)						184.421

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	33,91
Services aux collectivités	16,21
Biens de consommation non cyclique	10,34
Valeurs industrielles	6,40
Communications	6,00
Gouvernement	3,76
Biens de consommation cyclique	3,36
Technologie	2,93
Matériaux de base	2,91
Organismes de placement collectif	2,00
Énergie	1,78
Fonds négociés en bourse	1,54
Titres adossés à des actifs	0,14
Portefeuille de titres à la valeur de marché	91,28
Autres éléments de l'actif net	8,72
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché EUR	% de l'actif net			Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
Albanie							
EUR 18.890.000	Albania Government International Bond RegS 3,50% 9/10/2025	20.073.647	0,35	USD 511.000	Fortune Star BVI Ltd RegS 6,85% 2/7/2024	447.535	0,01
EUR 8.256.000	Albania Government International Bond RegS 3,50% 16/6/2027	8.824.426	0,16	USD 398.000	Fortune Star BVI Ltd RegS 5,95% 19/10/2025	343.126	0,01
		28.898.073	0,51	USD 200.000	Fortune Star BVI Ltd RegS 5,05% 27/1/2027	165.233	0,00
Australie							
EUR 5.925.000	APT Pipelines Ltd RegS 2,00% 15/7/2030	6.377.315	0,11	USD 200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd RegS 4,75% 27/4/2027	109.571	0,00
AUD 42.320.000	Australia Government Bond RegS 1,75% 21/6/2051	21.928.828	0,39	USD 300.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd RegS 3,625% 30/9/2030	163.466	0,00
EUR 13.050.000	Macquarie Group Ltd RegS 0,35% 3/3/2028	12.828.150	0,22	USD 515.000	New Metro Global Ltd RegS 4,80% 15/12/2024	426.402	0,01
		41.134.293	0,72	USD 333.000	NWD MTN Ltd RegS 4,50% 19/5/2030	289.429	0,00
Autriche							
EUR 600.000	ams AG RegS 5/3/2025 (Zero Coupon)	508.050	0,01	USD 240.000	Ocean Laurel Co Ltd RegS 2,375% 20/10/2025	195.109	0,00
EUR 700.000	ams AG RegS 2,125% 3/11/2027	682.479	0,01	USD 417.000	Peak RE Bvi Holding Ltd RegS FRN (Perpetual)	360.792	0,01
EUR 2.500.000	BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029	2.608.900	0,05	USD 227.000	RKPF Overseas 2019 A Ltd RegS 6,70% 30/9/2024	197.647	0,00
EUR 7.500.000	Erste Group Bank AG RegS 0,05% 16/9/2025	7.524.750	0,13	USD 341.000	RKPF Overseas 2019 A Ltd RegS 5,90% 5/3/2025	290.710	0,01
EUR 1.600.000	Kommunalkredit Austria AG RegS 0,25% 14/5/2024	1.598.800	0,03	USD 227.000	RKPF Overseas 2019 A Ltd RegS 6,00% 4/9/2025	193.716	0,00
EUR 18.300.000	Raiffeisen Bank International AG RegS 0,25% 5/7/2021	18.310.980	0,32	USD 450.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance II Ltd RegS 5,95% 4/2/2027	413.200	0,01
EUR 17.418.000	Republic of Austria Government Bond RegS 0,70% 20/4/2071	16.260.922	0,29	USD 300.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd RegS 3,25% 5/5/2026	246.219	0,00
		47.494.881	0,84	USD 500.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd RegS 4,75% 5/8/2029	416.605	0,01
Belgique							
EUR 7.600.000	Ageas SA RegS FRN (Perpetual)^	8.058.052	0,14	USD 182.660	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd RegS 6,75% 24/4/2033	171.002	0,00
EUR 2.100.000	Argenta Spaarbank NV RegS 1,00% 13/10/2026	2.147.607	0,04	USD 200.000	Studio City Finance Ltd 5,00% 15/1/2029	167.496	0,00
EUR 4.300.000	KBC Group NV RegS FRN 10/9/2026	4.288.476	0,08	USD 800.000	TSMC Global Ltd RegS 1,75% 23/4/2028	651.482	0,01
EUR 26.176.141	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2031 (Zero Coupon)	25.772.767	0,45	USD 600.000	TSMC Global Ltd RegS 2,25% 23/4/2031	488.409	0,01
		40.266.902	0,71	USD 480.000	Wheelock MTN BVI Ltd RegS 2,375% 25/1/2026	393.915	0,01
Bermudes							
USD 341.000	Hopson Development Holdings Ltd RegS 7,50% 27/6/2022	285.854	0,00			7.613.846	0,13
		285.854	0,00	Canada			
Brésil							
USD 1.215.000	Oi SA 10,00% 27/7/2025	1.017.208	0,02	EUR 4.730.000	CPPIB Capital Inc RegS 0,75% 15/7/2049	4.638.536	0,08
		1.017.208	0,02			4.638.536	0,08
Îles Vierges britanniques							
USD 210.000	Champion Path Holdings Ltd RegS 4,50% 27/1/2026	178.885	0,00	Îles Caïmans			
USD 340.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd RegS FRN (Perpetual)	290.637	0,01	USD 227.000	21Vianet Group Inc RegS 7,875% 15/10/2021	188.289	0,00
USD 445.000	Easy Tactic Ltd RegS 11,75% 2/8/2023	378.636	0,01	USD 284.000	Agile Group Holdings Ltd RegS 5,75% 2/1/2025	237.704	0,00
USD 533.000	Elect Global Investments Ltd RegS FRN (Perpetual)	443.380	0,01	USD 227.000	Agile Group Holdings Ltd RegS 6,05% 13/10/2025	191.704	0,00
USD 227.000	Fortune Star BVI Ltd RegS 5,95% 29/1/2023	191.244	0,00	USD 227.000	Agile Group Holdings Ltd RegS FRN (Perpetual)	191.685	0,00
				USD 341.000	China Aoyuan Group Ltd RegS 6,35% 8/2/2024	279.766	0,01
				USD 341.000	China Aoyuan Group Ltd RegS 5,98% 18/8/2025	266.602	0,01
				USD 283.000	China Aoyuan Group Ltd RegS 6,20% 24/3/2026	217.481	0,00
				USD 227.000	China SCE Group Holdings Ltd RegS 7,25% 19/4/2023	193.024	0,00
				USD 398.000	China SCE Group Holdings Ltd RegS 7,375% 9/4/2024	341.822	0,01
				USD 284.000	China SCE Group Holdings Ltd RegS 7,00% 2/5/2025	239.941	0,01
				USD 227.000	CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 6,55% 28/3/2024	196.104	0,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Îles Caïmans suite				Îles Caïmans suite			
USD 227.000	CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 6,45% 7/11/2024	197.611	0,00	USD 284.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 7,70% 20/2/2025	213.642	0,00
USD 284.000	CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 6,00% 16/7/2025	246.066	0,01	USD 284.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 8,30% 27/5/2025	214.566	0,00
USD 341.000	CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 5,95% 20/10/2025	296.830	0,01	USD 284.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 7,375% 13/1/2026	201.781	0,00
USD 227.000	Country Garden Holdings Co Ltd RegS 4,20% 6/2/2026	194.254	0,00	USD 227.000	Zhenro Properties Group Ltd RegS 9,15% 6/5/2023	195.173	0,00
USD 255.000	Country Garden Holdings Co Ltd RegS 2,70% 12/7/2026	205.063	0,00	USD 227.000	Zhenro Properties Group Ltd RegS 8,30% 15/9/2023	192.621	0,00
USD 365.000	Country Garden Holdings Co Ltd RegS 3,30% 12/1/2031	284.792	0,01	USD 227.000	Zhenro Properties Group Ltd RegS 8,35% 10/3/2024	193.110	0,00
USD 200.000	Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 6,95% 17/12/2021	160.824	0,00	USD 227.000	Zhenro Properties Group Ltd RegS 7,875% 14/4/2024 [*]	190.043	0,00
USD 398.000	Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 10,875% 9/1/2023	317.232	0,01			16.849.563	0,30
USD 227.000	Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 11,875% 1/6/2023	180.625	0,00	Chine			
USD 227.000	Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 9,25% 28/7/2023	169.921	0,00	EUR 15.425.000	China Development Bank RegS 27/10/2023 (Zero Coupon)	15.438.882	0,27
USD 575.000	Haidilao International Holding Ltd RegS 2,15% 14/1/2026	466.699	0,01	CNY 112.450.000	China Government Bond 1,99% 9/4/2025	13.977.750	0,25
USD 341.000	Kaisa Group Holdings Ltd RegS 11,50% 30/1/2023	287.908	0,01	CNY 91.430.000	China Government Bond 3,29% 23/5/2029	11.955.212	0,21
USD 341.000	Kaisa Group Holdings Ltd RegS 10,875% 23/7/2023	289.894	0,01	CNY 206.690.000	China Government Bond 2,68% 21/5/2030	25.664.788	0,45
USD 227.000	Kaisa Group Holdings Ltd RegS 9,75% 28/9/2023	191.067	0,00	EUR 4.080.000	China Government International Bond RegS 0,125% 12/11/2026	4.092.240	0,07
USD 454.000	Kaisa Group Holdings Ltd RegS 11,95% 12/11/2023	391.655	0,01	EUR 3.214.000	China Government International Bond RegS 0,50% 12/11/2031	3.193.913	0,06
USD 227.000	Kaisa Group Holdings Ltd RegS 11,70% 11/11/2025	185.932	0,00	EUR 7.725.000	China Government International Bond RegS 0,625% 25/11/2035 [^]	7.560.226	0,13
USD 515.000	Logan Group Co Ltd RegS 4,85% 14/12/2026	425.461	0,01	USD 200.000	Guoren Property & Casualty Insurance Co Ltd RegS 3,35% 1/6/2026	164.572	0,00
USD 227.000	Redsun Properties Group Ltd RegS 10,50% 3/10/2022	194.957	0,00	USD 450.000	Wens Foodstuffs Group Co Ltd RegS 2,349% 29/10/2025	336.840	0,01
USD 341.000	Redsun Properties Group Ltd RegS 9,70% 16/4/2023	291.286	0,01	USD 300.000	Wens Foodstuffs Group Co Ltd RegS 3,258% 29/10/2030	194.961	0,00
USD 227.000	Ronshine China Holdings Ltd RegS 8,10% 9/6/2023	185.634	0,00	USD 267.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd RegS 3,125% 16/7/2025	219.645	0,01
USD 454.000	Ronshine China Holdings Ltd RegS 7,35% 15/12/2023	361.801	0,01	USD 517.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd RegS 3,50% 8/3/2026	428.812	0,01
USD 4.670.000	Seagate HDD Cayman 4,091% 1/6/2029	3.860.229	0,07			83.227.841	1,47
USD 977.000	Shimao Group Holdings Ltd RegS 5,60% 15/7/2026	863.072	0,02	Colombie			
USD 227.000	Shimao Group Holdings Ltd RegS 3,45% 11/1/2031	175.828	0,00	USD 27.720.000	Colombia Government International Bond 3,25% 22/4/2032	21.973.380	0,39
USD 284.000	Sunac China Holdings Ltd RegS 7,95% 11/10/2023	245.409	0,01			21.973.380	0,39
USD 284.000	Sunac China Holdings Ltd RegS 7,50% 1/2/2024	244.963	0,01	Chypre			
USD 335.000	Sunac China Holdings Ltd RegS 6,65% 3/8/2024	285.365	0,01	EUR 27.194.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023	29.641.460	0,52
USD 200.000	Times China Holdings Ltd RegS 6,75% 16/7/2023	169.423	0,00	EUR 38.475.000	Cyprus Government International Bond RegS 2,75% 27/6/2024	42.031.629	0,74
USD 400.000	Times China Holdings Ltd RegS 6,75% 8/7/2025	339.515	0,01	EUR 82.750.000	Cyprus Government International Bond RegS 0,625% 3/12/2024	84.944.530	1,50
USD 390.000	Times China Holdings Ltd RegS 6,20% 22/3/2026	320.283	0,01			156.617.619	2,76
GBP 350.000	Trafford Centre Finance Ltd RegS FRN 28/7/2035	345.239	0,01				
USD 200.000	Wynn Macau Ltd RegS 5,625% 26/8/2028	172.116	0,00				
USD 227.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 8,50% 26/2/2024	180.832	0,00				
USD 227.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 8,375% 30/10/2024	176.719	0,00				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Danemark				France suite			
DKK 440.377.393	Nordea Kredit			GBP 20.100.000	Dexia Credit Local SA RegS 0,25% 10/12/2026	22.721.410	0,40
	Realkreditatieselskab 0,50% 1/10/2050	54.332.914	0,96	EUR 9.100.000	Dexia Credit Local SA RegS 21/1/2028 (Zero Coupon)	9.113.013	0,16
GBP 2.507.000	Orsted A/S RegS 2,50% 16/5/2033	3.133.021	0,05	EUR 546.182	E-Carat SA 'B' RegS FRN 20/12/2028	546.237	0,01
DKK 113.147.144	Realkredit Danmark A/S RegS 0,50% 1/10/2050	13.948.313	0,25	EUR 136.546	E-Carat SA 'C' RegS FRN 20/12/2028	136.463	0,00
		71.414.248	1,26	EUR 136.546	E-Carat SA 'D' RegS FRN 20/12/2028	136.744	0,00
Égypte				EUR 204.818	E-Carat SA 'E' RegS FRN 20/12/2028	205.127	0,00
USD 6.800.000	Egypt Government International Bond RegS 5,875% 16/2/2031	5.493.585	0,10	EUR 1.768.900	Electricite de France SA RegS 14/9/2024 (Zero Coupon)	268.944	0,00
USD 4.265.000	Egypt Government International Bond RegS 7,50% 16/2/2061	3.372.228	0,06	GBP 1.400.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	1.823.847	0,03
		8.865.813	0,16	EUR 600.000	Electricite de France SA RegS 2,00% 9/12/2049	633.012	0,01
Estonie				GBP 300.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	387.080	0,01
EUR 5.700.000	Elering AS RegS 0,875% 3/5/2023	5.784.859	0,10	GBP 150.000	Electricite de France SA RegS 5,125% 22/9/2050	262.359	0,00
		5.784.859	0,10	EUR 600.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	618.108	0,01
Finlande				EUR 600.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	624.828	0,01
EUR 1.225.000	Finnair Oyj RegS 4,25% 19/5/2025	1.248.030	0,02	EUR 4.700.000	Engie SA RegS 4/3/2027 (Zero Coupon)	4.662.635	0,08
		1.248.030	0,02	EUR 3.789.070	FCT Autonomia '2019-1 B' RegS FRN 25/9/2035	3.798.448	0,07
France				EUR 280.672	FCT Autonomia '2019-1 C' RegS FRN 25/9/2035	281.804	0,01
EUR 1.465.000	Alice France SA RegS 5,875% 1/2/2027	1.560.870	0,03	EUR 210.821	FCT Autonomia '2019-1 D' RegS FRN 25/9/2035	211.343	0,00
EUR 15.300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 0,75% 15/6/2023	15.631.857	0,28	EUR 280.250	FCT Autonomia '2019-1 E' RegS FRN 25/9/2035	282.830	0,01
USD 300.000	BNP Paribas SA FRN (Perpetual)	231.094	0,00	EUR 280.672	FCT Autonomia '2019-1 F' RegS FRN 25/9/2035	280.728	0,01
EUR 8.900.000	BNP Paribas SA RegS FRN 15/7/2025	9.009.737	0,16	EUR 986.264	FCT Noria '2018-1 C' RegS FRN 25/6/2038	989.207	0,02
GBP 12.041.000	BNP Paribas SA RegS 3,375% 23/1/2026	15.265.709	0,27	EUR 460.325	FCT Noria '2018-1 D' RegS FRN 25/6/2038	460.505	0,01
GBP 4.900.000	BNP Paribas SA RegS FRN 24/5/2031	5.736.301	0,10	EUR 493.132	FCT Noria '2018-1 E' RegS FRN 25/6/2038	494.765	0,01
EUR 12.300.000	BNP Paribas SA RegS 0,625% 3/12/2032*	11.789.673	0,21	EUR 1.117.765	FCT Noria '2018-1B' RegS FRN 25/6/2038	1.120.003	0,02
EUR 1.200.000	BPCE SA RegS 0,625% 26/9/2023	1.225.704	0,02	EUR 21.370.000	France Government Bond OAT RegS 0,75% 25/5/2052	20.090.364	0,35
EUR 4.200.000	BPCE SA RegS 0,125% 4/12/2024	4.239.774	0,07	EUR 400.000	Goldstory SASU RegS 5,375% 1/3/2026	408.352	0,01
EUR 7.200.000	BPCE SFH SA RegS 0,125% 3/12/2030	7.195.320	0,13	EUR 9.045.391	Harmony French Home Loans FCT '2020-2 A' RegS FRN 27/8/2061	9.177.661	0,16
USD 400.000	Carrefour SA RegS 14/6/2023 (Zero Coupon)	322.504	0,01	EUR 4.500.000	Harmony French Home Loans FCT '2020-2 B' RegS FRN 27/8/2061	4.573.507	0,08
USD 800.000	Carrefour SA RegS 27/3/2024 (Zero Coupon)	682.392	0,01	EUR 826.500	Korian SA RegS 0,875% 6/3/2027	470.692	0,01
EUR 5.800.000	Cars Alliance Auto Loans France V '2018-1 B' RegS FRN 21/10/2029	5.796.520	0,10	EUR 943.000	La Financiere Atalian SASU RegS 4,00% 15/5/2024*	928.855	0,02
EUR 1.731.000	Casino Guichard Perrachon SA FRN (Perpetual)	801.453	0,01	EUR 12.700.000	La Poste SA RegS 1,375% 21/4/2032	13.649.325	0,24
EUR 700.000	Casino Guichard Perrachon SA RegS FRN (Perpetual)	519.029	0,01	EUR 2.825.000	PSA Banque France SA RegS 0,50% 12/4/2022	2.843.956	0,05
EUR 1.100.000	Cie de Saint-Gobain RegS 0,875% 21/9/2023	1.127.412	0,02	EUR 4.500.000	Schneider Electric SE RegS 12/6/2023 (Zero Coupon)	4.531.005	0,08
EUR 3.600.000	Cie de Saint-Gobain RegS 0,625% 15/3/2024	3.677.724	0,07	EUR 13.800.000	Societe Generale SA FRN 24/11/2030	13.730.034	0,24
EUR 2.400.000	CMA CGM SA RegS 5,25% 15/1/2025*	2.463.576	0,04	EUR 9.900.000	Societe Generale SA RegS 0,75% 25/1/2027	9.968.508	0,18
EUR 1.700.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,375% 17/1/2025	1.788.587	0,03				
EUR 10.100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 0,875% 7/5/2027*	10.468.347	0,18				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				Allemagne suite			
EUR 11.500.000	Societe Generale SA RegS 0,125% 18/2/2028	11.329.915	0,20	EUR 177.947	Red & Black Auto Germany 6 UG 'D' RegS FRN 15/10/2028	181.211	0,00
EUR 3.500.000	Societe Generale SA RegS FRN 22/9/2028	3.544.380	0,06	EUR 568.000	TK Elevator Midco GmbH RegS 4,375% 15/7/2027	595.764	0,01
USD 400.000	Societe Generale SA RegS FRN (Perpetual)	333.597	0,01	EUR 200.000	TUI AG RegS 5,00% 16/4/2028	227.548	0,00
EUR 11.300.000	Suez SA RegS 9/6/2026 (Zero Coupon)	11.250.732	0,20	EUR 12.000.000	Volkswagen Financial Services AG RegS 1,375% 16/10/2023	12.423.960	0,22
EUR 1.300.000	Suez SA RegS FRN (Perpetual)	1.299.792	0,02	EUR 19.075.000	Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,375% 20/7/2026	19.082.821	0,34
EUR 8.100.000	Thales SA RegS 26/3/2026 (Zero Coupon) [^]	8.067.276	0,14	EUR 6.700.000	ZF Finance GmbH RegS 2,75% 25/5/2027	6.935.773	0,12
USD 1.400.000	TOTAL SE RegS 0,50% 2/12/2022	1.178.711	0,02			409.166.311	7,21
EUR 295.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	306.428	0,01	Grèce			
EUR 23.200.000	UNEDIC ASSEO RegS 0,10% 25/5/2034	22.228.616	0,39	EUR 10.225.000	Alpha Bank SA RegS 2,50% 5/2/2023	10.629.501	0,19
USD 200.000	Valeo SA RegS 16/6/2021 (Zero Coupon)	163.731	0,00	EUR 48.950.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 12/2/2026 (Zero Coupon)	48.710.145	0,86
EUR 4.100.000	Veolia Environnement SA RegS 0,80% 15/1/2032 [^]	4.108.938	0,07	EUR 6.212.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 2,00% 22/4/2027	6.853.700	0,12
EUR 20.900.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual) [^]	21.441.937	0,38	EUR 10.212.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,875% 12/3/2029	12.749.273	0,22
EUR 7.400.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual) [^]	7.351.160	0,13	EUR 13.959.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 1,50% 18/6/2030	14.901.791	0,26
		322.570.495	5,68	EUR 14.845.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 0,75% 18/6/2031	14.741.085	0,26
Allemagne				EUR 14.345.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 1,875% 24/1/2052	14.670.631	0,26
EUR 600.000	Bayer AG RegS FRN 12/11/2079	609.426	0,01			123.256.126	2,17
EUR 500.000	Bayer AG RegS FRN 12/11/2079	518.535	0,01	Hong Kong			
EUR 114.270.000	Bundesobligation RegS 8/4/2022 (Zero Coupon)	114.909.912	2,02	USD 850.000	Bank of East Asia Ltd RegS FRN 29/5/2030	730.258	0,01
EUR 137.422.737	Bundesobligation RegS 10/4/2026 (Zero Coupon) [^]	141.200.488	2,49	USD 284.000	Bank of East Asia Ltd RegS FRN (Perpetual)	250.746	0,01
EUR 16.629.849	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 15/8/2050 (Zero Coupon)	15.023.239	0,27	USD 284.000	Bank of East Asia Ltd RegS FRN (Perpetual)	248.346	0,01
EUR 880.000	CeramTec BondCo GmbH RegS 5,25% 15/12/2025	895.339	0,02	USD 583.000	CMB International Leasing Management Ltd RegS 2,75% 12/8/2030	463.662	0,01
GBP 9.000.000	Deutsche Bank AG RegS 2,625% 16/12/2024	10.918.004	0,19	USD 240.000	Far East Horizon Ltd RegS 2,625% 3/3/2024	196.049	0,00
EUR 7.000.000	Deutsche Bank AG RegS FRN 17/2/2032 [^]	6.977.740	0,12	USD 420.000	GLP China Holdings Ltd RegS 2,95% 29/3/2026	348.885	0,01
EUR 29.800.000	FMS Wertmanagement RegS 0,375% 29/4/2030	30.682.974	0,54	USD 700.000	Huaxin Cement International Finance Co Ltd RegS 2,25% 19/11/2025	570.135	0,01
EUR 17.100.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028	17.693.541	0,31	USD 300.000	Lenovo Group Ltd RegS 3,421% 2/11/2030	252.362	0,01
EUR 6.400.000	KION Group AG RegS 1,625% 24/9/2025	6.664.640	0,12	USD 333.000	Nanyang Commercial Bank Ltd RegS FRN 20/11/2029	283.566	0,01
EUR 1.236.000	KME SE RegS 6,75% 1/2/2023	928.545	0,02	USD 227.000	Nanyang Commercial Bank Ltd RegS FRN (Perpetual)	188.272	0,00
EUR 11.200.000	Landesbank Baden- Wuerttemberg RegS 2,20% 9/5/2029	11.773.104	0,21	USD 227.000	Yango Justice International Ltd RegS 10,00% 12/2/2023	193.956	0,00
EUR 8.700.000	Merck Financial Services GmbH RegS 0,005% 15/12/2023	8.742.456	0,15	USD 227.000	Yango Justice International Ltd RegS 8,25% 25/11/2023	188.774	0,00
EUR 2.000.000	Nidda Healthcare Holding GmbH RegS 3,50% 30/9/2024	2.002.540	0,04				
EUR 177.947	Red & Black Auto Germany 6 UG 'C' RegS FRN 15/10/2028	178.751	0,00				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Hong Kong suite				Indonésie suite			
USD 284.000	Yango Justice International Ltd RegS 7,50% 15/4/2024	234.209	0,00	IDR 64.458.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,00% 15/9/2030	3.850.320	0,07
USD 200.000	Yanlord Land HK Co Ltd RegS 5,125% 20/5/2026	167.006	0,00	USD 7.015.000	Pertamina Persero PT RegS 1,40% 9/2/2026	5.634.357	0,10
		4.316.226	0,08	USD 3.855.000	Pertamina Persero PT RegS 2,30% 9/2/2031^	3.000.859	0,05
Hongrie				Irlande			
HUF 6.795.830.000	Hungary Government Bond 3,25% 22/10/2031^	20.546.907	0,36	EUR 12.225.000	Abbott Ireland Financing DAC RegS 0,10% 19/11/2024	12.309.890	0,22
EUR 4.442.000	Hungary Government International Bond RegS 1,75% 5/6/2035	4.688.353	0,08	EUR 500.000	AIB Group Plc RegS FRN (Perpetual)	566.410	0,01
		25.235.260	0,44	EUR 150.000	Anchorage Capital Europe CLO 2021-4 DAC 'E' RegS FRN 25/4/2034	148.399	0,00
Islande				EUR 100.000	Avoca CLO XIV DAC '14X ER' RegS FRN 12/1/2031	99.403	0,00
EUR 3.375.000	Iceland Government International Bond RegS 0,625% 3/6/2026	3.477.094	0,06	EUR 100.000	Avoca CLO XIV DAC '14X FR' RegS FRN 12/1/2031	96.676	0,00
EUR 3.275.000	Iceland Government International Bond RegS 15/4/2028 (Zero Coupon)	3.241.791	0,06	EUR 275.000	Avoca CLO XIV DAC '14X SUB' RegS FRN 12/1/2031	203.980	0,00
		6.718.885	0,12	EUR 500.000	Avoca CLO XV DAC '15X FR' RegS FRN 15/4/2031	474.100	0,01
Inde				GBP 8.540.000	BAMS CMBS 2018-1 DAC 'A' RegS FRN 17/5/2028	9.945.255	0,18
USD 467.000	Adani Electricity Mumbai Ltd RegS 3,949% 12/2/2030	389.607	0,01	GBP 2.985.000	BAMS CMBS 2018-1 DAC 'B' RegS FRN 17/5/2028	3.466.481	0,06
USD 227.000	Adani Green Energy UP Ltd / Prayatna Developers Pvt Ltd / Parampujya Solar Energy RegS 6,25% 10/12/2024	206.897	0,00	GBP 1.775.000	BAMS CMBS 2018-1 DAC 'C' RegS FRN 17/5/2028	2.068.434	0,04
USD 333.000	Adani Transmission Ltd RegS 4,00% 3/8/2026	292.707	0,01	USD 1.600.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 19/9/2027	1.343.939	0,02
USD 249.645	Adani Transmission Ltd RegS 4,25% 21/5/2036	211.938	0,00	EUR 150.000	BBAM European CLO I DAC '1X ER' RegS FRN 22/7/2034	148.500	0,00
USD 365.000	Bharti Airtel Ltd RegS 3,25% 3/6/2031	294.469	0,01	EUR 150.000	BlueMountain EUR CLO DAC '2021-1X E' RegS FRN 15/4/2034	149.829	0,00
USD 284.000	GMR Hyderabad International Airport Ltd RegS 5,375% 10/4/2024	239.478	0,00	SEK 65.580.000	Bluestep Mortgage Securities No 4 DAC 'B' RegS FRN 10/8/2066	6.483.673	0,11
USD 227.000	HPCL-Mittal Energy Ltd RegS 5,45% 22/10/2026	192.717	0,00	EUR 150.000	Capital Four CLO II DAC 'E' RegS FRN 15/1/2034	148.331	0,00
USD 284.000	Manappuram Finance Ltd RegS 5,90% 13/1/2023	239.468	0,00	EUR 150.000	CIFC European Funding CLO III DAC 'E' RegS FRN 15/1/2034	145.599	0,00
USD 500.000	Oil India Ltd RegS 5,125% 4/2/2029	458.345	0,01	EUR 4.400.000	CRH SMW Finance DAC RegS 1,25% 5/11/2026^	4.652.648	0,08
USD 600.000	Power Finance Corp Ltd RegS 4,50% 18/6/2029	525.201	0,01	EUR 150.000	CVC Cordatus Loan Fund XX DAC '20X E' RegS FRN 22/6/2034	148.500	0,00
USD 600.000	Power Finance Corp Ltd RegS 3,90% 16/9/2029	505.295	0,01	EUR 10.550.000	Eaton Capital Unlimited Co RegS 0,128% 8/3/2026	10.549.684	0,19
USD 275.000	REC Ltd RegS 2,25% 1/9/2026	220.403	0,00	EUR 150.000	Henley CLO IV DAC 'E' RegS FRN 25/4/2034	145.310	0,00
USD 250.000	REC Ltd RegS 3,875% 7/7/2027	214.962	0,00	EUR 265.498	Invesco Euro Clo III DAC 'F' RegS FRN 15/7/2032	266.153	0,01
USD 284.000	ReNew Power Synthetic RegS 6,67% 12/3/2024	245.204	0,01	EUR 150.000	Invesco Euro CLO V DAC 'E' RegS FRN 15/1/2034	150.426	0,00
USD 227.000	Shriram Transport Finance Co Ltd RegS 5,95% 24/10/2022	190.376	0,00	EUR 7.389.000	Last Mile Securities PE '2021-X1 A1' DAC RegS FRN 17/8/2031	7.401.315	0,13
USD 341.000	Shriram Transport Finance Co Ltd RegS 5,10% 16/7/2023	282.001	0,01	EUR 1.988.000	Last Mile Securities PE '2021-X1 A2' DAC RegS FRN 17/8/2031	1.990.485	0,04
		4.709.068	0,08				
Indonésie							
USD 200.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT RegS 2,00% 19/4/2026	163.430	0,00				
USD 227.000	Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT RegS 4,20% 23/1/2025	190.208	0,01				

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Irlande suite				Irlande suite			
EUR 939.000	Last Mile Securities PE '2021-X1 B' DAC RegS FRN 17/8/2031	941.629	0,02	GBP 700.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC RegS 4,875% 15/7/2028	831.053	0,02
EUR 1.061.000	Last Mile Securities PE '2021-X1 C' DAC RegS FRN 17/8/2031	1.063.440	0,02	EUR 5.500.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co RegS FRN 17/9/2050	5.741.285	0,10
EUR 6.600.000	LT Autorahoitus DAC 'A' RegS FRN 18/4/2030	6.647.663	0,12			130.706.785	2,30
EUR 150.000	Marino Park CLO DAC 'D' RegS FRN 16/1/2034	148.065	0,00	Italie			
EUR 150.000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO '2021-1X E' RegS FRN 17/4/2034	147.608	0,00	EUR 650.000	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen Srl 'B' RegS FRN 15/4/2032	652.128	0,01
EUR 150.000	Northwoods Capital 23 Euro DAC '2021-23X E' RegS FRN 15/3/2034	148.579	0,00	EUR 320.000	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen Srl 'C' RegS FRN 15/4/2032	319.645	0,01
EUR 150.000	OCP Euro CLO DAC '2019-3X ER' RegS FRN 20/4/2033	149.428	0,00	EUR 300.000	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen Srl 'D' RegS FRN 15/4/2032	301.616	0,01
EUR 10.845.000	Pearl Finance 2020 DAC 'A1' RegS FRN 17/11/2032	10.896.405	0,19	EUR 100.000	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen Srl 'E' RegS FRN 15/4/2032	100.964	0,00
EUR 1.195.000	Pearl Finance 2020 DAC 'A2' RegS FRN 17/11/2032	1.197.988	0,02	EUR 2.500.000	ASTM SpA RegS 1,625% 8/2/2028	2.577.300	0,05
EUR 1.435.000	Pearl Finance 2020 DAC 'B' RegS FRN 17/11/2032	1.438.588	0,03	EUR 6.252.681	AutoFlorence 1 Srl 'A' RegS FRN 25/12/2042	6.290.283	0,11
EUR 150.000	Providus CLO V DAC 'E' RegS FRN 15/2/2035	147.316	0,00	EUR 947.165	AutoFlorence 1 Srl 'B' RegS FRN 25/12/2042	951.560	0,02
EUR 4.335.125	River Green Finance '2020-1 A' DAC RegS FRN 22/1/2032	4.343.795	0,08	EUR 903.000	Autostrade per l'Italia SpA RegS 2,00% 4/12/2028	934.813	0,02
EUR 548.063	River Green Finance '2020-1 B' DAC RegS FRN 22/1/2032	545.825	0,01	EUR 900.000	Autostrade per l'Italia SpA RegS 1,875% 26/9/2029	925.929	0,02
EUR 325.875	River Green Finance '2020-1 C' DAC RegS FRN 22/1/2032	324.568	0,01	EUR 500.000	Autostrade per l'Italia SpA RegS 2,00% 15/1/2030	512.250	0,01
EUR 150.000	Rockford Tower Europe CLO DAC '2021-1X E' RegS FRN 20/4/2034	149.513	0,00	EUR 100.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 3,625% 24/9/2024	105.976	0,00
EUR 1.600.000	SCF Rahoituspalvelut IX DAC 'B' RegS FRN 25/10/2030	1.596.885	0,03	EUR 200.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 2,625% 28/4/2025	206.248	0,00
EUR 166.667	Sound Point Euro CLO II Funding DAC 'X' RegS FRN 26/10/2032	166.687	0,00	EUR 2.967.068	Brignole Co '2019 1 A' RegS FRN 24/7/2034	2.968.939	0,05
EUR 150.000	Sound Point Euro CLO V Funding DAC 'E' RegS FRN 25/7/2035	148.659	0,00	EUR 330.000	Brignole Co '2019 1 B' RegS FRN 24/7/2034	330.500	0,01
EUR 343.082	Taurus '2019-1 FR B' DAC RegS FRN 2/2/2031	344.052	0,01	EUR 225.000	Brignole Co '2019 1 C' RegS FRN 24/7/2034	225.536	0,00
EUR 319.990	Taurus '2019-1 FR C' DAC RegS FRN 2/2/2031	321.161	0,01	EUR 17.955.000	Buzzi Unicem SpA RegS 2,125% 28/4/2023	18.647.345	0,33
EUR 1.197.059	Taurus '2019-1 FR' DAC RegS FRN 2/2/2031	1.200.889	0,02	USD 3.185.000	Intesa Sanpaolo SpA 4,198% 1/6/2032	2.648.145	0,05
GBP 3.484.208	Taurus '2019-2 B' UK DAC RegS FRN 17/11/2029	4.058.449	0,07	USD 3.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 4,95% 1/6/2042	2.653.738	0,05
GBP 2.178.253	Taurus '2019-2 C' UK DAC RegS FRN 17/11/2029	2.533.561	0,04	EUR 3.290.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,875% 27/6/2022	3.328.559	0,06
GBP 9.829.554	Taurus 2019-2 UK DAC 'A' RegS FRN 17/11/2029	11.512.107	0,20	EUR 5.050.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,75% 4/12/2024	5.170.493	0,09
GBP 4.642.596	Taurus '2020-2 A' UK DAC RegS FRN 17/8/2030	5.425.182	0,10	EUR 10.125.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,35% 24/2/2031	9.913.084	0,17
GBP 2.690.000	Taurus '2021-1 UK1X A' DAC RegS FRN 17/5/2031	3.132.823	0,06	EUR 250.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS FRN (Perpetual)	271.160	0,01
GBP 886.000	Taurus '2021-1 UK1X B' DAC RegS FRN 17/5/2031	1.029.728	0,02	EUR 450.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS FRN (Perpetual)	502.735	0,01
GBP 540.000	Taurus '2021-1 UK1X C' DAC RegS FRN 17/5/2031	627.932	0,01	EUR 228.970.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,95% 1/3/2023	234.110.376	4,12
GBP 551.000	Taurus '2021-1 UK1X D' DAC RegS FRN 17/5/2031	642.502	0,01				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Italie suite				Jersey suite			
EUR 86.804.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 15/4/2024 (Zero Coupon)	87.204.166	1,54	USD 742.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd RegS 2,625% 31/3/2036	597.777	0,01
EUR 147.478.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 0,50% 1/2/2026 [^]	150.067.714	2,64	USD 675.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd RegS 2,94% 30/9/2040	548.672	0,01
EUR 41.326.383	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,30% 15/5/2028	47.281.928	0,83	GBP 600.000	Heathrow Funding Ltd RegS 2,75% 13/10/2029	721.151	0,01
EUR 6.160.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045	5.910.150	0,10	GBP 900.000	Intu Jersey 2 Ltd RegS FRN 1/11/2022	205.266	0,01
EUR 14.690.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,45% 1/9/2050	16.623.351	0,29			4.509.216	0,08
EUR 800.000	Nexi SpA RegS 24/2/2028 (Zero Coupon)	775.520	0,01	Koweït			
EUR 3.937.880	Progetto Quinto SRL 'A' RegS FRN 27/10/2036	3.952.836	0,07	USD 425.000	Burgan Bank SAK RegS FRN 15/12/2031	332.293	0,01
EUR 550.000	Sisal Group SpA RegS 7,00% 31/7/2023	558.833	0,01			332.293	0,01
EUR 19.381.000	Snam SpA RegS 0,75% 17/6/2030 [^]	19.600.393	0,35	Luxembourg			
EUR 2.599.415	Sunrise SPV 40 Srl '2018-1 A' RegS FRN 27/7/2042	2.601.505	0,05	EUR 1.000.000	ADLER Group SA RegS 2,75% 13/11/2026	1.018.230	0,02
EUR 1.768.929	Sunrise SPV Z70 Srl '2019-1 A' RegS FRN 27/5/2044	1.774.221	0,03	EUR 1.700.000	Altice Financing SA RegS 3,00% 15/1/2028	1.637.219	0,03
EUR 197.319	Taurus '2018-IT1 A' SRL FRN 18/5/2030	196.582	0,00	EUR 9.000.000	Bank of China Luxembourg SA RegS 0,125% 16/1/2023	9.028.170	0,16
EUR 9.788.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA RegS 0,75% 24/7/2032 [^]	9.710.185	0,17	EUR 5.668.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0,632% 4/6/2023	5.748.259	0,10
EUR 10.100.000	UniCredit SpA RegS 6,95% 31/10/2022	11.055.056	0,19	EUR 8.121.000	BL Consumer Credit '2021-1 A' RegS FRN 25/9/2038	8.251.394	0,15
EUR 14.150.000	UniCredit SpA RegS FRN 25/6/2025	14.560.491	0,26	EUR 528.000	BL Consumer Credit '2021-1 C' RegS FRN 25/9/2038	528.328	0,01
EUR 5.775.000	UniCredit SpA RegS FRN 3/1/2027	5.922.262	0,10	EUR 681.000	BL Consumer Credit '2021-1 D' RegS FRN 25/9/2038	684.201	0,01
EUR 5.570.000	UniCredit SpA RegS 1,80% 20/1/2030 [^]	5.723.342	0,10	EUR 355.000	BL Consumer Credit '2021-1 E' RegS FRN 25/9/2038	355.517	0,01
EUR 1.144.000	UniCredit SpA RegS FRN (Perpetual)	1.074.079	0,02	USD 200.000	Cirsa Finance International Sarl 7,875% 20/12/2023	167.361	0,00
		679.241.936	11,97	EUR 691.000	Cirsa Finance International Sarl RegS 6,25% 20/12/2023	703.086	0,01
Japon				EUR 341.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA RegS 10,75% 30/9/2023	362.198	0,01
USD 700.000	Asahi Mutual Life Insurance Co RegS FRN (Perpetual)	617.060	0,01	EUR 1.200.000	European TopSoho Sarl RegS 4,00% 21/9/2021	1.042.356	0,02
JPY 1.392.000.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,60% 20/9/2050	10.237.392	0,18	EUR 2.716.473	FACT SA Compartment '2018-1 A' RegS FRN 20/11/2025	2.726.778	0,05
USD 250.000	Nippon Life Insurance Co RegS FRN 21/1/2051	198.763	0,00	EUR 2.520.000	Garfunkelux Holdco 3 SA RegS 6,75% 1/11/2025	2.626.067	0,05
USD 5.600.000	Nissan Motor Co Ltd 4,81% 17/9/2030 [^]	5.080.153	0,09	GBP 379.000	Garfunkelux Holdco 3 SA RegS 7,75% 1/11/2025	459.307	0,01
EUR 1.583.000	Rakuten Group Inc RegS FRN (Perpetual)	1.623.303	0,03	EUR 671.000	Herens Midco Sarl RegS 5,25% 15/5/2029	661.975	0,01
USD 200.000	SoftBank Group Corp RegS 4,75% 19/9/2024	175.372	0,00	EUR 1.100.000	Kleopatra Holdings 2 SCA RegS 6,50% 1/9/2026 [^]	1.062.292	0,02
EUR 529.000	SoftBank Group Corp RegS 5,00% 15/4/2028	603.203	0,01	EUR 245.000	Matterhorn Telecom SA RegS 4,00% 15/11/2027	252.306	0,00
EUR 2.039.000	SoftBank Group Corp RegS 4,00% 19/9/2029 [^]	2.198.557	0,04	EUR 10.675.000	Medtronic Global Holdings SCA 2/12/2022 (Zero Coupon)	10.735.954	0,19
USD 1.700.000	SoftBank Group Corp RegS FRN (Perpetual)	1.423.282	0,03	EUR 5.100.000	Medtronic Global Holdings SCA 0,25% 2/7/2025	5.157.120	0,09
EUR 10.950.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,00% 9/7/2040	11.473.957	0,20	EUR 730.000	Medtronic Global Holdings SCA 1,125% 7/3/2027	767.434	0,01
		33.631.042	0,59	EUR 300.000	Monitchem HoldCo 3 SA RegS 5,25% 15/3/2025	309.255	0,01
Jersey				EUR 1.600.000	Motion Finco Sarl RegS 7,00% 15/5/2025	1.690.256	0,03
GBP 600.000	Derwent London Capital No 3 Jersey Ltd RegS 1,50% 12/6/2025	716.804	0,01	EUR 9.600.000	Novartis Finance SA RegS 23/9/2028 (Zero Coupon)	9.442.560	0,17
GBP 1.000.000	Galaxy Finco Ltd RegS 9,25% 31/7/2027	1.232.943	0,02				
USD 600.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd RegS 2,16% 31/3/2034	486.603	0,01				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Luxembourg suite				Monténégro suite			
EUR 6.500.000	SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 A' RegS FRN 14/11/2034	6.580.857	0,12	EUR 39.793.000	Montenegro Government International Bond RegS 2,875% 16/12/2027	36.955.361	0,65
EUR 5.500.000	SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 B' RegS FRN 14/11/2034	5.542.799	0,10	EUR 4.900.000	Montenegro Government International Bond RegS 2,55% 3/10/2029	4.397.848	0,08
EUR 2.500.000	SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 C' RegS FRN 14/11/2034	2.524.150	0,04			43.339.489	0,76
EUR 1.400.000	SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 D' RegS FRN 14/11/2034	1.414.021	0,02	Maroc			
EUR 7.767.000	SES SA RegS FRN (Perpetual)	7.805.835	0,14	EUR 15.839.000	Morocco Government International Bond RegS 1,375% 30/3/2026	16.045.541	0,28
EUR 3.100.000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 'B' RegS FRN 15/3/2027	3.101.389	0,05			16.045.541	0,28
EUR 300.000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 'D' RegS FRN 15/3/2027	302.716	0,01	Pays-Bas			
EUR 300.000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 RegS FRN 15/3/2027	299.782	0,00	EUR 2.340.000	Ashland Services BV RegS 2,00% 30/1/2028	2.334.150	0,04
EUR 450.526	Summer BC Holdco A Sarl RegS 9,25% 31/10/2027	480.378	0,01	EUR 5.300.000	Athora Netherlands NV RegS FRN 15/7/2031	5.394.499	0,10
EUR 1.600.000	Summer BC Holdco B Sarl RegS 5,75% 31/10/2026	1.671.840	0,03	EUR 8.600.000	Bayer Capital Corp BV RegS FRN 26/6/2022	8.631.476	0,15
USD 300.000	Telecom Italia Capital SA 6,375% 15/11/2033	284.865	0,00	EUR 6.980.000	BMW Finance NV RegS 0,50% 22/11/2022	7.073.043	0,12
EUR 520.000	Telecom Italia Finance SA 7,75% 24/11/2033	761.914	0,01	EUR 10.225.000	BMW Finance NV RegS 24/3/2023 (Zero Coupon)	10.283.180	0,18
EUR 6.400.000	Traton Finance Luxembourg SA RegS 1,25% 24/3/2033	6.382.464	0,11	EUR 44.169.000	Daimler International Finance BV RegS 0,25% 9/8/2021	44.228.628	0,78
		102.570.633	1,81	EUR 12.700.000	de Volksbank NV RegS 0,75% 25/6/2023^	12.952.095	0,23
Macédoine				EUR 5.349.000	Domi 2021-1 BV '2021-1 A' RegS FRN 15/6/2053	5.368.470	0,09
EUR 8.000.000	North Macedonia Government International Bond RegS 3,675% 3/6/2026^	8.750.000	0,16	CHF 1.400.000	Dufry One BV RegS 0,75% 30/3/2026	1.278.232	0,02
EUR 14.805.000	North Macedonia Government International Bond RegS 1,625% 10/3/2028	14.379.356	0,25	EUR 1.000.000	Dufry One BV RegS 2,00% 15/2/2027	933.140	0,02
		23.129.356	0,41	EUR 500.000	Dufry One BV RegS 3,375% 15/4/2028	493.330	0,01
Malaisie				EUR 290.000	Dutch Property Finance '2020-2 B' BV RegS FRN 28/1/2058	294.517	0,01
USD 1.135.000	Dua Capital Ltd RegS 2,78% 11/5/2031	922.313	0,02	EUR 8.654.000	Dutch Property Finance '2021-1 A' BV RegS FRN 28/7/2058	8.680.533	0,15
		922.313	0,02	EUR 739.000	Dutch Property Finance '2021-1 B' BV RegS FRN 28/7/2058	740.811	0,01
Îles Marshall				EUR 7.371.157	Dutch Property Finance BV '2020-2 A' RegS FRN 28/1/2058	7.418.357	0,13
USD 1.300.000	Danaos Corp 8,50% 1/3/2028	1.151.432	0,02	EUR 3.725.000	ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN (Perpetual)	4.001.619	0,07
		1.151.432	0,02	EUR 6.400.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	6.432.960	0,11
Maurice				EUR 9.200.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	9.426.136	0,17
USD 250.000	India Green Energy Holdings RegS 5,375% 29/4/2024	213.058	0,00	EUR 3.500.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	3.811.465	0,07
USD 511.000	Network i2i Ltd RegS FRN (Perpetual)	445.894	0,01	EUR 6.000.000	ING Groep NV RegS 1,00% 20/9/2023	6.171.000	0,11
		658.952	0,01	EUR 25.700.000	ING Groep NV RegS FRN 18/2/2029^	25.101.961	0,44
Mexique				EUR 3.590.408	Jubilee Place 2020-1 BV 'A' RegS FRN 17/10/2057	3.631.747	0,06
MXN 101.000.000	Mexican Bonos 8,50% 31/5/2029	4.677.921	0,08	EUR 6.475.000	Jubilee Place '2021-1 A' BV RegS FRN 17/7/2058	6.527.933	0,12
USD 11.716.000	Mexico Government International Bond 3,75% 19/4/2071	8.650.049	0,15	EUR 200.000	Just Eat Takeaway.com NV RegS 1,25% 30/4/2026	203.136	0,00
		13.327.970	0,23	EUR 200.000	Koninklijke KPN NV RegS 0,875% 14/12/2032	197.852	0,00
Monténégro							
EUR 2.000.000	Montenegro Government International Bond RegS 3,375% 21/4/2025^	1.986.280	0,03				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Oman			
EUR 420.276	Magoi BV '2019-1 B' RegS FRN 27/7/2039	421.093	0,01	USD 11.690.000	Oman Government International Bond RegS 3,625% 15/6/2021*	9.578.342	0,17
EUR 139.984	Magoi BV '2019-1 C' RegS FRN 27/7/2039	140.431	0,00			9.578.342	0,17
EUR 70.163	Magoi BV '2019-1 D' RegS FRN 27/7/2039	70.585	0,00	Pakistan			
EUR 70.164	Magoi BV '2019-1 E' RegS FRN 27/7/2039	70.964	0,00	USD 260.000	Pakistan Government International Bond RegS 7,375% 8/4/2031	223.275	0,01
USD 454.000	Mong Duong Finance Holdings BV RegS 5,125% 7/5/2029	370.675	0,01	USD 200.000	Pakistan Water & Power Development Authority RegS 7,50% 4/6/2031	165.130	0,00
EUR 22.896.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	25.583.762	0,45			388.405	0,01
EUR 537.000	Repsol International Finance BV RegS FRN (Perpetual)	586.726	0,01	Panama			
EUR 10.000.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV RegS 20/2/2023 (Zero Coupon)	10.060.100	0,18	EUR 1.515.000	Carnival Corp RegS 10,125% 1/2/2026	1.772.444	0,03
EUR 8.500.000	Silver Arrow Athlon NL 2021-1 BV '2021-1 A' RegS FRN 26/4/2031	8.578.498	0,15			1.772.444	0,03
EUR 2.385.200	Stichting AK Rabobank Certificaten RegS FRN (Perpetual)*	3.123.825	0,06	Philippines			
EUR 144.000	Sudzucker International Finance BV RegS FRN (Perpetual)	120.960	0,00	USD 320.000	Globe Telecom Inc RegS 2,50% 23/7/2030	248.983	0,01
EUR 1.048.750	Summer BidCo BV RegS 9,00% 15/11/2025	1.073.522	0,02	USD 227.000	Rizal Commercial Banking Corp RegS FRN (Perpetual)	191.728	0,00
EUR 10.900.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	11.221.005	0,20			440.711	0,01
EUR 7.500.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	8.035.275	0,14	Pologne			
EUR 3.100.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	3.356.277	0,06	EUR 6.550.000	Santander Bank Polska SA RegS 0,75% 20/9/2021	6.572.303	0,12
EUR 12.216.000	TenneT Holding BV RegS FRN (Perpetual)	12.615.952	0,22			6.572.303	0,12
EUR 1.000.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	1.156.320	0,02	Portugal			
EUR 290.000	Ziggo Bond Co BV RegS 3,375% 28/2/2030	286.050	0,01	EUR 6.500.000	Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria SA RegS 0,875% 17/10/2022	6.604.455	0,12
USD 758.000	Ziggo BV 5,50% 15/1/2027	644.399	0,01	EUR 32.519.556	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,30% 17/10/2031	31.963.146	0,56
		269.126.689	4,74	EUR 7.853.874	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052	7.043.197	0,12
Nouvelle-Zélande				EUR 500.000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 'B' RegS FRN 20/3/2033	502.450	0,01
EUR 9.270.000	ASB Finance Ltd RegS 0,25% 21/5/2031	9.265.087	0,16	EUR 283.745	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 'A' RegS FRN 20/3/2033	284.809	0,01
NZD 7.513.000	Auckland Council RegS 2,95% 28/9/2050	3.867.320	0,07	EUR 800.000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 'C' RegS FRN 20/3/2033	832.741	0,01
EUR 10.000.000	Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023	10.269.400	0,18	EUR 4.731.753	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VI RegS 1,10% 13/2/2023	4.769.324	0,08
NZD 21.960.000	Housing New Zealand Ltd RegS 1,534% 10/9/2035	11.171.691	0,20	EUR 18.662.427	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VII RegS 0,70% 12/2/2024	18.623.447	0,33
NZD 22.369.000	New Zealand Government Bond 1,75% 15/5/2041	11.473.951	0,20	EUR 9.333.847	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta V RegS 0,85% 12/2/2022	9.363.855	0,17
NZD 65.107.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,00% 20/9/2025	48.737.168	0,86			79.987.424	1,41
		94.784.617	1,67	Norvège			
EUR 15.100.000	DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023	15.214.005	0,27	EUR 15.100.000	DNB Bank ASA RegS 0,05% 14/11/2023	15.214.005	0,27
USD 3.205.000	Norske Skogindustri ASA 7,125% 15/10/2033	53	0,00	USD 3.205.000	Norske Skogindustri ASA 7,125% 15/10/2033	53	0,00
EUR 7.200.000	Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon)*	7.241.328	0,12	EUR 7.200.000	Telenor ASA RegS 25/9/2023 (Zero Coupon)*	7.241.328	0,12
		22.455.386	0,39			22.455.386	0,39

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Roumanie				Espagne suite			
EUR 9.877.000	Romanian Government International Bond RegS 3,624% 26/5/2030	11.383.243	0,20	GBP 2.500.000	CaixaBank SA RegS FRN 3/12/2026	2.904.971	0,05
		11.383.243	0,20	EUR 400.000	CaixaBank SA RegS FRN (Perpetual)	457.740	0,01
Russie				EUR 4.600.000	Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033	4.469.268	0,08
RUB 958.160.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,05% 19/1/2028	10.867.208	0,19	EUR 700.000	Cellnex Telecom SA RegS 1,50% 16/1/2026	1.203.916	0,02
		10.867.208	0,19	EUR 800.000	Cellnex Telecom SA RegS 0,50% 5/7/2028	1.058.456	0,02
Serbie				EUR 3.400.000	Cellnex Telecom SA RegS 0,75% 20/11/2031	3.281.340	0,06
EUR 9.890.000	Serbia International Bond RegS 1,50% 26/6/2029	9.877.638	0,18	EUR 1.132.533	Driver Espana Five FDT '5A' RegS FRN 21/12/2028	1.134.298	0,02
USD 17.100.000	Serbia International Bond RegS 2,125% 1/12/2030	13.085.892	0,23	EUR 690.193	Driver Espana Five FDT '5B' RegS FRN 21/12/2028	689.803	0,01
EUR 7.830.000	Serbia International Bond RegS 1,65% 3/3/2033	7.571.375	0,13	EUR 3.545.982	FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 A' RegS FRN 20/3/2033	3.586.129	0,06
		30.534.905	0,54	EUR 886.495	FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 B' RegS FRN 20/3/2033	887.097	0,02
Singapour				EUR 265.949	FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 C' RegS FRN 20/3/2033	266.985	0,00
USD 200.000	ABJA Investment Co Pte Ltd RegS 5,95% 31/7/2024	178.365	0,00	EUR 443.248	FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 D' RegS 3,50% 20/3/2033	447.509	0,01
USD 631.104	LLPL Capital Pte Ltd RegS 6,875% 4/2/2039	605.322	0,01	EUR 1.800.000	International Consolidated Airlines Group SA RegS 0,625% 17/11/2022	1.742.454	0,03
		783.687	0,01	EUR 900.000	International Consolidated Airlines Group SA RegS 1,50% 4/7/2027	815.184	0,01
Slovénie				EUR 1.100.000	International Consolidated Airlines Group SA RegS 1,125% 18/5/2028	1.105.324	0,02
EUR 4.569.000	Slovenia Government Bond RegS 0,488% 20/10/2050*	3.976.446	0,07	EUR 600.000	International Consolidated Airlines Group SA RegS 3,75% 25/3/2029	597.348	0,01
		3.976.446	0,07	EUR 4.900.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,50% 4/10/2021	4.915.974	0,09
Corée du Sud				EUR 5.300.000	Santander Consumer Finance SA RegS 1,00% 27/2/2024	5.456.509	0,10
USD 450.000	Shinhan Financial Group Co Ltd RegS FRN (Perpetual)	367.072	0,01	EUR 34.100.000	Spain Government Bond RegS 0,50% 30/4/2030	34.588.994	0,61
USD 400.000	Tongyang Life Insurance Co Ltd RegS FRN (Perpetual)	341.537	0,00	EUR 13.453.000	Spain Government Bond RegS 0,85% 30/7/2037	13.132.415	0,23
		708.609	0,01	EUR 4.500.000	Telefonica Emisiones SA RegS 1,477% 14/9/2021	4.523.850	0,08
Espagne				EUR 1.500.000	Tendam Brands SAU RegS 5,00% 15/9/2024*	1.449.450	0,03
EUR 12.302	Auto ABS Spanish Loans FT '2016-1 A' RegS FRN 31/12/2032	12.311	0,00	EUR 4.100.000	Wizink Master Credit Cards FT '2019-2 A' RegS FRN 26/3/2033	4.093.254	0,07
EUR 502.277	Autonomia Spain '2019 B' RegS FRN 25/12/2035	503.061	0,01			117.622.941	2,07
EUR 418.564	Autonomia Spain '2019 C' RegS FRN 25/12/2035	422.731	0,01	Supranational			
EUR 251.138	Autonomia Spain '2019 D' RegS FRN 25/12/2035	251.962	0,00	EUR 3.451.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc RegS 2,00% 1/9/2028	3.454.278	0,06
EUR 251.139	Autonomia Spain '2019 E' RegS FRN 25/12/2035	254.404	0,00	GBP 30.499.000	Council Of Europe Development Bank RegS 0,625% 15/6/2022*	35.580.077	0,63
EUR 167.426	Autonomia Spain '2019 F' RegS FRN 25/12/2035	168.143	0,00	EUR 15.167.000	European Investment Bank RegS 14/1/2031 (Zero Coupon)	15.106.635	0,27
EUR 3.400.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,375% 15/11/2026*	3.431.960	0,06				
EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS FRN (Perpetual)	228.482	0,00				
EUR 2.800.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 22/7/2025	2.860.816	0,05				
EUR 2.800.000	Banco de Sabadell SA RegS FRN 11/3/2027	2.884.532	0,05				
EUR 400.000	Banco de Sabadell SA RegS FRN (Perpetual)	419.152	0,01				
EUR 200.000	Banco Santander SA RegS FRN (Perpetual)	205.918	0,00				
EUR 8.100.000	Bankia SA RegS 1,125% 12/11/2026*	8.317.566	0,15				
EUR 4.800.000	BBVA Consumer Auto '2020-1 A' FTA RegS FRN 20/1/2036	4.853.635	0,09				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Supranational suite				Turquie			
EUR 4.722.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,125% 3/1/2051	4.042.315	0,07	USD 7.510.000	Turkey Government International Bond 5,125% 25/3/2022 [^]	6.305.329	0,11
EUR 14.489.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061	11.955.454	0,21	USD 7.310.000	Turkey Government International Bond 6,25% 26/9/2022 [^]	6.248.147	0,11
		70.138.759	1,24			12.553.476	0,22
Suède				Émirats arabes unis			
EUR 185.000	Heimstaden Bostad AB RegS FRN (Perpetual)	183.731	0,00	USD 250.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC RegS 3,40% 29/4/2051	210.287	0,00
EUR 3.600.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028	3.697.920	0,07	USD 300.000	Abu Dhabi Ports Co PJSC RegS 2,50% 6/5/2031	245.538	0,00
GBP 19.823.000	Svensk Exportkredit AB RegS 0,125% 15/12/2025	22.588.963	0,40	USD 375.000	MDGH GMTN RSC Ltd RegS 3,40% 7/6/2051	309.197	0,01
EUR 648.000	Verisure Holding AB RegS FRN 15/4/2025	663.714	0,01			765.022	0,01
EUR 1.580.000	Verisure Midholding AB RegS 5,25% 15/2/2029	1.631.366	0,03	Royaume-Uni			
		28.765.694	0,51	GBP 957.434	Albion No 4 Plc 'A' RegS FRN 17/8/2062	1.119.865	0,02
Suisse				GBP 3.291.000	Atlas Funding '2021-1 A' Plc RegS FRN 25/7/2058	3.847.980	0,07
CHF 1.000.000	Cembra Money Bank AG RegS 9/7/2026 (Zero Coupon)	938.603	0,02	GBP 306.000	Atlas Funding '2021-1 B' Plc RegS FRN 25/7/2058	357.521	0,01
EUR 9.450.000	Credit Suisse AG RegS 0,25% 5/1/2026	9.457.560	0,17	GBP 100.000	Atlas Funding '2021-1 C' Plc RegS FRN 25/7/2058	116.167	0,00
USD 200.000	Credit Suisse Group AG FRN (Perpetual)	182.890	0,00	GBP 100.000	Atlas Funding '2021-1 D' Plc RegS FRN 25/7/2058	117.205	0,00
EUR 3.325.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 2/4/2026	3.669.204	0,06	GBP 2.986.971	Auto ABS UK Loans '2019-1 A' Plc RegS FRN 27/11/2027	3.476.726	0,06
EUR 21.675.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 14/1/2028	21.596.970	0,38	GBP 685.574	Azure Finance No 1 Plc 'B' RegS FRN 30/6/2027	797.218	0,01
EUR 7.100.000	Credit Suisse Group AG RegS 0,625% 18/1/2033	6.585.534	0,12	GBP 6.461.241	Azure Finance No 2 Plc 'A' RegS FRN 20/7/2030	7.539.647	0,13
USD 200.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN (Perpetual)	182.890	0,00	GBP 555.000	Azure Finance No 2 Plc 'C' RegS FRN 20/7/2030	659.174	0,01
USD 200.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN (Perpetual)	177.237	0,00	GBP 4.355.000	Azure Finance Plc 'C' RegS FRN 30/6/2027	5.075.619	0,09
EUR 8.354.000	UBS AG RegS 0,25% 10/1/2022	8.387.834	0,15	USD 500.000	Barclays Plc FRN (Perpetual)	453.613	0,01
EUR 9.275.000	UBS AG RegS 0,01% 31/3/2026	9.248.937	0,16	GBP 1.622.993	Barley Hill No 1 Plc 'A' RegS FRN 28/8/2059	1.891.411	0,03
EUR 12.250.000	UBS Group AG RegS FRN 20/9/2022	12.271.682	0,22	GBP 1.300.000	BAT International Finance Plc RegS 4,00% 4/9/2026	1.660.109	0,03
USD 4.125.000	UBS Group AG RegS FRN (Perpetual) [^]	3.648.142	0,06	EUR 11.457.000	BAT International Finance Plc RegS 2,25% 16/1/2030	12.177.531	0,21
		76.347.483	1,34	GBP 12.900.000	Bellis Acquisition Co Plc RegS 3,25% 16/2/2026	14.996.842	0,26
Thaïlande				GBP 1.800.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,00% 28/4/2023	2.181.887	0,04
USD 227.000	Bangkok Bank PCL RegS FRN 25/9/2034	190.377	0,00	EUR 6.421.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,104% 15/11/2034	6.410.149	0,11
USD 398.000	Bangkok Bank PCL RegS FRN (Perpetual)	343.547	0,01	EUR 9.075.000	BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual)	9.734.480	0,17
USD 200.000	GC Treasury Center Co Ltd RegS 2,98% 18/3/2031	164.900	0,00	GBP 9.297.000	BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual)	11.405.568	0,20
USD 265.000	GC Treasury Center Co Ltd RegS 4,30% 18/3/2051	229.385	0,01	GBP 4.048.830	Brass No 10 Plc 'A2' RegS FRN 16/4/2069	4.711.693	0,08
USD 227.000	Kasikornbank PCL RegS FRN 2/10/2031	191.087	0,00	GBP 1.917.000	Brass No 6 Plc 'A' RegS FRN 16/12/2060	2.228.189	0,04
USD 398.000	Kasikornbank PCL RegS FRN (Perpetual)	345.302	0,01	GBP 2.921.100	Brass No 7 Plc 'A' RegS FRN 16/10/2059	3.408.599	0,06
USD 227.000	TMB Bank PCL RegS FRN (Perpetual)	187.573	0,00	GBP 1.177.940	Brass No 8 Plc 'A2' RegS FRN 16/11/2066	1.380.891	0,02
		1.652.171	0,03	GBP 7.067.000	BUPA Finance Plc RegS 5,00% 8/12/2026	9.573.797	0,17

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
EUR 9.325.000	Cadent Finance Plc RegS 0,625% 19/3/2030	9.302.713	0,16	GBP 5.985.000	Finsbury Square Plc '2018-2 C' RegS FRN 12/9/2068	6.990.846	0,12
GBP 300.000	Canary Wharf Finance II Plc 'C2' RegS FRN 22/10/2037	296.527	0,01	GBP 950.000	Finsbury Square Plc '2018-2 D' RegS FRN 12/9/2068	1.112.963	0,02
GBP 2.051.000	Canary Wharf Finance II Plc 'D2' RegS FRN 22/10/2037	2.071.697	0,04	GBP 1.403.152	Finsbury Square Plc '2019-1 A' RegS FRN 16/6/2069	1.634.372	0,03
EUR 10.250.000	Chanel Ceres Plc RegS 1,00% 31/7/2031	10.204.490	0,18	GBP 485.000	Finsbury Square Plc '2019-1 B' RegS FRN 16/6/2069	566.147	0,01
EUR 3.450.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	3.441.548	0,06	GBP 1.637.184	Finsbury Square Plc '2020-2 A' RegS FRN 16/6/2070	1.920.645	0,03
EUR 5.125.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	5.223.554	0,09	GBP 1.404.871	Friary No 4 Plc 'A' RegS FRN 21/1/2050	1.634.350	0,03
GBP 1.625.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	1.901.948	0,03	GBP 654.847	Gemgarto 2018-1 Plc 'C' RegS FRN 16/9/2065	752.641	0,01
GBP 975.962	Charter Mortgage Funding Plc '2017-1 A' RegS FRN 12/6/2054	1.134.013	0,02	GBP 6.334.000	Gemgarto '2021-1 A' Plc RegS FRN 16/12/2067	7.390.409	0,13
GBP 4.489.624	CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057	5.225.415	0,09	GBP 669.000	Gemgarto '2021-1 B' Plc RegS FRN 16/12/2067	779.322	0,01
GBP 220.000	CMF '2020-1 B' Plc RegS FRN 16/1/2057	255.025	0,00	GBP 218.000	Gemgarto '2021-1 C' Plc RegS FRN 16/12/2067	253.946	0,00
GBP 100.000	CMF '2020-1 C' Plc RegS FRN 16/1/2057	115.926	0,00	GBP 11.118.402	Gemgarto Plc '2018-1 A' RegS FRN 16/9/2065	12.986.806	0,23
GBP 7.064.241	Dignity Finance Plc RegS 3,546% 31/12/2034	8.906.005	0,16	GBP 1.585.629	Gemgarto Plc '2018-1 B' RegS FRN 16/9/2065	1.835.358	0,03
GBP 3.404.000	Dignity Finance Plc RegS 4,696% 31/12/2049	3.684.870	0,07	GBP 234.945	Gemgarto Plc '2018-1 D' RegS FRN 16/9/2065	269.483	0,00
GBP 296.769	DLL UK Equipment Finance Plc '2019-1UK A' RegS FRN 25/3/2028	345.283	0,01	EUR 11.050.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 23/9/2023 (Zero Coupon)*	11.109.228	0,20
EUR 2.000.000	EC Finance Plc RegS 2,375% 15/11/2022	1.964.120	0,03	GBP 2.175.744	Globaldrive Auto Receivables UK '2019-A A' Plc RegS FRN 20/9/2026	2.528.206	0,04
GBP 4.696.000	E-Carat 12 Plc '12 A' RegS FRN 18/8/2029	5.453.182	0,10	GBP 2.820.000	Globaldrive Auto Receivables 'UK 2019-A B' Plc RegS FRN 20/9/2026	3.290.859	0,06
GBP 1.400.000	Economic Master Issuer Plc '2020-1 A1' RegS FRN 25/6/2072	1.632.226	0,03	GBP 5.000.000	Gosforth Funding Plc '2017-1X A2' RegS FRN 19/12/2059	5.824.682	0,10
EUR 100.000	eG Global Finance Plc RegS 3,625% 7/2/2024	96.978	0,00	GBP 4.576.001	Gosforth Funding Plc '2018-1X A2' RegS FRN 25/8/2060	5.336.545	0,09
GBP 1.967.000	eG Global Finance Plc RegS 6,25% 30/3/2026	2.268.183	0,04	GBP 1.000.000	Greene King Finance Plc 1,88% 15/12/2034	979.174	0,02
GBP 4.009.268	Elvet Mortgages Plc '2018-1 A' RegS FRN 22/10/2058	4.674.750	0,08	GBP 2.758.614	Greene King Finance Plc RegS FRN 15/12/2033	3.186.260	0,06
USD 1.265.466	EnQuest Plc RegS 7,00% 15/10/2023	912.153	0,02	GBP 1.666.850	Greene King Finance Plc RegS 3,593% 15/3/2035	2.047.854	0,04
GBP 110.872	EnQuest Plc RegS 7,00% 15/10/2023	113.658	0,00	GBP 905.821	Greene King Finance Plc RegS 4,064% 15/3/2035	1.145.380	0,02
GBP 48.966	Eurosail Plc '2006-1X A2C' RegS FRN 10/6/2044	56.842	0,00	GBP 3.687.293	Hops Hill No 1 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2054	4.309.659	0,08
GBP 1.828.826	Feldspar Plc '2016-1 A' RegS FRN 15/9/2045	2.125.968	0,04	GBP 345.980	Hops Hill No 1 Plc 'B' RegS FRN 27/5/2054	405.371	0,01
GBP 2.705.000	Finsbury Square '2018-2B' Plc RegS FRN 12/9/2068	3.153.744	0,06	GBP 199.992	Hops Hill No 1 Plc 'C' RegS FRN 27/5/2054	233.951	0,00
GBP 155.000	Finsbury Square '2019-2 C' Plc RegS FRN 16/9/2069	181.175	0,00	GBP 99.998	Hops Hill No 1 Plc 'D' RegS FRN 27/5/2054	117.558	0,00
GBP 145.000	Finsbury Square '2019-2 D' Plc RegS FRN 16/9/2069	169.825	0,00	USD 400.000	HSBC Bank Plc FRN (Perpetual)	306.457	0,01
GBP 2.053.388	Finsbury Square '2019-3 A' Plc RegS FRN 16/12/2069	2.398.804	0,04	EUR 15.375.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2026*	15.387.915	0,27
GBP 348.998	Finsbury Square '2019-3 C' Plc RegS FRN 16/12/2069	408.908	0,01	EUR 7.475.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2031	7.395.915	0,13
GBP 3.143.530	Finsbury Square '2020-1X A' Plc RegS FRN 16/3/2070	3.659.984	0,06	EUR 400.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN (Perpetual)	451.120	0,01
GBP 214.960	Finsbury Square '2020-1X C' Plc RegS FRN 16/3/2070	248.554	0,00	EUR 5.450.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc RegS 2,50% 15/1/2026	5.477.632	0,10
GBP 5.481.731	Finsbury Square Plc '2018-2 A' RegS FRN 12/9/2068	6.384.693	0,11				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
USD 1.050.000	Ithaca Energy North Sea Plc 9,375% 15/7/2024	870.853	0,02	GBP 3.121.000	Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029	3.638.935	0,06
USD 1.500.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 4,50% 1/10/2027*	1.178.760	0,02	GBP 775.000	Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X B' RegS FRN 15/3/2029	901.855	0,02
USD 800.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 5,875% 15/1/2028	669.872	0,01	GBP 6.800.000	Newday Partnership Funding Plc '2017-1 A' RegS FRN 15/12/2027	7.892.048	0,14
GBP 5.720.818	Jupiter Mortgage NO 1 Plc 'A' RegS FRN 20/7/2060	6.648.721	0,12	EUR 334.800	Newgate Funding Plc '2006-1 BB' RegS FRN 1/12/2050	327.882	0,01
GBP 4.046.088	Kenrick No 3 Plc 'A' RegS FRN 11/10/2054	4.708.832	0,08	GBP 8.223.000	NGG Finance Plc RegS FRN 18/6/2073	10.681.468	0,19
GBP 7.790.000	Lanark Master Issuer Plc '2017-1X 2A' RegS FRN 22/12/2069	9.089.961	0,16	EUR 5.000.000	NGG Finance Plc RegS FRN 5/12/2079	5.039.200	0,09
GBP 7.500.000	Lanark Master Issuer Plc '2018-1X 2A' RegS FRN 22/12/2069	8.747.631	0,15	GBP 9.743.581	Oat Hill No 2 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2046	11.341.546	0,20
GBP 2.115.500	Lanark Master Issuer Plc '2019-1X 1A2' RegS FRN 22/12/2069	2.459.690	0,04	GBP 1.729.021	Orbita Funding '2020-1 A' Plc RegS FRN 17/3/2027	2.011.014	0,04
GBP 1.334.500	Lanark Master Issuer Plc RegS FRN 22/12/2069	1.558.416	0,03	EUR 20.836.000	OTE Plc RegS 0,875% 24/9/2026^	21.332.105	0,38
GBP 370.000	Lanebrook Mortgage Transaction '2020-1 C' Plc RegS FRN 12/6/2057	437.150	0,01	EUR 800.714	Paragon Mortgages No 12 Plc '12X A2B' RegS FRN 15/11/2038	788.303	0,01
GBP 10.058.740	Lanebrook Mortgage Transaction Plc '2020-1 A1' RegS FRN 12/6/2057	11.779.007	0,21	GBP 6.445.785	Paragon Mortgages No 25 Plc 'A' RegS FRN 15/5/2050	7.487.154	0,13
GBP 630.000	Lanebrook Mortgage Transaction Plc '2020-1 B' RegS FRN 12/6/2057	743.168	0,01	GBP 975.000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'B' RegS FRN 15/5/2050	1.126.022	0,02
GBP 20.517.000	LCR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028	30.006.414	0,53	GBP 770.000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'C' RegS FRN 15/5/2050	893.154	0,02
GBP 375.000	Legal & General Group Plc RegS FRN (Perpetual)	481.294	0,01	GBP 7.462.000	PCL Funding III Plc '2017-2 A' RegS FRN 15/6/2023	8.669.624	0,15
EUR 400.000	Lloyds Banking Group Plc RegS FRN (Perpetual)*	439.208	0,01	GBP 332.000	PCL Funding III Plc '2017-2 C' RegS FRN 15/6/2023	385.520	0,01
GBP 3.719.000	London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051	4.337.471	0,08	GBP 745.000	PCL Funding III Plc 'B' RegS FRN 15/6/2023	865.208	0,02
GBP 933.000	Matalan Finance Plc RegS 6,75% 31/1/2023^	988.512	0,02	GBP 5.730.000	PCL Funding IV Plc '2020-1 A' RegS FRN 15/9/2024	6.692.550	0,12
GBP 100.000	Metrocentre Finance Plc 8,75% 6/12/2023	58.358	0,00	GBP 605.000	PCL Funding IV Plc '2020-1 B' RegS FRN 15/9/2024	707.543	0,01
GBP 394.850	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS 6,013% 15/12/2028	506.596	0,01	GBP 230.000	PCL Funding IV Plc '2020-1 C' RegS FRN 15/9/2024	269.192	0,00
GBP 2.080.000	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS 6,469% 15/9/2030	2.716.357	0,05	GBP 4.402.000	PCL Funding V Plc '2021-1 A' RegS FRN 15/10/2025	5.118.422	0,09
GBP 955.000	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/9/2034	902.622	0,02	GBP 486.000	PCL Funding V Plc '2021-1 B' RegS FRN 15/10/2025	564.699	0,01
GBP 1.165.000	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/6/2036	1.091.933	0,02	GBP 115.000	PCL Funding V Plc '2021-1 C' RegS FRN 15/10/2025	133.593	0,00
GBP 336.718	Motor Plc '2016-1 A' RegS 1,30% 25/11/2025	391.185	0,01	GBP 5.305.000	Penarth Master Issuer Plc '2018-1X A2' RegS FRN 18/3/2025	6.182.128	0,11
GBP 1.710.000	Motor Plc '2016-1 C' RegS 3,75% 25/11/2025	1.986.067	0,04	GBP 3.965.000	Permanent Master Issuer Plc RegS FRN 15/7/2058	4.624.139	0,08
GBP 343.000	Motor Plc '2016-1 D' RegS 4,25% 25/11/2025	398.375	0,01	GBP 4.453.000	Precise Mortgage Funding '2019-1B A2' Plc RegS FRN 12/12/2055	5.236.053	0,09
GBP 285.000	Motor Plc '2016-1 E' RegS 5,25% 25/11/2025	331.011	0,01	GBP 115.000	Precise Mortgage Funding '2020-1B B' Plc RegS FRN 16/10/2056	134.417	0,00
GBP 6.133.000	National Grid Electricity Transmission Plc RegS 2,00% 16/9/2038	6.960.414	0,12	GBP 100.000	Precise Mortgage Funding '2020-1B C' Plc RegS FRN 16/10/2056	116.667	0,00
GBP 3.090.000	National Grid Electricity Transmission Plc RegS 2,00% 17/4/2040	3.455.824	0,06	GBP 100.000	Precise Mortgage Funding '2020-1B D' Plc RegS FRN 16/10/2056	116.258	0,00
EUR 6.525.000	Nationwide Building Society RegS 0,50% 5/5/2041	6.360.505	0,11	GBP 133.793	Premiertel Plc 6,175% 8/5/2032	186.920	0,00
GBP 12.075.000	Natwest Group Plc RegS FRN 28/11/2031	14.020.918	0,25	GBP 8.668.376	Prs Finance Plc RegS 1,75% 24/11/2026	10.630.749	0,19
USD 3.489.000	Neptune Energy Bondco Plc 6,625% 15/5/2025	2.898.922	0,05				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
GBP 5.200.000	Prs Finance Plc RegS 2,00% 23/1/2029	6.422.534	0,11	EUR 500.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc RegS FRN 31/7/2025	499.450	0,01
GBP 2.155.644	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'A' RegS FRN 20/12/2046	2.506.795	0,04	GBP 1.300.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc RegS 8,25% 31/7/2025	1.592.577	0,03
GBP 3.070.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'B' RegS FRN 20/12/2046	3.574.915	0,06	EUR 2.800.000	Swiss Re Finance UK Plc RegS FRN 4/6/2052	3.063.508	0,05
GBP 695.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'C' RegS FRN 20/12/2046	807.647	0,01	GBP 250.000	Telereal Securitisation Plc FRN 10/12/2031	247.554	0,00
GBP 2.734.816	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'A' RegS FRN 20/3/2050	3.179.456	0,06	GBP 510.206	Tesco Property Finance 1 Plc RegS 7,623% 13/7/2039	875.539	0,02
GBP 2.350.000	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'B' RegS FRN 20/3/2050	2.732.392	0,05	GBP 12.605.557	Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040	19.433.273	0,34
GBP 460.000	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'C' RegS FRN 20/3/2050	534.157	0,01	GBP 1.347.096	Tesco Property Finance 4 Plc RegS 5,801% 13/10/2040	2.080.699	0,04
GBP 5.152.177	Residential Mortgage Securities '32X A' Plc RegS FRN 20/6/2070	6.058.903	0,11	GBP 8.190.000	Tower Bridge Funding '2021-1 A' RegS FRN 21/7/2064	9.536.704	0,17
GBP 525.000	Residential Mortgage Securities '32X C' Plc RegS FRN 20/6/2070	620.907	0,01	GBP 383.000	Tower Bridge Funding '2021-1 B' RegS FRN 21/7/2064	445.433	0,01
GBP 6.883.338	Ripon Mortgages Plc '1X A1' RegS FRN 20/8/2056	8.013.441	0,14	GBP 365.000	Tower Bridge Funding '2021-1 C' RegS FRN 21/7/2064	424.509	0,01
GBP 22.810.000	Ripon Mortgages Plc '1X B1' RegS FRN 20/8/2056	26.545.759	0,47	GBP 253.000	Tower Bridge Funding '2021-1 D' RegS FRN 21/7/2064	293.904	0,01
GBP 485.000	Ripon Mortgages Plc '1X B2' RegS FRN 20/8/2056	563.699	0,01	GBP 4.629.018	Tower Bridge Funding Plc '2020-1 A' RegS FRN 20/9/2063	5.435.059	0,10
GBP 11.250.000	Ripon Mortgages Plc '1X C1' RegS FRN 20/8/2056	13.093.860	0,23	GBP 695.000	Tower Bridge Funding Plc '2020-1 B' RegS FRN 20/9/2063	819.743	0,01
EUR 2.314.310	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS1X M1C' RegS FRN 12/6/2044	2.238.026	0,04	GBP 145.000	Tower Bridge Funding Plc '2020-1 C' RegS FRN 20/9/2063	171.102	0,00
GBP 4.651.766	RMAC Securities No 2 Plc '2018-2 A' RegS FRN 12/6/2046	5.426.311	0,10	GBP 115.000	Tower Bridge Funding Plc '2020-1 D' RegS FRN 20/9/2063	137.590	0,00
GBP 410.000	RMAC Securities No 2 Plc '2018-2 B' RegS FRN 12/6/2046	477.775	0,01	GBP 8.250.000	Tritax Big Box REIT Plc RegS 1,50% 27/11/2033	9.131.210	0,16
GBP 420.000	RMAC Securities No 2 Plc '2018-2 C' RegS FRN 12/6/2046	488.554	0,01	USD 1.400.000	Tullow Oil Plc 10,25% 15/5/2026	1.180.145	0,02
GBP 3.345.000	Sage AR Funding No 1 Plc 'A' RegS FRN 17/11/2030	3.895.768	0,07	GBP 252.941	Turbo Finance 8 Plc 'A' RegS FRN 20/2/2026	293.788	0,01
GBP 1.085.000	Sage AR Funding No 1 Plc 'B' RegS FRN 17/11/2030	1.264.213	0,02	GBP 1.190.000	Turbo Finance 8 Plc 'C' RegS FRN 20/2/2026	1.387.085	0,02
GBP 535.000	Sage AR Funding No 1 Plc 'C' RegS FRN 17/11/2030	623.661	0,01	GBP 1.594.000	Turbo Finance 9 Plc 'B' RegS FRN 20/8/2028	1.866.799	0,03
GBP 5.893.952	Silk Road Finance Number Six Plc 'A' RegS FRN 21/9/2067	6.901.658	0,12	GBP 8.620.000	Turbo Finance Plc '9 A' RegS FRN 20/8/2028	10.070.662	0,18
GBP 9.435.000	Silverstone Master Issuer Plc '2018-1X 2A' RegS FRN 21/1/2070	11.007.368	0,19	GBP 1.685.000	Twin Bridges 2018-1 Plc 'B' RegS FRN 12/9/2050	1.962.216	0,03
GBP 1.768.800	Silverstone Master Issuer Plc '2019-1X 2A' RegS FRN 21/1/2070	2.073.676	0,04	GBP 1.854.039	Twin Bridges '2019-2 A' Plc RegS FRN 12/6/2053	2.168.516	0,04
GBP 9.640.000	Silverstone Master Issuer Plc RegS FRN 21/1/2070	11.237.672	0,20	GBP 1.196.000	Twin Bridges '2019-2 B' Plc RegS FRN 12/6/2053	1.399.339	0,02
EUR 951.000	Sky Ltd RegS 2,25% 17/11/2025	1.045.758	0,02	GBP 565.000	Twin Bridges '2019-2 C' Plc RegS FRN 12/6/2053	660.863	0,01
USD 5.195.000	Standard Chartered Plc RegS FRN 23/3/2025*	4.293.279	0,08	GBP 250.000	Twin Bridges '2019-2 D' Plc RegS FRN 12/3/2055	293.598	0,01
GBP 525.221	Stanlington No 1 Plc '2017-1 A' RegS FRN 12/6/2046	610.655	0,01	GBP 5.884.000	Twin Bridges '2021-1 D' Plc RegS FRN 12/3/2055	6.866.651	0,12
GBP 180.000	Stanlington No 1 Plc '2017-1E' RegS FRN 12/6/2046	211.105	0,00	GBP 436.000	Twin Bridges '2021-1 D' Plc RegS FRN 12/3/2055	507.326	0,01
				GBP 220.000	Twin Bridges '2021-1 D' Plc RegS FRN 12/3/2055	256.999	0,00
				GBP 1.310.000	Twin Bridges '2021-1 D' Plc RegS FRN 12/3/2055	1.525.293	0,03

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				États-Unis suite			
GBP 10.860.827	Twin Bridges Plc '2018-1 A' RegS FRN 12/9/2050	12.682.194	0,22	EUR 21.300.000	Bank of America Corp RegS FRN 26/10/2031	20.890.529	0,37
GBP 3.483.000	Twin Bridges Plc '2018-1 C' RegS FRN 12/9/2050	4.081.660	0,07	EUR 7.300.000	Bank of America Corp RegS FRN 24/5/2032	7.389.936	0,13
GBP 2.040.000	Twin Bridges Plc '2018-1 D' RegS FRN 12/9/2050	2.384.512	0,04	EUR 11.825.000	BAT Capital Corp RegS FRN 16/8/2021	11.832.331	0,21
GBP 2.186.632	Twin Bridges Plc '2019-1 A' RegS FRN 12/12/2052	2.549.968	0,05	EUR 2.556.000	Becton Dickinson and Co 1,401% 24/5/2023	2.628.488	0,05
GBP 385.000	Twin Bridges Plc '2019-1B' RegS FRN 12/12/2052	448.701	0,01	EUR 5.700.000	Booking Holdings Inc 0,10% 8/3/2025	5.712.198	0,10
GBP 550.000	Twin Bridges Plc '2019-1C' RegS FRN 12/12/2052	641.659	0,01	USD 5.000.000	Cargo Aircraft Management Inc 4,75% 1/2/2028	4.199.830	0,07
GBP 6.540.780	Twin Bridges Plc '2020-1 A' RegS FRN 12/12/2054	7.706.402	0,14	EUR 600.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co RegS 4,375% 15/5/2026	622.887	0,01
GBP 1.145.000	Twin Bridges Plc '2020-1 B' RegS FRN 12/12/2054	1.353.223	0,02	EUR 6.150.000	Coca-Cola Co 0,125% 9/3/2029	6.047.172	0,11
GBP 390.000	Twin Bridges Plc '2020-1 C' RegS FRN 12/12/2054	460.832	0,01	USD 6.500.000	Commercial Metals Co 4,875% 15/5/2023	5.626.646	0,10
GBP 225.000	Twin Bridges Plc '2020-1 D' RegS FRN 12/12/2054	265.472	0,00	USD 5.310.000	Delta Air Lines '2019-1 AA' Pass Through Trust 3,204% 25/4/2024	4.556.529	0,08
GBP 272.000	Unique Pub Finance Co Plc RegS 7,395% 28/3/2024	341.361	0,01	GBP 528.000	Encore Capital Group Inc RegS 4,25% 1/6/2028	613.499	0,01
GBP 1.022.433	Unique Pub Finance Co Plc RegS 5,659% 30/6/2027	1.341.885	0,02	USD 3.577.000	Energy Transfer LP 4,25% 15/3/2023	3.086.657	0,05
GBP 371.000	Unique Pub Finance Co Plc RegS 6,464% 30/3/2032	504.201	0,01	USD 8.540.000	Energy Transfer LP 5,875% 15/1/2024	7.785.722	0,14
GBP 11.100.000	United Kingdom Gilt RegS 0,625% 22/10/2050	10.761.218	0,19	USD 2.080.000	Energy Transfer LP 7,60% 1/2/2024	1.943.458	0,03
GBP 100.000	Virgin Media Secured Finance Plc RegS 5,25% 15/5/2029	123.140	0,00	USD 5.231.000	Energy Transfer LP 4,20% 15/4/2027	4.714.361	0,08
GBP 600.000	Virgin Media Secured Finance Plc RegS 4,25% 15/1/2030	698.155	0,01	USD 2.821.000	Energy Transfer LP / Regency Energy Finance Corp 4,50% 1/11/2023	2.486.534	0,04
GBP 245.000	Vmed O2 UK Financing I Plc RegS 4,00% 31/1/2029	282.585	0,01	EUR 8.450.000	Fidelity National Information Services Inc 0,125% 3/12/2022	8.489.123	0,15
EUR 300.000	Vmed O2 UK Financing I Plc RegS 3,25% 31/1/2031	302.736	0,01	EUR 3.235.000	Fidelity National Information Services Inc 0,75% 21/5/2023	3.287.698	0,06
EUR 500.000	Vodafone Group Plc RegS FRN 3/1/2079	518.620	0,01	USD 5.500.000	FirstEnergy Transmission LLC 4,35% 15/1/2025	4.902.267	0,09
EUR 900.000	Vodafone Group Plc RegS FRN 27/8/2080	917.631	0,02	USD 3.210.000	Flex Intermediate Holdco LLC 4,317% 30/12/2039	2.639.463	0,05
		811.757.344	14,30	USD 17.100.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,875% 2/8/2021	14.099.365	0,25
États-Unis				USD 19.897.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,813% 12/10/2021	16.499.402	0,29
USD 3.250.000	ADT Security Corp 3,50% 15/7/2022	2.714.470	0,05	USD 19.896.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,339% 28/3/2022	16.547.385	0,29
EUR 11.050.000	Air Products and Chemicals Inc 0,80% 5/5/2032	11.200.722	0,20	USD 6.500.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,35% 1/11/2022	5.454.665	0,10
USD 2.776.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 3,50% 15/2/2023	2.334.327	0,04	USD 6.500.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,087% 9/1/2023	5.432.669	0,10
USD 5.846.000	Amazon.com Inc 2,70% 3/6/2060	4.277.611	0,07	GBP 10.269.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,535% 6/3/2025	12.698.293	0,22
USD 15.737.972	American Airlines '2013-2 A' Pass Through Trust 4,95% 15/1/2023	13.014.769	0,23	USD 4.000.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,25% 1/6/2025	3.705.258	0,06
USD 2.776.465	American Airlines '2015-2B' Pass Through Trust 4,40% 22/9/2023	2.190.981	0,04	USD 9.000.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,375% 15/4/2026	8.429.715	0,15
USD 3.983.151	American Airlines 2016-3 Class AA Pass Through Trust 3,00% 15/10/2028	3.288.709	0,06	USD 1.000.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,30% 15/1/2029	947.742	0,02
USD 6.099.446	American Airlines 2017-2 Class B Pass Through Trust 3,70% 15/10/2025	4.708.026	0,08	EUR 9.500.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 27/7/2021	9.514.060	0,17
USD 2.000.000	Amkor Technology Inc 6,625% 15/9/2027	1.770.705	0,03	EUR 16.150.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 9/9/2022	16.169.864	0,28
USD 14.878.000	Apple Inc 2,55% 20/8/2060	10.696.724	0,19	EUR 18.350.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 21/4/2023	18.391.948	0,32
USD 12.600.000	Apple Inc 2,80% 8/2/2061	9.446.496	0,17	EUR 9.425.000	Goldman Sachs Group Inc RegS FRN 30/4/2024	9.432.257	0,17
GBP 8.780.000	Bank of America Corp RegS FRN 2/6/2029	10.222.853	0,18				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				États-Unis suite			
EUR 5.950.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 3,375% 27/3/2025	6.674.234	0,12	USD 13.394.952	United States Treasury Inflation Indexed Bond 1,00% 15/2/2048 [^]	14.149.923	0,25
USD 1.015.000	Gray Oak Pipeline LLC 2,00% 15/9/2023	849.460	0,01	USD 2.253.006	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,25% 15/2/2050	2.006.739	0,03
USD 7.010.000	Gray Oak Pipeline LLC 2,60% 15/10/2025	5.917.666	0,10			522.147.575	9,20
USD 2.730.000	Huntsman International LLC 2,95% 15/6/2031	2.251.621	0,04	Total des obligations		4.680.820.333	82,46
USD 600.000	Hyundai Capital America RegS 6,375% 8/4/2030	631.320	0,01	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
EUR 15.025.000	International Flavors & Fragrances Inc 1,80% 25/9/2026 [^]	16.101.842	0,28	Irlande			
GBP 5.330.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2026	6.200.145	0,11	EUR 133.413	iShares EUR Corp Bond 1-5yr UCITS ETF ^{^-^}	14.894.894	0,26
GBP 3.220.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2033	3.750.539	0,07	USD 528.076	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ^{^-^}	24.807.096	0,44
EUR 500.000	Kronos International Inc RegS 3,75% 15/9/2025 [^]	510.715	0,01			39.701.990	0,70
USD 1.345.000	Level 3 Financing Inc 3,75% 15/7/2029	1.064.020	0,02	Total des Fonds négociés en bourse		39.701.990	0,70
EUR 5.609.000	Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027	5.806.773	0,10	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		4.720.522.323	83,16
USD 2.895.000	Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,10% 15/5/2028	2.637.126	0,05	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
EUR 14.700.000	Morgan Stanley FRN 26/7/2024	14.930.643	0,26	OBLIGATIONS			
EUR 24.600.000	Morgan Stanley FRN 29/10/2027	24.566.052	0,43	Japon			
EUR 8.800.000	National Grid North America Inc RegS 0,75% 8/8/2023	8.964.824	0,16	JPY 7.891.395	Japanese Government CPI Linked Bond 0,10% 10/3/2028	60.363	0,00
USD 2.782.000	Navient Corp 7,25% 25/1/2022	2.365.063	0,04			60.363	0,00
USD 3.718.000	Navient Corp 6,50% 15/6/2022	3.191.251	0,06	Nouvelle-Zélande			
USD 21.500.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4,25% 15/7/2024	18.687.495	0,33	NZD 10.240.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond RegS 2,50% 20/9/2040	8.347.569	0,15
USD 13.962.000	NGPL PipeCo LLC 4,375% 15/8/2022	11.852.001	0,21			8.347.569	0,15
USD 7.135.000	Nissan Motor Acceptance Corp 2,00% 9/3/2026	5.860.851	0,10	Royaume-Uni			
USD 3.415.000	Nissan Motor Acceptance Corp 2,75% 9/3/2028	2.807.385	0,05	GBP 950.000	Stonegate Pub Co Financing Plc RegS 8,00% 13/7/2025	1.149.456	0,02
USD 14.900.000	Occidental Petroleum Corp 10/10/2036 (Zero Coupon)	6.086.117	0,11	GBP 649.000	Virgin Media Secured Finance Plc RegS 4,125% 15/8/2030	749.782	0,01
USD 12.800.000	Oracle Corp 2,875% 25/3/2031	10.741.863	0,19			1.899.238	0,03
USD 427.000	Periama Holdings LLC RegS 5,95% 19/4/2026	378.179	0,01	Total des obligations		10.307.170	0,18
EUR 2.000.000	Scientific Games International Inc RegS 5,50% 15/2/2026	2.023.980	0,04	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		10.307.170	0,18
USD 365.000	SK Battery America Inc RegS 2,125% 26/1/2026	297.143	0,00	Organismes de placement collectif			
USD 750.000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC 3,36% 20/9/2021	616.546	0,01	Irlande			
USD 5.000.000	Trans-Allegheny Interstate Line Co 3,85% 1/6/2025	4.431.656	0,08	3.596	BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund ^{^-}	355.405	0,01
USD 2.008.633	United Airlines '2014-1 A' Pass Through Trust 4,00% 11/4/2026	1.711.649	0,03	2.248.224	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund (Dist) ^{^-}	222.274.947	3,91
USD 2.108.498	United Airlines '2014-2 B' Pass Through Trust 4,625% 3/9/2022	1.765.961	0,03			222.630.352	3,92
USD 8.640.030	United Airlines '2020-1 A' Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027	7.824.023	0,14	Total des organismes de placement collectif		222.630.352	3,92
USD 2.144.805	United Airlines '2020-1 B' Pass Through Trust 'B' 4,875% 15/1/2026	1.848.426	0,03	Portefeuille de titres à la valeur de marché		4.953.459.845	87,26
				Autres éléments de l'actif net		722.826.913	12,74
				Total de l'actif net (EUR)		5.676.286.758	100,00

[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	USD 6.750.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.25 Version 8 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(28.501)	(535.645)
CCCDs	EUR 26.338.200	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(73.820)	(3.120.654)
CCCDs	EUR 282.500.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(577.183)	(7.153.787)
CCCDs	EUR 9.220.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Sub Financials Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(63.970)	37.516
CCCDs	USD 30.000.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Asia HJ IG Series 24 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	72.394	173.283
CCILS	EUR 25.093.577	Fund receives Fixed 1,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFE	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(426.376)	(425.804)
CCILS	USD 21.536.100	Fund receives Fixed 2,321% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	25/2/2031	(591.846)	(591.442)
CCILS	USD 10.280.000	Fund receives Fixed 2,338% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	11/3/2031	(261.211)	(261.014)
CCILS	USD 18.795.000	Fund receives Fixed 2,348% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2031	(462.961)	(462.605)
CCILS	USD 19.928.863	Fund receives Fixed 2,350% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(485.948)	(485.572)
CCILS	USD 19.928.862	Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(478.871)	(478.494)
CCILS	USD 39.857.725	Fund receives Fixed 2,358% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(945.354)	(944.600)
CCILS	USD 39.110.000	Fund receives Fixed 2,388% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2031	(847.811)	(847.074)
CCILS	USD 9.505.000	Fund receives Fixed 2,432% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	6/5/2051	(115.571)	(115.200)
CCILS	USD 9.505.000	Fund receives Fixed 2,438% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	7/5/2051	(100.156)	(99.783)
CCILS	USD 18.330.000	Fund receives Fixed 2,448% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	29/3/2031	(282.617)	(282.263)
CCILS	USD 9.180.000	Fund receives Fixed 2,474% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2031	(117.119)	(116.941)
CCILS	USD 9.505.000	Fund receives Fixed 2,484% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2051	29.183	29.552
CCILS	USD 9.505.000	Fund receives Fixed 2,488% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2051	40.431	40.800
CCILS	USD 4.860.000	Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	30/3/2031	(49.549)	(49.455)
CCILS	USD 26.610.000	Fund receives Fixed 2,669% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	189.643	190.145
CCILS	GBP 10.695.000	Fund receives Fixed 3,202% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(505.241)	(504.973)
CCILS	GBP 13.367.500	Fund receives Fixed 3,270% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(499.522)	(499.173)
CCILS	GBP 5.445.000	Fund receives Fixed 3,285% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(191.569)	(191.427)
CCILS	GBP 13.367.500	Fund receives Fixed 3,290% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(460.554)	(460.205)
CCILS	GBP 5.445.000	Fund receives Fixed 3,293% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(185.215)	(185.073)
CCILS	GBP 25.780.000	Fund receives Fixed 3,315% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2030	(936.763)	(936.103)
CCILS	GBP 9.360.000	Fund receives Fixed 3,340% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(254.060)	(253.816)
CCILS	GBP 33.942.000	Fund receives Fixed 3,456% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2030	(1.095.711)	(1.094.861)
CCILS	GBP 43.112.933	Fund receives Fixed 3,475% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/10/2029	402.125	403.259
CCILS	GBP 48.635.000	Fund receives Fixed 3,500% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2030	(963.686)	(962.467)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	GBP 22.100.000	Fund receives Fixed 3,625% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2031	(443.623)	(443.040)
CCILS	GBP 18.765.000	Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2030	(228.764)	(228.296)
CCILS	GBP 49.279.000	Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(828.396)	(827.103)
CCILS	GBP 27.410.000	Fund receives Fixed 3,658% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(430.229)	(429.503)
CCILS	GBP 14.340.000	Fund receives Fixed 3,700% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(90.467)	(135.654)
CCILS	GBP 28.300.000	Fund receives Fixed 3,730% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(126.317)	(141.101)
CCILS	GBP 7.055.666	Fund receives Fixed 3,756% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(6.997)	(6.809)
CCILS	GBP 13.851.000	Fund receives Fixed 3,758% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(11.443)	(11.077)
CCILS	GBP 55.113.000	Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2028	2.848.482	2.868.169
CCILS	GBP 4.617.000	Fund receives Fixed 3,790% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	18.332	18.454
CCILS	GBP 7.353.000	Fund receives Fixed 3,796% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	35.819	36.014
CCILS	EUR 100.000.000	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,122%	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2021	(552.941)	(552.004)
CCILS	GBP 48.635.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,410%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2025	307.737	308.543
CCIRS	NOK 424.942.500	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/11/2022	(174.350)	(174.022)
CCIRS	NOK 481.601.500	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	24/11/2022	(198.661)	(198.288)
CCIRS	NOK 385.281.200	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/11/2022	(159.779)	(159.482)
CCIRS	NOK 732.034.280	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/11/2022	(308.541)	(307.973)
CCIRS	NOK 404.545.260	Fund receives Fixed 0,475% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/11/2022	(168.535)	(168.221)
CCIRS	NOK 252.580.000	Fund receives Fixed 0,490% and pays Floating NOK 6 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/9/2022	(64.584)	(64.393)
CCIRS	NOK 404.545.260	Fund receives Fixed 0,495% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/12/2022	(167.473)	(167.160)
CCIRS	CAD 34.529.000	Fund receives Fixed 0,780% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	17/11/2023	(98.803)	(98.620)
CCIRS	CAD 135.166.000	Fund receives Fixed 0,780% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	18/11/2023	(393.261)	(392.543)
CCIRS	CAD 278.995.000	Fund receives Fixed 0,809% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	16/11/2023	(741.351)	(739.864)
CCIRS	CZK 1.476.930.000	Fund receives Fixed 1,120% and pays Floating CZK 6 Month PRIBO	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2023	(234.860)	(234.389)
CCIRS	CZK 2.213.370.000	Fund receives Fixed 1,170% and pays Floating CZK 6 Month PRIBO	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2023	(264.823)	(264.117)
CCIRS	NZD 10.900.000	Fund receives Fixed 1,890% and pays Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate	Bank of America Merrill Lynch	11/5/2031	(63.351)	(63.225)
CCIRS	HUF 5.359.290.000	Fund receives Fixed 2,162% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2026	(104.766)	(104.556)
CCIRS	AUD 3.617.354	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,676%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	306.420	306.507
CCIRS	AUD 3.568.919	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,677%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	301.795	301.881
CCIRS	AUD 3.621.530	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,682%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	303.335	303.422
CCIRS	AUD 3.809.191	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,685%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	317.662	317.754

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	AUD 3.836.588	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,686%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	319.387	319.479
CCIRS	AUD 3.577.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,708%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	286.283	286.369
CCIRS	AUD 3.429.252	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,727%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	264.942	265.024
CCIRS	AUD 4.388.466	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 2,152%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	66.318	66.427
CCIRS	AUD 6.651.700	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 2,172%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	81.575	81.739
CCIRS	CZK 318.280.000	Fund receives Floating CZK 6 Month PRIBO and pays Fixed 1,766%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2031	11.186	11.434
CCIRS	CZK 239.180.000	Fund receives Floating CZK 6 Month PRIBO and pays Fixed 1,798%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2031	(20.134)	(19.948)
CCIRS	CZK 239.180.000	Fund receives Floating CZK 6 Month PRIBO and pays Fixed 1,809%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2031	(29.944)	(29.758)
CCIRS	EUR 23.970.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,032%	Bank of America Merrill Lynch	9/4/2031	212.750	213.211
CCIRS	EUR 2.382.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,172%	Bank of America Merrill Lynch	12/4/2052	244.443	244.533
CCIRS	EUR 6.525.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,473%	Bank of America Merrill Lynch	29/4/2041	46.376	46.594
CCIRS	EUR 13.769.797	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,533%	Bank of America Merrill Lynch	4/12/2049	(19.363)	(18.840)
CCIRS	USD 11.990.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,570%	Bank of America Merrill Lynch	11/3/2031	(34.614)	(34.421)
CCIRS	USD 33.400.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,650%	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	(294.558)	(267.645)
CCIRS	USD 5.740.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,680%	Bank of America Merrill Lynch	30/3/2031	(63.234)	(63.140)
CCIRS	USD 12.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,860%	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2028	(1.090.277)	(1.090.082)
CCIRS	USD 28.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,972%	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2027	(2.575.059)	(2.574.609)
CCIRS	USD 5.340.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,974%	Bank of America Merrill Lynch	3/5/2028	(520.837)	(520.752)
CCIRS	USD 1.903.567	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,018%	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2028	(190.561)	(190.530)
CDS	USD 2.000.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Republic of Italy	Bank of America	20/6/2025	109.424	40.621
CDS	EUR 1.250.000	Fund receives default protection on Glencore Finance Europe Ltd and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	(21.930)	(220.259)
CDS	EUR 250.000	Fund receives default protection on Koninklijke KPN NV and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	2.388	850
CDS	EUR 730.000	Fund receives default protection on Renault SA and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	6.534	38.562
CDS	USD 2.000.000	Fund receives default protection on Republic of Italy and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2025	(142.322)	(22.020)
CDS	EUR 144.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	129	7.450
CDS	EUR 260.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	6.986	23.225
CDS	USD 180.000	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2023	(8.524)	(11.805)
CDS	EUR 9.240.000	Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2021	248.625	(4.784)
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Casino Guichard Perrachon SA and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2021	(8.016)	(516)
CDS	EUR 180.000	Fund receives default protection on Casino Guichard Perrachon SA and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/12/2022	(7.003)	(4.303)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Cellnex Telecom SA and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(9.248)	(185.035)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	EUR 370.000	Fund receives default protection on Glencore Finance Europe Ltd and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/12/2025	(957)	(65.197)
CDS	EUR 1.210.000	Fund receives default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/12/2022	(75.975)	(54.376)
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Jaguar Land Rover Automotive PLC and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/12/2022	(1.773)	(13.482)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Marks & Spencer Plc and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2022	(3.801)	(298)
CDS	EUR 250.000	Fund receives default protection on Marks & Spencer Plc and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/12/2025	(13.993)	7.500
CDS	EUR 750.000	Fund receives default protection on Marks & Spencer Plc and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/12/2025	(38.640)	22.500
CDS	EUR 1.500.000	Fund receives default protection on Nokia Oyj and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(18.265)	(301.771)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on SES SA and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(5.511)	(8.089)
CDS	EUR 250.000	Fund receives default protection on Stonegate Pub Co Financing Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2022	(3.350)	(4.249)
CDS	EUR 750.000	Fund receives default protection on Sunrise Communications Holdings SA and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank Plc	20/12/2024	28.124	(129.876)
CDS	EUR 9.240.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Air Liquide SA	Barclays Bank Plc	20/6/2021	(248.696)	4.713
CDS	EUR 106.555	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	Barclays Bank Plc	20/12/2025	(481)	7.947
CDS	EUR 153.445	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	Barclays Bank Plc	20/12/2025	(1.055)	11.445
CDS	EUR 360.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA	Barclays Bank Plc	20/6/2026	92	18.625
CDS	EUR 360.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA	Barclays Bank Plc	20/6/2026	92	18.625
CDS	EUR 144.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc	Barclays Bank Plc	20/6/2026	1.690	8.713
CDS	EUR 216.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc	Barclays Bank Plc	20/6/2026	2.548	13.070
CDS	EUR 165.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on UPC Holding BV	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(1.228)	19.543
CDS	EUR 165.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on UPC Holding BV	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(1.228)	19.543
CDS	EUR 330.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on UPC Holding BV	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(2.447)	39.087
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ziggo Bond Company BV	Barclays Bank Plc	20/12/2025	(2.836)	29.380
CDS	EUR 2.750.000	Fund receives default protection on Barclays Bank Plc and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2021	(185.403)	(1.115)
CDS	EUR 66.084	Fund receives default protection on Cable Wireless Ltd and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/12/2023	4.444	(7.559)
CDS	EUR 250.000	Fund receives default protection on Koninklijke KPN NV and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/12/2025	2.389	850
CDS	EUR 160.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	BNP Paribas	20/12/2025	(497)	11.934
CDS	EUR 220.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA	BNP Paribas	20/6/2026	1.180	11.382
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Virgin Media Finance PLC	BNP Paribas	20/12/2025	(226)	27.662
CDS	USD 240.000	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2022	(20.658)	(8.964)
CDS	USD 102.857	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/12/2025	(13.527)	(10.020)
CDS	USD 220.000	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2026	(2.359)	(21.453)
CDS	USD 470.000	Fund receives default protection on Bausch Health Cos Inc and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2022	13.628	(16.624)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	USD 720.000	Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	(3.095)	20.274
CDS	EUR 1.020.000	Fund receives default protection on British Telecommunications Plc and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/12/2025	(15.807)	(19.531)
CDS	EUR 500.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank AG London and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	(10.351)	11.582
CDS	EUR 510.000	Fund receives default protection on Deutsche Lufthansa AG and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	(24.494)	8.345
CDS	EUR 500.000	Fund receives default protection on HeidelbergCement AG and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/12/2025	9.278	(97.626)
CDS	EUR 1.900.000	Fund receives default protection on HSBC Holdings Plc and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/12/2025	(59.593)	(20.709)
CDS	EUR 2.370.000	Fund receives default protection on Next Group PLC and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	(16.085)	(17.308)
CDS	USD 2.764.865	Fund receives default protection on Occidental Petroleum Corp and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/12/2025	(86.352)	153.228
CDS	EUR 500.000	Fund receives default protection on Saipem Finance International BV and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2026	4.055	(27.577)
CDS	JPY 135.676.243	Fund receives default protection on SoftBank Group Corp and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	3.200	33.058
CDS	EUR 390.000	Fund receives default protection on Stonegate Pub Co Financing Plc and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2022	3.799	(6.628)
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB	Citibank	20/12/2025	15.956	22.332
CDS	EUR 106.560	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Vougeot Bidco Plc	Citibank	20/12/2025	378	(5.483)
CDS	EUR 80.000	Fund receives default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2024	(3.372)	(4.974)
CDS	EUR 250.000	Fund receives default protection on Stonegate Pub Co Financing Plc and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2021	(5.338)	(2.838)
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Stonegate Pub Co Financing Plc and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/3/2022	1.137	(2.833)
CDS	EUR 250.000	Fund receives default protection on Stonegate Pub Co Financing Plc and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2022	(6.124)	(4.249)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Stonegate Pub Co Financing Plc and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2022	(8.599)	(2.599)
CDS	EUR 270.000	Fund receives default protection on Stonegate Pub Co Financing PLC and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2022	(10.079)	(4.679)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Sunrise Communications Holdings SA and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2024	4.755	(17.317)
CDS	EUR 325.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Finco SA	Credit Suisse	20/6/2026	1.349	20.269
CDS	EUR 400.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Finco SA	Credit Suisse	20/6/2026	3.173	24.946
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	Credit Suisse	20/12/2025	2.994	11.188
CDS	EUR 520.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	Credit Suisse	20/12/2025	3.190	38.784
CDS	EUR 310.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA	Credit Suisse	20/12/2025	8.773	18.448
CDS	EUR 360.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA	Credit Suisse	20/6/2026	1.401	18.625
CDS	EUR 110.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc	Credit Suisse	20/12/2024	8.672	6.840
CDS	EUR 40.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc	Credit Suisse	20/12/2027	126	2.297
CDS	EUR 131.680	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive PLC	Credit Suisse	20/12/2027	13.486	7.561
CDS	EUR 590.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Monitchem HoldCo 3 SA	Credit Suisse	20/12/2025	7.655	63.163
CDS	EUR 160.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Novafives SAS	Credit Suisse	20/12/2025	6.764	(17.636)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	EUR 204.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Unilabs Subholding AB	Credit Suisse	20/6/2026	106	30.990
CDS	EUR 136.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Unilabs Subholding AB	Credit Suisse	20/6/2026	466	20.660
CDS	EUR 570.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ziggo Bond Co BV	Credit Suisse	20/12/2025	(4.030)	66.987
CDS	EUR 500.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ziggo Bond Company BV	Credit Suisse	20/12/2025	(4.383)	58.761
CDS	EUR 4.925.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1	Deutsche Asset Management Life	20/12/2021	(43.772)	25.825
CDS	EUR 317.822	Fund receives default protection on Koninklijke KPN NV and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2026	5.694	2.905
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Marks & Spencer Plc and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2022	(4.713)	(447)
CDS	EUR 640.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Credit Suisse Group Finance	Deutsche Bank	20/6/2026	2.888	12.859
CDS	EUR 640.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Credit Suisse Group Finance	Deutsche Bank	20/6/2026	3.224	12.859
CDS	USD 220.000	Fund receives default protection on Ally Finl Inc and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	1.104	(16.881)
CDS	USD 266.766	Fund receives default protection on Ashland LLC and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2025	5.621	(39.589)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	(26.707)	(19.674)
CDS	EUR 470.000	Fund receives default protection on BP Capital Markets Plc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2025	(9.492)	(10.462)
CDS	EUR 92.518	Fund receives default protection on Cable Wireless Ltd and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2023	6.793	(10.583)
CDS	EUR 76.250	Fund receives default protection on Cable Wireless Ltd and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2023	4.914	(8.722)
CDS	USD 280.000	Fund receives default protection on Carnival Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2021	(15.016)	506
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Casino Guichard Perrachon SA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2021	(2.422)	(172)
CDS	EUR 160.000	Fund receives default protection on Casino Guichard Perrachon SA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2023	(221)	(2.292)
CDS	EUR 1.629.000	Fund receives default protection on CNH Industrial NV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	(86.522)	(286.476)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Crown European Holdings SA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.518	(15.165)
CDS	EUR 855.000	Fund receives default protection on Electricite de France SA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	1.746	(21.859)
CDS	USD 3.900.000	Fund receives default protection on ERP Operating LP and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2025	(8.940)	(90.945)
CDS	EUR 800.000	Fund receives default protection on ITV Plc and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2025	(17.407)	(147.140)
CDS	EUR 2.300.000	Fund receives default protection on LANXESS AG and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	1.587	(52.577)
CDS	EUR 106.550	Fund receives default protection on Marks & Spencer PLC and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2025	(5.786)	3.197
CDS	USD 1.885.135	Fund receives default protection on Occidental Petroleum Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2025	(65.994)	104.474
CDS	EUR 230.000	Fund receives default protection on Ses SA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	(9.592)	(3.086)
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Ses SA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	(7.154)	(2.684)
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Standard Chartered Plc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2024	(7.316)	(2.371)
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Monitchem HoldCo 3 SA	Goldman Sachs	20/6/2026	1.015	21.978

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	EUR 153.440	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Vertical Holdco GmbH	Goldman Sachs	20/12/2026	8.046	10.234
CDS	EUR 2.280.000	Fund receives default protection on Altice France Holding SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2021	52.862	(5.601)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Altice France Holding SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2021	22.975	(2.457)
CDS	EUR 190.000	Fund receives default protection on Altice Luxembourg SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2021	10.440	(467)
CDS	EUR 180.000	Fund receives default protection on Altice Luxembourg SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2022	(2.562)	(7.603)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on American Electric Power Co Inc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2025	17.882	(60.616)
CDS	EUR 1.010.000	Fund receives default protection on Auchan Holding SA and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2026	(10.090)	(13.015)
CDS	USD 102.857	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/12/2025	(13.965)	(10.020)
CDS	EUR 5.000.000	Fund receives default protection on Barclays Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(76.756)	(107.984)
CDS	EUR 5.000.000	Fund receives default protection on Barclays Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(74.183)	(107.984)
CDS	EUR 1.140.000	Fund receives default protection on Cellnex Telecom SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2026	(11.501)	(210.940)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Clariant AG and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2026	(7.486)	(12.201)
CDS	EUR 1.685.000	Fund receives default protection on CNH Industrial Finance Europe SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2025	(89.496)	(296.324)
CDS	EUR 1.686.000	Fund receives default protection on CNH Industrial NV and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2025	(94.508)	(296.500)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on Dominion Energy Inc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2025	4.902	(58.959)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on Exelon Corp and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2025	20.882	(60.773)
CDS	EUR 260.000	Fund receives default protection on INEOS Group Holdings SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/12/2025	(4.687)	(30.992)
CDS	EUR 255.000	Fund receives default protection on Koninklijke KPN NV and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(1.290)	867
CDS	EUR 255.000	Fund receives default protection on Koninklijke KPN NV and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(1.037)	867
CDS	EUR 5.000.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(78.620)	(134.806)
CDS	EUR 5.000.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(76.057)	(134.806)
CDS	EUR 163.000	Fund receives default protection on Novafives SAS and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/12/2022	(2.282)	4.238
CDS	EUR 535.000	Fund receives default protection on Publicis Groupe SA and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(3.776)	(11.421)
CDS	EUR 535.000	Fund receives default protection on Publicis Groupe SA and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(5.373)	(11.421)
CDS	USD 4.020.000	Fund receives default protection on Republic of Italy and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2024	(120.118)	(46.238)
CDS	USD 660.000	Fund receives default protection on Republic of South Africa Government International Bond and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2026	(10.684)	23.439
CDS	EUR 5.000.000	Fund receives default protection on Royal Bank of Scotland Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(73.213)	(114.924)
CDS	EUR 5.000.000	Fund receives default protection on Royal Bank of Scotland Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(70.644)	(114.924)
CDS	EUR 500.000	Fund receives default protection on Santander Issuances and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2025	(18.360)	687
CDS	JPY 95.893.757	Fund receives default protection on SoftBank Group Corp and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2026	2.621	23.365
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on Southern Co/The and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2025	25.121	(56.534)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Standard Chartered Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2024	(7.035)	(2.371)
CDS	EUR 1.720.000	Fund receives default protection on Sudzucker International Finance BV and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2026	(13.833)	(2.800)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on United Parcel Service of America Inc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2025	12.972	(66.577)
CDS	USD 4.020.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Republic of Italy	JP Morgan	20/12/2024	72.326	75.748
CDS	EUR 520.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on thyssenkrupp AG	JP Morgan	20/12/2025	(6.597)	(36.183)
CDS	EUR 220.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Adler Real Estate AG	JP Morgan	20/6/2025	30.186	27.834
CDS	EUR 60.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Adler Real Estate AG	JP Morgan	20/6/2025	6.135	7.591
CDS	EUR 520.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG	JP Morgan	20/12/2025	(4.036)	69.649
CDS	EUR 325.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Finco SA	JP Morgan	20/6/2026	(529)	20.269
CDS	EUR 180.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Finco SA	JP Morgan	20/6/2026	1.638	11.226
CDS	EUR 240.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	JP Morgan	20/12/2025	770	17.900
CDS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	JP Morgan	20/12/2025	963	22.375
CDS	EUR 261.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	JP Morgan	20/12/2025	459	19.467
CDS	EUR 330.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Cirsa Finance International Sarl	JP Morgan	20/6/2026	11.788	7.539
CDS	EUR 277.122	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Cirsa Finance International Sarl	JP Morgan	20/6/2026	8.115	6.331
CDS	EUR 132.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Cirsa Finance International Sarl	JP Morgan	20/6/2026	3.016	3.016
CDS	EUR 330.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on CMA CGM SA	JP Morgan	20/12/2025	5.860	19.638
CDS	EUR 400.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Novafives SAS	JP Morgan	20/12/2025	8.910	(44.090)
CDS	EUR 170.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Virgin Media Finance Plc	JP Morgan	20/12/2025	854	18.810
CDS	EUR 210.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Virgin Media Finance PLC	JP Morgan	20/12/2025	700	23.236
CDS	EUR 270.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Virgin Media Finance PLC	JP Morgan	20/6/2026	521	29.511
CDS	EUR 350.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ziggo Bond Co BV	JP Morgan	20/6/2025	(4.228)	41.103
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ziggo Bond Co BV	JP Morgan	20/12/2025	(2.011)	29.380
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ziggo Bond Co BV	JP Morgan	20/6/2026	(609)	23.520
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ziggo Bond Co BV	JP Morgan	20/12/2027	(1.499)	26.139
CDS	USD 3.900.000	Fund receives default protection on Altria Group Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	35.951	(69.640)
CDS	USD 154.286	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	(19.961)	(15.030)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on Cardinal Health Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2025	14.917	(43.757)
CDS	EUR 400.000	Fund receives default protection on Casino Guichard Perrachon SA and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2021	(5.170)	(7.076)
CDS	EUR 220.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank AG and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2021	(16.095)	(870)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on DR Horton Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2025	18.294	(53.910)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on Honeywell International Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2025	17.705	(67.116)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on International Paper Co and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2025	15.661	(57.590)
CDS	EUR 670.000	Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo SPA and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	(10.610)	16.940
CDS	USD 3.900.000	Fund receives default protection on Johnson & Johnson and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	21.344	(114.982)
CDS	EUR 665.000	Fund receives default protection on Koninklijke KPN NV and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2026	6.078	6.078
CDS	USD 3.900.000	Fund receives default protection on McDonald's Corp and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	19.558	(107.328)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on McKesson Corp and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2025	11.032	(52.829)
CDS	USD 3.900.000	Fund receives default protection on Pfizer Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	24.168	(103.574)
CDS	EUR 685.440	Fund receives default protection on Renault SA and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2026	(1.138)	36.208
CDS	EUR 374.560	Fund receives default protection on Renault SA and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2026	(622)	19.786
CDS	EUR 3.260.000	Fund receives default protection on Repsol International Finance BV and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2026	(8.560)	(56.947)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Stonegate Pub Co Financing Plc and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2021	(10.703)	(1.703)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on Tyson Foods Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2025	16.350	(53.764)
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on UnitedHealth Group Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2025	15.245	(63.252)
CDS	EUR 665.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Credit Suisse Group Finance	Morgan Stanley	20/6/2026	1.287	13.362
CDS	EUR 665.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Credit Suisse Group Finance	Morgan Stanley	20/6/2026	594	13.362
CDS	EUR 330.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Telecom Italia SpA	Morgan Stanley	20/6/2026	3.854	(11.618)
CDS	EUR 260.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on thyssenkrupp AG	Morgan Stanley	20/12/2025	(947)	(18.091)
CDS	EUR 260.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG	Morgan Stanley	20/12/2025	(1.035)	34.824
CDS	EUR 504.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	Morgan Stanley	20/6/2026	1.885	33.154
CDS	EUR 216.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	Morgan Stanley	20/6/2026	808	14.209
CDS	EUR 360.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB	Morgan Stanley	20/12/2025	7.916	32.158
CDS	EUR 106.555	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB	Morgan Stanley	20/12/2025	606	9.518
CDS	EUR 153.445	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB	Morgan Stanley	20/12/2025	872	13.707
CDS	EUR 133.829	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum AB	Morgan Stanley	20/6/2026	2.894	11.519
CDS	EUR 600.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on UPC Holding BV	Morgan Stanley	20/12/2025	(7.152)	70.576
CDS	EUR 260.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on UPC Holding BV	Morgan Stanley	20/12/2025	(818)	30.583
ILS	EUR 42.995.000	Fund receives Fixed 1,412% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Barclays Bank Plc	15/3/2027	397.657	397.657
IRS	EUR 185.150.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	16/4/2025	(117.289)	(114.873)
IRS	EUR 134.150.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	28/5/2025	3.224	4.974
IRS	EUR 134.140.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	28/5/2025	(9.246)	(7.496)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
IRS	EUR 32.470.689	Fund receives Fixed -0,012% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/3/2031	(406.724)	(406.100)
IRS	USD 5.000.000	Fund receives Fixed 0,056% and pays Floating USD 6 Month LIBOR SONIA FEDL SOFR	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2022	670	670
IRS	USD 2.500.000	Fund receives Fixed 0,176% and pays Floating USD 6 Month LIBOR SONIA FEDL SOFR	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2025	(32.998)	(32.998)
IRS	EUR 92.575.000	Fund receives Fixed -0,236% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	22/4/2025	(16.813)	(15.604)
IRS	EUR 92.575.000	Fund receives Fixed -0,266% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	29/4/2025	(47.517)	(46.309)
IRS	EUR 185.130.000	Fund receives Fixed -0,303% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	9/4/2025	(148.925)	(149.069)
IRS	GBP 32.060.000	Fund receives Fixed 0,766% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2031	14.144	451
IRS	GBP 640.000	Fund receives Fixed 0,786% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	31/3/2031	1.494	1.509
IRS	GBP 63.960.000	Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	7/12/2030	152.738	154.166
IRS	EUR 4.570.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	25/9/2050	679.324	679.498
IRS	EUR 4.730.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	25/9/2050	703.774	703.954
IRS	EUR 7.450.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,018%	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2061	1.373.145	1.373.428
IRS	EUR 6.944.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,025%	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2061	1.297.186	1.297.449
IRS	EUR 26.519.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,144%	Bank of America Merrill Lynch	22/10/2031	840.337	840.870
IRS	EUR 14.886.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,234%	Bank of America Merrill Lynch	14/1/2031	492.183	492.469
IRS	EUR 64.941.378	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,336%	Bank of America Merrill Lynch	4/3/2026	202.896	203.744
IRS	EUR 8.900.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,357%	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2028	141.756	141.901
IRS	GBP 31.628.000	Fund receives Floating GBP 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 0,440%	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(142.676)	(142.366)
IRS	GBP 19.677.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed -0,043%	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2025	469.989	470.274
IRS	GBP 17.266.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,092%	Bank of America Merrill Lynch	10/12/2026	474.142	447.314
IRS	GBP 11.740.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,933%	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2051	9.961	(18.908)
IRS	GBP 250.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,947%	Bank of America Merrill Lynch	31/3/2051	(1.459)	(1.448)
IRS	GBP 7.525.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR SONIO and pays Fixed 0,168%	Bank of America Merrill Lynch	24/11/2026	156.665	155.506
IRS	USD 5.000.000	Fund receives Floating USD 6 Month LIBOR SONIA FEDL and pays Fixed 0,051%	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2022	2.475	2.475
IRS	USD 2.500.000	Fund receives Floating USD 6 Month LIBOR SONIA FEDL and pays Fixed 0,182%	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2025	35.894	35.894
TRS	EUR 12.021	Fund receives 3 Month EURIBOR and pays iBoxx EUR Liquid High Yield Index	Barclays Bank Plc	20/9/2021	(20.272)	(22.502)
TRS	EUR 13.750	Fund receives 3 Month EURIBOR and pays iBoxx EUR Liquid High Yield Index	Barclays Bank Plc	20/9/2021	(25.666)	(28.214)
TRS	EUR 700.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Finco SA	Credit Suisse	13/1/2023	(4.898)	(4.898)
TRS	EUR 250.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Finco SA	Credit Suisse	16/1/2023	(1.716)	(1.716)
TRS	EUR 333.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ams AG	Credit Suisse	12/12/2022	(1.153)	(1.153)
TRS	EUR 167.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ams AG	Credit Suisse	12/12/2022	(578)	(578)
TRS	EUR 300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ams AG	Credit Suisse	9/3/2023	(4.524)	(4.524)
TRS	EUR 300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ams AG	Credit Suisse	9/3/2023	(5.004)	(5.004)
TRS	EUR 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ams AG	Credit Suisse	9/3/2023	(3.776)	(3.776)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
TRS	EUR 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ams AG	Credit Suisse	9/3/2023	(3.276)	(3.276)
TRS	EUR 900.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ARD Finance SA	Credit Suisse	22/11/2021	(50.616)	(50.616)
TRS	EUR 1.000.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Banijay Group SAS	Credit Suisse	9/3/2023	(57.045)	(57.045)
TRS	USD 500.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays BNP Paribas SA	Credit Suisse	10/3/2023	(13.776)	(13.776)
TRS	EUR 391.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Eircom Finance Dac	Credit Suisse	18/10/2021	1.765	1.765
TRS	EUR 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Eircom Finance Dac	Credit Suisse	18/10/2021	753	753
TRS	EUR 500.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays INEOS Quattro Finance 1 Plc	Credit Suisse	1/2/2023	(11.103)	(11.103)
TRS	EUR 1.000.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays INEOS Quattro Finance 2 Plc	Credit Suisse	1/2/2023	(14.799)	(14.799)
TRS	GBP 190.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays TALKTALK Telecom Group Plc	Credit Suisse	7/3/2022	504	504
TRS	GBP 20.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays TALKTALK Telecom Group Plc	Credit Suisse	7/3/2022	(5)	(5)
TRS	EUR 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Vivendi SE	Credit Suisse	17/3/2023	(86)	(86)
TRS	EUR 400.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays BanCo Bilbao Vizcaya Argentaria	JP Morgan	16/8/2021	(62.929)	(62.929)
TRS	EUR 400.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Cooperatieve Rabobank UA	JP Morgan	16/8/2021	(47.846)	(47.846)
TRS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ericom Finance Dac	JP Morgan	10/1/2022	1.725	1.725
TRS	EUR 132.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ericom Finance Dac	JP Morgan	19/4/2022	181	180
TRS	EUR 198.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ericom Finance Dac	JP Morgan	25/4/2022	(643)	(643)
TRS	EUR 1.000.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Orange SA	JP Morgan	14/6/2022	3.845	3.845
TRS	EUR 350.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays SES SA	JP Morgan	21/6/2022	(1.664)	(1.664)
TRS	EUR 350.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays SES SA	JP Morgan	24/6/2022	(1.995)	(1.995)
TRS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Vivendi SA	JP Morgan	21/6/2022	(2.229)	(2.229)
TRS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Vivendi SA	JP Morgan	24/6/2022	(2.501)	(2.501)
TRS	EUR 800.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Vivendi SE	JP Morgan	19/4/2022	(321)	(321)
TRS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays ARD Finance SA	JP Morgan Chase Bank (Depository Cle)	4/2/2022	(6.172)	(6.172)
TRS	EUR 228.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ericom Finance Dac	JP Morgan Chase Bank (Depository Cle)	30/12/2021	(2.908)	(2.908)
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ineos Finance Plc	JP Morgan Chase Bank (Depository Cle)	16/7/2021	(4.004)	(4.004)
TRS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ineos Finance Plc	JP Morgan Chase Bank (Depository Cle)	13/9/2021	(7.889)	(7.889)
TRS	EUR 500.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ryanair DAC	JP Morgan Chase Bank (Depository Cle)	30/8/2021	(43.355)	(43.355)
TRS	GBP 100.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays TalkTalk Telecom Group Plc	JP Morgan Chase Bank (Depository Cle)	19/7/2021	707	707
TRS	GBP 100.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays TalkTalk Telecom Group Plc	JP Morgan Chase Bank (Depository Cle)	22/7/2021	(127)	(127)
TRS	GBP 500.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays TalkTalk Telecom Group Plc	JP Morgan Chase Bank (Depository Cle)	30/7/2021	(11.745)	(11.745)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 3.703.657.942)					(10.120.125)	(21.757.759)

CCCDs: Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)
 CCILS: Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)
 CCIRS: Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)
 CDS: Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)
 ILS: Swaps liés à l'inflation (Inflation Linked Swaps)
 IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)
 TRS: Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
2.233	EUR	3 Month Euribor Futures December 2022	Décembre 2022	560.790.038	55.825
(4.812)	EUR	Euro BOBL Futures June 2021	Juin 2021	648.080.160	1.530.877
(705)	EUR	Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	103.832.400	(757.836)
(3.242)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	550.524.020	(1.428.095)
(490)	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	98.509.600	1.431.179
625	EUR	Euro Schatz Futures June 2021	Juin 2021	70.025.000	12.500
(1.215)	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	Juin 2021	194.788.800	(710.212)
(242)	EUR	Euro-OAT Futures September 2021	Septembre 2021	38.274.720	27.560
(255)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	288.646.739	(60.760)
2.062	EUR	Short Euro BTP Futures June 2021	Juin 2021	233.253.440	185.680
(2.802)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	Septembre 2021	413.993.486	(420.850)
(50)	USD	US Long Bond Futures September 2021	Septembre 2021	6.401.586	9.425
(3.942)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	467.504.569	1.098.368
(1.201)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	129.717.077	301.303
(170)	USD	US Treasury 2 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	30.746.881	1.076
(682)	USD	US Treasury 5 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	69.186.126	53.796
(781)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	Septembre 2021	118.231.454	477.018
Total				4.022.506.096	1.806.854

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
67.100.000	Call	OTC USD/CAD	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,28	23/06/2021	(442.785)	3.739
18.800.000	Call	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0,89	06/08/2021	(248.705)	29.347
11.540.000	Call	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1,25	28/06/2021	(187.087)	878.055
113.390.000	Call	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1,22	18/06/2021	(46.263)	427.820
112.500.000	Put	OTC EUR/GBP	Citibank	EUR 0,85	11/06/2021	(983.843)	35.550
260	Put	iShares USD High Yield Corp Bond	Exchange Traded	USD 102,50	18/06/2021	(1.768)	21.518
113.420.000	Put	OTC EUR/GBP	Goldman Sachs	EUR 0,85	03/06/2021	(731.332)	1.361
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 1.146.208)						(2.641.783)	1.397.390

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
WRITTEN OPTIONS							
(113.390.000)	Call	OTC EUR/USD	Bank of America Merrill Lynch	EUR 1,23	18/06/2021	(56.241)	(427.820)
(112.500.000)	Put	OTC EUR/GBP	Citibank	EUR 0,83	11/06/2021	293.655	(113)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 0)						237.414	(427.933)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	(Moins-value) nette non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS ACHETÉES							
5.400.000	Put	Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 16/6/2021; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2021	Barclays Bank	EUR 2,75	16/06/2021	(17.008)	5.537
11.100.000	Put	Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 18/8/2021; and provides 1% Fixed quarterly from 20/6/2021	Barclays Bank	EUR 0,65	18/08/2021	(8.562)	9.864
11.100.000	Put	Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 21/7/2021; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2021	Barclays Bank	EUR 2,75	21/07/2021	(43.208)	49.477
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 7.664.358)						(68.778)	64.878

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(36.660.768)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0,11% Fixed annually from 14/1/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	(784.042)	(1.333.037)
(36.660.768)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 18/7/2022; and pays -0,11% Fixed annually from 14/1/2022	Barclays Bank	EUR 0,11	14/01/2022	425.877	(123.118)
(70.750.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/10/2021; and pays 0,92% Fixed semi-annually from 26/7/2021	BNP Paribas	USD 0,92	26/07/2021	383.800	(8.737)
(68.620.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021; and pays 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021	JP Morgan	USD 1,13	08/09/2021	(8.560)	(602.179)
(68.620.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,125% Fixed semi-annually from 8/9/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2021	JP Morgan	USD 1,13	08/09/2021	383.941	(209.678)
(104.125.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023; and pays 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	192.304	(3.250.773)
(104.125.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2% Fixed semi-annually from 26/4/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023	Barclays Bank	USD 0,02	26/04/2023	104.467	(3.305.318)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(3.600.000)	Put	Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed quarterly from 20/6/2021; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 16/6/2021	BNP Paribas	EUR 3,00	16/06/2021	9.493	(1.577)
(11.100.000)	Call	Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 21/7/2021; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2021	Barclays Bank	EUR 2,37	21/07/2021	2.321	(29.175)
(11.100.000)	Put	Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed quarterly from 20/6/2021; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 21/7/2021	Barclays Bank	EUR 3,25	21/07/2021	26.076	(23.596)
(380.000.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,45% Fixed annually from 19/5/2022; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 23/11/2022	Citibank	EUR 0,00	19/05/2022	249.014	(826.386)
(11.100.000)	Put	Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 18/8/2021; and provides 1% Fixed quarterly from 20/6/2021	Barclays Bank	EUR 0,75	18/08/2021	6.496	(6.546)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 181.764.673)						991.187	(9.720.120)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	29.000.000	EUR	18.638.323	Westpac	15/7/2021	(258.708)
BRL	5.590.000	USD	992.243	Barclays Bank	16/6/2021	64.178
CNH	124.200.000	USD	18.996.211	Goldman Sachs	16/6/2021	397.834
CNH	13.110.000	USD	1.999.329	Natwest Markets	16/6/2021	46.767
EUR	44.231.432	AUD	69.140.000	HSBC	15/7/2021	411.895
EUR	2.044.205	CHF	2.240.000	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2021	5.621
EUR	30.935.062	CNH	242.059.000	Citibank	16/6/2021	(168.568)
EUR	17.085.326	CNH	134.510.000	Goldman Sachs	15/7/2021	(156.554)
EUR	71.951.824	DKK	535.250.000	Toronto Dominion Bank	15/7/2021	(12.521)
EUR	3.181.179	GBP	2.762.520	Barclays Bank	16/6/2021	(25.549)
EUR	58.030.000	GBP	50.180.849	BNP Paribas	16/6/2021	(219.835)
EUR	22.490.000	GBP	19.283.938	Citibank	16/6/2021	105.241
EUR	33.900.000	GBP	29.358.814	Deutsche Bank	16/6/2021	(179.657)
EUR	6.478.821	GBP	5.617.436	JP Morgan Standard	16/6/2021	(41.887)
EUR	22.620.000	GBP	19.590.147	Chartered Bank	16/6/2021	(120.206)
EUR	11.581	GBP	10.000	BNP Paribas	17/6/2021	(27)
EUR	500.308	GBP	430.000	Citibank	17/6/2021	1.174
EUR	17.983.564	GBP	15.480.000	JP Morgan	17/6/2021	14.728
EUR	9.581.446	GBP	8.310.000	BNP Paribas	15/7/2021	(59.721)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	794.253.551	GBP	688.820.000	Goldman Sachs	15/7/2021	(4.907.544)
EUR	2.082.531	GBP	1.800.000	HSBC	15/7/2021	(5.809)
EUR	1.482.085	GBP	1.290.000	Morgan Stanley	15/7/2021	(14.559)
EUR	496.353	GBP	430.000	Natwest Markets	15/7/2021	(2.528)
EUR	6.237.610	GBP	5.390.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	(15.805)
EUR	10.971.079	GBP	9.470.000	Societe Generale	15/7/2021	(15.906)
EUR	5.974.643	GBP	5.200.000	Standard Chartered Bank	15/7/2021	(58.337)
EUR	20.889.540	HUF	7.675.590.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.180.897)
EUR	4.068.781	IDR	70.768.300.000	HSBC	16/6/2021	4.822
EUR	119.665	JPY	15.930.000	Deutsche Bank	17/6/2021	632
EUR	53.500.093	JPY	6.975.180.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	1.396.565
EUR	4.755.996	MXN	119.810.000	Natwest Markets	16/6/2021	(167.060)
EUR	11.235.202	NOK	114.900.000	JP Morgan	16/6/2021	(43.712)
EUR	46.011.042	NOK	466.050.000	Barclays Bank	15/7/2021	285.607
EUR	93.773.140	NZD	158.930.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(794.106)
EUR	6.810.131	SEK	69.510.000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(55.469)
EUR	274.641	TRY	2.810.000	Goldman Sachs	14/7/2021	10.036

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	812.608	USD	990.000	Deutsche Bank	1/6/2021	1.399
EUR	77.760.563	USD	94.374.053	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	450.920
EUR	44.990.000	USD	53.935.632	Barclays Bank	16/6/2021	806.833
EUR	39.377.035	USD	47.820.849	BNP Paribas	16/6/2021	202.997
EUR	148.415.097	USD	178.656.652	Citibank	16/6/2021	2.062.561
EUR	100.254.903	USD	120.505.717	Goldman Sachs	16/6/2021	1.538.639
EUR	41.237.746	USD	49.625.695	JP Morgan	16/6/2021	585.209
EUR	32.046.073	USD	38.374.692	Morgan Stanley	16/6/2021	610.167
EUR	41.394.857	USD	49.666.358	Natwest Markets	16/6/2021	709.008
EUR	7.148.583	USD	8.585.829	UBS	16/6/2021	115.217
EUR	17.273.260	USD	21.110.000	BNP Paribas	17/6/2021	(19.359)
EUR	269.781	USD	330.000	Goldman Sachs	17/6/2021	(544)
EUR	575.430	USD	700.000	HSBC	15/7/2021	2.324
EUR	459.353.311	USD	548.570.000	Morgan Stanley	15/7/2021	10.225.815
EUR	1.951.164	USD	2.390.000	Royal Bank of Canada	15/7/2021	(5.587)
EUR	4.670.171	USD	5.670.000	Standard Chartered Bank	15/7/2021	28.006
EUR	7.310.157	USD	8.960.000	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	(25.611)
EUR	11.485.420	USD	13.870.000	UBS	15/7/2021	129.716
EUR	3.216.009	USD	3.870.000	Westpac	15/7/2021	47.546
GBP	420.000	EUR	488.870	Citibank	1/6/2021	(1.211)
GBP	1.875.628	EUR	2.154.260	Barclays Bank	16/6/2021	22.965
GBP	102.201.180	EUR	118.440.000	BNP Paribas	16/6/2021	194.937
GBP	12.882.104	EUR	14.795.740	Deutsche Bank	16/6/2021	157.781
GBP	9.800.036	EUR	11.310.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	65.863
GBP	5.330.000	EUR	6.160.404	JP Morgan	15/7/2021	23.401
GBP	58.190.000	USD	81.260.275	HSBC	16/6/2021	979.787
GBP	9.800.000	USD	13.470.204	Morgan Stanley	16/6/2021	341.256
IDR	7.955.476.789	USD	544.155	Barclays Bank	16/6/2021	11.090
IDR	16.374.400.000	USD	1.137.759	Citibank	16/6/2021	8.287
IDR	20.468.000.000	USD	1.415.981	HSBC	16/6/2021	15.453
IDR	166.097.460.000	USD	11.451.049	JP Morgan	16/6/2021	157.848
IDR	18.120.523.211	USD	1.239.275	UBS	16/6/2021	25.400
INR	1.920.390.000	USD	26.064.809	ANZ	16/6/2021	282.916
INR	131.770.000	USD	1.747.592	BNP Paribas	16/6/2021	52.899
JPY	3.500.000.000	EUR	26.590.352	Morgan Stanley	15/7/2021	(445.887)
KRW	3.057.000.000	USD	2.722.997	BNP Paribas	16/6/2021	28.958
KRW	3.057.000.000	USD	2.725.328	Goldman Sachs	16/6/2021	27.049
KRW	9.171.000.000	USD	8.214.798	HSBC	16/6/2021	49.351
MXN	129.300.000	USD	6.148.602	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	276.174
NOK	256.300.000	EUR	25.264.687	HSBC	16/6/2021	(105.542)
NOK	195.000.000	EUR	19.290.518	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2021	(158.537)
NOK	128.000.000	EUR	12.738.907	Toronto Dominion Bank	15/7/2021	(180.479)
NOK	28.250.000	USD	3.375.032	Citibank	16/6/2021	8.332
NOK	289.300.000	USD	34.612.080	Goldman Sachs	16/6/2021	44.884
NOK	154.630.000	USD	18.572.885	JP Morgan	16/6/2021	(35.670)
NOK	37.170.000	USD	4.492.076	Morgan Stanley	16/6/2021	(31.119)
NOK	18.580.000	USD	2.235.928	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	(7.768)
NOK	55.800.000	USD	6.716.494	UBS	16/6/2021	(24.551)
NZD	9.500.000	EUR	5.677.034	Morgan Stanley	15/7/2021	(24.301)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
RUB	32.776.772	USD	434.343	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	9.655
RUB	88.817.114	USD	1.150.479	Citibank	16/6/2021	47.858
RUB	1.551.561.428	USD	20.829.064	Goldman Sachs	16/6/2021	237.106
RUB	207.724.686	USD	2.696.278	UBS	16/6/2021	107.387
SEK	14.150.000	USD	1.693.848	Barclays Bank	16/6/2021	10.501
SEK	58.700.000	USD	7.042.548	JP Morgan	16/6/2021	30.644
SEK	7.080.000	USD	848.621	Morgan Stanley	16/6/2021	4.354
TRY	40.430.000	USD	5.185.994	HSBC	16/6/2021	(380.438)
USD	59.183.261	EUR	49.326.869	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(844.933)
USD	59.667.859	EUR	49.449.963	Barclays Bank	16/6/2021	(571.054)
USD	147.424.423	EUR	122.121.168	BNP Paribas	16/6/2021	(1.353.551)
USD	70.251.708	EUR	58.230.000	Citibank	16/6/2021	(680.977)
USD	112.433.614	EUR	93.000.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(896.267)
USD	9.685.772	EUR	8.052.000	JP Morgan	16/6/2021	(117.578)
USD	114.316.180	EUR	94.610.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(964.101)
USD	7.479.720	EUR	6.170.000	Royal Bank of Canada	16/6/2021	(42.739)
USD	2.720.287	EUR	2.220.000	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	8.414
USD	2.218.428	EUR	1.860.000	UBS	16/6/2021	(42.701)
USD	990.000	EUR	812.371	Deutsche Bank	17/6/2021	(1.396)
USD	10.000.000	EUR	8.257.629	Citibank	15/7/2021	(70.388)
USD	54.000.000	EUR	44.793.346	State Street Bank & Trust Company	15/7/2021	(582.243)
USD	49.575.997	GBP	35.780.000	Barclays Bank	16/6/2021	(921.530)
USD	45.028.093	GBP	32.210.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(503.048)
USD	1.534.837	INR	111.695.588	Citibank	16/6/2021	(1.030)
USD	4.210.717	INR	306.424.412	Deutsche Bank	16/6/2021	(2.774)
USD	644.471	INR	47.082.068	Goldman Sachs	16/6/2021	(2.478)
USD	842.150	INR	61.535.464	HSBC	16/6/2021	(3.373)
USD	421.075	INR	30.762.468	Morgan Stanley	16/6/2021	(1.627)
USD	1.675.291	NOK	13.825.000	Barclays Bank	16/6/2021	15.269
USD	8.557.596	NOK	70.010.000	JP Morgan	16/6/2021	137.856
USD	5.688.551	RUB	420.620.000	Barclays Bank	16/6/2021	(29.951)
USD	17.691.796	RUB	1.316.888.491	Goldman Sachs	16/6/2021	(190.496)
USD	23.823.349	SEK	201.250.000	Citibank	16/6/2021	(368.571)
USD	13.726.305	SEK	115.300.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(147.716)
USD	18.591.155	SEK	155.800.000	JP Morgan	16/6/2021	(164.065)
USD	4.531.705	SEK	37.670.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(9.641)
USD	2.273.347	SEK	18.830.000	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	1.813
USD	6.410.167	SEK	53.100.000	UBS	16/6/2021	4.621
USD	1.571.096	TRY	13.480.000	Barclays Bank	16/6/2021	(2.584)
USD	1.594.515	TRY	13.480.000	Credit Suisse	16/6/2021	16.601
						5.199.786
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	139.599.692	EUR	127.242.065	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(196.478)
EUR	1.167.394	CHF	1.280.578	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1.977
						(194.501)

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	6.849.988	GBP	5.896.441	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	5.289
GBP	14.078.450	EUR	16.215.209	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	127.319
						<u>132.608</u>
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
EUR	4.378	JPY	577.173	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	65
JPY	51.846.806	EUR	393.314	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(5.892)
						<u>(5.827)</u>
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	2.953.610	USD	3.586.045	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	15.924
USD	189.260.195	EUR	156.674.001	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1.632.184)
						<u>(1.616.260)</u>
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 4.356.935.273)						3.515.806

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	33,15
Finance	16,89
Titres hypothécaires	8,77
Biens de consommation cyclique	4,99
Titres adossés à des actifs	4,05
Organismes de placement collectif	3,92
Services aux collectivités	3,68
Biens de consommation non cyclique	3,48
Valeurs industrielles	2,19
Communications	1,92
Énergie	1,69
Matériaux de base	0,92
Technologie	0,91
Fonds négociés en bourse	0,70
Diversifiés	0,00
Portefeuille de titres à la valeur de marché	87,26
Autres éléments de l'actif net	12,74
	<u>100,00</u>

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 200.000	Itau Unibanco Holding SA 3,25% 24/1/2025	168.920	0,11
				USD 60.000	Oi SA 10,00% 27/7/2025	50.232	0,03
						385.066	0,24
ACTIONS ORDINAIRES				Brésil suite			
Italie				Îles Vierges britanniques			
33.005	Telecom Italia SpA - RSP	15.559	0,01	USD 200.000	Fortune Star BVI Ltd RegS 5,95% 29/1/2023	168.497	0,11
		15.559	0,01	USD 200.000	Ocean Laurel Co Ltd RegS 2,375% 20/10/2025	162.591	0,10
Total des actions ordinaires				USD 200.000	RKPF Overseas 2019 A Ltd RegS 6,70% 30/9/2024	174.138	0,11
		15.559	0,01	USD 200.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance II Ltd RegS 5,95% 4/2/2027	183.645	0,12
OBLIGATIONS				USD 177.340	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd RegS 6,75% 24/4/2033	166.021	0,10
Argentine				USD 200.000	TSMC Global Ltd RegS 1,75% 23/4/2028	162.870	0,10
USD 152.000	Argentine Republic Government International Bond FRN 9/7/2035	41.288	0,02			1.017.762	0,64
USD 13.000	Capex SA 6,875% 15/5/2024	9.740	0,01	Canada			
USD 26.000	Genneia SA RegS 8,75% 20/1/2022	19.470	0,01	USD 100.000	Bank of Montreal FRN 10/3/2023	82.741	0,05
USD 24.000	YPF SA 7,00% 15/12/2047	11.875	0,01	USD 30.000	Bausch Health Cos Inc 5,50% 1/11/2025	25.265	0,02
		82.373	0,05	USD 35.000	Bausch Health Cos Inc 5,75% 15/8/2027	29.935	0,02
Australie				USD 100.000	Cenovus Energy Inc 3,80% 15/9/2023	86.568	0,05
GBP 100.000	APT Pipelines Ltd RegS 4,25% 26/11/2024	129.034	0,08	USD 40.000	Enbridge Inc 2,50% 15/1/2025	34.420	0,02
AUD 1.130.000	Australia Government Bond RegS 1,75% 21/6/2051	585.529	0,37	USD 246.192	Stoneway Capital Corp 10,00% 1/3/2027	55.539	0,04
GBP 280.000	BHP Billiton Finance Ltd RegS FRN 22/10/2077	349.164	0,22	USD 132.838	Stoneway Capital Corp RegS 10,00% 1/3/2027	29.967	0,02
USD 75.000	Macquarie Bank Ltd 2,10% 17/10/2022	63.046	0,04	USD 45.000	Toronto-Dominion Bank FRN 27/1/2023	37.066	0,02
GBP 100.000	QBE Insurance Group Ltd RegS FRN 24/5/2042	121.622	0,07			381.501	0,24
		1.248.395	0,78	Îles Caïmans			
Autriche				USD 200.000	21Vianet Group Inc RegS 7,875% 15/10/2021	165.893	0,10
EUR 100.000	ams AG RegS 2,125% 3/11/2027	97.497	0,06	USD 200.000	Agile Group Holdings Ltd RegS 5,125% 14/8/2022	166.567	0,10
EUR 400.000	BAWAG Group AG RegS FRN 26/3/2029	417.424	0,26	USD 112.500	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A XRP' FRN 17/7/2028	92.151	0,06
USD 200.000	Klabn Austria GmbH 3,20% 12/1/2031	158.397	0,10	USD 200.000	China Aoyuan Group Ltd RegS 7,95% 19/2/2023	168.797	0,11
EUR 200.000	Lenzing AG RegS FRN (Perpetual)	210.546	0,13	USD 200.000	China SCE Group Holdings Ltd RegS 7,25% 19/4/2023	170.065	0,11
EUR 100.000	Volksbank Wien AG RegS FRN 6/10/2027	102.461	0,07	USD 200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 6,45% 7/11/2024	174.107	0,11
		986.325	0,62	USD 13.000	Embraer Overseas Ltd RegS 5,696% 16/9/2023	11.390	0,01
Belgique				USD 200.000	Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 15,00% 18/12/2021	167.568	0,10
GBP 300.000	Anheuser-Busch InBev SA RegS 9,75% 30/7/2024	444.850	0,28	USD 200.000	Grupo Aval Ltd 4,375% 4/2/2030	161.660	0,10
EUR 200.000	Belfius Bank SA RegS 1,00% 26/10/2024	206.368	0,13	USD 200.000	Kaisa Group Holdings Ltd RegS 11,95% 22/10/2022	172.833	0,11
EUR 200.000	KBC Group NV RegS FRN 3/12/2029	199.626	0,13	USD 200.000	Logan Group Co Ltd RegS 6,50% 16/7/2023	168.135	0,10
EUR 685.268	Kingdom of Belgium Government Bond RegS 22/10/2031 (Zero Coupon)	674.708	0,42	USD 250.000	Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A BR2' FRN 19/4/2030	203.995	0,13
EUR 100.000	Solvay SA FRN (Perpetual)	102.641	0,06				
		1.628.193	1,02				
Bermudes							
USD 200.000	Hopson Development Holdings Ltd RegS 7,50% 27/6/2022	167.656	0,11				
		167.656	0,11				
Brésil							
USD 200.000	Brazilian Government International Bond 3,875% 12/6/2030	165.914	0,10				

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Îles Caïmans suite				Colombie			
USD 250.000	Marble Point CLO XVII Ltd '2020-1A D' FRN 20/4/2033	206.398	0,13	USD 17.000	Ecopetrol SA 5,375% 26/6/2026	15.327	0,01
USD 200.000	Modern Land China Co Ltd RegS 12,85% 25/10/2021	168.558	0,10	USD 13.000	Ecopetrol SA 6,875% 29/4/2030	12.662	0,01
USD 250.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd '2017-26A B' FRN 18/10/2030	205.146	0,13			27.989	0,02
USD 249.883	OZLM XIII Ltd '2015-13AA1R' FRN 30/7/2027	204.672	0,13	Danemark			
USD 155.000	Park Aerospace Holdings Ltd 5,25% 15/8/2022	133.547	0,08	EUR 300.000	Danske Bank A/S RegS FRN 27/8/2025	302.895	0,19
USD 200.000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd RegS 7,125% 8/11/2022	170.880	0,11	EUR 150.000	Danske Bank A/S RegS FRN 21/6/2029	158.032	0,10
USD 250.000	Redco Properties Group Ltd RegS 8,50% 19/8/2021	205.590	0,13	GBP 200.000	Orsted A/S RegS 2,50% 16/5/2033	249.942	0,16
USD 200.000	Redsun Properties Group Ltd RegS 9,95% 11/4/2022	169.933	0,11			710.869	0,45
USD 355.000	Ronshine China Holdings Ltd RegS 8,75% 25/10/2022	295.966	0,18	Ecuador			
USD 105.000	Seagate HDD Cayman 4,875% 1/3/2024	93.028	0,06	USD 105.000	Ecuador Government International Bond RegS 0,50% 31/7/2035	60.549	0,04
USD 130.000	Seagate HDD Cayman 4,091% 1/6/2029	107.458	0,07			60.549	0,04
USD 200.000	Seazen Group Ltd RegS 6,45% 11/6/2022	167.699	0,10	Égypte			
USD 200.000	Shui On Development Holding Ltd RegS 5,75% 12/11/2023	169.398	0,11	USD 200.000	Egypt Government International Bond RegS 5,875% 16/2/2031	161.576	0,10
USD 200.000	Times China Holdings Ltd RegS 6,75% 16/7/2023	169.423	0,11			161.576	0,10
USD 186.956	Treman Park CLO Ltd '2015-1A.ARR' FRN 20/10/2028	153.333	0,10	Finlande			
EUR 100.000	UPCB Finance VII Ltd RegS 3,625% 15/6/2029	102.335	0,06	EUR 100.000	Finnair Oyj RegS 4,25% 19/5/2025	101.880	0,06
USD 200.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd RegS 8,50% 4/2/2023	163.817	0,10	EUR 100.000	OP Corporate Bank Plc RegS FRN 9/6/2030	103.244	0,07
USD 200.000	Zhenro Properties Group Ltd RegS 8,70% 3/8/2022	169.246	0,11			205.124	0,13
		4.879.588	3,06	France			
Chili				EUR 27.000	Accor SA RegS 0,70% 7/12/2027	14.209	0,01
USD 200.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 4,75% 1/8/2026	181.556	0,11	EUR 100.000	Altice France SA RegS 5,875% 1/2/2027	106.544	0,07
		181.556	0,11	EUR 100.000	Altice France SA RegS 4,125% 15/1/2029	101.500	0,06
Chine				EUR 200.000	AXA SA RegS FRN 4/7/2043	220.766	0,14
CNY 11.240.000	China Development Bank 2,89% 22/6/2025	1.429.507	0,90	EUR 300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 3,00% 21/5/2024	325.989	0,20
CNY 3.290.000	China Development Bank 3,45% 20/9/2029	421.810	0,27	GBP 200.000	BNP Paribas SA 5,75% 24/1/2022	239.961	0,15
CNY 6.600.000	China Government Bond 1,99% 9/4/2025	820.393	0,51	USD 250.000	BNP Paribas SA FRN 10/1/2025	225.004	0,14
CNY 3.000.000	China Government Bond 2,41% 19/6/2025	378.579	0,24	GBP 300.000	BNP Paribas SA RegS 3,375% 23/1/2026	380.343	0,24
CNY 7.300.000	China Government Bond 2,85% 4/6/2027	929.152	0,58	GBP 200.000	BNP Paribas SA RegS FRN 24/5/2031	234.135	0,15
CNY 600.000	China Government Bond 3,29% 23/5/2029	78.455	0,05	EUR 100.000	BNP Paribas SA RegS FRN 15/1/2032	100.342	0,06
CNY 7.260.000	China Government Bond 3,13% 21/11/2029	934.936	0,59	EUR 100.000	BPCE SA RegS 4,625% 18/7/2023	109.886	0,07
CNY 1.800.000	China Government Bond 2,68% 21/5/2030	223.507	0,14	EUR 100.000	Casino Guichard Perrachon SA RegS 4,048% 5/8/2026	97.456	0,06
CNY 1.500.000	China Government Bond 3,27% 19/11/2030	196.099	0,12	EUR 100.000	Credit Agricole Assurances SA RegS FRN (Perpetual)	111.000	0,07
CNY 2.060.000	China Government Bond 3,86% 22/7/2049	275.973	0,17	GBP 100.000	Credit Agricole SA 7,375% 18/12/2023	134.861	0,08
		5.688.411	3,57	USD 200.000	Credit Agricole SA 4,375% 17/3/2025	180.885	0,11
				EUR 200.000	Credit Agricole SA RegS 0,50% 24/6/2024	203.092	0,13
				EUR 200.000	Credit Agricole SA RegS FRN 22/4/2026	206.154	0,13

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				Allemagne suite			
EUR 300.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 1,25% 31/5/2024	310.620	0,19	GBP 300.000	Deutsche Bank AG RegS 2,625% 16/12/2024	363.934	0,23
EUR 100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS FRN 25/10/2029	104.251	0,07	GBP 200.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS 1,75% 21/11/2022	235.270	0,15
GBP 600.000	Dexia Credit Local SA RegS 0,25% 10/12/2026	678.251	0,43	EUR 200.000	Evonik Industries AG RegS FRN 7/7/2077	203.486	0,13
EUR 100.000	Dexia Credit Local SA RegS 21/1/2028 (Zero Coupon)	100.143	0,06	EUR 116.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 2,125% 9/7/2027	123.155	0,08
GBP 100.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	129.027	0,08	EUR 200.000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide RegS 1,875% 31/3/2028	206.942	0,13
EUR 200.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	204.954	0,13	EUR 250.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA RegS 0,25% 29/11/2023	251.953	0,16
EUR 100.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	108.247	0,07	EUR 100.000	HeidelbergCement AG RegS 2,25% 3/6/2024	106.435	0,07
EUR 350.840	FCT Autonoria '2019-1 B' RegS FRN 25/9/2035	351.708	0,22	EUR 100.000	KION Group AG RegS 1,625% 24/9/2025	104.135	0,06
EUR 65.751	FCT Noria '2018-1 C' RegS FRN 25/6/2038	65.947	0,04	GBP 200.000	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS FRN 26/5/2042	245.490	0,15
EUR 1.000.000	Harmony French Home Loans FCT '2020-2 B' RegS FRN 27/8/2061	1.016.335	0,64	EUR 100.000	Nidda Healthcare Holding GmbH RegS 3,50% 30/9/2024	100.127	0,06
EUR 100.000	Loxam SAS RegS 5,75% 15/7/2027	104.671	0,07	GBP 500.000	NRW Bank RegS 1,00% 15/6/2022	585.540	0,37
EUR 100.000	Orange SA RegS FRN (Perpetual)	112.298	0,07	EUR 240.000	thyssenkrupp AG RegS 1,375% 3/3/2022	240.562	0,15
EUR 100.000	Picard Groupe SAS RegS FRN 30/11/2023	100.005	0,06	EUR 100.000	Vertical Holdco GmbH RegS 6,625% 15/7/2028	107.178	0,07
EUR 260.000	RCI Banque SA RegS 0,75% 10/4/2023	263.468	0,17	EUR 161.000	Volkswagen Leasing GmbH RegS 0,625% 19/7/2029	159.591	0,10
USD 250.000	Societe Generale SA 4,75% 24/11/2025	229.341	0,14	EUR 200.000	ZF Finance GmbH RegS 2,00% 6/5/2027	200.560	0,13
EUR 200.000	Societe Generale SA RegS FRN 16/9/2026	201.506	0,13	EUR 100.000	ZF Finance GmbH RegS 3,75% 21/9/2028	108.812	0,07
EUR 200.000	Societe Generale SA RegS FRN 30/6/2031	198.858	0,12			4.802.281	3,01
EUR 300.000	Teleperformance RegS 1,50% 3/4/2024	311.388	0,20	Grèce			
EUR 100.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	99.465	0,06	EUR 96.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 2,00% 22/4/2027	105.917	0,07
EUR 100.000	TOTAL SE RegS FRN (Perpetual)	99.458	0,06	EUR 40.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,75% 30/1/2028	48.858	0,03
EUR 200.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual)	205.186	0,13	EUR 146.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,875% 12/3/2029	182.275	0,11
EUR 300.000	Veolia Environnement SA RegS FRN (Perpetual)	298.020	0,19	EUR 337.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 1,50% 18/6/2030	359.761	0,23
EUR 100.000	Verallia SA RegS 1,625% 14/5/2028	100.402	0,06	EUR 268.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 0,75% 18/6/2031	266.124	0,17
		8.385.676	5,26	EUR 200.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 1,875% 24/1/2052	204.540	0,13
Allemagne				EUR 100.000	Mytilineos SA RegS 2,25% 30/10/2026	101.449	0,06
EUR 100.000	Bayer AG RegS 0,375% 6/7/2024	101.058	0,06			1.268.924	0,80
EUR 100.000	Bayer AG RegS 0,05% 12/1/2025	99.642	0,06				
EUR 100.000	Bayer AG RegS 1,375% 6/7/2032	100.995	0,06				
EUR 200.000	Bayer AG RegS FRN 12/11/2079	203.142	0,13				
EUR 100.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	103.652	0,06				
EUR 100.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH RegS 4,375% 15/1/2028	103.709	0,06				
EUR 400.000	Commerzbank AG RegS 1,25% 23/10/2023	412.108	0,26				
EUR 200.000	Commerzbank AG RegS FRN (Perpetual)	217.962	0,14				
GBP 100.000	Deutsche Bank AG RegS 1,75% 16/12/2021	116.843	0,07				

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Guernesey				Irlande suite			
USD 250.000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 3,80% 15/9/2022	213.678	0,13	EUR 100.000	Kerry Group Financial Services Unltd Co RegS 2,375% 10/9/2025	109.462	0,07
GBP 250.000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd RegS 3,00% 27/5/2022	297.144	0,19	EUR 538.000	Last Mile Securities PE '2021- X1 A1' DAC RegS FRN 17/8/2031	538.897	0,34
		510.822	0,32	EUR 100.000	Northwoods Capital 23 Euro DAC '2021-23X E' RegS FRN 15/3/2034	99.053	0,06
Hong Kong				EUR 100.000	OCP Euro CLO DAC '2019-3X ER' RegS FRN 20/4/2033	99.619	0,06
USD 250.000	Bank of East Asia Ltd RegS FRN (Perpetual)	220.727	0,14	EUR 780.000	Pearl Finance 2020 DAC 'A1' RegS FRN 17/11/2032	783.697	0,49
USD 200.000	Yango Justice International Ltd RegS 9,25% 15/4/2023	169.125	0,10	EUR 250.000	Penta CLO DAC '2019-6X B1' RegS FRN 25/7/2032	250.391	0,16
		389.852	0,24	EUR 241.938	River Green Finance '2020-1 A' DAC RegS FRN 22/1/2032	242.421	0,15
Hongrie				EUR 600.000	Rockford Tower Europe CLO DAC '2019-1 B1' RegS FRN 20/1/2033	599.549	0,38
EUR 52.000	Hungary Government International Bond RegS 1,75% 5/6/2035	54.884	0,03	EUR 700.000	SCF Rahoituspalvelut IX DAC 'B' RegS FRN 25/10/2030	698.637	0,44
		54.884	0,03	USD 95.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2,875% 23/9/2023	81.793	0,05
Inde				EUR 157.648	Taurus '2019-1 FR' DAC RegS FRN 2/2/2031	158.153	0,10
USD 200.000	Adani Transmission Ltd RegS 4,00% 3/8/2026	175.800	0,11	GBP 199.382	Taurus '2019-2 C' UK DAC RegS FRN 17/11/2029	231.905	0,15
USD 200.000	Power Finance Corp Ltd RegS 4,50% 18/6/2029	175.067	0,11	GBP 225.000	Taurus '2021-1 UK1X A' DAC RegS FRN 17/5/2031	262.039	0,16
USD 200.000	ReNew Power Pvt Ltd RegS 6,45% 27/9/2022	170.026	0,11	GBP 100.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC RegS 4,875% 15/7/2028	118.722	0,07
USD 200.000	ReNew Power Synthetic RegS 6,67% 12/3/2024	172.679	0,11			5.622.188	3,53
USD 200.000	Shriram Transport Finance Co Ltd RegS 5,70% 27/2/2022	165.419	0,10	Israël			
		858.991	0,54	USD 35.000	Energean Israel Finance Ltd RegS 5,875% 30/3/2031	29.814	0,02
Indonésie				USD 16.031	Leviathan Bond Ltd RegS 5,75% 30/6/2023	13.861	0,01
IDR 1.416.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,50% 15/6/2025	84.624	0,05			43.675	0,03
IDR 8.508.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,00% 15/9/2030	508.215	0,32	Italie			
IDR 752.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,50% 15/2/2031	43.453	0,03	EUR 100.000	Atlantia SpA RegS 1,875% 12/2/2028	102.355	0,06
USD 200.000	Pertamina Persero PT RegS 1,40% 9/2/2026	160.637	0,10	EUR 100.000	Autostrade per l'Italia SpA RegS 2,00% 4/12/2028	103.523	0,07
USD 200.000	Pertamina Persero PT RegS 2,30% 9/2/2031	155.686	0,10	EUR 100.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 2,625% 28/4/2025	103.124	0,06
		952.615	0,60	EUR 100.000	Cedacri Mergesco SpA RegS FRN 15/5/2028	102.403	0,06
Irlande				EUR 100.000	Centurion Bidco SpA RegS 5,875% 30/9/2026	104.658	0,07
USD 150.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3,50% 26/5/2022	126.138	0,08	EUR 250.000	Eni SpA RegS 0,625% 19/9/2024	256.047	0,16
EUR 300.000	AIB Group Plc RegS FRN 19/11/2029*	306.687	0,19	EUR 100.000	Eni SpA RegS FRN (Perpetual)	104.286	0,07
EUR 100.000	AIB Group Plc RegS FRN 30/5/2031	106.775	0,07	EUR 100.000	Eni SpA RegS FRN (Perpetual)	99.523	0,06
EUR 200.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 25/11/2025	205.394	0,13	EUR 100.000	FCA Bank SpA RegS 0,125% 16/11/2023	100.320	0,06
EUR 100.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 11/8/2031	99.340	0,06	USD 200.000	Intesa Sanpaolo SpA 4,95% 1/6/2042	165.859	0,10
EUR 100.000	BBAM European CLO I DAC '1X ER' RegS FRN 22/7/2034	99.000	0,06	EUR 100.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 6,625% 13/9/2023	113.411	0,07
SEK 1.230.000	Bluestep Mortgage Securities No 4 DAC 'B' RegS FRN 10/8/2066	121.606	0,08	EUR 150.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,75% 4/12/2024	153.579	0,10
EUR 100.000	CVC Cordatus Loan Fund XX DAC '20X E' RegS FRN 22/6/2034	99.000	0,06				
EUR 40.000	Fresenius Finance Ireland Plc RegS 0,875% 1/10/2031	39.484	0,03				
EUR 150.000	Glencore Capital Finance DAC RegS 1,25% 1/3/2033	144.426	0,09				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Italie suite				Luxembourg suite			
EUR 100.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,00% 19/11/2026	102.469	0,06	EUR 100.000	CNH Industrial Finance Europe SA RegS 2,875% 17/5/2023	105.756	0,07
EUR 100.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 2,925% 14/10/2030	105.225	0,07	EUR 100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA RegS 6,75% 1/11/2025	104.209	0,06
EUR 500.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,35% 24/2/2031	489.535	0,31	USD 40.000	Gol Finance SA 7,00% 31/1/2025	30.187	0,02
EUR 200.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS FRN (Perpetual)	218.466	0,14	EUR 100.000	Herens Midco Sarl RegS 5,25% 15/5/2029	98.655	0,06
EUR 0	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,30% 15/5/2028	—	0,00	EUR 100.000	Matterhorn Telecom SA RegS 4,00% 15/11/2027	102.982	0,06
EUR 538.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,50% 30/4/2045	516.179	0,32	EUR 100.000	Rossini Sarl RegS 6,75% 30/10/2025	105.208	0,07
EUR 230.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,45% 1/9/2050	260.270	0,16	USD 200.000	Rumo Luxembourg Sarl 5,875% 18/1/2025	172.648	0,11
EUR 30.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 2,80% 1/3/2067	35.341	0,02	EUR 600.000	SC Germany SA Compartment Consumer '2020-1 B' RegS FRN 14/11/2034	604.669	0,38
EUR 287.046	Progetto Quinto SRL 'A' RegS FRN 27/10/2036	288.136	0,18	USD 70.000	Schlumberger Investment SA 2,40% 1/8/2022	58.410	0,04
EUR 100.000	Rekeep SpA RegS 7,25% 1/2/2026	107.659	0,07	EUR 100.000	SES SA RegS 2,00% 2/7/2028	108.035	0,07
EUR 80.727	Sunrise SPV 40 Srl '2018-1 A' RegS FRN 27/7/2042	80.792	0,05	EUR 200.000	SES SA RegS FRN (Perpetual)	201.000	0,13
GBP 300.000	Telecom Italia SpA 5,875% 19/5/2023	378.400	0,24	EUR 100.000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 'B' RegS FRN 15/3/2027	100.045	0,06
EUR 350.000	UniCredit SpA RegS FRN 3/7/2025	361.137	0,23	EUR 100.000	Simon International Finance SCA RegS 1,125% 19/3/2033	99.384	0,06
EUR 200.000	UniCredit SpA RegS FRN (Perpetual)	187.776	0,12	EUR 90.105	Summer BC Holdco A Sarl RegS 9,25% 31/10/2027	96.076	0,06
		4.640.473	2,91	EUR 100.000	Summer BC Holdco B Sarl RegS 5,75% 31/10/2026	104.490	0,06
Japon				EUR 100.000	Traton Finance Luxembourg SA RegS 0,125% 24/3/2025	100.081	0,06
JPY 39.000.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,60% 20/9/2050	286.824	0,18	EUR 100.000	Traton Finance Luxembourg SA RegS 0,75% 24/3/2029	100.293	0,06
USD 125.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3,455% 2/3/2023	107.852	0,07			2.749.409	1,72
USD 200.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 8/9/2024	164.866	0,10	Îles Marshall			
USD 200.000	Nissan Motor Co Ltd 4,81% 17/9/2030	181.434	0,11	USD 107.000	Danaos Corp 8,50% 1/3/2028	94.772	0,06
EUR 220.000	Nissan Motor Co Ltd RegS 2,652% 17/3/2026 [†]	238.872	0,15			94.772	0,06
EUR 200.000	Rakuten Group Inc RegS FRN (Perpetual)	205.092	0,13	Maurice			
USD 200.000	SoftBank Group Corp RegS FRN (Perpetual)	167.445	0,10	USD 200.000	Network i2i Ltd RegS FRN (Perpetual)	174.518	0,11
USD 100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3,748% 19/7/2023	87.750	0,06			174.518	0,11
EUR 200.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd RegS 1,125% 21/11/2022	203.958	0,13	Mexique			
		1.644.093	1,03	USD 200.000	Mexico City Airport Trust RegS 5,50% 31/7/2047	162.946	0,10
Jersey				MXN 500.000	Petroleos Mexicanos 7,19% 12/9/2024	19.543	0,01
GBP 100.000	CPUK Finance Ltd RegS 4,875% 28/8/2025	117.531	0,08	USD 76.000	Petroleos Mexicanos 6,50% 23/1/2029	63.894	0,04
USD 200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 2,16% 31/3/2034	162.116	0,10	USD 42.000	Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047	30.542	0,02
GBP 200.000	Glencore Finance Europe Ltd RegS 6,00% 3/4/2022	242.313	0,15	USD 40.000	Petroleos Mexicanos 7,69% 23/1/2050	31.514	0,02
		521.960	0,33	USD 12.000	Petroleos Mexicanos RegS 6,875% 16/10/2025	10.951	0,01
Koweït						319.390	0,20
USD 200.000	Burgan Bank SAK RegS FRN 15/12/2031	156.373	0,10	Pays-Bas			
		156.373	0,10	EUR 400.000	ABN AMRO Bank NV RegS FRN 18/1/2028	417.512	0,26
Luxembourg				EUR 100.000	Achmea BV RegS FRN 4/4/2043	110.611	0,07
EUR 150.000	ArcelorMittal SA RegS 3,125% 14/1/2022	153.018	0,10	EUR 300.000	Aegon NV RegS FRN 25/4/2044	330.975	0,21
EUR 200.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0,632% 4/6/2023	202.832	0,13	EUR 300.000	Allianz Finance II BV FRN 8/7/2041	301.785	0,19
EUR 100.000	Cidron Aida Finco Sarl RegS 5,00% 1/4/2028	101.431	0,06				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Pays-Bas suite			
EUR 100.000	ASML Holding NV RegS 0,25% 25/2/2030	99.147	0,06	EUR 100.000	Upjohn Finance BV RegS 0,816% 23/6/2022	101.025	0,06
EUR 100.000	BMW Finance NV RegS 1,00% 15/2/2022	101.027	0,06	GBP 200.000	Volkswagen Financial Services NV RegS 1,625% 30/11/2022	235.321	0,15
EUR 100.000	Conti-Gummi Finance BV 2,125% 27/11/2023	105.159	0,07	GBP 200.000	Volkswagen Financial Services NV RegS 1,125% 18/9/2023	233.807	0,15
EUR 110.000	Conti-Gummi Finance BV RegS 1,125% 25/9/2024	113.705	0,07	EUR 100.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	102.931	0,06
GBP 300.000	Daimler International Finance BV RegS 1,50% 18/8/2021	349.147	0,22	EUR 100.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	107.830	0,07
EUR 398.000	Domi 2021-1 BV '2021-1 A' RegS FRN 15/6/2053	399.449	0,25	EUR 100.000	Wintershall Dea Finance BV RegS FRN (Perpetual)	98.852	0,06
EUR 100.000	Dufry One BV RegS 3,375% 15/4/2028	98.666	0,06	EUR 100.000	Wolters Kluwer NV RegS 0,75% 3/7/2030	101.599	0,06
EUR 632.000	Dutch Property Finance '2021-1 A' BV RegS FRN 28/7/2058	633.938	0,40			7.723.765	4,84
EUR 528.589	Dutch Property Finance BV '2020-2 A' RegS FRN 28/1/2058	531.974	0,33	Norvège			
EUR 100.000	easyJet FinCo BV RegS 1,875% 3/3/2028	100.453	0,06	EUR 825.000	Storebrand Livsforsikring AS RegS FRN 30/9/2051	804.680	0,50
EUR 100.000	ELM BV for Firmenich International SA RegS FRN (Perpetual)	107.426	0,07			804.680	0,50
USD 8.000	Embraer Netherlands Finance BV 5,40% 1/2/2027	6.981	0,00	Oman			
EUR 100.000	Givaudan Finance Europe BV RegS 1,625% 22/4/2032	110.596	0,07	USD 360.000	Oman Government International Bond RegS 3,625% 15/6/2021	294.971	0,18
USD 200.000	Greenko Dutch BV RegS 3,85% 29/3/2026	167.782	0,11	USD 200.000	Oman Government International Bond RegS 4,125% 17/1/2023	169.082	0,11
EUR 100.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	100.515	0,06	USD 450.000	Oman Sovereign Sukuk Co RegS 4,397% 1/6/2024	384.333	0,24
EUR 100.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	102.750	0,06			848.386	0,53
EUR 100.000	Iberdrola International BV RegS FRN (Perpetual)	108.899	0,07	Pakistan			
EUR 100.000	ING Groep NV RegS 1,00% 20/9/2023	102.850	0,06	USD 200.000	Pakistan Government International Bond RegS 6,00% 8/4/2026	168.135	0,11
EUR 400.000	ING Groep NV RegS FRN 15/2/2029	422.380	0,27			168.135	0,11
EUR 325.484	Jubilee Place 2020-1 BV 'A' RegS FRN 17/10/2057	329.231	0,21	Panama			
USD 75.000	LYB International Finance BV 4,00% 15/7/2023	65.868	0,04	EUR 100.000	Carnival Corp RegS 10,125% 1/2/2026	116.993	0,07
EUR 70.046	Magoi BV '2019-1 B' RegS FRN 27/7/2039	70.182	0,04			116.993	0,07
EUR 200.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	223.478	0,14	Portugal			
USD 40.000	NXP BV / NXP Funding LLC 4,875% 1/3/2024	36.327	0,02	EUR 916.715	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 0,30% 17/10/2031	901.030	0,57
USD 9.000	Petrobras Global Finance BV 6,25% 17/3/2024	8.286	0,01	EUR 75.813	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS 1,00% 12/4/2052	67.988	0,04
USD 34.000	Petrobras Global Finance BV 5,299% 27/1/2025	31.151	0,02			969.018	0,61
EUR 200.000	Repsol International Finance BV RegS FRN (Perpetual)	199.320	0,13	Afrique du Sud			
EUR 180.000	Stellantis NV RegS 3,375% 7/7/2023	191.187	0,12	ZAR 2.401.490	Republic of South Africa Government Bond 7,00% 28/2/2031	122.481	0,08
EUR 94.950	Stichting AK Rabobank Certificaten RegS FRN (Perpetual)	124.353	0,08	ZAR 1.445.828	Republic of South Africa Government Bond 8,25% 31/3/2032	78.152	0,05
EUR 125.000	Technip Energies NV RegS 1,125% 28/5/2028	124.568	0,08			200.633	0,13
EUR 100.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	107.137	0,07	Espagne			
EUR 100.000	TenneT Holding BV RegS FRN (Perpetual)	103.274	0,06	EUR 300.000	Amadeus IT Group SA RegS FRN 18/3/2022	300.228	0,19
EUR 100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4,50% 1/3/2025	104.767	0,07	EUR 200.000	Amadeus IT Group SA RegS FRN 9/2/2023	200.278	0,13
EUR 100.000	United Group BV RegS 4,00% 15/11/2027	99.544	0,06	EUR 100.000	Amadeus IT Group SA RegS 1,875% 24/9/2028	106.507	0,07

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Espagne suite				Suède suite			
EUR 100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 0,75% 11/9/2022	101.391	0,06	EUR 100.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 0,05% 1/7/2024	100.806	0,06
EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS 1,125% 28/2/2024	206.410	0,13	EUR 350.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS FRN 31/10/2028	359.520	0,23
EUR 100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS FRN 16/1/2030	100.160	0,06	GBP 488.000	Svensk Exportkredit AB RegS 0,125% 15/12/2025	556.092	0,35
EUR 200.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 5/3/2023	203.280	0,13	EUR 300.000	Svenska Handelsbanken AB RegS FRN 5/3/2029	311.832	0,20
EUR 100.000	Banco de Sabadell SA RegS FRN 29/6/2023	102.043	0,06	EUR 100.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 0,50% 18/2/2030	99.422	0,06
EUR 100.000	Banco de Sabadell SA RegS 2,50% 15/4/2031	100.347	0,06	GBP 150.000	Swedbank AB RegS 1,625% 28/12/2022	177.562	0,11
GBP 400.000	Banco Santander SA RegS 2,75% 12/9/2023	485.059	0,30	EUR 100.000	Telefonaktiebolaget LM Ericsson RegS 1,00% 26/5/2029	100.236	0,06
EUR 300.000	BBVA Consumer Auto '2020-1 A' FTA RegS FRN 20/1/2036	303.352	0,19	EUR 100.000	Verisure Holding AB RegS 3,875% 15/7/2026	102.735	0,07
EUR 400.000	CaixaBank SA RegS 1,00% 25/6/2024	410.332	0,26	EUR 100.000	Verisure Holding AB RegS 3,25% 15/2/2027	100.914	0,06
EUR 100.000	CaixaBank SA RegS FRN 16/11/2026	104.198	0,07			2.005.433	1,26
EUR 100.000	Cellnex Finance Co SA RegS 0,75% 15/11/2026	98.893	0,06	Suisse			
EUR 200.000	Cellnex Finance Co SA RegS 1,50% 8/6/2028	198.984	0,12	USD 200.000	UBS Group AG 3,491% 23/5/2023	168.896	0,11
EUR 100.000	Cellnex Finance Co SA RegS 2,00% 15/2/2033	97.158	0,06	EUR 200.000	UBS Group AG RegS FRN 20/9/2022	200.354	0,12
EUR 200.000	Cellnex Telecom SA RegS 0,75% 20/11/2031	193.020	0,12	EUR 200.000	UBS Group AG RegS FRN 17/4/2025	206.800	0,13
EUR 354.598	FT Santander Consumer Spain Auto '2020-1 A' RegS FRN 20/3/2033	358.613	0,23			576.050	0,36
GBP 100.000	Iberdrola Finanzas SA 7,375% 29/1/2024	136.402	0,09	Thaïlande			
EUR 100.000	International Consolidated Airlines Group SA RegS 2,75% 25/3/2025	99.832	0,06	USD 200.000	Bangkok Bank PCL RegS FRN 25/9/2034	167.734	0,10
EUR 100.000	International Consolidated Airlines Group SA RegS 1,125% 18/5/2028	100.484	0,06	USD 200.000	Kasikornbank PCL RegS FRN (Perpetual)	173.518	0,11
EUR 100.000	Lorca Telecom Bondco SA RegS 4,00% 18/9/2027	101.488	0,06			341.252	0,21
EUR 845.000	Spain Government Bond RegS 0,50% 30/4/2030	857.117	0,54	Turquie			
EUR 200.000	Wizink Master Credit Cards FT '2019-2 A' RegS FRN 26/3/2033	199.671	0,13	USD 230.000	Turkey Government International Bond 6,25% 26/9/2022^	196.590	0,12
		5.165.247	3,24			196.590	0,12
Sri Lanka				Royaume-Uni			
USD 200.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 7,85% 14/3/2029	110.853	0,07	GBP 270.000	Atlas Funding '2021-1 A' Plc RegS FRN 25/7/2058	315.696	0,20
		110.853	0,07	GBP 200.000	Aviva Plc FRN (Perpetual)	247.771	0,16
Supranational				GBP 31.604	Azure Finance No 1 Plc 'B' RegS FRN 30/6/2027	36.750	0,02
USD 200.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 5,25% 30/4/2025	172.374	0,11	GBP 570.831	Azure Finance No 2 Plc 'A' RegS FRN 20/7/2030	666.105	0,42
EUR 243.000	European Investment Bank RegS 14/1/2031 (Zero Coupon)	242.033	0,15	EUR 450.000	Barclays Plc RegS FRN 7/2/2028	462.163	0,29
EUR 76.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,20% 21/1/2061	62.711	0,04	GBP 250.000	BAT International Finance Plc 7,25% 12/3/2024	337.434	0,21
		477.118	0,30	GBP 220.000	BP Capital Markets Plc RegS FRN (Perpetual)	269.896	0,17
Suède				GBP 271.245	Brass No 7 Plc 'A' RegS FRN 16/10/2059	316.513	0,20
EUR 100.000	Molnlycke Holding AB RegS 0,625% 15/1/2031	96.314	0,06	GBP 68.334	Brass No 8 Plc 'A2' RegS FRN 16/11/2066	80.107	0,05
				EUR 200.000	British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024	206.608	0,13
				EUR 100.000	British Telecommunications Plc RegS FRN 18/8/2080	99.126	0,06
				GBP 200.000	BUPA Finance Plc RegS 5,00% 25/4/2023	249.991	0,16
				GBP 200.000	BUPA Finance Plc RegS 5,00% 8/12/2026	270.944	0,17
				EUR 225.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	224.449	0,14

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
GBP 146.307	Charter Mortgage Funding Plc '2017-1 A' RegS FRN 12/6/2054	170.000	0,11	GBP 100.000	National Grid Electricity Transmission Plc RegS 2,00% 17/4/2040	111.839	0,07
GBP 215.899	CMF '2020-1 A' Plc RegS FRN 16/1/2057	251.282	0,16	EUR 450.000	Natwest Group Plc RegS FRN 4/3/2025	473.575	0,30
GBP 241.454	Dignity Finance Plc RegS 3,546% 31/12/2034	304.405	0,19	GBP 345.000	Natwest Group Plc RegS FRN 28/11/2031	400.598	0,25
GBP 37.683	DLL UK Equipment Finance Plc '2019-1UK A' RegS FRN 25/3/2028	43.843	0,03	GBP 312.000	Newday Funding Master Issuer Plc '2021-1X A1' RegS FRN 15/3/2029	363.777	0,23
EUR 100.000	eG Global Finance Plc RegS 6,25% 30/10/2025	101.874	0,06	GBP 350.000	NGG Finance Plc RegS FRN 18/6/2073	454.641	0,29
EUR 400.000	FCE Bank Plc RegS 0,869% 13/9/2021	400.772	0,25	GBP 846.240	Oat Hill No 2 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2046	985.025	0,62
GBP 245.042	Feldspar Plc '2016-1 A' RegS FRN 15/9/2045	284.855	0,18	GBP 226.960	Orbita Funding '2020-1 A' Plc RegS FRN 17/3/2027	263.976	0,17
GBP 554.000	Finsbury Square '2018-2B' Plc RegS FRN 12/9/2068	645.905	0,41	GBP 260.000	PCL Funding IV Plc '2020-1 B' RegS FRN 15/9/2024	304.068	0,19
GBP 323.301	Finsbury Square Plc '2018-2 A' RegS FRN 12/9/2068	376.555	0,24	GBP 370.000	PCL Funding V Plc '2021-1 A' RegS FRN 15/10/2025	430.217	0,27
GBP 124.168	Finsbury Square Plc '2020-2 A' RegS FRN 16/6/2070	145.667	0,09	GBP 100.000	Phoenix Group Holdings Plc RegS 4,125% 20/7/2022	120.285	0,08
GBP 295.023	Friary No 4 Plc 'A' RegS FRN 21/1/2050	343.214	0,22	GBP 370.000	Precise Mortgage Funding '2019-1B A2' Plc RegS FRN 12/12/2055	435.064	0,27
GBP 468.000	Gemgarto '2021-1 A' Plc RegS FRN 16/12/2067	546.055	0,34	GBP 408.886	Prs Finance Plc RegS 1,75% 24/11/2026	501.450	0,31
GBP 619.204	Gemgarto Plc '2018-1 A' RegS FRN 16/9/2065	723.259	0,45	GBP 300.000	Prs Finance Plc RegS 2,00% 23/1/2029	370.531	0,23
GBP 419.467	Gosforth Funding Plc '2018-1X A2' RegS FRN 25/8/2060	489.183	0,31	GBP 923.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'B' RegS FRN 20/12/2046	1.074.804	0,67
GBP 303.777	Hops Hill No 1 Plc 'A' RegS FRN 27/5/2054	355.051	0,22	GBP 320.559	Residential Mortgage Securities 31 Plc 'A' RegS FRN 20/9/2065	373.107	0,23
GBP 99.994	Hops Hill No 1 Plc 'B' RegS FRN 27/5/2054	117.159	0,07	GBP 411.808	Residential Mortgage Securities '32X A' Plc RegS FRN 20/6/2070	484.282	0,30
GBP 200.000	HSBC Bank Plc RegS 6,50% 7/7/2023	259.368	0,16	GBP 114.671	Ripon Mortgages Plc '1X A1' RegS FRN 20/8/2056	133.498	0,08
USD 250.000	HSBC Holdings Plc 4,25% 18/8/2025	227.312	0,14	GBP 340.000	Ripon Mortgages Plc '1X B1' RegS FRN 20/8/2056	395.684	0,25
EUR 100.000	Informa Plc RegS 1,50% 5/7/2023	103.092	0,06	GBP 135.000	RMAC Securities No 2 Plc '2018-2 B' RegS FRN 12/6/2046	157.316	0,10
EUR 100.000	Informa Plc RegS 2,125% 6/10/2025	106.221	0,07	GBP 385.000	Sage AR Funding No 1 Plc 'B' RegS FRN 17/11/2030	448.592	0,28
USD 200.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 5,875% 15/1/2028	167.468	0,10	EUR 200.000	Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 28/2/2025	201.574	0,13
GBP 100.000	Jerrold Finco Plc RegS 5,25% 15/1/2027	120.246	0,08	GBP 50.000	Segro Plc 5,75% 20/6/2035	84.479	0,05
GBP 114.750	Lanark Master Issuer Plc RegS FRN 22/12/2069	134.004	0,08	GBP 257.860	Silk Road Finance Number Six Plc 'A' RegS FRN 21/9/2067	301.948	0,19
GBP 345.000	Lanebrook Mortgage Transaction Plc '2020-1 B' RegS FRN 12/6/2057	406.973	0,26	GBP 131.340	Silverstone Master Issuer Plc '2019-1X 2A' RegS FRN 21/1/2070	153.978	0,10
GBP 300.000	Legal & General Group Plc RegS FRN 23/7/2041	352.944	0,22	GBP 479.000	Silverstone Master Issuer Plc RegS FRN 21/1/2070	558.386	0,35
GBP 250.000	Lloyds Bank Plc RegS 7,625% 22/4/2025	361.289	0,23	USD 400.000	SSE Plc RegS FRN 16/9/2077	339.561	0,21
USD 200.000	Lloyds Banking Group Plc 3,00% 11/1/2022	166.690	0,10	EUR 200.000	Standard Chartered Plc RegS 3,625% 23/11/2022	210.824	0,13
EUR 250.000	Lloyds Banking Group Plc RegS FRN 12/11/2025	253.335	0,16	EUR 200.000	Standard Chartered Plc RegS 3,125% 19/11/2024	220.510	0,14
GBP 313.000	London Wall Mortgage Capital Plc '2021-FL1 A' RegS FRN 15/5/2051	365.052	0,23	EUR 200.000	Standard Chartered Plc RegS FRN 23/9/2031	200.120	0,13
GBP 283.000	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/9/2034	267.479	0,17	GBP 203.495	Stanlington No 1 Plc '2017-1 A' RegS FRN 12/6/2046	236.596	0,15
GBP 288.000	Motor Plc '2016-1 C' RegS 3,75% 25/11/2025	334.496	0,21	GBP 100.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc RegS 8,25% 31/7/2025	122.506	0,08
GBP 280.000	National Grid Electricity Transmission Plc RegS 2,00% 16/9/2038	317.775	0,20				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				États-Unis suite			
USD 100.000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 'S1' 5,00% 1/11/2041	98.575	0,06	USD 170.000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 'L' 5,00% 1/7/2045	157.732	0,10
USD 5.570.010	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 XA' FRN 10/5/2058	303.789	0,19	EUR 100.000	Coty Inc RegS 4,00% 15/4/2023	99.259	0,06
USD 40.000	Charles Schwab Corp FRN 13/5/2026	32.913	0,02	USD 53	Countrywide Asset-Backed Certificates '2007-4 A2' FRN 25/4/2047	2	0,00
USD 165.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,464% 23/7/2022	140.514	0,09	USD 10.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3,454% 1/10/2030	8.907	0,01
USD 300.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,908% 23/7/2025	279.468	0,18	USD 120.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4,062% 1/10/2031	110.925	0,07
USD 120.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3,75% 15/2/2028	107.049	0,07	USD 80.000	Cox Communications Inc 3,25% 15/12/2022	68.429	0,04
USD 90.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,875% 31/3/2025	84.704	0,05	USD 40.000	Cox Communications Inc 2,95% 30/6/2023	34.362	0,02
USD 27.000	Cigna Corp 3,75% 15/7/2023	23.635	0,01	USD 539.111	Credit Suisse Mortgage Securities Corp '2005-12 2A1' 6,50% 25/1/2036	356.130	0,22
USD 40.000	Cigna Corp 4,125% 15/11/2025	36.923	0,02	USD 50.000	Crown Castle International Corp 3,30% 1/7/2030	43.478	0,03
USD 43.000	Citgo Holding Inc 9,25% 1/8/2024	36.159	0,02	USD 29.000	CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust 'D' FRN 15/11/2048	24.170	0,02
USD 100.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-P6 B' FRN 10/12/2049	90.839	0,06	USD 160.000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 'C' FRN 15/8/2051	144.648	0,09
USD 100.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-B2 'A4' 4,009% 10/3/2051	93.072	0,06	USD 100.000	CVS Health Corp 3,50% 20/7/2022	84.534	0,05
USD 90.000	Citigroup Inc FRN 24/7/2023	75.903	0,05	USD 7.000	CVS Health Corp 3,70% 9/3/2023	6.064	0,00
USD 140.000	Citigroup Inc FRN 30/10/2024	115.300	0,07	USD 150.000	Daimler Finance North America LLC 0,75% 1/3/2024	123.227	0,08
USD 70.000	Citigroup Inc FRN 29/1/2031	58.476	0,04	EUR 100.000	Danaher Corp 2,50% 30/3/2030	115.635	0,07
USD 160.000	Citrix Systems Inc 1,25% 1/3/2026	129.437	0,08	USD 70.000	Dell International LLC / EMC Corp 5,85% 15/7/2025	67.189	0,04
USD 30.000	Citrix Systems Inc 4,50% 1/12/2027	27.931	0,02	USD 280.000	Dell International LLC / EMC Corp 6,02% 15/6/2026	273.380	0,17
USD 10.000	City of Riverside CA Electric Revenue 7,605% 1/10/2040	12.808	0,01	USD 100.000	Dell International LLC / EMC Corp 6,20% 15/7/2030	102.720	0,06
USD 1.000.000	CityLine Commercial Mortgage Trust '2016-CLNE A' FRN 10/11/2031	852.757	0,53	USD 170.000	Delta Air Lines '2019-1 AA' Pass Through Trust 3,204% 25/4/2024	145.878	0,09
USD 65.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 6,25% 15/5/2026^	56.934	0,04	USD 98.046	Delta Air Lines Pass Through Trust '2015 B' 4,25% 30/7/2023	82.353	0,05
EUR 100.000	Coca-Cola Co 0,50% 9/3/2033	97.044	0,06	USD 25.000	Diamondback Energy Inc 0,90% 24/3/2023	20.497	0,01
USD 260.000	Colorado Health Facilities Authority 5,00% 1/8/2044	263.404	0,17	GBP 100.000	Discovery Communications LLC 2,50% 20/9/2024	120.876	0,08
USD 30.000	Comcast Corp 3,00% 1/2/2024	26.185	0,02	USD 190.000	District of Columbia 5,591% 1/12/2034	200.630	0,13
EUR 100.000	Comcast Corp 0,75% 20/2/2032	99.882	0,06	USD 25.000	Dominion Energy Inc FRN 15/9/2023	20.501	0,01
USD 160.000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 'B' FRN 10/9/2047	132.133	0,08	USD 10.000	DuPont de Nemours Inc 4,205% 15/11/2023	8.910	0,01
USD 92.000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 'C' FRN 10/8/2048	81.052	0,05	USD 145.000	East Bay Municipal Utility District Water System Revenue 5,874% 1/6/2040	170.615	0,11
USD 200.000	Commercial Metals Co 4,875% 15/5/2023	173.128	0,11	USD 142.000	Elanco Animal Health Inc 4,662% 27/8/2021	117.517	0,07
USD 100.000	Commercial Mortgage Trust '2015-CCRE23 B' FRN 10/5/2048	87.783	0,06	EUR 100.000	Encore Capital Group Inc RegS 4,875% 15/10/2025	106.245	0,07
USD 168.122	Commercial Mortgage Trust '2015-CCRE27 B' FRN 10/10/2048	150.941	0,09	GBP 100.000	Encore Capital Group Inc RegS 4,25% 1/6/2028	116.193	0,07
USD 5.000	Commonwealth Financing Authority 4,144% 1/6/2038	4.742	0,00	USD 50.000	Energy Transfer LP 5,20% 1/2/2022	41.771	0,03
USD 75.000	Commonwealth of Massachusetts 2,90% 1/9/2049	62.625	0,04				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				États-Unis suite			
USD 120.000	Energy Transfer LP 3,60% 1/2/2023	102.286	0,06	USD 30.049	Freddie Mac Gold Pool 4,00% 1/2/2034	26.955	0,02
USD 100.000	Energy Transfer LP 4,25% 15/3/2023	86.292	0,05	USD 27.629	Freddie Mac Gold Pool 4,00% 1/3/2034	24.808	0,02
USD 230.000	Energy Transfer LP 5,875% 15/1/2024	209.686	0,13	USD 74.324	Freddie Mac REMICS '4390 CA' 3,50% 15/6/2050	62.726	0,04
USD 80.000	Energy Transfer LP 7,60% 1/2/2024	74.748	0,05	USD 42.226	Freddie Mac REMICS '4459 BN' 3,00% 15/8/2043	37.145	0,02
USD 105.000	Energy Transfer LP / Regency Energy Finance Corp 4,50% 1/11/2023	92.551	0,06	USD 17.588	Freddie Mac REMICS '4482 DH' 3,00% 15/6/2042	14.863	0,01
EUR 100.000	Exxon Mobil Corp 1,408% 26/6/2039	96.084	0,06	USD 170.000	Freeport-McMoRan Inc 5,00% 1/9/2027	147.139	0,09
USD 39.892	Fannie Mae '2014-14 LA' 2,50% 25/4/2031	33.062	0,02	USD 55.526.431	FREMF Mortgage Trust '2015-K151 X2A' 0,10% 25/4/2030	275.525	0,17
USD 1.579	Fannie Mae Pool 4,00% 1/5/2026	1.383	0,00	USD 80.370.487	FREMF Mortgage Trust '2015-K718 X2A' 0,10% 25/2/2048	21.041	0,01
USD 4.160	Fannie Mae Pool 4,00% 1/9/2026	3.639	0,00	USD 10.000	General Motors Co 5,40% 2/10/2023	9.065	0,01
USD 464	Fannie Mae Pool 4,00% 1/1/2027	409	0,00	USD 140.000	General Motors Financial Co Inc 3,25% 5/1/2023	119.367	0,07
USD 25.820	Fannie Mae Pool 4,00% 1/3/2027	22.583	0,01	USD 50.000	General Motors Financial Co Inc 3,70% 9/5/2023	43.164	0,03
USD 38.150	Fannie Mae Pool 4,00% 1/5/2027	33.416	0,02	USD 100.000	General Motors Financial Co Inc 4,15% 19/6/2023	87.518	0,05
USD 87.693	Fannie Mae Pool 4,00% 1/8/2027	76.811	0,05	USD 135.000	General Motors Financial Co Inc 1,05% 8/3/2024	111.324	0,07
USD 8.459	Fannie Mae Pool 4,00% 1/3/2031	7.410	0,00	USD 180.000	General Motors Financial Co Inc 1,25% 8/1/2026	146.327	0,09
USD 26.203	Fannie Mae Pool 4,00% 1/4/2033	22.918	0,01	USD 50.000	General Motors Financial Co Inc 3,60% 21/6/2030	43.924	0,03
USD 20.551	Fannie Mae Pool 4,00% 1/6/2033	18.191	0,01	EUR 350.000	General Motors Financial Co Inc RegS 0,20% 2/9/2022	351.564	0,22
USD 7.135	Fannie Mae Pool 4,00% 1/9/2033	6.322	0,00	USD 40.000	Georgia-Pacific LLC 3,734% 15/7/2023	34.778	0,02
USD 10.707	Fannie Mae Pool 4,00% 1/2/2034	9.604	0,01	USD 200.000	Gilead Sciences Inc 0,75% 29/9/2023	163.965	0,10
USD 5.711	Fannie Mae Pool 4,00% 1/3/2034	4.995	0,00	USD 25.000	Glencore Funding LLC 4,625% 29/4/2024	22.624	0,01
USD 5.002	Fannie Mae Pool 4,00% 1/3/2034	4.451	0,00	USD 5.000	Global Payments Inc 3,75% 1/6/2023	4.329	0,00
EUR 100.000	FedEx Corp 0,45% 4/5/2029	99.198	0,06	USD 20.000	Global Payments Inc 4,00% 1/6/2023	17.476	0,01
EUR 200.000	Fidelity National Information Services Inc 0,125% 3/12/2022	200.926	0,13	USD 75.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,375% 1/11/2023	67.216	0,04
USD 25.000	Fidelity National Information Services Inc 0,60% 1/3/2024	20.491	0,01	USD 355.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,25% 1/6/2025	328.842	0,21
EUR 150.000	Fidelity National Information Services Inc 1,10% 15/7/2024	154.828	0,10	USD 150.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,375% 15/4/2026	140.495	0,09
EUR 250.000	Fiserv Inc 0,375% 1/7/2023	252.377	0,16	USD 50.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4,00% 15/1/2030	43.539	0,03
USD 40.000	Fiserv Inc 3,80% 1/10/2023	35.236	0,02	USD 45.000	Goldman Sachs Group Inc 3,20% 23/2/2023	38.604	0,02
USD 85.000	Flex Intermediate Holdco LLC 4,317% 30/12/2039	69.892	0,04	USD 75.000	Goldman Sachs Group Inc FRN 17/11/2023	61.584	0,04
USD 200.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,875% 2/8/2021	164.905	0,10	USD 30.000	Goldman Sachs Group Inc 3,625% 20/2/2024	26.556	0,02
USD 258.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,813% 12/10/2021	213.944	0,13	USD 335.000	Goldman Sachs Group Inc FRN 5/6/2028	303.370	0,19
USD 259.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,339% 28/3/2022	215.409	0,14	USD 145.000	Goldman Sachs Group Inc 3,80% 15/3/2030	132.473	0,08
USD 200.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,35% 1/11/2022	167.836	0,11	EUR 500.000	Goldman Sachs Group Inc RegS 3,375% 27/3/2025	560.860	0,35
USD 200.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,087% 9/1/2023	167.159	0,10	USD 2.463.566	Government National Mortgage Association '2017-64 IO' FRN 16/11/2057	111.410	0,07
GBP 130.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,535% 6/3/2025	160.754	0,10	USD 300.000	Grant County Public Utility District No 2 4,584% 1/1/2040	322.354	0,20
USD 179.402	Freddie Mac Gold Pool 3,00% 1/8/2030	158.039	0,10				
USD 25.076	Freddie Mac Gold Pool 4,00% 1/2/2034	22.483	0,01				

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				États-Unis suite			
USD 135.000	Graphic Packaging International LLC 4,125% 15/8/2024	117.660	0,07	EUR 100.000	Metropolitan Life Global Funding I RegS 2,375% 11/1/2023	104.392	0,07
USD 70.000	Gray Oak Pipeline LLC 2,00% 15/9/2023	58.583	0,04	USD 20.000	Michigan Finance Authority 5,00% 15/11/2028	20.192	0,01
USD 155.000	Gray Oak Pipeline LLC 2,60% 15/10/2025	130.847	0,08	USD 90.000	Michigan Finance Authority 5,00% 15/11/2041	89.149	0,06
USD 125.000	GS Mortgage Securities Trust '2015-GS1 A3' 3,734% 10/11/2048	113.393	0,07	USD 70.000	Micron Technology Inc 5,327% 6/2/2029	68.475	0,04
USD 360.000	HCA Inc 4,125% 15/6/2029	330.482	0,21	USD 120.000	Micron Technology Inc 4,663% 15/2/2030	113.422	0,07
USD 142.599	HSI Asset Securitization Corp Trust '2007-NC1 A2' FRN 25/4/2037	89.116	0,06	USD 150.000	Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,10% 15/5/2028	136.639	0,09
USD 25.000	Humana Inc 4,875% 1/4/2030	24.436	0,02	USD 45.000	Moody's Corp 2,625% 15/1/2023	38.166	0,02
USD 85.000	Huntsman International LLC 4,50% 1/5/2029	78.717	0,05	USD 95.000	Morgan Stanley 3,125% 23/1/2023	81.449	0,05
USD 95.000	Huntsman International LLC 2,95% 15/6/2031	78.353	0,05	USD 100.000	Morgan Stanley FRN 10/11/2023	82.124	0,05
EUR 100.000	Illinois Tool Works Inc 0,25% 5/12/2024	101.259	0,06	EUR 450.000	Morgan Stanley FRN 26/7/2024	457.060	0,29
USD 25.000	International Flavors & Fragrances Inc 0,697% 15/9/2022	20.533	0,01	USD 120.000	Morgan Stanley 3,95% 23/4/2027	110.714	0,07
USD 10.000	Interpublic Group of Cos Inc 3,75% 1/10/2021	8.287	0,01	EUR 100.000	Morgan Stanley 1,875% 27/4/2027	108.586	0,07
USD 205.000	IQVIA Inc 5,00% 15/5/2027	176.099	0,11	USD 140.000	Morgan Stanley FRN 23/1/2030	133.202	0,08
EUR 100.000	IQVIA Inc RegS 2,875% 15/9/2025	101.562	0,06	USD 500.000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-150E A' 3,912% 9/9/2032	446.794	0,28
EUR 100.000	IQVIA Inc RegS 1,75% 15/3/2026	100.954	0,06	USD 170.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS 'E' FRN 15/11/2034	139.513	0,09
EUR 100.000	IQVIA Inc RegS 2,25% 15/3/2029	99.814	0,06	USD 32.782	Morgan Stanley Capital I Trust '2017-H1 C' FRN 15/6/2050	27.757	0,02
USD 40.000	Jefferies Group LLC / Jefferies Group Capital Finance Inc 4,15% 23/1/2030	36.355	0,02	USD 365.000	Morgan Stanley Capital I Trust '2018-H3 A5' 4,177% 15/7/2051	342.066	0,21
USD 227.029	JP Morgan Mortgage Trust 2017-2 'B3' FRN 25/5/2047	192.804	0,12	USD 144.931	Morgan Stanley Capital I Trust '2018-H3 B' FRN 15/7/2051	134.740	0,08
USD 35.000	JPMorgan Chase & Co 3,625% 13/5/2024	31.322	0,02	USD 160.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 'C' FRN 15/7/2051	148.933	0,09
USD 100.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/6/2024	83.669	0,05	USD 250.000	Morgan Stanley Capital I Trust '2018-H4 A4' 4,31% 15/12/2051	235.111	0,15
USD 70.000	JPMorgan Chase & Co 4,25% 1/10/2027	66.021	0,04	USD 100.000	Morgan Stanley Capital I Trust '2018-L1 A4' FRN 15/10/2051	94.803	0,06
GBP 175.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2026	203.569	0,13	USD 86.275	Mosaic Solar Loan Trust '2020-2A A' 1,44% 20/8/2046	68.839	0,04
GBP 110.000	JPMorgan Chase & Co RegS FRN 28/4/2033	128.124	0,08	USD 30.000	MPLX LP 3,50% 1/12/2022	25.598	0,02
EUR 100.000	Kellogg Co 0,80% 17/11/2022	101.581	0,06	USD 20.000	MPLX LP 3,375% 15/3/2023	17.185	0,01
USD 43.000	Keurig Dr Pepper Inc 4,057% 25/5/2023	37.691	0,02	USD 35.000	MPLX LP 4,875% 1/12/2024	32.384	0,02
USD 35.000	Keurig Dr Pepper Inc 0,75% 15/3/2024	28.735	0,02	GBP 100.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3,375% 24/4/2030	118.594	0,07
USD 25.000	Keysight Technologies Inc 4,60% 6/4/2027	23.694	0,01	USD 86.000	Navient Corp 7,25% 25/1/2022	73.111	0,05
USD 60.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 3,95% 1/9/2022	50.941	0,03	USD 114.000	Navient Corp 6,50% 15/6/2022	97.849	0,06
USD 30.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 4,15% 1/2/2024	26.641	0,02	USD 50.000	Navient Corp 6,125% 25/3/2024	43.966	0,03
USD 30.000	Kinder Morgan Inc 3,15% 15/1/2023	25.610	0,02	USD 310.000	Navient Private Education Refi Loan Trust '2020-CA A2A' 2,15% 15/11/2068	259.479	0,16
USD 30.000	Lear Corp 4,25% 15/5/2029	27.498	0,02	USD 120.000	New Jersey Economic Development Authority 3,72% 15/6/2030	104.954	0,07
USD 150.000	Lear Corp 3,50% 30/5/2030	131.147	0,08	USD 15.000	New Jersey Turnpike Authority 1,047% 1/1/2026	12.272	0,01
USD 45.000	Level 3 Financing Inc 3,75% 15/7/2029	35.599	0,02				
USD 70.000	Los Angeles Department of Water & Power Power System Revenue 5,716% 1/7/2039	81.187	0,05				
USD 250.000	Marsh & McLennan Cos Inc 2,25% 15/11/2030	205.499	0,13				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				États-Unis suite			
USD 51.198	New Residential Mortgage Trust '2018-1A A1A' FRN 25/12/2057	44.856	0,03	USD 55.000	Port Authority of New York & New Jersey 5,647% 1/11/2040	61.755	0,04
USD 95.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2,90% 1/11/2032	82.657	0,05	EUR 100.000	Procter & Gamble Co 1,20% 30/10/2028	107.555	0,07
USD 55.000	New York City Water & Sewer System 5,724% 15/6/2042	66.274	0,04	USD 95.000	Public Storage 1,85% 1/5/2028	77.906	0,05
USD 45.000	New York City Water & Sewer System 5,44% 15/6/2043	52.779	0,03	USD 50.000	Public Storage 2,30% 1/5/2031	41.079	0,03
USD 15.000	New York Life Global Funding 1,10% 5/5/2023	12.484	0,01	USD 45.000	QUALCOMM Inc FRN 30/1/2023	37.270	0,02
USD 15.000	New York State Dormitory Authority 3,19% 15/2/2043	12.986	0,01	USD 105.000	Qwest Corp 6,75% 1/12/2021	88.511	0,06
USD 20.000	New York State Urban Development Corp 'B' 3. 12% 15/3/2025	17.807	0,01	USD 120.000	Reliance Steel & Aluminum Co 2,15% 15/8/2030	95.926	0,06
USD 170.000	New York Transportation Development Corp 'A' 5,00% 1/7/2046	157.613	0,10	USD 30.000	Reynolds American Inc 4,45% 12/6/2025	27.321	0,02
USD 10.000	New York Transportation Development Corp 'A' 5,25% 1/1/2050	9.312	0,01	USD 10.000	Roper Technologies Inc 0,45% 15/8/2022	8.209	0,01
USD 70.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 2,403% 1/9/2021	57.669	0,04	USD 60.000	Rutgers The State University of New Jersey 3,27% 1/5/2043	51.942	0,03
USD 70.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 0,65% 1/3/2023	57.689	0,04	USD 90.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625% 1/3/2025	84.660	0,05
USD 595.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4,25% 15/7/2024	517.166	0,32	USD 40.000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 4,839% 1/1/2041	42.559	0,03
USD 370.000	NGPL PipeCo LLC 4,375% 15/8/2022	314.084	0,20	USD 16.000	Santander Holdings USA Inc 4,45% 3/12/2021	13.337	0,01
USD 78.000	Nissan Motor Acceptance Corp 3,875% 21/9/2023	68.112	0,04	USD 155.000	Sealed Air Corp 5,25% 1/4/2023	134.204	0,08
USD 20.000	Nissan Motor Acceptance Corp 1,05% 8/3/2024	16.422	0,01	USD 59	Sequoia Mortgage Trust '2017-CH2 A10' FRN 25/12/2047	48	0,00
USD 205.000	Nissan Motor Acceptance Corp 2,00% 9/3/2026	168.392	0,11	USD 105.000	Service Corp International 4,625% 15/12/2027	90.877	0,06
USD 450.000	Occidental Petroleum Corp 10/10/2036 (Zero Coupon)	183.809	0,12	USD 3.000	Sherwin-Williams Co 2,75% 1/6/2022	2.513	0,00
USD 25.000	Omega Healthcare Investors Inc 4,75% 15/1/2028	22.894	0,01	USD 96.000	Sherwin-Williams Co 2,30% 15/5/2030	78.969	0,05
USD 100.000	ONE Gas Inc 1,10% 11/3/2024	82.027	0,05	USD 50.000	Simon Property Group LP 3,375% 1/10/2024	44.202	0,03
USD 155.000	OneMain Financial Issuance Trust '2020-1A A' 3,84% 1 4/5/2032	132.902	0,08	USD 105.000	Sirius XM Radio Inc 5,00% 1/8/2027	90.017	0,06
USD 20.000	ONEOK Inc 4,35% 15/3/2029	18.295	0,01	USD 200.000	SK Battery America Inc RegS 2,125% 26/1/2026	162.818	0,10
USD 150.000	ONEOK Partners LP 4,90% 15/3/2025	137.572	0,09	USD 110.000	SMB Private Education Loan Trust '2020-PTB B' 2,50% 15/9/2054	91.565	0,06
USD 130.000	Oracle Corp 2,625% 15/2/2023	110.616	0,07	USD 7.000	South Carolina Public Service Authority 'D' 2,388% 1/12/2023	5.992	0,00
USD 25.000	Oracle Corp 2,95% 15/11/2024	21.910	0,01	USD 138.571	Southern California Edison Co 1,845% 1/2/2022	113.662	0,07
USD 20.000	Oregon School Boards Association 5,68% 30/6/2028	20.121	0,01	USD 35.000	Southern California Edison Co 1,10% 1/4/2024	28.893	0,02
USD 10.000	Oregon School Boards Association 'B' 5,55% 30/6/2028	9.861	0,01	USD 107.500	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC 3,36% 20/9/2021	88.372	0,06
USD 80.000	Pacific Gas and Electric Co 1,367% 10/3/2023	65.608	0,04	USD 15.000	State of Maryland Department of Transportation 0,361% 1/8/2023	12.288	0,01
USD 50.000	Par Pharmaceutical Inc 7,50% 1/4/2027	41.841	0,03	USD 115.000	Teleflex Inc 4,625% 15/11/2027	100.398	0,06
USD 80.000	PayPal Holdings Inc 1,35% 1/6/2023	66.884	0,04	USD 120.000	Texas Municipal Gas Acquisition & Supply Corp I 'D' 6,25% 15/12/2026	115.307	0,07
USD 75.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp 2,70% 14/3/2023	63.695	0,04	EUR 100.000	Thermo Fisher Scientific Inc 1,75% 15/4/2027	108.365	0,07
USD 35.000	Pioneer Natural Resources Co 0,55% 15/5/2023	28.776	0,02	USD 205.000	T-Mobile USA Inc 2,625% 15/4/2026	171.177	0,11
USD 110.000	Pioneer Natural Resources Co 0,75% 15/1/2024	90.248	0,06	USD 170.000	T-Mobile USA Inc 2,05% 15/2/2028	138.915	0,09

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				BILLET DE TRÉSORERIE			
USD 34.375	Towd Point Mortgage Trust '2016-3 A1' FRN 25/4/2056	28.368	0,02	États-Unis			
USD 160.000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C12 'B' FRN 15/8/2051	150.531	0,09	USD 35.000	UBS AG 0,305% 18/11/2021	28.679	0,02
USD 50.000	Union Pacific Corp 3,15% 1/3/2024	43.964	0,03			28.679	0,02
USD 157.688	United Airlines 2019-2 Class A Pass Through Trust 'A' 2,90% 1/5/2028	126.353	0,08	Total des billets de trésorerie			
USD 196.177	United Airlines 2019-2 Class B Pass Through Trust 'B' 3,50% 1/5/2028	158.808	0,10	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
USD 266.462	United Airlines '2020-1 A' Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027	241.296	0,15	Irlande			
USD 24.262	United Airlines '2020-1 B' Pass Through Trust 'B' 4,875% 15/1/2026	20.910	0,01	EUR 30.800	iShares EUR Corp Bond 1-5yr UCITS ETF [^]	3.438.666	2,16
USD 5.000	University of California 5,77% 15/5/2043	5.661	0,00	EUR 57.000	iShares EUR Ultrashort Bond UCITS ETF ⁻	5.707.125	3,58
USD 40.000	Verisk Analytics Inc 4,125% 15/3/2029	36.792	0,02	Total des Fonds négociés en bourse			
USD 30.000	Verizon Communications Inc FRN 22/3/2024	24.744	0,02	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
USD 100.000	Verizon Communications Inc 0,75% 22/3/2024	82.645	0,05				
USD 155.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 3,50% 15/2/2025	129.532	0,08	142.642.444 89,46			
USD 105.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 4,25% 1/12/2026	88.660	0,06	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
USD 25.000	Virginia Electric & Power Co 3,45% 1/9/2022	21.112	0,01	OBLIGATIONS			
USD 18.000	VMware Inc 3,90% 21/8/2027	16.375	0,01	Mexique			
GBP 45.000	Walmart Inc 5,25% 28/9/2035	76.192	0,05	USD 116.000	Petroleos Mexicanos 6,84% 23/1/2030	98.615	0,06
USD 75.000	Wells Fargo & Co 3,75% 24/1/2024	66.459	0,04				
GBP 200.000	Wells Fargo Bank NA RegS 5,25% 1/8/2023	253.908	0,16	Royaume-Uni			
USD 9.208.165	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-C41 XA' FRN 15/11/2050	476.381	0,30	GBP 100.000	Stonegate Pub Co Financing Plc RegS 8,00% 13/7/2025	120.995	0,08
USD 200.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C48 'C' FRN 15/1/2052	188.750	0,12				
GBP 100.000	Welltower Inc 4,80% 20/11/2028	137.665	0,09	États-Unis			
USD 25.000	Williams Cos Inc 4,00% 15/11/2021	20.634	0,01	USD 100.000	Air Lease Corp FRN 15/12/2022	81.959	0,05
USD 25.000	WRKCo Inc 3,75% 15/3/2025	22.515	0,01	USD 95.000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/6/2025	77.982	0,05
		34.976.154	21,93	USD 25.000	Morgan Stanley FRN 5/4/2024	20.563	0,01
Total des obligations		133.452.415	83,69	180.504 0,11			
				Total des obligations			
				400.114 0,25			
				Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
				400.114 0,25			
				Portefeuille de titres à la valeur de marché			
				143.042.558 89,71			
				Autres éléments de l'actif net			
				16.411.686 10,29			
				Total de l'actif net (EUR)			
				159.454.244 100,00			

[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDS	USD 7.330.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.30 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(8.573)	(146.337)
CCCDS	EUR 6.685.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(51.614)	(792.065)
CCCDS	EUR 4.190.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(4.962)	(87.922)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	EUR 19.460.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(31.072)	(492.789)
CCILS	EUR 700.000	Fund receives Fixed 1,382% and pays Floating EUR 12 Month CPTFE	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(11.894)	(11.878)
CCILS	USD 4.110.000	Fund receives Fixed 2,278% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	29/1/2031	(131.840)	(131.762)
CCILS	USD 105.000	Fund receives Fixed 2,321% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	25/2/2031	(2.886)	(2.884)
CCILS	USD 230.000	Fund receives Fixed 2,342% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	23/2/2031	(5.894)	(5.889)
CCILS	USD 30.625	Fund receives Fixed 2,350% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(747)	(746)
CCILS	USD 215.000	Fund receives Fixed 2,350% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(5.243)	(5.239)
CCILS	USD 30.625	Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(736)	(735)
CCILS	USD 215.000	Fund receives Fixed 2,354% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(5.166)	(5.162)
CCILS	USD 61.250	Fund receives Fixed 2,358% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(1.453)	(1.452)
CCILS	USD 430.000	Fund receives Fixed 2,358% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	5/3/2031	(10.199)	(10.191)
CCILS	USD 450.000	Fund receives Fixed 2,388% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2031	(9.755)	(9.746)
CCILS	USD 135.000	Fund receives Fixed 2,432% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	6/5/2051	(1.641)	(1.636)
CCILS	USD 135.000	Fund receives Fixed 2,438% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	7/5/2051	(1.422)	(1.417)
CCILS	USD 40.000	Fund receives Fixed 2,443% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	25/3/2031	(633)	(632)
CCILS	USD 90.000	Fund receives Fixed 2,445% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	18/3/2031	(1.417)	(1.415)
CCILS	USD 170.000	Fund receives Fixed 2,454% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	18/3/2031	(2.532)	(2.529)
CCILS	USD 135.000	Fund receives Fixed 2,484% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2051	415	420
CCILS	USD 135.000	Fund receives Fixed 2,488% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2051	574	579
CCILS	USD 100.000	Fund receives Fixed 2,505% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	30/3/2031	(1.019)	(1.018)
CCILS	USD 7.180.000	Fund receives Fixed 2,656% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	42.591	42.726
CCILS	USD 310.000	Fund receives Fixed 2,669% and pays Floating USD 12 Month USCPI	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	2.209	2.215
CCILS	GBP 245.000	Fund receives Fixed 3,202% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(11.574)	(11.568)
CCILS	GBP 310.000	Fund receives Fixed 3,270% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(11.584)	(11.576)
CCILS	GBP 265.000	Fund receives Fixed 3,285% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(9.323)	(9.316)
CCILS	GBP 310.000	Fund receives Fixed 3,290% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(10.680)	(10.672)
CCILS	GBP 265.000	Fund receives Fixed 3,293% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2030	(9.014)	(9.007)
CCILS	GBP 290.000	Fund receives Fixed 3,315% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2030	(10.538)	(10.530)
CCILS	GBP 6.300.000	Fund receives Fixed 3,380% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2022	(72.342)	(72.290)
CCILS	GBP 300.000	Fund receives Fixed 3,461% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2031	(13.661)	(13.653)
CCILS	GBP 320.000	Fund receives Fixed 3,480% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2030	(691)	(683)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCILS	GBP 180.000	Fund receives Fixed 3,510% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2029	378	383
CCILS	GBP 830.000	Fund receives Fixed 3,510% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/11/2030	(24.743)	(24.722)
CCILS	GBP 150.000	Fund receives Fixed 3,535% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2030	(4.166)	(4.162)
CCILS	GBP 390.000	Fund receives Fixed 3,580% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2029	4.903	4.913
CCILS	GBP 526.000	Fund receives Fixed 3,618% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2031	(11.145)	(11.131)
CCILS	GBP 330.000	Fund receives Fixed 3,625% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2031	(6.624)	(6.616)
CCILS	GBP 10.000	Fund receives Fixed 3,637% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2031	(145)	(145)
CCILS	GBP 1.074.000	Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2030	(27.891)	(13.066)
CCILS	GBP 550.000	Fund receives Fixed 3,650% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(9.246)	(9.231)
CCILS	GBP 550.000	Fund receives Fixed 3,658% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(8.633)	(8.618)
CCILS	GBP 266.000	Fund receives Fixed 3,700% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(1.678)	(2.516)
CCILS	GBP 48.000	Fund receives Fixed 3,735% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(205)	(204)
CCILS	GBP 228.117	Fund receives Fixed 3,756% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/4/2031	(226)	(220)
CCILS	GBP 54.000	Fund receives Fixed 3,758% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	(45)	(43)
CCILS	GBP 1.646.000	Fund receives Fixed 3,776% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2028	85.064	85.660
CCILS	GBP 18.000	Fund receives Fixed 3,790% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2031	71	72
CCILS	GBP 320.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,345%	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2025	(2.662)	(2.657)
CCILS	GBP 830.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,428%	Bank of America Merrill Lynch	15/11/2025	12.849	12.863
CCILS	GBP 1.000.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,467%	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2031	44.642	44.667
CCILS	GBP 390.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,505%	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2024	(7.260)	(7.254)
CCILS	USD 543.333	Fund receives Floating USD 12 Month USCPI and pays Fixed 2,285%	Bank of America Merrill Lynch	11/1/2031	17.083	17.093
CCILS	USD 543.334	Fund receives Floating USD 12 Month USCPI and pays Fixed 2,298%	Bank of America Merrill Lynch	11/1/2031	16.481	16.491
CCILS	USD 156.667	Fund receives Floating USD 12 Month USCPI and pays Fixed 2,312%	Bank of America Merrill Lynch	11/1/2051	7.935	7.941
CCILS	USD 156.667	Fund receives Floating USD 12 Month USCPI and pays Fixed 2,319%	Bank of America Merrill Lynch	11/1/2051	7.658	7.664
CCILS	USD 9.580.000	Fund receives Floating USD 12 Month USCPI and pays Fixed 3,565%	Bank of America Merrill Lynch	25/5/2022	12.332	12.390
CCIRS	EUR 710.000	Fund receives Fixed 0,016% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/3/2031	(6.296)	(7.320)
CCIRS	EUR 130.000	Fund receives Fixed 0,017% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	29/3/2031	(1.779)	(1.326)
CCIRS	EUR 520.000	Fund receives Fixed 0,023% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	14/4/2031	(3.660)	(5.155)
CCIRS	EUR 1.170.000	Fund receives Fixed 0,034% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/4/2031	(9.733)	(10.143)
CCIRS	EUR 2.300.000	Fund receives Fixed 0,035% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	3.720	(23.010)
CCIRS	EUR 390.000	Fund receives Fixed 0,078% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/4/2031	(1.816)	(1.809)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	JPY 19.250.000	Fund receives Fixed 0,130% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2035	(2.400)	(2.397)
CCIRS	JPY 3.200.000	Fund receives Fixed 0,130% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2035	(400)	(399)
CCIRS	JPY 12.000.000	Fund receives Fixed 0,136% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	12/6/2035	(1.292)	(1.289)
CCIRS	EUR 140.000	Fund receives Fixed 0,162% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	186	403
CCIRS	USD 620.000	Fund receives Fixed 0,250% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/7/2023	(474)	(469)
CCIRS	USD 40.000	Fund receives Fixed 0,325% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/9/2025	(558)	(557)
CCIRS	JPY 52.650.000	Fund receives Fixed 0,363% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/7/2028	8.814	8.822
CCIRS	JPY 79.810.000	Fund receives Fixed 0,366% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	29/1/2028	13.006	13.018
CCIRS	JPY 14.690.000	Fund receives Fixed 0,399% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/4/2041	269	274
CCIRS	USD 210.000	Fund receives Fixed 0,441% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/3/2024	(2)	(1)
CCIRS	NOK 10.705.500	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/11/2022	(4.392)	(4.384)
CCIRS	NOK 12.132.900	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	24/11/2022	(5.005)	(4.995)
CCIRS	NOK 9.706.320	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/11/2022	(4.025)	(4.018)
CCIRS	NOK 18.442.008	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/11/2022	(7.773)	(7.759)
CCIRS	USD 710.000	Fund receives Fixed 0,471% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2026	(8.672)	(8.665)
CCIRS	NOK 10.191.636	Fund receives Fixed 0,475% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/11/2022	(4.246)	(4.238)
CCIRS	NOK 4.920.000	Fund receives Fixed 0,490% and pays Floating NOK 6 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/9/2022	(1.258)	(1.254)
CCIRS	NOK 10.191.636	Fund receives Fixed 0,495% and pays Floating NOK 3 Month NIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/12/2022	(4.219)	(4.211)
CCIRS	USD 620.000	Fund receives Fixed 0,532% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	12/5/2024	74	79
CCIRS	USD 10.000	Fund receives Fixed 0,586% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/4/2024	14	14
CCIRS	CAD 170.000	Fund receives Fixed 0,640% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	21/4/2023	(10)	(10)
CCIRS	CAD 821.000	Fund receives Fixed 0,780% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	17/11/2023	(2.349)	(2.345)
CCIRS	CAD 3.214.000	Fund receives Fixed 0,780% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	18/11/2023	(9.351)	(9.334)
CCIRS	CAD 6.635.000	Fund receives Fixed 0,809% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	16/11/2023	(17.631)	(17.595)
CCIRS	USD 645.000	Fund receives Fixed 0,872% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/3/2023	6.258	6.263
CCIRS	USD 2.570.000	Fund receives Fixed 0,876% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/3/2023	25.065	25.084
CCIRS	USD 645.000	Fund receives Fixed 0,903% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/3/2023	6.541	6.545
CCIRS	HKD 1.520.000	Fund receives Fixed 0,910% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	123	125
CCIRS	CAD 13.660.000	Fund receives Fixed 0,960% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2024	(4.549)	(4.429)
CCIRS	USD 95.000	Fund receives Fixed 0,978% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/3/2023	1.065	1.066
CCIRS	USD 2.950.000	Fund receives Fixed 0,979% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2026	4.242	12.450

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	USD 635.000	Fund receives Fixed 0,986% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/3/2023	7.191	7.196
CCIRS	HKD 1.570.000	Fund receives Fixed 1,024% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1.062	1.064
CCIRS	SGD 150.000	Fund receives Fixed 1,055% and pays Floating SGD 6 Month SORF6	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(48)	(47)
CCIRS	SGD 155.000	Fund receives Fixed 1,060% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(26)	(25)
CCIRS	SGD 430.000	Fund receives Fixed 1,070% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	59	63
CCIRS	SGD 400.000	Fund receives Fixed 1,080% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	178	181
CCIRS	USD 1.950.000	Fund receives Fixed 1,088% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/3/2023	24.915	24.930
CCIRS	SGD 300.000	Fund receives Fixed 1,100% and pays Floating SGD 6 Month SORF6	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	317	319
CCIRS	SGD 150.000	Fund receives Fixed 1,102% and pays Floating SGD 6 Month SORF6	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	168	169
CCIRS	SGD 430.000	Fund receives Fixed 1,102% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	487	491
CCIRS	SGD 155.000	Fund receives Fixed 1,105% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	187	189
CCIRS	SGD 84.960	Fund receives Fixed 1,115% and pays Floating SGD 6 Month SORF6	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	129	129
CCIRS	CZK 41.750.000	Fund receives Fixed 1,120% and pays Floating CZK 6 Month PRIBO	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2023	(6.639)	(6.626)
CCIRS	SGD 151.040	Fund receives Fixed 1,120% and pays Floating SGD 6 Month SORF6	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	252	253
CCIRS	SGD 164.000	Fund receives Fixed 1,136% and pays Floating SGD 6 Month SORF6	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	354	355
CCIRS	SGD 230.000	Fund receives Fixed 1,148% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	577	579
CCIRS	CZK 62.530.000	Fund receives Fixed 1,170% and pays Floating CZK 6 Month PRIBO	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2023	(7.482)	(7.462)
CCIRS	SGD 350.000	Fund receives Fixed 1,180% and pays Floating SGD 6 Month SORF6	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1.226	1.229
CCIRS	SGD 210.000	Fund receives Fixed 1,195% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	832	834
CCIRS	USD 1.665.000	Fund receives Fixed 1,247% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	6/10/2022	19.895	19.908
CCIRS	USD 110.000	Fund receives Fixed 1,270% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2032	(3.669)	(3.667)
CCIRS	USD 103.000	Fund receives Fixed 1,342% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2027	698	699
CCIRS	USD 403.000	Fund receives Fixed 1,375% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	30/3/2027	3.225	3.125
CCIRS	PLN 590.000	Fund receives Fixed 1,463% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.050)	(1.048)
CCIRS	PLN 660.000	Fund receives Fixed 1,465% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.160)	(1.158)
CCIRS	USD 140.000	Fund receives Fixed 1,505% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/3/2031	(450)	(264)
CCIRS	PLN 640.000	Fund receives Fixed 1,513% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(794)	(792)
CCIRS	PLN 720.000	Fund receives Fixed 1,524% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(807)	(805)
CCIRS	USD 280.000	Fund receives Fixed 1,534% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	11/5/2031	(268)	(264)
CCIRS	USD 130.000	Fund receives Fixed 1,544% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/5/2031	(53)	(51)
CCIRS	PLN 660.000	Fund receives Fixed 1,562% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(466)	(464)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	PLN 730.000	Fund receives Fixed 1,580% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(378)	(376)
CCIRS	PLN 840.000	Fund receives Fixed 1,598% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(276)	(274)
CCIRS	PLN 780.000	Fund receives Fixed 1,600% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(236)	(233)
CCIRS	PLN 570.000	Fund receives Fixed 1,616% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(74)	(72)
CCIRS	PLN 460.000	Fund receives Fixed 1,630% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	10	11
CCIRS	PLN 660.000	Fund receives Fixed 1,643% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	107	109
CCIRS	USD 10.000	Fund receives Fixed 1,912% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/12/2056	(506)	(505)
CCIRS	USD 800.000	Fund receives Fixed 1,946% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	6.532	(5.774)
CCIRS	USD 7.270.000	Fund receives Fixed 1,977% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/3/2026	16.387	16.448
CCIRS	USD 1.790.000	Fund receives Fixed 2,030% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	24.198	16.285
CCIRS	USD 90.000	Fund receives Fixed 2,044% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	5/5/2033	347	348
CCIRS	USD 60.000	Fund receives Fixed 2,061% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	838	913
CCIRS	USD 1.640.000	Fund receives Fixed 2,068% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	51.961	27.020
CCIRS	USD 280.000	Fund receives Fixed 2,120% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	16/5/2033	2.557	2.562
CCIRS	USD 150.000	Fund receives Fixed 2,420% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	18/5/2031	10.187	10.190
CCIRS	MXN 4.838.000	Fund receives Fixed 4,180% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	16/2/2023	(3.066)	(3.064)
CCIRS	MXN 9.256.000	Fund receives Fixed 4,288% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	13/1/2023	(4.580)	(4.576)
CCIRS	MXN 5.101.000	Fund receives Fixed 4,915% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	25/4/2023	(1.106)	(1.104)
CCIRS	MXN 5.262.000	Fund receives Fixed 5,220% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	29/3/2023	219	220
CCIRS	MXN 3.367.000	Fund receives Fixed 5,310% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	22/4/2024	(1.152)	(1.151)
CCIRS	MXN 1.735.941	Fund receives Fixed 5,470% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	21/3/2024	(217)	(216)
CCIRS	MXN 2.110.000	Fund receives Fixed 5,778% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	9/9/2026	(1.999)	(1.998)
CCIRS	MXN 4.360.000	Fund receives Fixed 6,110% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	9/9/2026	(1.541)	(1.539)
CCIRS	MXN 3.330.000	Fund receives Fixed 6,262% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	9/9/2026	(273)	(271)
CCIRS	MXN 1.930.000	Fund receives Fixed 6,380% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	9/9/2026	249	250
CCIRS	MXN 3.220.000	Fund receives Fixed 6,402% and pays Floating MXN 1 Month TIIE	Bank of America Merrill Lynch	9/9/2026	544	546
CCIRS	AUD 60.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,906%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	191	191
CCIRS	AUD 100.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,910%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	307	308
CCIRS	AUD 200.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,923%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	529	531
CCIRS	AUD 160.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,935%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	363	365
CCIRS	AUD 100.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,936%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	222	223

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	AUD 60.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,949%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	110	110
CCIRS	AUD 200.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,952%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	348	350
CCIRS	AUD 100.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,965%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	133	134
CCIRS	AUD 100.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,975%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	102	103
CCIRS	AUD 250.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,980%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	216	218
CCIRS	AUD 180.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,990%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	102	103
CCIRS	AUD 100.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,992%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	47	48
CCIRS	AUD 230.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	58	60
CCIRS	AUD 340.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,005%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	28	31
CCIRS	AUD 110.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,007%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	2	3
CCIRS	AUD 100.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,010%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(6)	(5)
CCIRS	AUD 360.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,012%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(50)	(46)
CCIRS	AUD 90.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,018%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(28)	(27)
CCIRS	AUD 96.132	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,676%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	8.143	8.145
CCIRS	AUD 94.845	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,677%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	8.020	8.023
CCIRS	AUD 96.243	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,682%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	8.061	8.064
CCIRS	AUD 101.231	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,685%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	8.442	8.444
CCIRS	AUD 101.959	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,686%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	8.488	8.490
CCIRS	AUD 95.060	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,708%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	7.608	7.610
CCIRS	AUD 91.134	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,727%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	7.041	7.043
CCIRS	AUD 116.625	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 2,152%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	1.762	1.765
CCIRS	AUD 176.771	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 2,172%	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2051	2.168	2.172
CCIRS	CAD 350.000	Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 1,375%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2026	204	208
CCIRS	CZK 9.000.000	Fund receives Floating CZK 6 Month PRIBO and pays Fixed 1,766%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2031	316	323
CCIRS	CZK 6.755.000	Fund receives Floating CZK 6 Month PRIBO and pays Fixed 1,798%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2031	(569)	(563)
CCIRS	CZK 6.755.000	Fund receives Floating CZK 6 Month PRIBO and pays Fixed 1,809%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2031	(846)	(840)
CCIRS	EUR 1.010.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,032%	Bank of America Merrill Lynch	9/4/2031	8.964	8.984
CCIRS	EUR 65.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,172%	Bank of America Merrill Lynch	12/4/2052	6.670	6.673
CCIRS	EUR 220.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,185%	Bank of America Merrill Lynch	16/1/2030	(2.959)	(2.917)
CCIRS	EUR 250.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,440%	Bank of America Merrill Lynch	16/5/2033	(1.203)	(1.198)
CCIRS	JPY 50.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,192%	Bank of America Merrill Lynch	4/1/2029	(3.716)	(3.708)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	JPY 1.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,225%	Bank of America Merrill Lynch	22/12/2040	333	333
CCIRS	JPY 6.110.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,295%	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2039	407	408
CCIRS	JPY 7.720.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,329%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2039	158	160
CCIRS	JPY 10.970.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,355%	Bank of America Merrill Lynch	4/2/2034	(1.621)	(1.619)
CCIRS	JPY 12.850.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,409%	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2039	(1.162)	(1.159)
CCIRS	JPY 30.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,522%	Bank of America Merrill Lynch	30/11/2031	(8.384)	(8.379)
CCIRS	JPY 2.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,616%	Bank of America Merrill Lynch	14/12/2038	(736)	(736)
CCIRS	JPY 10.522.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,657%	Bank of America Merrill Lynch	6/12/2038	(4.427)	(4.424)
CCIRS	JPY 8.200.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,715%	Bank of America Merrill Lynch	21/3/2044	(2.468)	(2.466)
CCIRS	SEK 2.710.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,378%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	912	915
CCIRS	SEK 2.690.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,387%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	792	796
CCIRS	SEK 2.550.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,389%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	726	729
CCIRS	SEK 2.810.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,392%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	758	762
CCIRS	SEK 1.430.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,395%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	350	368
CCIRS	SEK 2.970.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,398%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	713	718
CCIRS	SEK 1.330.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,402%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	297	298
CCIRS	SEK 2.290.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,406%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	427	463
CCIRS	SEK 2.390.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,421%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	298	302
CCIRS	USD 600.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,202%	Bank of America Merrill Lynch	8/2/2023	(76)	(72)
CCIRS	USD 440.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,203%	Bank of America Merrill Lynch	10/2/2023	(59)	(56)
CCIRS	USD 1.170.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,242%	Bank of America Merrill Lynch	11/5/2023	(415)	(407)
CCIRS	USD 140.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,273%	Bank of America Merrill Lynch	23/4/2023	(119)	(124)
CCIRS	USD 12.320.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,281%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(14.804)	(10.664)
CCIRS	USD 80.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,394%	Bank of America Merrill Lynch	22/11/2023	72	73
CCIRS	USD 11.930.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,450%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2024	(6.734)	(6.817)
CCIRS	USD 467.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,505%	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2024	(1.328)	(1.324)
CCIRS	USD 50.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,634%	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2030	3.016	3.017
CCIRS	USD 140.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,666%	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	8.431	8.434
CCIRS	USD 250.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,670%	Bank of America Merrill Lynch	9/10/2030	15.180	15.185
CCIRS	USD 300.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,678%	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	17.793	17.798
CCIRS	USD 150.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,684%	Bank of America Merrill Lynch	17/9/2030	8.836	8.838

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	USD 140.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,706%	Bank of America Merrill Lynch	14/9/2030	8.017	8.019
CCIRS	USD 317.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,760%	Bank of America Merrill Lynch	3/6/2031	19.601	19.607
CCIRS	USD 700.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,765%	Bank of America Merrill Lynch	4/5/2032	54.067	54.080
CCIRS	USD 590.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,834%	Bank of America Merrill Lynch	15/11/2027	9.412	9.419
CCIRS	USD 194.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,886%	Bank of America Merrill Lynch	5/11/2030	8.858	8.861
CCIRS	USD 250.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 0,944%	Bank of America Merrill Lynch	30/12/2030	10.723	10.727
CCIRS	USD 170.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,034%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(409)	(407)
CCIRS	USD 220.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,040%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(582)	(580)
CCIRS	USD 550.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,046%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.612)	(1.605)
CCIRS	USD 100.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,051%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(311)	(310)
CCIRS	USD 340.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,069%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.306)	(1.302)
CCIRS	USD 100.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,151%	Bank of America Merrill Lynch	4/2/2031	2.838	2.840
CCIRS	USD 190.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,154%	Bank of America Merrill Lynch	4/2/2031	5.357	5.360
CCIRS	USD 190.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,164%	Bank of America Merrill Lynch	4/2/2031	5.206	5.209
CCIRS	USD 190.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,176%	Bank of America Merrill Lynch	14/1/2031	4.934	4.937
CCIRS	USD 780.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,194%	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2030	16.320	16.333
CCIRS	USD 190.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,216%	Bank of America Merrill Lynch	8/2/2031	4.480	4.483
CCIRS	USD 50.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,237%	Bank of America Merrill Lynch	6/3/2050	7.040	7.042
CCIRS	USD 860.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,251%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2028	(2.618)	(2.607)
CCIRS	USD 390.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,270%	Bank of America Merrill Lynch	20/4/2027	(1.027)	(1.023)
CCIRS	USD 10.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,292%	Bank of America Merrill Lynch	29/4/2027	(32)	(32)
CCIRS	USD 780.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,300%	Bank of America Merrill Lynch	27/2/2030	7.292	7.442
CCIRS	USD 870.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,305%	Bank of America Merrill Lynch	27/8/2030	11.374	11.391
CCIRS	USD 980.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,370%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2028	(9.137)	(9.125)
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,482%	Bank of America Merrill Lynch	26/2/2031	723	727
CCIRS	USD 1.390.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,505%	Bank of America Merrill Lynch	25/2/2026	1.783	1.794
CCIRS	USD 79.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,516%	Bank of America Merrill Lynch	28/5/2031	200	201
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,545%	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2031	(206)	(203)
CCIRS	USD 2.070.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,545%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(9.629)	1.641
CCIRS	USD 70.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,553%	Bank of America Merrill Lynch	12/3/2031	(112)	(111)
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,568%	Bank of America Merrill Lynch	1/3/2031	(589)	(586)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	USD 16.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,573%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2031	(28)	(28)
CCIRS	USD 510.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,575%	Bank of America Merrill Lynch	26/2/2026	372	377
CCIRS	USD 4.310.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,593%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(18.427)	(12.762)
CCIRS	USD 100.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,602%	Bank of America Merrill Lynch	18/3/2031	(525)	(523)
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,606%	Bank of America Merrill Lynch	18/3/2031	(1.112)	(1.108)
CCIRS	USD 100.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,610%	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2031	(604)	(603)
CCIRS	USD 100.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,624%	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2031	(704)	(702)
CCIRS	USD 80.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,626%	Bank of America Merrill Lynch	5/5/2031	(497)	(496)
CCIRS	USD 90.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,648%	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2031	(705)	(704)
CCIRS	USD 580.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,650%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2031	(3.002)	(2.990)
CCIRS	USD 390.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,650%	Bank of America Merrill Lynch	14/5/2031	(3.439)	(3.125)
CCIRS	USD 50.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,657%	Bank of America Merrill Lynch	25/3/2031	(467)	(466)
CCIRS	USD 100.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,658%	Bank of America Merrill Lynch	9/3/2031	(971)	(969)
CCIRS	USD 100.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,660%	Bank of America Merrill Lynch	9/3/2031	(979)	(977)
CCIRS	USD 150.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,663%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(658)	(1.262)
CCIRS	USD 90.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,664%	Bank of America Merrill Lynch	17/8/2049	2.451	2.453
CCIRS	USD 5.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,673%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(27.012)	(45.879)
CCIRS	USD 120.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,680%	Bank of America Merrill Lynch	30/3/2031	(1.317)	(1.315)
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,689%	Bank of America Merrill Lynch	9/3/2031	(2.409)	(2.406)
CCIRS	USD 120.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,705%	Bank of America Merrill Lynch	16/8/2049	3.004	3.007
CCIRS	USD 120.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,754%	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2031	(1.994)	(1.992)
CCIRS	USD 180.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,765%	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2031	(3.200)	(3.134)
CCIRS	USD 300.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,778%	Bank of America Merrill Lynch	16/8/2049	6.327	6.335
CCIRS	USD 820.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,070%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2047	(9.094)	(8.858)
CCIRS	USD 25.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,120%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2040	(1.293)	(676)
CCIRS	USD 70.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,295%	Bank of America Merrill Lynch	24/6/2034	(539)	(538)
CCIRS	USD 150.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,338%	Bank of America Merrill Lynch	5/7/2049	(1.378)	(1.374)
CCIRS	USD 591.500	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,762%	Bank of America Merrill Lynch	10/3/2031	(55.674)	(55.664)
CCIRS	USD 750.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,780%	Bank of America Merrill Lynch	4/4/2039	(18.031)	(18.014)
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,974%	Bank of America Merrill Lynch	8/12/2048	(8.676)	(8.670)
CCIRS	ZAR 986.668	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 5,840%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2026	104	105

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	ZAR 1.276.332	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 5,880%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2026	2	3
CCIRS	ZAR 2.830.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 6,020%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	640	642
CCIRS	ZAR 2.850.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 6,061%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	344	347
CCIRS	ZAR 2.930.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 6,110%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(15)	(12)
CCIRS	ZAR 2.310.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 6,159%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(302)	(301)
CCIRS	ZAR 2.920.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 6,225%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(877)	(875)
CCIRS	ZAR 5.100.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 6,240%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.729)	(1.725)
CCIRS	ZAR 2.930.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 6,260%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.144)	(1.141)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group PLC and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	(15)	(4.178)
CDS	USD 396.003	Fund receives default protection on Brazilian Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(8.128)	11.151
CDS	EUR 570.000	Fund receives default protection on LANXESS AG and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	403	(13.030)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(55)	(74)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(61)	(74)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	—	(74)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(49)	(74)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(74)	(74)
CDS	USD 48.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(128)	(118)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(19)	(74)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(19)	(74)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(25)	(49)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(13)	(49)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(37)	(74)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(25)	(49)
CDS	USD 21.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank Plc	20/6/2026	(35)	(52)
CDS	USD 200.000	Fund receives default protection on Hess Corp and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2025	(41.003)	(598)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2026	(201)	(4.178)
CDS	USD 290.000	Fund receives default protection on Tyson Foods Inc and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/12/2023	(2.082)	(4.667)
CDS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Unibail-Rodamco-Westfield SE	BNP Paribas	20/6/2026	348	(2.045)
CDS	EUR 500.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Valeo SA	BNP Paribas	20/6/2026	908	(10.358)
CDS	USD 27.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	79	444
CDS	USD 27.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	58	444

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	USD 44.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	69	724
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group PLC and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	(30)	(8.355)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	(1)	(49)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	3	(49)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	(1)	(49)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	(5)	(49)
CDS	USD 31.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2026	(32)	(76)
CDS	USD 83.243	Fund receives default protection on Occidental Petroleum Corp and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/12/2025	(2.600)	4.613
CDS	USD 280.000	Fund receives default protection on Arrow Electronics Inc and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/12/2023	(3.150)	(4.385)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Allstate Corp/The and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.488	(4.043)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Autozone Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2024	1.638	(6.301)
CDS	EUR 450.000	Fund receives default protection on Barclays PLC and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(283)	(9.721)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Barrick Gold Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.627	(2.933)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Bristol Myers Squibb Co and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2024	2.723	(7.127)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Campbell Soup Co and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	2.299	(3.131)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Cardinal Health Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.790	(2.625)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Caterpillar Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	426	(3.846)
CDS	USD 79.000	Fund receives default protection on Chile Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	363	(1.027)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on CSX Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.977	(3.965)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Dominion Energy Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2024	3.243	(6.470)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on ERP Operating LP and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2025	(688)	(6.996)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Exelon Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.020	(3.646)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Home Depot Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2024	3.187	(7.351)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on International Paper Co and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.829	(3.455)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Lowes Cos Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2024	2.820	(6.755)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on McKesson Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.607	(3.170)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(9)	(49)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(9)	(49)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(9)	(49)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Mondelez International Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.731	(3.480)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Motorola Solutions Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.037	(3.163)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Newmont Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	776	(3.568)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Norfolk Southern Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.726	(3.996)
CDS	USD 56.757	Fund receives default protection on Occidental Petroleum Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2025	(1.987)	3.145
CDS	USD 156.981	Fund receives default protection on Philippine Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	116	(3.464)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Quest Diagnostics Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2024	2.641	(6.388)
CDS	USD 57.600	Fund receives default protection on Republic of South Africa Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(1.413)	2.046
CDS	USD 542.236	Fund receives default protection on Republic of South Africa Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(13.306)	19.257
CDS	USD 85.164	Fund receives default protection on Republic of South Africa Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(2.090)	3.024
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Southern Co/The and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.561	(3.392)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on United Parcel Service of America Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	277	(3.995)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on UnitedHealth Gp Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2024	1.991	(6.901)
CDS	EUR 30.000	Fund receives default protection on Volkswagen International Finance NV and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2026	(38)	(569)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on WestRock MWV LLC and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2024	3.646	(7.168)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on XLIT Ltd and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2025	1.925	(4.333)
CDS	USD 125.000	Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.BBB	Goldman Sachs	17/9/2058	1.581	(10.118)
CDS	EUR 30.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	Goldman Sachs	20/6/2025	(642)	2.520
CDS	EUR 260.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ArcelorMittal SA	Goldman Sachs	20/6/2026	(961)	46.591
CDS	EUR 10.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on International Game Technology PLC	Goldman Sachs	20/12/2025	170	1.174
CDS	USD 200.000	Fund receives default protection on CDN Natural Resources Ltd and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2025	(27.985)	(2.698)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on D R Horton Inc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2025	(16.454)	(6.469)
CDS	USD 225.000	Fund receives default protection on Indonesia Government International Bond and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2026	(1.059)	(2.156)
CDS	EUR 450.000	Fund receives default protection on Standard Chartered PLC and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2026	864	(10.720)
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Repsol International Finance BV	JP Morgan	20/6/2026	264	4.367
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Repsol International Finance BV	JP Morgan	20/6/2026	(387)	4.367
CDS	EUR 20.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	JP Morgan	20/6/2025	(317)	1.680
CDS	EUR 30.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice France SA/France	JP Morgan	20/6/2025	(358)	2.520
CDS	EUR 10.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on International Game Technology PLC	JP Morgan	20/6/2026	232	1.175
CDS	EUR 10.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Virgin Media Finance PLC	JP Morgan	20/12/2025	33	1.106
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Altria Group Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	2.765	(5.357)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Barclays PLC and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2026	24	(3.240)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Johnson & Johnson and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	1.642	(8.845)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on McDonald's Corp and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	1.504	(8.256)
CDS	USD 372.495	Fund receives default protection on Mexico Government International Bond and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2026	(2.990)	(915)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Pfizer Inc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2025	1.859	(7.967)
CDS	USD 125.000	Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.BBB	Morgan Stanley	17/9/2058	11.234	(10.118)
CDS	USD 77.000	Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.BBB	Morgan Stanley	17/9/2058	11.173	(6.233)
CDS	EUR 10.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG	Morgan Stanley	20/12/2025	(40)	1.339
IRS	EUR 2.610.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	16/4/2025	(1.653)	(1.619)
IRS	EUR 1.980.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	28/5/2025	48	73
IRS	EUR 1.980.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	28/5/2025	(136)	(111)
IRS	EUR 700.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	16/11/2026	1.299	1.309
IRS	GBP 1.540.000	Fund receives Fixed 0,019% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	12/2/2023	(2.904)	(2.890)
IRS	GBP 34.700.000	Fund receives Fixed 0,025% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	10/2/2023	(54.322)	(60.131)
IRS	GBP 120.000	Fund receives Fixed 0,047% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	22/2/2023	(143)	(165)
IRS	GBP 630.000	Fund receives Fixed 0,110% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2023	(198)	(216)
IRS	GBP 1.890.000	Fund receives Fixed 0,116% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	9/4/2023	(492)	(474)
IRS	GBP 1.460.000	Fund receives Fixed 0,118% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	7/5/2023	(539)	(525)
IRS	GBP 530.000	Fund receives Fixed 0,120% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2023	(24)	(31)
IRS	EUR 1.310.000	Fund receives Fixed -0,236% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	22/4/2025	(238)	(221)
IRS	EUR 1.310.000	Fund receives Fixed -0,266% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	29/4/2025	(672)	(655)
IRS	EUR 2.610.000	Fund receives Fixed -0,303% and pays Floating EUR 1 Month EONIA	Bank of America Merrill Lynch	9/4/2025	(2.100)	(2.102)
IRS	GBP 33.300.000	Fund receives Fixed 0,324% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2026	(181.734)	(259.153)
IRS	GBP 6.900.000	Fund receives Fixed 0,404% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2024	(415)	(349)
IRS	GBP 470.000	Fund receives Fixed 0,424% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2026	(495)	(944)
IRS	GBP 330.000	Fund receives Fixed 0,470% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2026	409	199
IRS	GBP 1.040.000	Fund receives Fixed 0,512% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2026	3.255	3.168
IRS	GBP 900.000	Fund receives Fixed 0,766% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2031	397	13
IRS	GBP 20.000	Fund receives Fixed 0,786% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	31/3/2031	47	47
IRS	GBP 1.870.000	Fund receives Fixed 0,800% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	7/12/2030	4.466	4.507
IRS	GBP 1.460.000	Fund receives Fixed 0,811% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	7/12/2030	5.099	5.131
IRS	GBP 520.000	Fund receives Fixed 0,858% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	12.807	(11.065)
IRS	GBP 520.000	Fund receives Fixed 0,925% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	4.408	(344)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
IRS	GBP 525.000	Fund receives Fixed 0,934% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	1.630	964
IRS	GBP 50.000	Fund receives Fixed 0,959% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	467	482
IRS	GBP 540.000	Fund receives Fixed 0,981% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2051	20.361	8.841
IRS	KRW 185.675.000	Fund receives Fixed 1,535% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(906)	(906)
IRS	KRW 158.635.000	Fund receives Fixed 1,547% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(705)	(705)
IRS	KRW 209.766.000	Fund receives Fixed 1,557% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(855)	(855)
IRS	KRW 158.635.000	Fund receives Fixed 1,560% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(630)	(630)
IRS	KRW 211.885.000	Fund receives Fixed 1,560% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(841)	(841)
IRS	KRW 326.200.000	Fund receives Fixed 1,560% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.295)	(1.295)
IRS	KRW 291.470.000	Fund receives Fixed 1,561% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.146)	(1.146)
IRS	KRW 332.160.000	Fund receives Fixed 1,566% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.246)	(1.246)
IRS	KRW 391.760.000	Fund receives Fixed 1,590% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(1.120)	(1.120)
IRS	KRW 292.160.000	Fund receives Fixed 1,591% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(830)	(830)
IRS	KRW 303.526.400	Fund receives Fixed 1,599% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(774)	(774)
IRS	EUR 900.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	11/5/2023	137	144
IRS	EUR 5.360.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2024	(346)	134
IRS	EUR 270.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2026	49	(184)
IRS	EUR 230.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	301	304
IRS	EUR 440.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(810)	(804)
IRS	EUR 280.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(800)	(796)
IRS	EUR 170.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(11)	(8)
IRS	EUR 75.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,025%	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2061	14.011	14.013
IRS	EUR 702.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,145%	Bank of America Merrill Lynch	22/10/2031	23.585	22.259
IRS	EUR 250.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,195%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(213)	(209)
IRS	EUR 239.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,234%	Bank of America Merrill Lynch	14/1/2031	7.902	7.907
IRS	EUR 190.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,259%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	456	458
IRS	EUR 990.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,261%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1.920	2.504
IRS	EUR 250.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,275%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	803	806
IRS	EUR 3.040.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,306%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2026	7.496	8.946
IRS	EUR 146.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,357%	Bank of America Merrill Lynch	21/1/2028	2.325	2.328
IRS	EUR 8.170.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,475%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	945	1.634

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
IRS	EUR 1.090.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,489%	Bank of America Merrill Lynch	23/4/2023	321	330
IRS	EUR 830.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,499%	Bank of America Merrill Lynch	20/4/2023	325	419
IRS	EUR 8.380.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,504%	Bank of America Merrill Lynch	8/4/2023	4.623	4.547
IRS	EUR 5.530.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,510%	Bank of America Merrill Lynch	31/3/2023	3.177	3.561
IRS	EUR 3.660.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,512%	Bank of America Merrill Lynch	14/4/2023	2.191	2.576
IRS	GBP 486.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed -0,043%	Bank of America Merrill Lynch	15/12/2025	11.608	11.615
IRS	GBP 23.210.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,059%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	42.851	45.507
IRS	GBP 582.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,092%	Bank of America Merrill Lynch	10/12/2026	15.982	15.078
IRS	GBP 160.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,094%	Bank of America Merrill Lynch	16/3/2023	84	91
IRS	GBP 1.040.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,162%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(422)	(435)
IRS	GBP 2.340.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,250%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2024	1.089	579
IRS	GBP 2.970.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,422%	Bank of America Merrill Lynch	10/2/2031	103.575	109.420
IRS	GBP 20.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,478%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2031	497	618
IRS	GBP 230.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,509%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(48)	(45)
IRS	GBP 130.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,538%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(236)	(234)
IRS	GBP 230.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,561%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(734)	(730)
IRS	GBP 310.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,640%	Bank of America Merrill Lynch	22/2/2031	3.764	4.104
IRS	GBP 14.410.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,664%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	50.250	180.027
IRS	GBP 710.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,712%	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2031	2.435	3.997
IRS	GBP 240.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,727%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	400	1.315
IRS	GBP 130.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,740%	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2031	107	439
IRS	GBP 260.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,744%	Bank of America Merrill Lynch	7/5/2031	742	748
IRS	GBP 520.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,745%	Bank of America Merrill Lynch	1/3/2031	3.228	944
IRS	GBP 410.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,763%	Bank of America Merrill Lynch	9/4/2031	142	151
IRS	GBP 360.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,764%	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2031	(108)	75
IRS	GBP 1.420.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,774%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(5.935)	192
IRS	GBP 1.425.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,801%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(539)	(4.117)
IRS	GBP 880.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,805%	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2031	(3.295)	(3.987)
IRS	GBP 1.430.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,819%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(19.050)	(6.966)
IRS	GBP 170.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,819%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(1.145)	(838)
IRS	GBP 430.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,828%	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2031	(2.555)	(2.573)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
IRS	GBP 340.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,933%	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2051	288	(548)
IRS	GBP 558.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIO and pays Fixed 0,347%	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(1.008)	(1.882)
IRS	GBP 416.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR SONIO and pays Fixed 0,168%	Bank of America Merrill Lynch	24/11/2026	8.661	8.597
IRS	USD 9.520.000	Fund receives Floating USD 12 Month FEDL and pays Fixed 0,628%	Bank of America Merrill Lynch	10/3/2024	(11.079)	(11.013)
IRS	KRW 1.733.851.280	Fund receives Fixed 1,418% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Barclays Bank Plc	21/9/2023	(1.492)	(1.492)
IRS	KRW 119.682.500	Fund receives Fixed 1,558% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Citibank	15/9/2026	(482)	(481)
IRS	KRW 323.145.000	Fund receives Fixed 1,575% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Citibank	15/9/2026	(1.106)	(1.106)
IRS	KRW 170.733.600	Fund receives Fixed 1,580% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Citibank	15/9/2026	(553)	(553)
IRS	KRW 1.769.236.000	Fund receives Fixed 1,415% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	HSBC	21/9/2023	(1.555)	(1.555)
IRS	KRW 107.715.000	Fund receives Fixed 1,566% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	JP Morgan	15/9/2026	(406)	(406)
IRS	KRW 222.267.500	Fund receives Fixed 1,568% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	JP Morgan	15/9/2026	(813)	(813)
IRS	KRW 211.885.000	Fund receives Fixed 1,572% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	JP Morgan	15/9/2026	(745)	(744)
IRS	KRW 351.670.000	Fund receives Fixed 1,576% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	JP Morgan	15/9/2026	(1.197)	(1.197)
IRS	KRW 1.496.065.961	Fund receives Fixed 1,400% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Morgan Stanley	21/9/2023	(1.479)	(1.479)
IRS	KRW 185.675.000	Fund receives Fixed 1,540% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Morgan Stanley	15/9/2026	(872)	(872)
IRS	KRW 69.922.000	Fund receives Fixed 1,545% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Morgan Stanley	15/9/2026	(316)	(316)
IRS	KRW 69.922.000	Fund receives Fixed 1,555% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Morgan Stanley	15/9/2026	(290)	(290)
IRS	KRW 321.580.000	Fund receives Fixed 1,556% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Morgan Stanley	15/9/2026	(1.323)	(1.323)
IRS	KRW 370.060.000	Fund receives Fixed 1,562% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Morgan Stanley	15/9/2026	(1.442)	(1.442)
IRS	KRW 378.360.000	Fund receives Fixed 1,587% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Morgan Stanley	15/9/2026	(1.130)	(1.130)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 448.710.816)					(98.120)	(1.648.773)

CCCDs: Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)
 CCILS: Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)
 CCIRS: Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)
 CDS: Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)
 IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(7)	USD	90 Day Euro Futures June 2022	Juin 2022	1.431.087	(645)
162	AUD	Australian 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	14.377.933	87.841
(77)	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures September 2021	Septembre 2021	7.528.043	(17.234)
39	EUR	Euro BOBL Futures June 2021	Juin 2021	5.252.520	(17.160)
(29)	EUR	Euro BOBL Futures June 2021	Juin 2021	3.905.720	9.930

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
40	EUR	Euro BTP Futures June 2021	June 2021	5.891.200	(35.520)
(11)	EUR	Euro BTP Futures June 2021	June 2021	1.620.080	(8.683)
(210)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	June 2021	35.660.100	80.106
(9)	EUR	Euro BUXL 30 Year Bond Futures June 2021	June 2021	1.809.360	45.510
(27)	EUR	EURO STOXX Bank Index Futures June 2021	June 2021	132.840	(225)
47	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	June 2021	7.535.040	(68.341)
(3)	EUR	Euro-OAT Futures June 2021	June 2021	480.960	(110)
(3)	EUR	Euro-OAT Futures September 2021	September 2021	474.480	350
(3)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	June 2021	3.395.844	(673)
206	EUR	Short Euro BTP Futures June 2021	June 2021	23.302.720	19.960
84	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	September 2021	12.410.940	(32.522)
(94)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	September 2021	13.888.432	(28.273)
(15)	USD	US Long Bond Futures September 2021	September 2021	1.920.476	8.717
4	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	September 2021	474.383	(867)
(165)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	September 2021	19.568.304	71.607
8	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	September 2021	864.060	(822)
(232)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	September 2021	25.057.753	40.014
9	USD	US Treasury 2 Year Note Futures September 2021	September 2021	1.627.776	288
(25)	USD	US Treasury 2 Year Note Futures September 2021	September 2021	4.521.600	(574)
(65)	USD	US Treasury 5 Year Note Futures September 2021	September 2021	6.593.986	(1.957)
5	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	September 2021	756.924	(2.118)
(14)	USD	US Ultra Bond Futures September 2021	September 2021	2.119.386	17.052
Total				202.601.947	165.651

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
64.000	Put	OTC EUR/PLN	Bank of America Merrill Lynch	EUR 4,52	02/06/2021	378	578
130.000	Call	OTC EUR/USD	Bank of America Merrill Lynch	EUR 1,22	15/06/2021	207	530
6.000	Call	OTC EUR/USD	Bank of America Merrill Lynch	EUR 1,24	16/07/2021	92	871
96.000	Put	OTC USD/IDR	Bank of America Merrill Lynch	USD 14.450,00	24/06/2021	536	1.206
86.000	Put	OTC USD/KRW	Bank of America Merrill Lynch	USD 1.110,00	21/07/2021	115	817
86.000	Call	OTC USD/KRW	Bank of America Merrill Lynch	USD 1.132,00	21/07/2021	(391)	287
118.000	Put	OTC USD/KRW	Bank of America Merrill Lynch	USD 1.130,00	17/06/2021	1.416	2.010
79.000	Call	OTC USD/MXN	Bank of America Merrill Lynch	USD 20,30	10/06/2021	(375)	187
78.000	Put	OTC USD/RUB	Bank of America Merrill Lynch	USD 73,75	16/07/2021	17	993
95.000	Put	OTC USD/BRL	Barclays Bank	USD 5,48	18/06/2021	2.261	4.033
76.000	Put	OTC USD/BRL	Barclays Bank	USD 5,48	21/06/2021	1.635	3.251
70.000	Call	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1,25	28/06/2021	(1.135)	5.326
1.590.000	Call	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1,23	18/06/2021	(649)	5.999
96.000	Call	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1,23	16/07/2021	(194)	661
154.000	Put	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 5,30	01/06/2021	1.673	2.067
153.600	Call	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1,22	24/06/2021	(68)	605
98.000	Put	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 14,00	08/07/2021	634	2.038
1.600.000	Put	OTC EUR/GBP	Citibank	EUR 0,85	11/06/2021	(13.992)	506
29.000	Call	OTC USD/TRY	Citibank	USD 9,00	29/06/2021	(216)	224
98.000	Put	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 5,18	08/07/2021	(396)	1.260
57.000	Call	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1,26	18/06/2021	(298)	5
97.000	Put	OTC USD/IDR	Deutsche Bank	USD 14.450,00	02/07/2021	478	1.265
57.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20,00	17/06/2021	(24)	581

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS ACHETÉES							
77.000	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20,20	25/06/2021	(587)	535
78.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19,85	17/06/2021	10	152
24	Put	90 Day Euro Futures	Exchange Traded	USD 99,62	10/09/2021	116	1.229
24	Put	90 Day Euro Futures	Exchange Traded	USD 99,50	10/09/2021	10.284	16.470
14	Put	90 Day Euro Futures	Exchange Traded	USD 99,50	10/09/2021	73	502
8	Put	Cellnex Telecom SA	Exchange Traded	EUR 32,82	18/06/2021	(679)	74
19	Call	Cellnex Telecom SA	Exchange Traded	EUR 59,28	17/12/2021	1.969	2.719
7	Put	Cellnex Telecom SA	Exchange Traded	EUR 42,32	18/06/2021	(626)	61
1	Call	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.300,00	18/06/2021	(545)	738
1	Put	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3.850,00	16/07/2021	(3.681)	1.745
1	Call	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.400,00	16/07/2021	(1.341)	758
2	Put	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.100,00	16/07/2021	(7.433)	8.574
1	Call	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.200,00	16/07/2021	(543)	6.660
1	Put	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.000,00	20/08/2021	(2.535)	5.449
6	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.700,00	18/06/2021	(1.731)	318
9	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4.300,00	17/09/2021	1.071	2.880
20	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4.200,00	20/08/2021	1.363	8.600
27	Call	EURO STOXX 600 Telecom	Exchange Traded	EUR 230,00	18/06/2021	2.177	5.603
54	Call	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 100,00	18/06/2021	1.657	4.118
36	Call	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 100,00	17/09/2021	4.822	8.820
7	Call	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 90,00	18/06/2021	2.079	3.089
734	Call	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 95,00	17/12/2021	31.530	317.455
25	Call	FTSE MIB	Exchange Traded	EUR 26.000,00	17/06/2022	12.656	67.656
5	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130,50	25/06/2021	(1.033)	640
4	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131,00	23/07/2021	(972)	1.690
11	Put	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 122,50	25/06/2021	(2.317)	246
1.580.000	Put	OTC EUR/GBP	Goldman Sachs	EUR 0,85	03/06/2021	(10.188)	19
8.000	Put	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 5,05	16/11/2021	2	854
5.000	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 19,50	18/06/2021	60	702
78.000	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 19,85	09/07/2021	(250)	746
69.000	Put	OTC USD/ZAR	UBS	USD 13,90	10/06/2021	178	805
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 9.005.753)						27.290	505.207

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS VENDUES							
(1.590.000)	Call	OTC EUR/USD	Bank of America Merrill Lynch	EUR 1,23	18/06/2021	(789)	(5.999)
(144.000)	Put	OTC USD/IDR	Bank of America Merrill Lynch	USD 14.150,00	24/06/2021	(99)	(375)
(78.000)	Call	OTC USD/KRW	Bank of America Merrill Lynch	USD 1.155,00	17/06/2021	195	(18)
(39.000)	Call	OTC USD/RUB	Bank of America Merrill Lynch	USD 75,50	18/06/2021	163	(91)
(118.000)	Put	OTC USD/RUB	Bank of America Merrill Lynch	USD 72,20	16/07/2021	52	(606)
(95.000)	Put	OTC USD/BRL	Barclays Bank	USD 5,24	18/06/2021	(620)	(1.259)
(38.000)	Call	OTC USD/BRL	Barclays Bank	USD 5,75	21/06/2021	515	(17)
(76.000)	Put	OTC USD/BRL	Barclays Bank	USD 5,24	21/06/2021	(455)	(1.056)
(70.000)	Put	OTC USD/MXN	Barclays Bank	USD 19,50	11/06/2021	247	(85)
(146.000)	Call	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1,25	16/07/2021	192	(323)
(153.600)	Call	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1,24	24/06/2021	40	(168)
(59.000)	Call	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 14,40	10/06/2021	389	(27)
(98.000)	Put	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13,50	08/07/2021	(168)	(571)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS VENDUES							
(1.600.000)	Put	OTC EUR/GBP	Citibank	EUR 0,83	11/06/2021	4.176	(2)
(35.000)	Call	OTC USD/TRY	Citibank	USD 9,50	29/06/2021	180	(116)
(59.000)	Call	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 5,45	10/06/2021	261	(54)
(98.000)	Put	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 4,99	08/07/2021	273	(328)
(86.000)	Call	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1,29	18/06/2021	128	(1)
(78.000)	Call	OTC USD/IDR	Deutsche Bank	USD 14.800,00	02/07/2021	293	(74)
(115.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20,85	25/06/2021	569	(260)
(24)	Put	90 Day Euro Futures	Exchange Traded	USD 99,37	10/09/2021	(7.841)	(11.799)
(24)	Put	90 Day Euro Futures	Exchange Traded	USD 99,75	10/09/2021	(600)	(2.827)
(1)	Put	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3.950,00	16/07/2021	4.456	(2.475)
(1)	Put	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.000,00	16/07/2021	4.930	(2.954)
(2)	Call	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.300,00	16/07/2021	2.822	(5.120)
(1)	Put	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3.750,00	20/08/2021	1.825	(2.847)
(1)	Put	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3.900,00	16/07/2021	997	(2.073)
(9)	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4.400,00	17/09/2021	(315)	(1.296)
(11)	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4.350,00	20/08/2021	(2)	(1.100)
(9)	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4.400,00	20/08/2021	87	(612)
(734)	Call	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 105,00	17/12/2021	(74.464)	(155.058)
(25)	Call	FTSE MIB	Exchange Traded	EUR 30.000,00	17/06/2022	(2.025)	(12.438)
(4)	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 129,00	23/07/2021	486	(435)
(5)	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130,00	25/06/2021	806	(352)
(2)	Call	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 133,50	23/07/2021	—	(307)
(4)	Put	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 123,00	25/06/2021	1.013	(256)
(39.000)	Call	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 5,50	02/06/2021	418	—
(98.000)	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 19,45	09/07/2021	224	(350)
(49.000)	Call	OTC USD/ZAR	UBS	USD 14,35	10/06/2021	275	(28)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 8.775.253)						(61.366)	(213.757)

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS ACHETÉES							
2.170.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,2% Fixed semi-annually from 28/4/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/8/2022	Bank of America Merrill Lynch	USD 0,01	28/04/2022	3.375	20.975
4.950.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,595% Fixed semi-annually from 24/2/2025; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 26/5/2025	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,59	24/02/2025	(690)	21.719
4.950.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 26/5/2025; and pays 1,595% Fixed semi-annually from 24/2/2025	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,59	24/02/2025	5.200	25.368
2.800.000	Put	Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 16/6/2021; and provides 1% Fixed quarterly from 20/6/2021	Barclays Bank	EUR 55,00	16/06/2021	(2.356)	780

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS ACHETÉES							
32.508.000	Put	Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 35 Version 1 from 16/6/2021; and provides 1% Fixed quarterly from 20/6/2021	Barclays Bank	EUR 0,55	16/06/2021	(38.892)	9.057
50.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,95% Fixed annually from 12/3/2024; and pays Floating Max USD 0 - 5 Year Constant Maturity Swap quarterly from 7/1/2020	Barclays Bank	USD 2,95	12/03/2024	1.817	3.816
50.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,95% Fixed semi-annually from 12/3/2024; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 21/11/2020	Barclays Bank	USD 2,95	12/03/2024	(1.105)	894
1.400.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 17/5/2022; and pays -0,15% Fixed annually from 15/11/2021	Barclays Bank	EUR 0,00	15/11/2021	(2.426)	5.844
130.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 2,25% Fixed quarterly from 8/8/2022	Barclays Bank	USD 2,25	08/08/2022	(961)	1.793
737.500	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 2,9775% Fixed quarterly from 7/3/2024	Barclays Bank	USD 2,98	07/03/2024	(17.413)	12.775
1.060.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 3,8% Fixed quarterly from 7/6/2021	Barclays Bank	USD 3,80	07/06/2021	(35.000)	—
322.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 4% Fixed quarterly from 9/8/2033	Barclays Bank	EUR 4,00	09/08/2033	(6.698)	4.411
737.500	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/2/2021; and pays 2,9775% Fixed semi-annually from 7/3/2024	Barclays Bank	USD 2,98	07/03/2024	27.277	57.466
270.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 1,492% Fixed quarterly from 25/2/2025	Citibank	USD 1,49	25/02/2025	(8.016)	5.071
270.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 27/5/2027; and pays 1,492% Fixed semi-annually from 25/2/2025	Citibank	USD 1,49	25/02/2025	7.744	20.831
83.580.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,25% Fixed semi-annually from 11/1/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/11/2022	Credit Suisse	JPY 1,25	11/01/2022	(9.694)	19

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS ACHETÉES							
150.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,89% Fixed annually from 30/4/2025; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 29/1/2021	Deutsche Bank	USD 0,89	30/04/2025	9.525	16.977
150.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,89% Fixed quarterly from 30/4/2025; and pays Floating Markit iTraxx quarterly from 20/12/2019	Deutsche Bank	USD 0,89	30/04/2025	(5.977)	1.475
4.460.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,71% Fixed semi-annually from 4/3/2025; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 6/6/2025	Deutsche Bank	USD 1,71	04/03/2025	1.957	21.965
390.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,602% Fixed semi-annually from 7/4/2026; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 9/7/2022	Deutsche Bank	USD 0,03	07/04/2026	3.160	21.653
1.170.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/9/2028; and pays 3,05% Fixed semi-annually from 27/6/2028	Deutsche Bank	USD 0,00	27/06/2028	(24.648)	983.322
4.460.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 6/6/2025; and pays 1,71% Fixed semi-annually from 4/3/2025	Deutsche Bank	USD 1,71	04/03/2025	1.452	21.460
390.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 9/7/2022; and pays 2,602% Fixed semi-annually from 7/4/2026	Deutsche Bank	USD 0,03	07/04/2026	(3.056)	15.437
140.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,2825% Fixed semi-annually from 4/6/2025; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 6/9/2025	Goldman Sachs	USD 1,28	04/06/2025	(4.560)	2.158
1.280.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,25% Fixed annually from 3/5/2022; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 29/12/2021	Goldman Sachs	USD 3,25	03/05/2022	(57.594)	4.546
140.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 6/9/2025; and pays 1,2825% Fixed semi-annually from 4/6/2025	Goldman Sachs	USD 1,28	04/06/2025	5.975	12.693
765.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,525% Fixed semi-annually from 5/4/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/7/2022	JP Morgan	USD 0,02	05/04/2022	4.795	14.244
35.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,86% Fixed semi-annually from 22/2/2039; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/9/2020	JP Morgan	USD 2,86	22/02/2039	1.035	2.562

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS ACHETÉES							
26.750.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 1,6% Fixed quarterly from 16/3/2022	JP Morgan	JPY 1,60	16/03/2022	(2.757)	1
680.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 2,25% Fixed quarterly from 2/8/2022	JP Morgan	USD 2,25	02/08/2022	(7.319)	9.217
200.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 2,985% Fixed quarterly from 27/4/2038	JP Morgan	USD 2,98	27/04/2038	(772)	6.919
200.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 2,985% Fixed quarterly from 27/4/2038	JP Morgan	USD 2,98	27/04/2038	7.820	15.510
35.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 12/9/2020; and pays 2,86% Fixed semi-annually from 22/2/2039	JP Morgan	USD 2,86	22/02/2039	(249)	1.278
765.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/7/2022; and pays 1,525% Fixed semi-annually from 5/4/2022	JP Morgan	USD 0,02	05/04/2022	(5.047)	4.402
40.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,1806% Fixed semi-annually from 15/9/2025; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/12/2025	Morgan Stanley	USD 1,18	15/09/2025	(1.253)	573
1.520.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,385% Fixed semi-annually from 8/4/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 12/7/2022	Morgan Stanley	USD 0,01	08/04/2022	2.872	21.930
4.960.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,62% Fixed semi-annually from 24/2/2025; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 26/5/2025	Morgan Stanley	USD 1,62	24/02/2025	(370)	22.355
720.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 2,5% Fixed quarterly from 13/6/2024	Morgan Stanley	USD 2,50	13/06/2024	(7.136)	21.575
130.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 2,5% Fixed quarterly from 20/6/2024	Morgan Stanley	USD 2,50	20/06/2024	(735)	3.918
30.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 3,0366% Fixed quarterly from 11/1/2029	Morgan Stanley	USD 3,04	11/01/2029	(424)	1.065
1.520.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 12/7/2022; and pays 1,385% Fixed semi-annually from 8/4/2022	Morgan Stanley	USD 0,01	08/04/2022	(7.259)	11.271

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS ACHETÉES							
130.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/12/2025; and pays 1,1784% Fixed semi-annually from 15/9/2025	Morgan Stanley	USD 1,18	15/09/2025	(4.066)	1.857
130.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/12/2025; and pays 1,1784% Fixed semi-annually from 15/9/2025	Morgan Stanley	USD 1,18	15/09/2025	6.685	12.790
40.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/12/2025; and pays 1,1806% Fixed semi-annually from 15/9/2025	Morgan Stanley	USD 1,18	15/09/2025	2.055	3.930
4.960.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 26/5/2025; and pays 1,62% Fixed semi-annually from 24/2/2025	Morgan Stanley	USD 1,62	24/02/2025	2.369	25.021
30.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 8/10/2020; and pays 3,0366% Fixed semi-annually from 11/1/2029	Morgan Stanley	USD 3,04	11/01/2029	785	2.274
330.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,04% Fixed semi-annually from 10/1/2029; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/11/2022	Nomura International	USD 3,04	10/01/2029	(4.597)	11.688
330.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,04% Fixed semi-annually from 10/1/2029; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/2/2025	Nomura International	USD 3,04	10/01/2029	8.784	25.068
1.150.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 24/9/2024; and pays 2,85% Fixed semi-annually from 9/5/2022	Nomura International	USD 2,85	09/05/2022	(45.959)	13.660
30.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,429% Fixed semi-annually from 5/6/2025; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 9/12/2025	UBS	USD 1,43	05/06/2025	1.057	2.481
30.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,429% Fixed semi-annually from 5/6/2025; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 9/9/2025	UBS	USD 1,43	05/06/2025	(882)	541
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 32.852.745)						(202.172)	1.528.635

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(3.200.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,25% Fixed semi-annually from 3/5/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 12/11/2020	Goldman Sachs	USD 3,25	03/05/2022	59.224	(2.134)
(2.240.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 3,87% Fixed quarterly from 7/6/2021	Barclays Bank	USD 3,87	07/06/2021	37.142	—
(320.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 21/11/2020; and pays 3,05% Fixed semi-annually from 12/3/2029	Barclays Bank	USD 3,05	12/03/2029	3.739	(11.321)
(320.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 3,05% Fixed quarterly from 12/3/2029	Barclays Bank	USD 3,05	12/03/2029	(9.403)	(24.463)
(2.510.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,75% Fixed semi-annually from 9/5/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 8/10/2020	Nomura International	USD 2,75	09/05/2022	53.658	(11.255)
(9.790.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/11/2020; and pays 2,4% Fixed semi-annually from 1/6/2021	Morgan Stanley	USD 2,40	01/06/2021	15.902	—
(720.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 3,5% Fixed quarterly from 13/6/2024	Morgan Stanley	USD 3,50	13/06/2024	1.904	(8.784)
(720.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed semi-annually from 13/6/2024; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/11/2022	Morgan Stanley	USD 3,00	13/06/2024	3.839	(13.697)
(130.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 20/6/2024; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 11/9/2020	Morgan Stanley	USD 3,00	20/06/2024	320	(2.491)
(130.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 3,5% Fixed quarterly from 20/6/2024	Morgan Stanley	USD 3,50	20/06/2024	87	(1.600)
(630.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 0% Fixed quarterly from 1/7/2021	Barclays Bank	EUR 0,00	01/07/2021	1.153	—
(680.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,25% Fixed semi-annually from 2/8/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/9/2020	JP Morgan	USD 3,25	02/08/2022	1.804	(2.208)
(680.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,75% Fixed semi-annually from 2/8/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/11/2020	JP Morgan	USD 2,75	02/08/2022	3.986	(4.405)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(130.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 2,75% Fixed quarterly from 8/8/2022	Barclays Bank	USD 2,75	08/08/2022	540	(861)
(130.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 3,25% Fixed quarterly from 8/8/2022	Barclays Bank	USD 3,25	08/08/2022	258	(434)
(400.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,25% Fixed semi-annually from 20/8/2024; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 11/11/2020	Morgan Stanley	USD 2,25	20/08/2024	(5.025)	(15.725)
(810.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,1% Fixed semi-annually from 6/1/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 14/10/2020	Barclays Bank	USD 2,10	06/01/2022	10.565	(6.047)
(530.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,15% Fixed annually from 10/1/2022; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 15/3/2023	Bank of America Merrill Lynch	USD 2,15	10/01/2022	7.479	(3.634)
(540.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 1,6% Fixed quarterly from 28/2/2022	Deutsche Bank	USD 1,60	28/02/2022	(4.750)	(13.605)
(100.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,6% Fixed annually from 4/3/2022; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 21/1/2022	Deutsche Bank	USD 1,60	04/03/2022	(1.039)	(2.551)
(230.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 0,74% Fixed quarterly from 2/5/2022	Deutsche Bank	USD 0,74	02/05/2022	6.915	(413)
(230.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating Markit iTraxx quarterly from 20/6/2019; and pays 0,74% Fixed quarterly from 2/5/2022	Deutsche Bank	USD 0,74	02/05/2022	(11.585)	(18.913)
(1.170.000)	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/9/2028; and pays 3,05% Fixed semi-annually from 27/6/2028	Deutsche Bank	USD 0,00	27/06/2028	49.441	(958.702)
(1.250.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed semi-annually from 1/6/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/9/2021	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,00	01/06/2021	(38.467)	(55.405)
(600.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,746% Fixed semi-annually from 2/6/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/9/2021	Deutsche Bank	USD 0,75	02/06/2021	(25.080)	(38.523)
(600.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/9/2021; and pays 0,746% Fixed semi-annually from 2/6/2021	Deutsche Bank	USD 0,75	02/06/2021	13.443	—

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(305.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,742% Fixed semi-annually from 25/6/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/9/2021	Bank of America Merrill Lynch	USD 0,74	25/06/2021	(12.886)	(20.037)
(305.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/9/2021; and pays 0,742% Fixed semi-annually from 25/6/2021	Bank of America Merrill Lynch	USD 0,74	25/06/2021	7.151	—
(15.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 1/10/2021; and pays 0,715% Fixed semi-annually from 29/6/2021	BNP Paribas	USD 0,71	29/06/2021	348	—
(15.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,715% Fixed semi-annually from 29/6/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 1/10/2021	BNP Paribas	USD 0,71	29/06/2021	(670)	(1.019)
(140.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,15% Fixed semi-annually from 10/1/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA semi-annually from 12/4/2022	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,15	10/01/2022	(4.723)	(6.589)
(240.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,95% Fixed semi-annually from 5/8/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 9/11/2021	Deutsche Bank	USD 0,95	05/08/2021	(10.052)	(12.393)
(120.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 9/11/2021; and pays 0,75% Fixed semi-annually from 5/8/2021	Bank of America Merrill Lynch	USD 0,75	05/08/2021	1.998	(10)
(780.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,6% Fixed semi-annually from 3/9/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/12/2021	Deutsche Bank	USD 0,60	03/09/2021	(9.086)	(12.444)
(2.470.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0,4664% Fixed annually from 14/9/2021; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 16/3/2022	Barclays Bank	EUR 0,47	14/09/2021	2.037	(2.343)
(380.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,7761% Fixed semi-annually from 14/9/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/12/2021	Barclays Bank	USD 0,78	14/09/2021	(17.129)	(25.503)
(35.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,8938% Fixed semi-annually from 14/9/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/12/2022	Morgan Stanley	USD 0,89	14/09/2022	(1.680)	(2.755)
(35.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/12/2022; and pays 0,8938% Fixed semi-annually from 14/9/2022	Morgan Stanley	USD 0,89	14/09/2022	877	(136)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(255.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,064% Fixed semi-annually from 11/10/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 13/1/2023	Deutsche Bank	USD 1,06	11/10/2022	(10.258)	(17.561)
(255.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 13/1/2023; and pays 1,064% Fixed semi-annually from 11/10/2022	Deutsche Bank	USD 1,06	11/10/2022	5.806	(1.486)
(255.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,2325% Fixed semi-annually from 16/12/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/3/2023	Goldman Sachs	USD 1,23	16/12/2022	(8.973)	(15.812)
(255.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,245% Fixed semi-annually from 16/12/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/3/2023	Goldman Sachs	USD 1,24	16/12/2022	(8.783)	(15.622)
(255.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/3/2023; and pays 1,2325% Fixed semi-annually from 16/12/2022	Goldman Sachs	USD 1,23	16/12/2022	4.599	(2.240)
(255.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/3/2023; and pays 1,245% Fixed semi-annually from 16/12/2022	Goldman Sachs	USD 1,24	16/12/2022	4.546	(2.293)
(280.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/4/2023; and pays 1,254% Fixed semi-annually from 30/12/2022	Citibank	USD 1,25	30/12/2022	4.932	(2.594)
(280.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,254% Fixed semi-annually from 30/12/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/4/2023	Citibank	USD 1,25	30/12/2022	(9.683)	(17.210)
(540.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,438% Fixed semi-annually from 9/1/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 11/4/2023	Barclays Bank	USD 1,44	09/01/2023	(13.468)	(27.829)
(540.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 11/4/2023; and pays 1,438% Fixed semi-annually from 9/1/2023	Barclays Bank	USD 1,44	09/01/2023	7.338	(7.023)
(380.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,2475% Fixed semi-annually from 27/1/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 30/4/2022	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,25	27/01/2022	(8.538)	(15.943)
(380.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 30/4/2022; and pays 1,2475% Fixed semi-annually from 27/1/2022	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,25	27/01/2022	5.435	(1.970)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(410.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,5% Fixed semi-annually from 27/1/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 30/4/2022	Deutsche Bank	USD 1,50	27/01/2022	(6.726)	(11.379)
(410.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 30/4/2022; and pays 1% Fixed semi-annually from 27/1/2022	Deutsche Bank	USD 1,00	27/01/2022	3.637	(1.015)
(370.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,62% Fixed semi-annually from 18/2/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 22/5/2022	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,62	18/02/2022	(647)	(8.768)
(370.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 22/5/2022; and pays 1,62% Fixed semi-annually from 18/2/2022	Bank of America Merrill Lynch	USD 1,62	18/02/2022	2.710	(5.412)
(3.260.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/5/2022; and pays 0,405% Fixed semi-annually from 23/2/2022	Goldman Sachs	USD 0,41	23/02/2022	1.652	(4.912)
(3.780.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/6/2022; and pays 0,508% Fixed semi-annually from 1/3/2022	Deutsche Bank	USD 0,51	01/03/2022	434	(9.415)
(3.780.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,508% Fixed semi-annually from 1/3/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/6/2022	Deutsche Bank	USD 0,51	01/03/2022	3.113	(6.735)
(580.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/6/2023; and pays 2,01% Fixed semi-annually from 1/3/2023	Bank of America Merrill Lynch	USD 2,01	01/03/2023	(27)	(18.377)
(580.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,01% Fixed semi-annually from 1/3/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/6/2023	Bank of America Merrill Lynch	USD 2,01	01/03/2023	1.549	(16.801)
(5.610.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/6/2022; and pays 0,485% Fixed semi-annually from 2/3/2022	JP Morgan	USD 0,48	02/03/2022	810	(12.583)
(5.610.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,485% Fixed semi-annually from 2/3/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/6/2022	JP Morgan	USD 0,49	02/03/2022	2.576	(10.817)
(1.930.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/6/2022; and pays 0,518% Fixed semi-annually from 3/3/2022	Citibank	USD 0,52	03/03/2022	(293)	(4.956)
(1.930.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,518% Fixed semi-annually from 3/3/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/6/2022	Citibank	USD 0,52	03/03/2022	1.249	(3.413)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés							
SWAPTIONS VENDUES							
(1.930.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 23/6/2022; and pays 0,562% Fixed semi-annually from 21/3/2022	Deutsche Bank	USD 0,56	21/03/2022	(345)	(5.804)
(1.930.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,562% Fixed semi-annually from 21/3/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 23/6/2022	Deutsche Bank	USD 0,56	21/03/2022	2.010	(3.450)
(3.750.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/6/2022; and pays 0,568% Fixed semi-annually from 23/3/2022	Deutsche Bank	USD 0,57	23/03/2022	(1.232)	(11.498)
(3.750.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,568% Fixed semi-annually from 23/3/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/6/2022	Deutsche Bank	USD 0,57	23/03/2022	3.568	(6.698)
(3.260.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,75% Fixed semi-annually from 25/2/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 1/6/2022	Deutsche Bank	USD 0,01	25/02/2022	3.716	(2.820)
(4.280.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 12/4/2022; and pays 0,508% Fixed semi-annually from 10/1/2022	Morgan Stanley	USD 0,01	10/01/2022	(924)	(11.595)
(4.280.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,508% Fixed semi-annually from 10/1/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 12/4/2022	Morgan Stanley	USD 0,01	10/01/2022	5.329	(4.783)
(340.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,775% Fixed semi-annually from 14/10/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 18/1/2022	Goldman Sachs	USD 0,02	14/10/2021	2.832	(3.260)
(340.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 18/1/2022; and pays 1,775% Fixed semi-annually from 14/10/2021	Goldman Sachs	USD 0,02	14/10/2021	(308)	(6.400)
(3.250.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/8/2022; and pays 0,9% Fixed semi-annually from 28/4/2022	Bank of America Merrill Lynch	USD 0,01	28/04/2022	(2.129)	(14.155)
(700.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,7% Fixed annually from 15/5/2023; and pays Floating EUR Interbank Offer Rate 6 Month semi-annually from 17/11/2023	Barclays Bank	EUR 0,01	15/05/2023	2.560	(12.951)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 30.279.929)						130.302	(1.605.980)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	30.000	CAD	28.525	JP Morgan	16/6/2021	(320)
AUD	460.000	EUR	297.121	Royal Bank of Canada	16/6/2021	(5.460)
AUD	60.000	NZD	65.198	JP Morgan	16/6/2021	(777)
BRL	257.568	USD	49.000	Barclays Bank	2/6/2021	318
BRL	213.300	USD	40.798	Citibank	2/6/2021	84
BRL	349.835	USD	66.914	Deutsche Bank	2/6/2021	136
BRL	203.412	USD	37.600	Goldman Sachs	2/6/2021	1.151
BRL	715.553	USD	135.528	Morgan Stanley	2/6/2021	1.377
BRL	158.489	USD	30.000	Citibank	4/6/2021	316
BRL	80.000	USD	14.200	Barclays Bank	16/6/2021	918
CAD	28.002	AUD	30.000	Citibank	16/6/2021	(35)
CLP	21.320.800	USD	29.000	Citibank	16/6/2021	456
CNH	3.060.000	USD	466.876	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	10.740
CNH	600.000	USD	92.067	Barclays Bank	16/6/2021	1.678
CNH	2.425.000	USD	369.221	BNP Paribas	16/6/2021	9.144
CNH	1.855.000	USD	285.043	Citibank	16/6/2021	4.858
CNH	1.265.000	USD	194.046	Goldman Sachs	16/6/2021	3.589
CNH	3.135.000	USD	481.515	HSBC	16/6/2021	8.386
CNH	250.000	USD	38.617	Natwest Markets	16/6/2021	490
EUR	1.556.958	AUD	2.400.000	Natwest Markets	16/6/2021	35.249
EUR	83.969	AUD	130.000	Royal Bank of Canada	16/6/2021	1.543
EUR	129.413	AUD	200.000	Westpac	16/6/2021	2.604
EUR	33.170	CAD	50.000	Royal Bank of Canada	16/6/2021	(732)
EUR	267.915	CAD	400.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(3.297)
EUR	46.897	GBP	40.725	Barclays Bank	16/6/2021	(377)
EUR	820.000	GBP	709.078	BNP Paribas	16/6/2021	(3.096)
EUR	322.069	GBP	276.147	Citibank	16/6/2021	1.517
EUR	480.000	GBP	415.701	Deutsche Bank	16/6/2021	(2.544)
EUR	708.706	GBP	610.725	JP Morgan	16/6/2021	(222)
EUR	253.160	GBP	220.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(2.215)
EUR	926.083	GBP	800.000	Royal Bank of Canada	16/6/2021	(2.555)
EUR	320.000	GBP	277.139	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(1.702)
EUR	36.152.868	GBP	31.000.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	168.127
EUR	1.152.605	GBP	1.000.000	The Bank of New York Mellon	16/6/2021	(8.193)
EUR	99.473	HKD	920.000	Barclays Bank	16/6/2021	2.363
EUR	53.863	HKD	500.000	Royal Bank of Canada	16/6/2021	1.086
EUR	323.035	JPY	42.061.000	Natwest Markets	16/6/2021	8.740
EUR	77.236	JPY	10.000.000	Royal Bank of Canada	16/6/2021	2.512
EUR	8.740	JPY	1.131.000	UBS	16/6/2021	289
EUR	20.000	MXN	498.044	Citibank	16/6/2021	(465)
EUR	40.130	MXN	1.000.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(960)
EUR	24.000	PLN	109.419	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(394)
EUR	22.056	PLN	100.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(239)
EUR	196.899	SEK	2.000.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(709)
EUR	34.253	SGD	55.000	Barclays Bank	16/6/2021	167
EUR	913.586	USD	1.103.283	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	9.796
EUR	31.772	USD	38.000	Bank of New York	16/6/2021	643
EUR	16.450.088	USD	19.605.213	Barclays Bank	16/6/2021	389.828
EUR	1.027.677	USD	1.236.669	BNP Paribas	16/6/2021	14.619

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	19.174.815	USD	23.201.263	Citibank	16/6/2021	168.731
EUR	1.098.129	USD	1.317.695	Goldman Sachs	16/6/2021	18.695
EUR	1.668.574	USD	2.040.000	HSBC	16/6/2021	(2.560)
EUR	3.556.629	USD	4.243.499	JP Morgan	16/6/2021	80.427
EUR	537.731	USD	644.316	Morgan Stanley	16/6/2021	9.918
EUR	3.436.899	USD	4.107.814	Natwest Markets	16/6/2021	71.847
EUR	32.573	USD	38.919	Royal Bank of Canada	16/6/2021	692
EUR	79.514	USD	95.559	Standard Chartered Bank	16/6/2021	1.233
EUR	621.037	USD	752.087	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	4.940
EUR	56.937	USD	68.287	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	998
EUR	995.940	USD	1.216.963	UBS	16/6/2021	(976)
EUR	18.291.253	USD	21.838.000	Westpac	16/6/2021	401.929
EUR	14.665	ZAR	270.000	Societe Generale	17/6/2021	(1.388)
GBP	26.558	EUR	30.503	Barclays Bank	16/6/2021	325
GBP	1.449.652	EUR	1.680.000	BNP Paribas	16/6/2021	2.752
GBP	182.401	EUR	209.497	Deutsche Bank	16/6/2021	2.234
GBP	1.000	EUR	1.158	Natwest Markets	16/6/2021	2
GBP	698.639	EUR	808.979	Standard Chartered Bank	16/6/2021	2.000
GBP	4.100.000	EUR	4.775.334	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(16.062)
GBP	830.000	USD	1.159.233	HSBC	16/6/2021	13.839
GBP	140.000	USD	192.431	Morgan Stanley	16/6/2021	4.875
IDR	4.771.210.000	USD	327.019	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	6.104
IDR	761.200.000	USD	52.002	Barclays Bank	16/6/2021	1.114
IDR	4.776.285.000	USD	328.263	BNP Paribas	16/6/2021	5.377
IDR	841.305.000	USD	57.545	Deutsche Bank	16/6/2021	1.173
IDR	840.420.000	USD	58.000	JP Morgan	16/6/2021	750
IDR	561.070.000	USD	38.000	Morgan Stanley	1/7/2021	1.038
INR	3.546.720	USD	48.000	JP Morgan	9/6/2021	682
INR	38.456.700	USD	511.076	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	14.582
INR	19.943.300	USD	265.457	Goldman Sachs	16/6/2021	7.219
JPY	4.152.271	USD	38.000	Natwest Markets	16/6/2021	(102)
JPY	4.257.415	USD	39.000	Barclays Bank	21/6/2021	(134)
KRW	266.265.000	USD	235.637	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	3.780
KRW	116.295.000	USD	103.116	Barclays Bank	16/6/2021	1.489
KRW	45.000.000	USD	40.083	BNP Paribas	16/6/2021	426
KRW	32.316.440	USD	29.000	Citibank	16/6/2021	130
KRW	45.000.000	USD	40.118	Goldman Sachs	16/6/2021	398
KRW	197.440.000	USD	176.078	HSBC	16/6/2021	1.697
KRW	21.392.480	USD	19.000	JP Morgan	16/6/2021	248
KZT	8.442.512	USD	19.240	Deutsche Bank	15/7/2021	269
MXN	512.682	EUR	20.000	Barclays Bank	16/6/2021	1.066
MXN	1.178.391	USD	59.000	Citibank	16/6/2021	89
MXN	616.132	USD	30.289	Goldman Sachs	16/6/2021	505
MXN	599.450	USD	30.145	HSBC	16/6/2021	(63)
MYR	480.000	USD	117.173	Barclays Bank	16/6/2021	(672)
MYR	320.000	USD	78.106	Morgan Stanley	16/6/2021	(441)
NOK	400.000	USD	47.788	Citibank	16/6/2021	118
NOK	8.200.000	USD	981.147	Goldman Sachs	16/6/2021	1.197
NOK	2.200.000	USD	264.254	JP Morgan	16/6/2021	(512)
NOK	540.000	USD	65.260	Morgan Stanley	16/6/2021	(452)
NOK	260.000	USD	31.289	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	(109)
NOK	1.700.000	USD	204.624	UBS	16/6/2021	(748)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
NZD	32.703	AUD	30.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	450
NZD	32.713	AUD	30.000	JP Morgan	16/6/2021	456
PLN	109.434	EUR	24.000	Citibank	16/6/2021	397
RUB	2.730.000	USD	36.717	Goldman Sachs	16/6/2021	361
SEK	90.000	EUR	8.866	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	27
SEK	200.000	USD	23.941	Barclays Bank	16/6/2021	148
SEK	1.600.000	USD	191.960	JP Morgan	16/6/2021	835
SEK	100.000	USD	11.986	Morgan Stanley	16/6/2021	61
TWD	1.586.200	USD	56.000	Citibank	7/6/2021	1.276
TWD	3.570.000	USD	128.371	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	1.137
TWD	3.465.000	USD	124.604	Barclays Bank	16/6/2021	1.097
TWD	3.465.000	USD	124.595	BNP Paribas	16/6/2021	1.104
USD	49.266	BRL	257.569	Barclays Bank	2/6/2021	(100)
USD	40.000	BRL	213.300	Citibank	2/6/2021	(738)
USD	65.500	BRL	349.835	Deutsche Bank	2/6/2021	(1.295)
USD	38.907	BRL	203.412	Goldman Sachs	2/6/2021	(79)
USD	136.238	BRL	715.553	Morgan Stanley	2/6/2021	(793)
USD	30.000	BRL	159.182	Citibank	4/6/2021	(425)
USD	59.000	BRL	312.676	Citibank	2/7/2021	(648)
USD	29.000	CLP	20.447.030	Morgan Stanley	16/6/2021	536
USD	1.128.074	CNH	7.404.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(27.286)
USD	1.126.695	CNH	7.400.000	BNP Paribas	16/6/2021	(27.901)
USD	55.263	CNH	360.000	Citibank	16/6/2021	(988)
USD	3.668.844	CNH	23.626.256	Goldman Sachs	16/6/2021	(30.425)
USD	926.010	CNH	6.005.820	HSBC	24/8/2021	(9.856)
USD	37.683	CNH	244.000	Morgan Stanley	24/8/2021	(350)
USD	29.000	COP	106.972.300	Deutsche Bank	16/6/2021	144
USD	1.205.770	EUR	1.009.782	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(22.036)
USD	850.090	EUR	704.594	Barclays Bank	16/6/2021	(8.214)
USD	1.710.209	EUR	1.420.415	BNP Paribas	16/6/2021	(19.443)
USD	1.339.291	EUR	1.107.503	Citibank	16/6/2021	(10.379)
USD	1.595.842	EUR	1.320.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(12.715)
USD	140.744	EUR	119.308	HSBC	16/6/2021	(4.012)
USD	174.306	EUR	144.000	JP Morgan	16/6/2021	(1.212)
USD	2.397.301	EUR	1.990.894	Morgan Stanley	16/6/2021	(27.065)
USD	138.869	EUR	115.000	Royal Bank of Canada	16/6/2021	(1.240)
USD	4.022.000	EUR	3.376.545	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(81.790)
USD	36.761	EUR	30.000	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	114
USD	2.000.000	EUR	1.641.230	UBS	16/6/2021	(2.864)
USD	706.642	GBP	510.000	Barclays Bank	16/6/2021	(13.137)
USD	643.140	GBP	460.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(7.118)
USD	694.119	IDR	9.887.000.597	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	837
USD	46.082	IDR	673.125.000	BNP Paribas	16/6/2021	(905)
USD	34.538	IDR	504.842.758	Goldman Sachs	16/6/2021	(698)
USD	38.000	IDR	560.500.000	Morgan Stanley	1/7/2021	(1.005)
USD	51.011	IDR	739.713.296	Standard Chartered Bank	24/8/2021	(356)
USD	48.000	INR	3.557.760	JP Morgan	9/6/2021	(807)
USD	132.153	INR	9.700.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(1.021)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	268.504	INR	19.700.000	Barclays Bank	16/6/2021	(1.983)
USD	38.000	JPY	4.149.265	HSBC	16/6/2021	124
USD	29.000	JPY	3.175.562	JP Morgan	16/6/2021	27
USD	39.000	JPY	4.258.738	HSBC	21/6/2021	124
USD	67.000	KRW	75.101.300	Citibank	16/6/2021	(626)
USD	30.000	MXN	600.976	Citibank	16/6/2021	(119)
USD	30.000	MXN	604.050	HSBC	16/6/2021	(245)
USD	12.178	MXN	242.472	JP Morgan	16/6/2021	12
USD	20.000	MXN	398.857	Morgan Stanley	16/6/2021	(6)
USD	2.336	MXN	47.000	UBS	16/6/2021	(18)
USD	21.206	NOK	175.000	Barclays Bank	16/6/2021	193
USD	218.881	NOK	1.790.000	JP Morgan	16/6/2021	3.592
USD	615.585	SEK	5.200.000	Citibank	16/6/2021	(9.502)
USD	404.765	SEK	3.400.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(4.356)
USD	268.546	SEK	2.250.000	JP Morgan	16/6/2021	(2.319)
USD	68.571	SEK	570.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(146)
USD	33.804	SEK	280.000	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	27
USD	193.150	SEK	1.600.000	UBS	16/6/2021	139
USD	19.000	TRY	164.255	JP Morgan	30/7/2021	224
USD	56.000	TWD	1.567.440	BNP Paribas	7/6/2021	(718)
USD	305.890	TWD	8.535.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(3.550)
USD	134.468	TWD	3.730.000	BNP Paribas	16/6/2021	(907)
USD	135.008	TWD	3.735.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(613)
USD	56.000	ZAR	800.601	BNP Paribas	17/6/2021	(1.727)
USD	20.000	ZAR	276.159	Deutsche Bank	17/6/2021	(36)
USD	47.002	ZAR	660.531	Citibank	24/8/2021	(419)
USD	199.814	ZAR	2.782.715	JP Morgan	24/8/2021	(293)
						1.128.059
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	156	EUR	142	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
EUR	1	CHF	1	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	6.297	GBP	5.477	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(61)
GBP	2.530.546	EUR	2.914.620	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	22.885
						22.824
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
EUR	2.812	SEK	28.464	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1)
SEK	25.235.296	EUR	2.487.055	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	6.316
						6.315
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	6.203	USD	7.533	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	32
USD	538.924	EUR	445.432	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(3.946)
						(3.914)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 173.599.338)						1.153.284

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)			
United States			
	Fannie Mae or Freddie Mac		
USD(7.602.000)	3,000 TBA	(6.505.032)	(4,08)
	Fannie Mae or Freddie Mac		
USD11.734.008	2,500 TBA	9.954.414	6,24
	Fannie Mae or Freddie Mac		
USD(6.120.000)	2,000 TBA	(5.055.295)	(3,17)
USD3.702.000	Ginnie Mae 3,000 TBA	3.165.195	1,99
USD3.300.000	Ginnie Mae 3,000 TBA	2.820.641	1,77
USD600.000	Ginnie Mae 3,000 TBA	512.383	0,32
USD450.800	Ginnie Mae 2,500 TBA	382.777	0,24
		<u>5.275.083</u>	<u>3,31</u>
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 28.395.736)		5.275.083	3,31

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	25,06
Titres hypothécaires	15,42
Gouvernement	9,73
Biens de consommation cyclique	5,93
Titres adossés à des actifs	5,89
Fonds négociés en bourse	5,74
Biens de consommation non cyclique	5,58
Communications	3,86
Énergie	3,26
Services aux collectivités	3,13
Valeurs industrielles	2,22
Technologie	2,16
Matériaux de base	1,73
Portefeuille de titres à la valeur de marché	<u>89,71</u>
Autres éléments de l'actif net	<u>10,29</u>
	100,00

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché USD	% de l'actif net			Valeur de marché USD	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES ET ACTIONS PRIVILÉGIÉES							
Îles Caïmans							
5.400	Kuaishou Technology	135.191	0,19	4.030	Freshpet Inc	712.585	1,01
69.052	RMG Acquisition Corp II 'A'	685.686	0,97	1.001	Intuitive Surgical Inc	843.022	1,20
2.806	Sea Ltd ADR	710.591	1,01	16.303	Live Nation Entertainment Inc	1.469.063	2,08
344.000	Weimob Inc	788.079	1,12	7.500	Mastercard Inc 'A'	2.704.350	3,83
73.000	Wuxi Biologics Cayman Inc	1.140.941	1,62	14.891	Mondelez International Inc 'A'	946.025	1,34
142.400	XD Inc	1.154.091	1,63	9.673	Natera Inc	910.616	1,29
		4.614.579	6,54	21.414	Otis Worldwide Corp	1.677.359	2,38
				5.435	PayPal Holdings Inc	1.413.209	2,00
Danemark				32.426	Ruth's Hospitality Group Inc	782.764	1,11
4.090	Ascendis Pharma A/S ADR	549.614	0,78			21.765.327	30,85
		549.614	0,78	Total des actions ordinaires et actions privilégiées			
France				Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
6.428	L'Oreal SA	2.894.707	4,10			64.624.201	91,60
20.023	Sanofi	2.137.913	3,03	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
		5.032.620	7,13	ACTIONS ORDINAIRES			
Allemagne				Hong Kong			
18.621	Covestro AG	1.310.783	1,86	36.400	Kuaishou Technology Lockup*	894.761	1,27
13.959	Volkswagen AG (Pref)	3.899.443	5,53			894.761	1,27
		5.210.226	7,39	Corée du Sud			
Islande				3.036	SK IE Technology*	406.019	0,57
179.171	Marel HF	1.311.963	1,86			406.019	0,57
		1.311.963	1,86	Total des actions ordinaires			
Inde				Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
32.038	Reliance Industries Ltd GDR	1.846.991	2,62			1.300.780	1,84
		1.846.991	2,62	Organismes de placement collectif			
Irlande				Irlande			
15.850	Ryanair Holdings Plc ADR	1.850.488	2,62	1	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund (Dist)~	90	0,00
		1.850.488	2,62			90	0,00
Italie				Total des organismes de placement collectif			
844.117	Intesa Sanpaolo SpA	2.497.110	3,54	Portefeuille de titres à la valeur de marché			
		2.497.110	3,54			65.925.071	93,44
Japon				Autres éléments de l'actif net			
47.700	BASE Inc	751.349	1,07	Total de l'actif net (USD)			
12.300	FANUC Corp	2.950.474	4,18			70.551.611	100,00
50.000	Recruit Holdings Co Ltd	2.533.291	3,59				
28.400	Sony Corp	2.793.634	3,96				
27.200	Toyota Motor Corp	2.261.291	3,21				
9.100	Visional Inc	560.243	0,79				
		11.850.282	16,80				
Luxembourg							
38.665	Arrival Group	741.981	1,05				
		741.981	1,05				
Pays-Bas							
13.477	Koninklijke DSM NV	2.486.838	3,52				
		2.486.838	3,52				
Corée du Sud							
2.481	LG Chem Ltd	1.828.846	2,59				
		1.828.846	2,59				
Espagne							
50.289	Cellnex Telecom SA	3.037.336	4,31				
		3.037.336	4,31				
États-Unis							
8.037	Axon Enterprise Inc	1.129.922	1,60				
53.302	BTRS Holdings Inc	762.219	1,08				
6.942	Cadence Design Systems Inc	881.564	1,25				
5.838	Chart Industries Inc	851.998	1,21				

* Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.

~ Investissement dans un fonds de partie liée.

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				États-Unis suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(7.418)	Electronic Arts Inc	UBS	(33.569)
Australie				2.228	Equinix Inc (REIT)	Goldman Sachs	41.798
(19.825)	Commonwealth Bank of Australia	JP Morgan	(62.495)	(4.248)	Expedia Group Inc	JP Morgan	(16.043)
			(62.495)	(13.683)	Fastenal Co	Goldman Sachs	6.882
Brésil				(22.457)	GFL Environmental Inc	UBS	(17.208)
232.797	Locaweb Servicos de Internet SA	JP Morgan	104.529	(43.290)	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs	(46.189)
			104.529	(13.175)	Molson Coors Beverage Co 'B'	Goldman Sachs	(5.656)
Canada				1.902	Netflix Inc	UBS	23.339
16.980	Canadian National Railway Co	UBS	79.590	7.940	NIKE Inc 'B'	UBS	163
			79.590	(14.959)	Omnicom Group Inc	UBS	11.600
France				(32.286)	Pfizer Inc	Goldman Sachs	40.010
6.276	EssilorLuxottica SA	Goldman Sachs	14.153	(3.682)	Wayfair Inc 'A'	UBS	(9.697)
			14.153	(2.793)	WD-40 Co	JP Morgan	(10.790)
Allemagne							(84.093)
(7.333)	BASF SE	JP Morgan	30.527	Total (Exposition brute sous-jacente - USD 43.649.430)			
(40.473)	Freenet AG	UBS	(27.739)				81.396
(8.768)	Stroeer SE & Co KGaA	UBS	(2.463)				
			325				
Italie							
(15.582)	De' Longhi SpA	JP Morgan	915				
			915				
Japon							
(27.900)	Dentsu Group Inc	JP Morgan	(53.148)				
(11.600)	Secom Co Ltd	Goldman Sachs	(75)				
(414.000)	Seven Bank Ltd	UBS	39.785				
(67.100)	SoftBank Corp	JP Morgan	23.618				
(12.100)	Unicharm Corp	UBS	(3.175)				
			7.005				
Pays-Bas							
(17.379)	JDE Peet's NV	Goldman Sachs	1.924				
			1.924				
Espagne							
(304.019)	Mapfre SA	JP Morgan	10.144				
(205.518)	Telefonica SA	UBS	26.353				
			36.497				
Suède							
(25.662)	Electrolux AB 'B'	JP Morgan	2.859				
(91.717)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Goldman Sachs	(585)				
			2.274				
Suisse							
(36.242)	ABB Ltd Reg	Goldman Sachs	(14.976)				
			(14.976)				
Royaume-Uni							
(32.506)	Bunzl Plc	Goldman Sachs	14.175				
66.066	Prudential Plc	Goldman Sachs	5.322				
(82.365)	Sage Group Plc	JP Morgan	(23.749)				
			(4.252)				
États-Unis							
(26.230)	2U Inc	JP Morgan	(7.024)				
(3.807)	Alibaba Group Holding Ltd ADR	Goldman Sachs	(10.481)				
(8.944)	AppLovin Corp 'A'	Goldman Sachs	(99.899)				
(33.903)	AT&T Inc	Goldman Sachs	58.856				
47.749	Baker Hughes Co	JP Morgan	(8.675)				
(406)	Booking Holdings Inc	JP Morgan	(35.492)				
(9.638)	Brink's Co	UBS	36.999				
22.948	Bristol-Myers Squibb Co	UBS	3.678				
(18.279)	Conagra Brands Inc	UBS	(6.695)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(62)	EUR	CAC 40 Index Futures June 2021	Juin 2021	4.887.949	(89.632)
(54)	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	11.355.120	(533.995)
(94)	JPY	Mini-Topix Index Futures June 2021	Juin 2021	1.653.402	893
(10)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures June 2021	Juin 2021	2.734.450	(90.380)
(305)	EUR	STOXX Europe 600 Index Futures June 2021	Juin 2021	8.324.750	(353.909)
Total				28.955.671	(1.067.023)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	623.586	CHF	558.555	Royal Bank of Canada	25/6/2021	2.910
USD	2.316.980	EUR	1.897.662	Bank of America Merrill Lynch	25/6/2021	43
USD	17.210.476	EUR	14.075.290	UBS	25/6/2021	25.346
USD	9.493.492	JPY	1.031.425.740	Barclays Bank	25/6/2021	84.436
USD	2.349.152	JPY	257.145.746	BNP Paribas	25/6/2021	3.371
USD	2.009.850	KRW	2.262.569.179	Citibank	25/6/2021	(31.696)
						84.410

Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	20.249.648	USD	15.718.798	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(45.700)
USD	173.072	AUD	221.198	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1.866
						(43.834)

Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	576.669	USD	635.156	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	5.481
USD	14.173	CHF	12.773	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(17)
						5.464

Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	10.618	USD	12.831	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	130
USD	254	EUR	208	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
						130

Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	1.598.808	USD	2.231.584	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	33.951
USD	35.787	GBP	25.380	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(175)
						33.776
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 52.732.971)						79.946

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	20,00
Biens de consommation cyclique	19,52
Valeurs industrielles	15,54
Communications	9,80
Technologie	9,08
Matériaux de base	8,54
Finance	7,37
Énergie	2,62
Diversifiés	0,97
Organismes de placement collectif	0,00
Portefeuille de titres à la valeur de marché	93,44
Autres éléments de l'actif net	6,56
<hr/>	
	100,00

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Israël				États-Unis suite			
USD 1.625.000	Fiverr International Ltd 1/11/2025 (Zero Coupon)	1.953.104	0,03	USD 13.487.000	RingCentral Inc 15/3/2026 (Zero Coupon)	13.276.266	0,22
USD 1.612.000	Wix.com Ltd 15/8/2025 (Zero Coupon)	1.628.233	0,03	USD 5.020.000	Shift4 Payments Inc 15/12/2025 (Zero Coupon)	6.802.351	0,11
		3.581.337	0,06	USD 4.013.000	SolarEdge Technologies Inc 15/9/2025 (Zero Coupon)	4.859.181	0,08
Jersey				USD 12.080.000	Sotheby's 7,375% 15/10/2027	12.940.942	0,22
USD 3.118.000	Novocure Ltd 1/11/2025 (Zero Coupon)	4.366.572	0,07	USD 5.446.000	Spotify USA Inc 15/3/2026 (Zero Coupon)	4.985.813	0,08
		4.366.572	0,07	USD 5.000.000	Sprint Corp 7,25% 15/9/2021	5.083.400	0,08
Luxembourg				USD 8.079.000	Square Inc 0,25% 1/11/2027	9.124.221	0,15
USD 3.219.000	Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc 6,125% 1/4/2029	3.178.762	0,05	USD 10.894.000	Staples Inc 7,50% 15/4/2026	11.312.874	0,19
		3.178.762	0,05	USD 17.829.000	Staples Inc 10,75% 15/4/2027	18.289.701	0,30
États-Unis				USD 13.767.000	Tenet Healthcare Corp 4,25% 1/6/2029	13.779.115	0,23
USD 2.903.000	Allegheny Technologies Inc 3,50% 15/6/2025	5.093.023	0,08	USD 20.320.000	T-Mobile USA Inc 2,625% 15/4/2026	20.706.994	0,34
USD 11.000.000	AMC Entertainment Holdings Inc 12,00% 15/6/2026	10.848.750	0,18	USD 3.698.000	Twitter Inc 15/3/2026 (Zero Coupon)	3.416.028	0,06
USD 9.000.000	American Airlines Group Inc 5,00% 1/6/2022	9.000.450	0,15	USD 166.000.000	United States Treasury Bill 15/7/2021 (Zero Coupon)	165.997.565	2,76
USD 2.536.000	Bentley Systems Inc 0,125% 15/1/2026	2.875.824	0,05	USD 62.000.000	United States Treasury Bill 30/9/2021 (Zero Coupon)	61.992.706	1,03
USD 12.564.000	Bill.com Holdings Inc 1/12/2025 (Zero Coupon)	14.990.422	0,25	USD 199.925.000	United States Treasury Bill- When Issued 6/7/2021 (Zero Coupon)	199.923.445	3,32
USD 7.587.000	Box Inc 15/1/2026 (Zero Coupon)	8.602.141	0,14	USD 5.746.000	Wayfair Inc 0,625% 1/10/2025	6.079.986	0,10
USD 2.439.000	Boyd Gaming Corp 4,75% 15/6/2031	2.470.219	0,04			852.468.890	14,16
USD 9.369.000	Caesars Entertainment Inc 6,25% 1/7/2025	9.885.888	0,16	Total des obligations		913.670.344	15,17
USD 10.660.000	Caesars Entertainment Inc 8,125% 1/7/2027^	11.845.232	0,20	CERTIFICAT DE DÉPÔTS			
USD 13.000.000	Cengage Learning Inc 9,50% 15/6/2024^	13.254.735	0,22	Canada			
USD 7.879.000	CHS/Community Health Systems Inc 5,625% 15/3/2027	8.271.689	0,14	USD 28.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 16/6/2021	28.000.000	0,47
USD 25.263.000	Coty Inc 5,00% 15/4/2026	25.665.440	0,43			28.000.000	0,47
USD 1.820.000	Dropbox Inc 1/3/2026 (Zero Coupon)	1.861.860	0,03	Suède			
USD 6.808.000	Entercom Media Corp 6,75% 31/3/2029	6.940.041	0,12	USD 18.250.000	Svenska Handelsbanken AB FRN 16/6/2021	18.250.000	0,30
USD 12.333.000	Envista Holdings Corp 2,375% 1/6/2025	26.655.313	0,44			18.250.000	0,30
USD 30.000.000	FirstEnergy Transmission LLC 2,866% 15/9/2028	30.654.562	0,51	Suisse			
USD 13.000.000	Golden Nugget Inc 6,75% 15/10/2024	13.136.890	0,22	USD 11.900.000	Credit Suisse AG FRN 15/2/2022	11.900.000	0,20
USD 5.500.000	GrubHub Holdings Inc 5,50% 1/7/2027	5.795.735	0,10			11.900.000	0,20
USD 6.269.000	Guardant Health Inc 15/11/2027 (Zero Coupon)	7.017.362	0,12	États-Unis			
USD 6.781.000	LivePerson Inc 15/12/2026 (Zero Coupon)	6.818.974	0,11	USD 14.550.000	Bank of Montreal 0,234% 6/10/2021	14.550.000	0,24
USD 25.000.000	Magic Mergeco Inc 7,875% 1/5/2029	25.574.750	0,42	USD 80.850.000	Bank of Nova Scotia 0,19% 18/5/2022	80.850.000	1,34
USD 2.707.000	Middleby Corp 1,00% 1/9/2025	3.774.912	0,06	USD 25.200.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 0,24% 4/5/2022	25.200.000	0,42
USD 7.019.000	Olin Corp 9,50% 1/6/2025	8.728.828	0,15	USD 20.600.000	Citibank NA 0,27% 16/8/2021	20.600.000	0,34
USD 7.194.000	Omicell Inc 0,25% 15/9/2025	10.859.343	0,18	USD 25.000.000	Citibank NA 0,25% 8/9/2021	25.000.000	0,42
USD 9.600.000	Palo Alto Networks Inc 0,75% 1/7/2023	13.824.000	0,23	USD 30.000.000	Commonwealth Bank of Australia 0,24% 18/6/2021	30.000.000	0,50
USD 1.462.000	Peloton Interactive Inc 15/2/2026 (Zero Coupon)	1.403.520	0,02	USD 16.500.000	Mizuho Bank Ltd 0,22% 16/8/2021	16.500.000	0,27
USD 5.411.000	Redfin Corp 15/10/2025 (Zero Coupon)	5.879.052	0,10	USD 6.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,21% 26/8/2021	6.000.000	0,10
USD 2.235.000	Repay Holdings Corp 1/2/2026 (Zero Coupon)	2.169.347	0,04	USD 14.000.000	Royal Bank of Canada 0,31% 16/11/2021	14.000.000	0,23
				USD 36.500.000	Standard Chartered Bank 0,214% 3/9/2021	36.500.000	0,61
				USD 21.750.000	Swedbank AB 0,222% 20/8/2021	21.750.000	0,36
				USD 12.850.000	Toronto-Dominion Bank 0,37% 16/7/2021	12.850.000	0,21

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
États-Unis suite				Japon suite			
USD 15.300.000	Toronto-Dominion Bank 0,43% 28/7/2021	15.300.000	0,26	USD 13.125.000	Mizuho Bank Ltd FRN 26/8/2021	13.120.610	0,22
USD 56.100.000	Toronto-Dominion Bank 0,19% 23/5/2022	56.100.000	0,93	USD 12.500.000	Mizuho Corporate Bank 14/6/2021 (Zero Coupon)	12.498.759	0,21
		375.200.000	6,23	USD 12.000.000	Mizuho Corporate Bank 2/8/2021 (Zero Coupon)	11.996.073	0,20
Total des Certificats de dépôts		433.350.000	7,20	USD 23.150.000	Mizuho Corporate Bank FRN 20/10/2021	23.132.319	0,38
				USD 8.950.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp FRN 13/8/2021	8.947.096	0,15
BILLET DE TRÉSORERIE							
Australie				Nouvelle-Zélande			
USD 25.000.000	ANZ New Zealand International Ltd 2/8/2021 (Zero Coupon)	24.992.681	0,42	USD 15.550.000	ASB Finance Ltd 28/6/2021 (Zero Coupon)	15.546.968	0,26
USD 24.000.000	Westpac Banking Corp FRN 31/8/2021	24.000.000	0,40	USD 13.600.000	ASB Finance Ltd FRN 1/10/2021	13.590.782	0,22
USD 32.100.000	Westpac Banking Corp FRN 4/2/2022	32.097.776	0,53	USD 17.950.000	Westpac Securities NZ Ltd 11/8/2021 (Zero Coupon)	17.942.920	0,30
		81.090.457	1,35			47.080.670	0,78
Canada				Singapour			
USD 1.250.000	British Columbia 8/6/2021 (Zero Coupon)	1.249.961	0,02	USD 28.950.000	DBS Bank Ltd FRN 15/9/2021	28.934.656	0,48
USD 7.500.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 13/9/2021 (Zero Coupon)	7.495.667	0,13	USD 13.600.000	DBS Group Holdings Ltd 7/9/2021 (Zero Coupon)	13.588.523	0,22
USD 1.900.000	Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 12/10/2021	1.898.596	0,03	USD 9.100.000	Oversea-Chinese Banking Corp 16/7/2021 (Zero Coupon)	9.096.815	0,15
USD 34.750.000	National Bank of Canada 1/6/2021 (Zero Coupon)	34.750.000	0,58	USD 49.300.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 9/6/2021 (Zero Coupon)	49.298.138	0,82
USD 69.900.000	National Bank of Canada 23/6/2021 (Zero Coupon)	69.894.020	1,16	USD 18.525.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 17/6/2021 (Zero Coupon)	18.523.683	0,31
USD 40.000.000	National Bank of Canada 22/7/2021 (Zero Coupon)	39.992.633	0,67	USD 16.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd FRN 1/7/2021	15.998.317	0,27
USD 17.600.000	National Bank of Canada 1/9/2021 (Zero Coupon)	17.591.904	0,29			135.440.132	2,25
USD 12.250.000	Royal Bank of Canada 3/9/2021 (Zero Coupon)	12.242.003	0,20	Suède			
USD 22.250.000	Toronto-Dominion Bank FRN 22/9/2021	22.237.429	0,37	USD 41.100.000	Nordea Bank Abp 1/6/2021 (Zero Coupon)	41.100.000	0,68
USD 26.120.000	Total Capital Canada Ltd 2/8/2021 (Zero Coupon)	26.115.052	0,43	USD 37.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 8/6/2021 (Zero Coupon)	36.998.273	0,62
		233.467.265	3,88	USD 20.125.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 12/7/2021 (Zero Coupon)	20.119.499	0,33
France				USD 26.100.000	Svenska Handelsbanken AB 28/1/2022 (Zero Coupon)	26.063.308	0,43
USD 7.500.000	BPCE SA FRN 10/12/2021	7.491.000	0,13	USD 10.000.000	Svenska Handelsbanken AB FRN 5/5/2022	9.978.405	0,17
USD 5.200.000	Credit Industriel et Commercial 1/7/2021 (Zero Coupon)	5.199.437	0,09	USD 70.000.000	Swedbank AB 1/6/2021 (Zero Coupon)	70.000.000	1,16
USD 33.750.000	Electricite De France 4/6/2021 (Zero Coupon)	33.749.227	0,56	USD 4.225.000	Swedbank AB 29/11/2021 (Zero Coupon)	4.221.369	0,07
USD 46.400.000	Electricite De France 23/6/2021 (Zero Coupon)	46.394.612	0,77			208.480.854	3,46
USD 15.777.000	Electricite De France 28/6/2021 (Zero Coupon)	15.773.746	0,26	Suisse			
		108.608.022	1,81	USD 14.000.000	Credit Suisse AG 2/7/2021 (Zero Coupon)	13.996.986	0,23
Allemagne						13.996.986	0,23
USD 50.000.000	BASF SE FRN 10/6/2021	49.997.750	0,83	Royaume-Uni			
USD 51.800.000	BASF SE FRN 21/6/2021	51.795.396	0,86	USD 73.600.000	Lloyds Bank Plc FRN 2/8/2021	73.591.127	1,22
USD 45.000.000	BASF SE FRN 14/7/2021	44.992.206	0,75			73.591.127	1,22
USD 37.500.000	Landesbank Baden Wuerttemberg FRN 10/9/2021	37.480.010	0,62	États-Unis			
		184.265.362	3,06	USD 50.000.000	Alinghi Funding Co LLC 8/7/2021 (Zero Coupon)	49.989.208	0,83
Japon				USD 61.435.000	Alinghi Funding Co LLC FRN 15/10/2021	61.383.941	1,02
USD 65.225.000	Mitsubishi Ufj Trust And Banking Corp FRN 3/9/2021	65.197.751	1,08	USD 19.850.000	Amcor Flexibles North America Inc FRN 11/6/2021	19.849.228	0,33
USD 28.600.000	Mitsubishi UFJ Trust And Banking Corp FRN 12/7/2021	28.593.974	0,48				
USD 41.250.000	Mitsubishi UFJ Trust And Banking Corp 24/8/2021 (Zero Coupon)	41.230.750	0,68				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
États-Unis suite				États-Unis suite			
USD 15.000.000	American Electric Power Co Inc FRN 14/6/2021	14.998.538	0,25	USD 7.750.000	Federation des Caisses Desjardins 15/12/2021 (Zero Coupon)	7.742.154	0,13
USD 9.760.000	American Electric Power Co Inc FRN 19/7/2021	9.756.747	0,16	USD 6.000.000	Fidelity National Information Services FRN 7/6/2021	5.999.730	0,10
USD 47.050.000	American Honda Finance Corp 3/6/2021 (Zero Coupon)	47.049.399	0,78	USD 46.800.000	Goldman Sachs International 7/7/2021 (Zero Coupon)	46.791.644	0,78
USD 51.000.000	American Honda Finance Corp FRN 7/6/2021	50.998.130	0,85	USD 7.250.000	ING US Funding LLC 7/9/2021 (Zero Coupon)	7.245.066	0,12
USD 25.645.000	American Honda Finance Corp FRN 19/7/2021	25.637.619	0,43	USD 37.325.000	ING US Funding LLC FRN 15/9/2021	37.305.218	0,62
USD 6.000.000	AT&T Inc 17/8/2021 (Zero Coupon)	5.996.792	0,10	USD 62.500.000	Ionic Capital II Trust 23/7/2021 (Zero Coupon)	62.481.944	1,04
USD 33.750.000	AT&T Inc 19/10/2021 (Zero Coupon)	33.701.437	0,56	USD 5.750.000	Korea Development Bank FRN 21/7/2021	5.748.642	0,10
USD 27.000.000	AT&T Inc 14/12/2021 (Zero Coupon)	26.941.200	0,45	USD 14.150.000	Korea Development Bank FRN 9/9/2021	14.143.318	0,23
USD 18.750.000	Barton Capital SA 6/7/2021 (Zero Coupon)	18.747.083	0,31	USD 10.300.000	La Fayette Asset Securitization LLC 9/7/2021 (Zero Coupon)	10.299.130	0,17
USD 24.750.000	Barton Capital SA 21/7/2021 (Zero Coupon)	24.743.813	0,41	USD 38.929.000	Lime Funding LLC 10/6/2021 (Zero Coupon)	38.927.443	0,65
USD 16.300.000	Barton Capital SA FRN 27/7/2021	16.295.690	0,27	USD 4.500.000	Lime Funding LLC 17/6/2021 (Zero Coupon)	4.499.660	0,07
USD 21.200.000	Barton Capital SA 2/8/2021 (Zero Coupon)	21.194.888	0,35	USD 25.007.000	Lime Funding LLC 8/7/2021 (Zero Coupon)	25.003.916	0,41
USD 43.300.000	Bayerische Landesbank 5/8/2021 (Zero Coupon)	43.288.273	0,72	USD 12.858.000	Lime Funding LLC 5/8/2021 (Zero Coupon)	12.853.821	0,21
USD 59.050.000	Bayerische Landesbank FRN 12/8/2021	59.035.205	0,98	USD 17.800.000	LMA Americas LLC FRN 25/6/2021	17.797.983	0,30
USD 15.000.000	Bedford Row Funding Corp 16/8/2021 (Zero Coupon)	14.993.033	0,25	USD 50.000.000	Macquarie Bank Ltd 1/6/2021 (Zero Coupon)	50.000.000	0,83
USD 35.000.000	Bedford Row Funding Corp 0,301% 7/4/2022	35.000.000	0,58	USD 3.350.000	Macquarie Bank Ltd 3/6/2021 (Zero Coupon)	3.349.972	0,06
USD 60.000.000	Bell Canada FRN 16/6/2021	59.996.250	1,00	USD 34.670.000	Macquarie Bank Ltd FRN 7/6/2021	34.669.075	0,58
USD 25.500.000	Bng Bank NV FRN 24/6/2021	25.498.697	0,42	USD 82.618.000	Manhattan Asset Funding Co LLC FRN 4/6/2021	82.617.105	1,37
USD 4.250.000	BNG Bank NV 16/6/2021 (Zero Coupon)	4.249.619	0,07	USD 19.200.000	Mont Blanc Capital Corp FRN 14/6/2021	19.198.891	0,32
USD 29.500.000	BofA Securities Inc FRN 9/12/2021	29.471.827	0,49	USD 33.382.000	Mont Blanc Capital Corp FRN 1/9/2021	33.370.057	0,55
USD 20.000.000	Caisse Des Depots et Consignations 3/6/2021 (Zero Coupon)	19.999.844	0,33	USD 8.000.000	National Grid Holdings Inc FRN 14/6/2021	7.999.480	0,13
USD 29.750.000	Cancara Asset Secur LLC 3/6/2021 (Zero Coupon)	29.749.537	0,49	USD 15.250.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 2/7/2021 (Zero Coupon)	15.247.374	0,25
USD 34.650.000	Chariot Funding LLC 9/7/2021 (Zero Coupon)	34.645.977	0,58	USD 49.240.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 26/7/2021 (Zero Coupon)	49.231.349	0,82
USD 25.000.000	Citigroup Global Markets Inc FRN 1/4/2022	24.949.333	0,41	USD 20.300.000	Nextera Energy Capital Holdings Inc FRN 2/6/2021	20.299.899	0,34
USD 38.500.000	Collateralized Commercial Paper V Co 9/8/2021 (Zero Coupon)	38.478.600	0,64	USD 49.500.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 24/6/2021	49.494.624	0,82
USD 50.000.000	Collateralized Commercial Paper V Co 22/11/2021 (Zero Coupon)	49.961.333	0,83	USD 13.585.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 28/6/2021	13.583.268	0,23
USD 75.425.000	DBS Bank Ltd 2/8/2021 (Zero Coupon)	75.404.866	1,25	USD 28.350.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 30/6/2021	28.346.346	0,47
USD 29.900.000	Duke Energy Corp 9/6/2021 (Zero Coupon)	29.899.203	0,50	USD 20.400.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 27/7/2021 (Zero Coupon)	20.396.192	0,34
USD 20.000.000	Duke Energy Corp FRN 8/7/2021	19.996.506	0,33	USD 10.000.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 20/8/2021 (Zero Coupon)	9.998.222	0,17
USD 14.375.000	Eaton Corp FRN 6/7/2021	14.372.624	0,24	USD 40.650.000	Nrw.Bank 23/7/2021 (Zero Coupon)	40.645.890	0,67
USD 4.800.000	Enbridge US Inc FRN 9/8/2021	4.797.424	0,08	USD 15.850.000	NRW.BANK 3/8/2021 (Zero Coupon)	15.846.533	0,26
USD 32.400.000	Eversource Energy 23/6/2021 (Zero Coupon)	32.397.426	0,54	USD 15.500.000	Ridgefield Funding Co LLC 16/6/2021 (Zero Coupon)	15.498.967	0,26
USD 250.000	Exxon Mobil Corp 23/6/2021 (Zero Coupon)	249.969	0,00				
USD 20.000.000	Federation des Caisses Desjardins FRN 2/7/2021	19.997.503	0,33				
USD 11.650.000	Federation des Caisses Desjardins 6/7/2021 (Zero Coupon)	11.648.414	0,19				

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
États-Unis suite			
USD 37.350.000	Ridgefield Funding Co LLC 3/9/2021 (Zero Coupon)	37.330.495	0,62
USD 42.500.000	Salisbury Receivables Co LLC FRN 10/6/2021	42.498.300	0,71
USD 16.000.000	Sheffield Receivables Corp 9/7/2021 (Zero Coupon)	15.997.467	0,27
USD 19.500.000	Societe Generale SA 2/6/2021 (Zero Coupon)	19.499.892	0,32
USD 47.700.000	Unitedhealth Group Inc FRN 10/6/2021	47.698.330	0,79
USD 10.000.000	Unitedhealth Group Inc FRN 15/6/2021	9.999.417	0,17
USD 48.800.000	Versailles Com Paper LLC 7/6/2021 (Zero Coupon)	48.798.780	0,81
USD 33.244.000	Versailles Com Paper LLC 28/7/2021 (Zero Coupon)	33.236.631	0,55
USD 5.752.000	Victory Receivables Corp FRN 16/6/2021	5.751.641	0,10
USD 39.000.000	VW Credit Inc FRN 2/6/2021	38.999.772	0,65
USD 29.300.000	VW Credit Inc 14/6/2021 (Zero Coupon)	29.298.201	0,49
USD 34.500.000	VW Credit Inc FRN 18/6/2021	34.497.230	0,57
		2.275.604.245	37,80
Total des billets de trésorerie		3.566.342.452	59,24
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		5.775.176.869	95,92
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
ACTIONS ORDINAIRES			
États-Unis			
476.486	Escrow Altegrity Inc	6.909.047	0,11
89.469	Project Butternut 'A'	3.164.419	0,05
112.616	Project Dvorak 'F'	1.564.236	0,03
		11.637.702	0,19
Total des actions ordinaires		11.637.702	0,19
OBLIGATIONS			
États-Unis			
USD 6.968.580	Bombardier Inc 31/5/2023 (Zero Coupon)	6.184.615	0,11
USD 18.875.000	Bruce Mansfield Unit 1 6,85% 1/6/2034	94.375	0,00
		6.278.990	0,11
Total des obligations		6.278.990	0,11
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		17.916.692	0,30
Portefeuille de titres à la valeur de marché		5.793.093.561	96,22
Autres éléments de l'actif net		227.346.749	3,78
Total de l'actif net (USD)		6.020.440.310	100,00
* Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.			
^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.			

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				États-Unis suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(477)	ASML Holding NV Reg	Morgan Stanley	(7.880)
Canada				(2.736.754)	AstraZeneca Plc ADR	Citibank	1.915.728
(78.487)	Canadian Solar Inc	Credit Suisse	(167.913)	(962.941)	AstraZeneca Plc ADR	Goldman Sachs	(857.018)
1.468.238	Shaw Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	72.917	(20.067)	Avery Dennison Corp	Morgan Stanley	(34.515)
			(94.996)	(37.547)	Ball Corp	Morgan Stanley	185.858
France				(4.355)	Becton Dickinson and Co	Citibank	7.970
1.980.846	Suez SA	Barclays Bank	12.087	(26.019)	Bentley Systems Inc 'B'	Credit Suisse	(276.329)
264.244	Suez SA	Citibank	1.613	(25.027)	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	33.286
314.318	Suez SA	Credit Suisse	40.277	(490.147)	BHP Group Ltd ADR	Goldman Sachs	2.249.775
1.810.743	Suez SA	Goldman Sachs	(29.844)	490.147	BHP Group Plc ADR	Goldman Sachs	(1.882.164)
			24.133	(55.296)	Bill.com Holdings Inc	Credit Suisse	(346.291)
Allemagne				(2.262)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Citibank	(21.059)
1.691.454	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs	(52.469)	(16.634)	Boeing Co	Citibank	(159.354)
571.070	Dialog Semiconductor Plc	Barclays Bank	153.326	(385)	Boeing Co	Morgan Stanley	(3.688)
			100.857	(189.120)	Box Inc 'A'	Credit Suisse	(157.779)
Japon				(598.103)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Credit Suisse	(2.593.044)
83.459	Toshiba Corp	UBS	91.345	3.579.311	Brookfield Property Partners LP	Credit Suisse	3.031.174
			91.345	(25.584)	Bruker Corp	Citibank	8.187
Pays-Bas				(91.439)	Canadian National Railway Co	Credit Suisse	(188.523)
(25.161)	Just Eat Takeaway.com NV	Citibank	(71.909)	(297.196)	Canadian National Railway Co	JP Morgan	(1.012.048)
(668.063)	Just Eat Takeaway.com NV	Credit Suisse	4.477.265	(293.548)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	(2.917.867)
(512.205)	Just Eat Takeaway.com NV	Goldman Sachs	(1.916.359)	91.124	Cantel Medical Corp	UBS	(156.733)
			2.488.997	(12.586)	Carrier Global Corp	Citibank	(19.508)
Suisse				95.636	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	148.236
(1.912.425)	Credit Suisse Group AG Reg	Goldman Sachs	(993.964)	(25.029)	Caterpillar Inc	Citibank	(50.809)
(2.178.789)	Credit Suisse Group AG Reg	JP Morgan	(1.627.523)	(464)	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	(942)
(211)	Credit Suisse Group Guernsey VII Ltd RegS	Goldman Sachs	207.443	(12.271)	Celanese Corp	Morgan Stanley	6.135
			(2.414.044)	3.245.047	Change Healthcare Inc	Goldman Sachs	1.914.578
Royaume-Uni				2.835.508	Change Healthcare Inc	JP Morgan	2.013.211
9.298.854	RSA Insurance Group LTD	Citibank	26.353	2.659	Cigna Corp	Citibank	(7.126)
6.563.696	RSA Insurance Group LTD	Credit Suisse	18.601	11.789	Cigna Corp	Morgan Stanley	(31.595)
904.342	RSA Insurance Group LTD	Goldman Sachs	10.252	166.547	CoreLogic Inc	Barclays Bank	(19.986)
443.968	Signature Aviation Plc	Barclays Bank	137	33.031	CoreLogic Inc	Goldman Sachs	—
537.640	Signature Aviation Plc	Goldman Sachs	4.680	307.713	CoreLogic Inc	JP Morgan	(36.926)
			60.023	568.840	Corteva Inc	Morgan Stanley	199.094
États-Unis				(19.316)	Cummins Inc	Citibank	(33.803)
(20.024)	3M Co	Citibank	(8.610)	(318)	Cummins Inc	Morgan Stanley	(557)
(407)	3M Co	Morgan Stanley	(175)	(20.320)	Deere & Co	Citibank	(35.357)
(50.552)	Advanced Micro Devices Inc	Citibank	(133.457)	(314)	Deere & Co	Morgan Stanley	(546)
(2.204.510)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	(11.970.489)	127.893	Dow Inc	Morgan Stanley	(144.519)
(2.214.382)	Advanced Micro Devices Inc	JP Morgan	(9.048.300)	(28.361)	Dropbox Inc 'A'	Credit Suisse	(50.303)
(2.032)	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	(5.364)	273.708	DuPont de Nemours Inc	Morgan Stanley	(183.384)
(11.671)	Agilent Technologies Inc	Citibank	(55.904)	(48.124)	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	41.387
(17.106)	Air Products and Chemicals Inc	Morgan Stanley	(1.540)	(15.247)	Ecolab Inc	Morgan Stanley	3.354
(43.869)	Albemarle Corp	Morgan Stanley	(328.579)	(76.563)	Emerson Electric Co	Citibank	(128.626)
1.288.406	Alexion Pharmaceuticals Inc	Citibank	(1.919.725)	(1.361)	Emerson Electric Co	Morgan Stanley	(2.286)
453.299	Alexion Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	815.938	(82.746)	Enbridge Inc	Citibank	34.753
(10.889)	Analog Devices Inc	Citibank	(22.758)	(155.500)	Envista Holdings Corp	Morgan Stanley	80.860
(364.902)	Analog Devices Inc	Credit Suisse	(5.039.297)	(67.456)	Equitrans Midstream Corp	Citibank	14.840
(686.857)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	(11.333.141)	(19.611)	FedEx Corp	Citibank	(58.245)
(1.249.117)	Analog Devices Inc	JP Morgan	(17.250.306)	(301)	FedEx Corp	Morgan Stanley	(894)
(2.301)	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	(4.809)	(5.333)	Fiverr International Ltd	Credit Suisse	(194.880)
(74.828)	Antero Midstream Corp	Citibank	11.972	(24.896)	FMC Corp	Morgan Stanley	1.245
49.053	Anthem Inc	Citibank	190.326	(191.223)	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	(219.906)
10.460	Anthem Inc	Morgan Stanley	40.585	(439)	Garrett Motion Inc	Citibank	(531)
(466.965)	Aon Plc 'A'	Barclays Bank	(88.723)	(377.473)	General Electric Co	Citibank	(332.176)
(389.011)	Aon Plc 'A'	JP Morgan	1.976.176	(10.314)	General Electric Co	Morgan Stanley	(9.076)
(28.599)	Applied Materials Inc	Citibank	(101.526)	(51.086)	Genesis Energy LP	Citibank	16.858
(3.214)	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	(11.410)	37.497	Grubhub Inc	Citibank	62.995
(4.445)	ASML Holding NV Reg	Citibank	(73.431)	995.622	Grubhub Inc	Credit Suisse	(4.719.248)
				763.347	Grubhub Inc	Goldman Sachs	1.992.336
				(32.551)	Guardant Health Inc	Credit Suisse	(75.897)
				(16.651)	Hologic Inc	Citibank	(5.328)
				(21.558)	Honeywell International Inc	Citibank	(127.408)
				(401)	Honeywell International Inc	Morgan Stanley	(2.370)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
13.591	Humana Inc	Morgan Stanley	(69.178)	(2.970)	Peloton Interactive Inc 'A'	Credit Suisse	(59.319)
(199.156)	Huntington Bancshares Inc	JP Morgan	(19.916)	(9.514)	PerkinElmer Inc	Citibank	(4.376)
(60.311)	Huntsman Corp	Morgan Stanley	2.412	(19.377)	Phillips 66 Partners LP	Citibank	5.619
(96.247)	ICON Plc	Barclays Bank	812.325	1.801.906	PPD Inc	Barclays Bank	—
(109.941)	ICON Plc	Citibank	927.902	1.074.229	PPD Inc	Goldman Sachs	42.969
923.002	IHS Markit Ltd	Goldman Sachs	1.476.803	(36.458)	PPG Industries Inc	Morgan Stanley	(5.469)
2.427.507	IHS Markit Ltd	JP Morgan	(4.136.965)	233.320	PRA Health Sciences Inc	Barclays Bank	(839.952)
(20.017)	Illinois Tool Works Inc	Citibank	6.205	266.523	PRA Health Sciences Inc	Citibank	(959.483)
(334)	Illinois Tool Works Inc	Morgan Stanley	104	313.461	Proofpoint Inc	Barclays Bank	550.022
(3.247)	Illumina Inc	Citibank	(18.346)	405.124	Proofpoint Inc	Morgan Stanley	704.916
100.959	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	(19.182)	(7.589)	Qorvo Inc	Citibank	(31.039)
(57.213)	International Paper Co	Morgan Stanley	74.377	(829)	Qorvo Inc	Morgan Stanley	(3.391)
80.991	Kansas City Southern	Credit Suisse	(821.249)	(49.105)	Redfin Corp	Credit Suisse	(164.732)
263.237	Kansas City Southern	JP Morgan	(381.183)	(35.921)	Repay Holdings Corp	Credit Suisse	(58.139)
260.007	Kansas City Southern	Morgan Stanley	1.261.034	(79.761)	Republic Services Inc	Morgan Stanley	16.750
(141.927)	Kinder Morgan Inc	Citibank	69.544	(757)	Resideo Technologies Inc	Citibank	(507)
(11.413)	KLA Corp	Citibank	7.533	(15.203)	RingCentral Inc 'A'	Credit Suisse	(25.656)
(1.045)	KLA Corp	Morgan Stanley	690	(15.528)	Rockwell Automation Inc	Citibank	(20.652)
(9.139)	Lam Research Corp	Citibank	(139.004)	(288)	Rockwell Automation Inc	Morgan Stanley	(383)
(721)	Lam Research Corp	Morgan Stanley	(10.966)	(261.947)	S&P Global Inc	Goldman Sachs	(1.184.000)
(5.253)	Livent Corp	Morgan Stanley	(5.621)	(688.927)	S&P Global Inc	JP Morgan	5.834.570
(57.871)	LivePerson Inc	Credit Suisse	(258.549)	(265.982)	salesforce.com Inc	Goldman Sachs	(6.128.225)
(55.999)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Morgan Stanley	(57.119)	(270.931)	salesforce.com Inc	UBS	(6.242.250)
(19.283)	Magellan Midstream Partners LP	Citibank	7.713	(64.529)	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	(24.521)
(10.925)	Martin Marietta Materials Inc	Morgan Stanley	30.699	(49.030)	Shift4 Payments Inc 'A'	Morgan Stanley	(32.360)
(16.360)	Maxim Integrated Products Inc	Citibank	(21.432)	(8.586)	Skyworks Solutions Inc	Citibank	(9.616)
579.210	Maxim Integrated Products Inc	Credit Suisse	5.421.406	(1.671)	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	(1.872)
1.090.249	Maxim Integrated Products Inc	Goldman Sachs	11.534.834	3.427.604	Slack Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	9.871.499
1.982.724	Maxim Integrated Products Inc	JP Morgan	18.558.297	3.491.375	Slack Technologies Inc 'A'	UBS	10.055.160
(4.225)	Maxim Integrated Products Inc	Morgan Stanley	(5.535)	(10.099)	SolarEdge Technologies Inc	Morgan Stanley	(30.907)
(3.850)	Mettler-Toledo International Inc	Citibank	(80.234)	(3.803)	Spotify Technology SA	Credit Suisse	(49.592)
(11.019)	Microchip Technology Inc	Citibank	(31.404)	(16.258)	Square Inc 'A'	Credit Suisse	(100.912)
(2.626)	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(7.484)	(19.578)	Stanley Black & Decker Inc	Citibank	(102.001)
(20.351)	Micron Technology Inc	Citibank	(25.235)	(352)	Stanley Black & Decker Inc	Morgan Stanley	(1.834)
(4.429)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	(5.492)	(30.788)	STERIS Plc	UBS	175.799
(17.298)	Middleby Corp	Morgan Stanley	(24.044)	(30.342)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	Citibank	(113.176)
(3.731)	MKS Instruments Inc	Citibank	(6.156)	(3.000)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	Morgan Stanley	(11.190)
(883)	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	(1.457)	117.635	Talend SA ADR	Barclays Bank	19.998
(1.656)	Monolithic Power Systems Inc	Citibank	(21.892)	66.315	TCF Financial Corp	JP Morgan	31.168
(393)	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	(5.195)	(14.385)	Teradyne Inc	Citibank	(67.034)
(141.491)	Mosaic Co	Morgan Stanley	(62.256)	(1.273)	Teradyne Inc	Morgan Stanley	(5.932)
(37.180)	MPLX LP	Citibank	8.551	(9.453)	Texas Instruments Inc	Citibank	(10.682)
(46.444)	Newmont Corp	Morgan Stanley	27.866	(2.125)	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	(2.401)
(14.587)	Novocure Ltd	Credit Suisse	(308.396)	(2.741)	Thermo Fisher Scientific Inc	Citibank	(19.297)
2.357.297	Nuance Communications Inc	Barclays Bank	23.573	18.333	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	68.199
1.614.572	Nuance Communications Inc	Goldman Sachs	613.537	(9.609)	Twitter Inc	Credit Suisse	(55.809)
1.761.827	Nuance Communications Inc	Morgan Stanley	82.603	(20.951)	Union Pacific Corp	Citibank	(24.513)
(58.599)	Nucor Corp	Morgan Stanley	48.051	(344)	Union Pacific Corp	Morgan Stanley	(402)
191.875	NXP Semiconductors NV	JP Morgan	4.296.081	(28.119)	United Parcel Service Inc 'B'	Citibank	(32.899)
(63.200)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(120.094)	(405)	United Parcel Service Inc 'B'	Morgan Stanley	(474)
(15.508)	ON Semiconductor Corp	Citibank	(10.856)	(7.213)	UnitedHealth Group Inc	Morgan Stanley	(6.997)
(4.961)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(3.473)	(19.371)	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	26.151
(6.293)	Otis Worldwide Corp	Citibank	(1.259)	(63.528)	Waste Management Inc	Morgan Stanley	27.317
65.111	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	13.022	(8.666)	Wayfair Inc 'A'	Credit Suisse	126.523
(30.205)	Palo Alto Networks Inc	JP Morgan	(624.396)	(30.523)	Western Midstream Partners LP	Citibank	22.892
				(193)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Citibank	(359)
				(64.474)	Westrock Co	Morgan Stanley	(3.868)
				863.459	Williams Cos Inc	Citibank	(146.788)
				432.375	Willis Towers Watson Plc	Barclays Bank	(674.505)
				360.230	Willis Towers Watson Plc	JP Morgan	(2.708.930)
				(1.908)	Wix.com Ltd	Credit Suisse	25.407
				(12.468)	Xilinx Inc	Citibank	(40.272)
				1.279.163	Xilinx Inc	Goldman Sachs	11.333.384

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite			
1.284.891	Xilinx Inc	JP Morgan	9.498.774
(1.968)	Xilinx Inc	Morgan Stanley	(6.357)
			<hr/>
			8.918.427
			<hr/>
			Total (Exposition brute sous-jacente - USD 6.102.826.512)
			9.174.742

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Moins-value nette non réalisée USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	USD 50.000.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.25 Version 8 and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/6/2026	(38.284)	(4.842.234)
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 54.842.234)					(38.284)	(4.842.234)
CCCDs : Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)						

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(1.358)	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	285.560.240	(19.691.520)
(68)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures June 2021	Juin 2021	18.594.260	(1.113.293)
(135)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	17.794.687	18.963
Total				321.949.187	(20.785.850)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en BRL						
BRL	530.270.801	USD	98.938.349	State Street Bank & Trust Company	2/6/2021	2.740.567
BRL	543.234.435	USD	102.381.660	State Street Bank & Trust Company	2/7/2021	1.499.174
USD	100.192.155	BRL	530.270.801	State Street Bank & Trust Company	2/6/2021	(1.486.761)
						2.752.980
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	66.714.826	USD	73.484.916	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	630.390
USD	54.615	CHF	49.192	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(36)
						630.354
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	2.703.228.520	USD	3.266.660.291	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	33.181.943
USD	2.357.380	EUR	1.934.162	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(3.657)
						33.178.286

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	906.112.342	USD	1.261.049.652	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	22.926.270
USD	1.261.507	GBP	893.179	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(4.143)
						22.922.127
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	42.742	USD	5.503	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	4
						4
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	8.678.417.071	USD	79.524.971	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(363.651)
						(363.651)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées	USD
Instruments financiers dérivés							
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS							
Catégorie d'Actions couverte en SGD							
SGD	3.307.907	USD	2.485.462	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021		17.109
USD	5.264	SGD	6.990	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(24)	
							17.085
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 5.050.528.154)							59.137.185

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	48,98
Gouvernement	8,88
Biens de consommation non cyclique	7,73
Biens de consommation cyclique	6,40
Services aux collectivités	5,98
Matériaux de base	5,40
Communications	4,87
Technologie	3,72
Valeurs industrielles	3,14
Énergie	0,74
Diversifiés	0,38
Portefeuille de titres à la valeur de marché	96,22
Autres éléments de l'actif net	3,78
100,00	

BlackRock Global Real Asset Securities Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie				Japon			
1.295.596	Atlas Arteria Ltd (Unit)	6.166.769	1,96	454	Kenedix Office Investment Corp (REIT)^	3.362.349	1,07
4.621.975	AusNet Services	6.277.947	1,99	134.100	Seibu Holdings Inc	1.548.437	0,49
1.375.925	Centuria Industrial REIT (REIT)	3.886.875	1,23			4.910.786	1,56
3.556.256	Centuria Office REIT (REIT)	6.302.915	2,00	Mexique			
414.355	Goodman Group (REIT)	6.231.009	1,98	1.491.990	Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	3.021.761	0,96
1.375.690	Sydney Airport (Unit)	6.249.879	1,98			3.021.761	0,96
1.188.856	Transurban Group (Unit)	12.771.199	4,05	Portugal			
		47.886.593	15,19	241.764	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	674.187	0,21
						674.187	0,21
Belgique				Singapour			
81.107	Warehouses De Pauw CVA (REIT)	3.086.291	0,98	3.293.580	Cromwell European Real Estate Investment Trust (REIT)	9.084.041	2,88
		3.086.291	0,98	10.035.300	ESR-REIT (REIT)	3.036.974	0,96
						12.121.015	3,84
Canada				Corée du Sud			
20.140	Summit Industrial Income (REIT)	266.722	0,08	1.041.891	ESR Kendall Square Co Ltd (REIT)	6.198.551	1,97
		266.722	0,08			6.198.551	1,97
Îles Caïmans				Espagne			
491.500	CK Asset Holdings Ltd	3.255.114	1,03	150.869	Cellnex Telecom SA^	9.112.130	2,89
2.437.200	ESR Cayman Ltd^	7.709.428	2,45			9.112.130	2,89
382.700	GDS Holdings Ltd 'A'	3.634.172	1,15	Royaume-Uni			
1.095.500	Shimao Group Holdings Ltd	3.105.379	0,99	6.087.663	Assura Plc (REIT)^	6.417.909	2,03
		17.704.093	5,62	60.954	Derwent London Plc (REIT)^	2.985.011	0,95
				860.016	National Grid Plc	11.445.497	3,63
Chine				725.016	Secure Income REIT Plc (REIT)	3.903.923	1,24
46.170.000	China Tower Corp Ltd 'H'	6.305.874	2,00	272.672	Severn Trent Plc	9.477.813	3,01
		6.305.874	2,00	1.942.457	Target Healthcare Plc (REIT)	3.165.332	1,00
						37.395.485	11,86
Danemark				États-Unis			
10.198	Orsted A/S	1.537.009	0,49	31.173	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	5.556.899	1,76
		1.537.009	0,49	39.151	Boston Properties Inc (REIT)	4.602.591	1,46
				89.318	CareTrust Inc (REIT)	2.079.323	0,66
France				32.666	Crown Castle International Corp (REIT)	6.190.207	1,96
64.674	Covivio (REIT)^	6.080.628	1,93	67.975	EPR Properties (REIT)	3.340.971	1,06
297.295	Getlink SE	4.752.929	1,51	12.883	Equinix Inc (REIT)	9.491.164	3,01
		10.833.557	3,44	77.978	Eversource Energy^	6.331.034	2,01
				375.906	Medical Properties Trust Inc (REIT)	7.957.930	2,52
Allemagne				126.930	NextEra Energy Inc^	9.293.815	2,95
45.613	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide^	3.236.429	1,03	301.105	Outfront Media Inc (REIT)	7.208.454	2,29
117.283	Hamburger Hafen und Logistik AG	3.088.794	0,98	52.581	Prologis Inc (REIT)	6.196.145	1,97
152.415	Vonovia SE	9.523.578	3,02	65.703	Public Service Enterprise Group Inc	4.081.470	1,29
		15.848.801	5,03	115.102	Rexford Industrial Realty Inc (REIT)	6.357.083	2,02
				99.264	Spirit Realty Capital Inc (REIT)^	4.691.217	1,49
Guernesey							
1.439.049	Stenprop Ltd	3.140.265	1,00				
		3.140.265	1,00				
Hong Kong							
1.322.000	SF Real Estate Investment Trust (REIT)	746.080	0,24				
		746.080	0,24				
Italie							
1.169.945	Enel SpA	11.543.777	3,66				
218.101	ERG SpA	6.632.971	2,11				
748.738	Infrastrutture Wireless Italiane SpA^	8.397.458	2,66				
537.521	Snam SpA^	3.157.941	1,00				
		29.732.147	9,43				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
États-Unis suite			
197.439	UDR Inc (REIT)	9.404.020	2,98
63.564	Welltower Inc (REIT)	4.752.680	1,51
		97.535.003	30,94
	Total des actions ordinaires	308.056.350	97,73
	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	308.056.350	97,73
	Portefeuille de titres à la valeur de marché	308.056.350	97,73
	Autres éléments de l'actif net	7.165.115	2,27
	Total de l'actif net (USD)	315.221.465	100,00
^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.			

BlackRock Global Real Asset Securities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-value nette non réalisée USD
Instruments financiers dérivés			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »			
États-Unis			
6.354	CareTrust REIT Inc (REIT)	Deutsche Bank	3.876
			<hr/> 3.876
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 147.921)			3.876

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS VENDUES							
(12.000)	Call	Rexford Industrial Realty Inc	Bank of America Merrill Lynch	USD 54,11	24/06/2021	(9.735)	(25.523)
(12.000)	Call	Rexford Industrial Realty Inc	Bank of America Merrill Lynch	USD 54,11	18/06/2021	(8.896)	(23.283)
(12.000)	Call	Rexford Industrial Realty Inc	Bank of America Merrill Lynch	USD 54,11	07/07/2021	(10.784)	(28.163)
(12.000)	Call	Rexford Industrial Realty Inc	Bank of America Merrill Lynch	USD 53,75	16/07/2021	(16.150)	(33.288)
(488.000)	Call	Assura Plc	Barclays Bank	GBP 0,72	22/06/2021	(7.869)	(14.851)
(604.500)	Call	Assura Plc	Barclays Bank	GBP 0,74	29/06/2021	(4.409)	(11.249)
(42.537)	Call	Cellnex Telecom SA	Barclays Bank	EUR 49,11	08/06/2021	21.689	(36.074)
(108.400)	Call	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Barclays Bank	EUR 9,74	29/06/2021	(626)	(10.780)
(87.000)	Call	Severn Trent Plc	Barclays Bank	GBP 25,01	22/06/2021	(1.420)	(22.619)
(100.000)	Call	Stenprop Ltd	Barclays Bank	GBP 1,51	29/06/2021	(3.566)	(5.766)
(100.000)	Call	Stenprop Ltd	Barclays Bank	GBP 1,51	22/06/2021	(3.367)	(5.315)
(37.700)	Call	Caretrust REIT Inc	Citibank	USD 24,39	09/06/2021	24.310	(1.103)
(487.300)	Call	Assura Plc	Credit Suisse	GBP 0,78	01/06/2021	6.786	(1)
(23.500)	Call	Cellnex Telecom Sa	Credit Suisse	EUR 47,11	22/06/2021	(39.563)	(72.269)
(27.300)	Call	Derwent London Plc	Credit Suisse	GBP 35,34	01/06/2021	10.475	(125)
(300.100)	Call	Enel SpA	Credit Suisse	EUR 8,37	15/06/2021	44.643	(8.654)
(175.800)	Call	Enel SpA	Credit Suisse	EUR 8,27	29/06/2021	13.432	(18.606)
(46.300)	Call	ERG SpA	Credit Suisse	EUR 24,75	22/06/2021	(31.316)	(47.940)
(50.400)	Call	Hamburger Hafen und Logistik AG	Credit Suisse	EUR 20,60	08/06/2021	(36.577)	(63.764)
(101.000)	Call	National Grid Plc	Credit Suisse	GBP 9,62	24/06/2021	5.672	(1.406)
(3.400)	Call	Orsted A/S	Credit Suisse	DKK 1.026,55	03/06/2021	15.492	(4)
(79.300)	Call	Secure Income REIT Plc	Credit Suisse	GBP 3,86	01/06/2021	3.777	(35)
(113.800)	Call	Secure Income REIT Plc	Credit Suisse	GBP 3,91	29/06/2021	1.185	(4.267)
(80.500)	Call	Target Healthcare REIT Plc	Credit Suisse	GBP 1,19	08/06/2021	905	(26)
(102.800)	Call	Target Healthcare REIT Plc	Credit Suisse	GBP 1,20	10/06/2021	844	(23)
(122.000)	Call	Target Healthcare REIT Plc	Credit Suisse	GBP 1,19	15/06/2021	1.020	(195)
(85.000)	Call	Target Healthcare REIT Plc	Credit Suisse	GBP 1,21	24/06/2021	626	(84)
(75.600)	Call	Target Healthcare REIT Plc	Credit Suisse	GBP 1,17	22/06/2021	1.109	(915)
(100.000)	Call	Target Healthcare REIT Plc	Credit Suisse	GBP 1,15	29/06/2021	(864)	(2.324)
(100.000)	Call	Target Healthcare REIT Plc	Credit Suisse	GBP 1,18	07/07/2021	457	(1.376)
(17)	Call	Alexandria Real Estate Equities	Exchange Traded	USD 180,00	18/06/2021	1.870	(3.400)
(114)	Call	Alexandria Real Estate Equities	Exchange Traded	USD 175,00	16/07/2021	(15.267)	(67.260)
(39)	Call	Boston Properties Inc	Exchange Traded	USD 115,00	18/06/2021	(8.895)	(14.430)
(128)	Call	Boston Properties Inc	Exchange Traded	USD 115,00	16/07/2021	(30.336)	(62.336)
(16)	Call	Crown Castle International Corp	Exchange Traded	USD 185,00	16/07/2021	(5.440)	(12.000)
(130)	Call	Crown Castle International Corp	Exchange Traded	USD 185,00	18/06/2021	(34.859)	(78.000)
(305)	Call	EPR Properties	Exchange Traded	USD 50,00	18/06/2021	30.042	(33.550)
(49)	Call	Equinix Inc	Exchange Traded	USD 740,00	18/06/2021	(17.158)	(66.395)
(6)	Call	Equinix Inc	Exchange Traded	USD 740,00	16/07/2021	(1.260)	(14.190)
(309)	Call	Eversource Energy	Exchange Traded	USD 85,00	18/06/2021	30.112	(9.270)
(592)	Call	Medical Properties Trust Inc	Exchange Traded	USD 23,00	18/06/2021	18.944	(1.776)
(155)	Call	Medical Properties Trust Inc	Exchange Traded	USD 21,00	18/06/2021	—	(6.200)
(884)	Call	Medical Properties Trust Inc	Exchange Traded	USD 21,00	16/07/2021	3.066	(44.200)
(233)	Call	NextEra Energy Inc	Exchange Traded	USD 75,00	18/06/2021	3.029	(13.281)
(78)	Call	NextEra Energy Inc	Exchange Traded	USD 77,50	18/06/2021	4.758	(1.872)
(246)	Call	NextEra Energy Inc	Exchange Traded	USD 75,00	16/07/2021	(477)	(33.210)
(1.282)	Call	Outfront Media Inc	Exchange Traded	USD 25,00	18/06/2021	1.247	(42.306)
(25)	Call	Prologis Inc	Exchange Traded	USD 120,00	18/06/2021	750	(2.875)
(203)	Call	Prologis Inc	Exchange Traded	USD 115,00	18/06/2021	(25.984)	(84.854)
(11)	Call	Public Service Enterprise Group Inc	Exchange Traded	USD 65,00	18/06/2021	220	(110)
(461)	Call	Spirit Realty Capital Inc	Exchange Traded	USD 47,00	18/06/2021	(10.372)	(44.947)

BlackRock Global Real Asset Securities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés							
OPTIONS VENDUES							
(381)	Call	UDR Inc	Exchange Traded	USD 45,00	18/06/2021	(50.122)	(109.537)
(230)	Call	Welltower Inc	Exchange Traded	USD 77,50	18/06/2021	39.100	(14.950)
(30)	Call	Welltower Inc	Exchange Traded	USD 75,00	18/06/2021	(1.020)	(4.470)
(26)	Call	Welltower Inc	Exchange Traded	USD 77,50	16/07/2021	—	(3.900)
(900.000)	Call	Assura Plc	Goldman Sachs	GBP 0,76	24/06/2021	761	(7.992)
(1.784.700)	Call	Ausnet Services	Goldman Sachs	AUD 1,92	22/06/2021	5.595	(3.235)
(492.500)	Call	Centuria Industrial REIT	Goldman Sachs	AUD 3,66	01/06/2021	11.418	(3.834)
(119.000)	Call	Centuria Industrial REIT	Goldman Sachs	AUD 3,57	24/06/2021	(5.950)	(10.463)
(239.000)	Call	Centuria Office REIT	Goldman Sachs	AUD 2,31	24/06/2021	(2.011)	(6.201)
(37.300)	Call	ERG SpA	Goldman Sachs	EUR 25,05	02/06/2021	6.508	(7.505)
(11.900)	Call	ERG SpA	Goldman Sachs	EUR 25,24	22/06/2021	(3.817)	(8.757)
(115.100)	Call	Getlink SE	Goldman Sachs	EUR 13,16	10/06/2021	(3.464)	(22.415)
(200.000)	Call	Infrastrutture Wireless Italiana SpA	Goldman Sachs	EUR 9,85	24/06/2021	15.620	(13.402)
(300)	Call	Kenedix Office Investment Corp	Goldman Sachs	JPY 817.820,00	24/06/2021	(13.672)	(35.488)
(277.000)	Call	National Grid Plc	Goldman Sachs	GBP 9,34	15/06/2021	10.752	(8.548)
(112.900)	Call	Secure Income REIT Plc	Goldman Sachs	GBP 3,87	22/06/2021	724	(5.028)
(458.800)	Call	Snam SpA	Goldman Sachs	EUR 4,88	22/06/2021	7.566	(8.459)
(79.400)	Call	Target Healthcare REIT Plc	Goldman Sachs	GBP 1,19	02/06/2021	1.038	—
(371.000)	Call	Transurban Group	Goldman Sachs	AUD 14,43	15/06/2021	31.301	(13.571)
(33.235)	Call	Warehouses De Pauw SCA	Goldman Sachs	EUR 30,54	10/06/2021	(17.589)	(32.577)
(913.600)	Call	ESR Cayman Ltd	JP Morgan	HKD 27,09	02/06/2021	86.672	—
(58.500)	Call	Seibu Holdings Inc	JP Morgan	JPY 1.186,33	15/06/2021	(30.546)	(47.107)
(1.271.400)	Call	Centuria Office REIT	Morgan Stanley	AUD 2,15	01/06/2021	(114.416)	(135.092)
(18.500.000)	Call	China Tower Corp Ltd	Morgan Stanley	HKD 1,15	15/06/2021	23.036	(3.640)
(28.800)	Call	Covivio	Morgan Stanley	EUR 77,96	22/06/2021	5.942	(37.907)
(19.300)	Call	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Morgan Stanley	EUR 61,11	22/06/2021	10.944	(18.004)
(162.000)	Call	Goodman Group	Morgan Stanley	AUD 19,77	01/06/2021	35.665	(626)
(30.700)	Call	Vonovia SE	Morgan Stanley	EUR 53,10	24/06/2021	16.734	(10.107)
(32.900)	Call	Vonovia SE	Morgan Stanley	EUR 52,10	08/07/2021	18.674	(30.510)
(173)	Call	Public Service Enterprise Group Inc	Nomura International	USD 61,50	18/06/2021	8.102	(17.848)
(113)	Call	Public Service Enterprise Group Inc	Nomura International	USD 62,25	16/07/2021	7.892	(12.448)
(474)	Call	UDR Inc	Nomura International	USD 46,10	16/07/2021	(40.280)	(100.478)
(41.200)	Call	Severn Trent Plc	UBS	GBP 24,81	08/07/2021	(4.444)	(23.236)
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 41.989.006)						(22.017)	(1.833.825)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	3.447.823	USD	4.171.743	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	37.029
USD	70.727	EUR	58.186	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(300)
						36.729

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	11.681.147	USD	1.504.000	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1.140
USD	3.731	HKD	28.976	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(3)
						1.137

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Real Asset Securities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	4.075.734	USD	3.062.367	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	21.097
USD	49.409	SGD	65.632	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(244)
						20.853
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 8.921.791)						58.719

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	54,68
Services aux collectivités	20,24
Valeurs industrielles	12,56
Biens de consommation non cyclique	6,99
Énergie	2,11
Communications	1,15
Portefeuille de titres à la valeur de marché	97,73
Autres éléments de l'actif net	2,27
	100,00

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre		Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre		Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé					Irlande suite						
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE											
Irlande											
USD 63.448		iShares Agribusiness UCITS ETF ⁻	2.490.556	2,45	EUR 2.868.971		iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	18.197.883	17,89		
GBP 8.142		iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻	1.138.974	1,12	USD 48.458		iShares Physical Gold ETC ⁻	1.468.252	1,44		
GBP 3.528		iShares Core GBP Corporate Bond UCITS ETF ⁻	627.764	0,62	GBP 1.250.041		iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF ⁻	4.997.225	4,91		
EUR 6.531		iShares Core S&P 500 UCITS ETF ⁻	2.278.339	2,24	EUR 57.306		iShares USD Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF ⁻	4.649.809	4,57		
USD 211.196		iShares Digitalisation UCITS ETF ⁻	1.838.706	1,81	EUR 69.940		iShares USD Corporate Bond UCITS ETF (Dist) ^{-^}	7.235.992	7,11		
EUR 5.816		iShares EUR Covered Bond UCITS ETF ⁻	914.421	0,90	EUR 29.203		iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻	5.889.661	5,79		
EUR 32.698		iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻	3.185.766	3,13	EUR 72.889		iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist) ⁻	8.017.790	7,88		
EUR 206.956		iShares EUR Government Bond 20yr Target Duration UCITS ETF ⁻	1.217.936	1,20	EUR 344.437		iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻	1.463.857	1,44		
EUR 7.470		iShares EUR Government Bond 10-15yr UCITS ETF ⁻	1.440.814	1,42				91.862.450	90,30		
EUR 3.768		iShares EUR Government Bond 15-30yr UCITS ETF ⁻	1.002.288	0,98	Total des Fonds négociés en bourse				91.862.450	90,30	
EUR 31.759		iShares EUR High Yield Corporate Bond UCITS ETF ^{-^}	3.267.048	3,21	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé					91.862.450	90,30
EUR 27.033		iShares Euro Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF ^{-^}	2.618.416	2,57	Organismes de placement collectif						
USD 26.043		iShares Global Water UCITS ETF ^{-^}	1.353.044	1,33	Irlande						
EUR 45.301		iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻	2.133.677	2,10	1.353.499		iShares China CNY Bond UCITS ETF (Dist) ⁻	6.193.747	6,09		
EUR 681.037		iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻	3.328.160	3,27	64.563		iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF ⁻	1.487.467	1,46		
EUR 788.465		iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻	4.504.501	4,43	264.297		iShares MSCI Europe Financials Sector UCITS ETF 'A' ⁻	1.638.377	1,61		
EUR 765.579		iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	4.849.943	4,77				9.319.591	9,16		
EUR 325.945		iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	1.751.628	1,72	Total des organismes de placement collectif				9.319.591	9,16	
					Portefeuille de titres à la valeur de marché				101.182.041	99,46	
					Autres éléments de l'actif net				546.184	0,54	
					Total de l'actif net (EUR)				101.728.225	100,00	

⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.
[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	1.828.627	GBP	1.590.675	Goldman Sachs	3/6/2021	(18.263)
EUR	1.850.360	GBP	1.590.675	Goldman Sachs	6/7/2021	4.569
EUR	1.139.569	USD	1.370.549	Goldman Sachs	3/6/2021	16.559
EUR	67.487.561	USD	81.288.835	State Street Bank & Trust Company	3/6/2021	880.493
EUR	537.360	USD	654.136	The Bank of New York Mellon	3/6/2021	1.369
EUR	62.460.296	USD	76.137.539	Morgan Stanley	6/7/2021	113.986
GBP	1.590.675	EUR	1.851.452	Goldman Sachs	3/6/2021	(4.562)
USD	1.338.543	EUR	1.105.598	Deutsche Bank	3/6/2021	(8.812)
USD	3.552.601	EUR	2.917.804	Goldman Sachs	3/6/2021	(6.846)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	76.768.409	EUR	63.022.173	Morgan Stanley	3/6/2021	(119.087)
USD	767.497	EUR	635.863	State Street Bank & Trust Company	3/6/2021	(6.986)
USD	886.470	EUR	738.170	The Bank of New York Mellon	3/6/2021	(11.808)
						840.612

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	15.671	GBP	13.488	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	13
GBP	526.145	EUR	606.031	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	4.729
						<u>4.742</u>
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	369.469	USD	448.913	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1.720
USD	15.494.857	EUR	12.823.720	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(130.344)
						<u>(128.624)</u>
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 218.105.560)						<u>716.730</u>

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Fonds négociés en bourse	99,46
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,46
Autres éléments de l'actif net	0,54
	<u>100,00</u>

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre		Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre		Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé									
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE									
Irlande					Irlande suite				
USD 47.053		iShares Agribusiness UCITS ETF ⁻	1.846.995	1,16	GBP 3.192.576		iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF ⁻	12.762.797	8,02
GBP 5.646		iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻	789.811	0,50	EUR 2.477.723		iShares USD Corporate Bond ESG UCITS ETF (Acc) ⁻	10.459.708	6,57
GBP 14.375		iShares Core GBP Corporate Bond UCITS ETF ⁻	2.557.855	1,61	EUR 74.467		iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻	15.018.504	9,44
USD 195.745		iShares Digitalisation UCITS ETF ⁻	1.704.187	1,07	EUR 109.555		iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist) ⁻	12.051.050	7,57
EUR 97.407		iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻	9.490.364	5,96	EUR 203.957		iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻	866.817	0,54
EUR 589.140		iShares EUR Government Bond 20yr Target Duration UCITS ETF ⁻	3.467.089	2,18				129.627.260	81,44
EUR 16.018		iShares EUR Government Bond 10-15yr UCITS ETF ⁻	3.089.552	1,94				129.627.260	81,44
EUR 3.803		iShares EUR Government Bond 15-30yr UCITS ETF ^{-^}	1.011.598	0,64	Total des Fonds négociés en bourse				
EUR 17.459		iShares EUR Govt Bond 5-7yr UCITS ETF ⁻	2.855.245	1,79	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				
EUR 70.042		iShares EUR High Yield Corporate Bond UCITS ETF ^{-^}	7.205.220	4,53					
EUR 86.567		iShares Euro Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF ^{-^}	8.384.880	5,27	Organismes de placement collectif				
USD 18.777		iShares Global Water UCITS ETF ⁻	975.545	0,61	Luxembourg				
EUR 11.642		iShares II Plc - iShares EUR Government Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻	2.632.722	1,65	15.509		BlackRock Global Index Funds - iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (LU) X2 (USD) ⁻	1.866.527	1,17
EUR 65.466		iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻	3.083.449	1,94				1.866.527	1,17
EUR 433.916		iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻	2.120.504	1,33	Irlande				
EUR 654.844		iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻	3.741.124	2,35	3.091.909		iShares China CNY Bond UCITS ETF (Dist) ⁻	14.148.885	8,89
EUR 595.621		iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	3.773.259	2,37	91.720		iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF ⁻	2.113.137	1,33
EUR 291.375		iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	1.565.849	0,98	1.287.765		iShares Euro Govt Bond Climate UCITS ETF (Acc) ⁻	6.281.846	3,95
EUR 2.533.261		iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	16.068.474	10,10	19.248		iShares Italy Govt Bond UCITS ETF ⁻	3.312.581	2,08
USD 69.462		iShares Physical Gold ETC ⁻	2.104.662	1,32	202.440		iShares MSCI Europe Financials Sector UCITS ETF 'A' ⁻	1.254.925	0,79
								27.111.374	17,04
								28.977.901	18,21
								158.605.161	99,65
								563.872	0,35
								159.169.033	100,00

⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.
[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	1.335.524	GBP	1.161.733	Bank of America	3/6/2021	(13.333)
EUR	2.480.250	GBP	2.157.505	Merrill Lynch	3/6/2021	(24.770)
EUR	3.861.119	GBP	3.319.239	Goldman Sachs	6/7/2021	9.534
EUR	93.549.751	USD	112.680.768	State Street Bank & Trust Company	3/6/2021	1.220.520
EUR	85.316.767	USD	103.999.006	Morgan Stanley	6/7/2021	155.697

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
GBP	3.319.238	EUR	3.863.398	Goldman Sachs	3/6/2021	(9.521)
USD	4.314.295	EUR	3.543.394	Goldman Sachs	3/6/2021	(8.314)
USD	3.077.457	EUR	2.533.122	JP Morgan	3/6/2021	(11.492)
USD	105.289.016	EUR	86.438.551	Morgan Stanley	3/6/2021	(166.031)
						1.152.290

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées	EUR
Instruments financiers dérivés							
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS							
Catégorie d'Actions couverte en CHF							
CHF	1.772.538	EUR	1.615.634	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(2.499)	
EUR	9.773	CHF	10.722	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	15	
						(2.484)	
Catégorie d'Actions couverte en GBP							
EUR	130.997	GBP	112.932	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(96)	
GBP	10.286.831	EUR	11.857.559	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	83.586	
						83.490	
Catégorie d'Actions couverte en USD							
EUR	2.893.363	USD	3.516.698	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	12.485	
USD	81.073.153	EUR	67.106.991	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(691.920)	
						(679.435)	
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 364.369.950)							553.861

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Fonds négociés en bourse	98,48
Organismes de placement collectif	1,17
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,65
Autres éléments de l'actif net	0,35
	100,00

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre		Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre		Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé					Irlande suite				
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE									
Irlande									
USD	511.707	iShares Agribusiness UCITS ETF [^]	20.086.291	5,43	EUR	90.704	iShares MSCI Korea UCITS ETF USD (Dist) ⁻	4.811.847	1,30
USD	483.473	iShares Automation & Robotics UCITS ETF 'A' ⁻	4.944.067	1,34	EUR	138.927	iShares MSCI Taiwan UCITS ETF ⁻	9.488.714	2,57
GBP	38.495	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻	5.385.014	1,46	EUR	11.178.670	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	70.906.304	19,17
EUR	101.279	iShares Core S&P 500 UCITS ETF [^]	35.331.179	9,55	USD	214.187	iShares Physical Gold ETC ⁻	6.489.754	1,75
USD	524.008	iShares Digital Security UCITS ETF 'A' ⁻	3.199.693	0,87	EUR	7.305.377	iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻	31.047.852	8,40
USD	443.491	iShares Digitalisation UCITS ETF ⁻	3.861.102	1,04	EUR	100.415	iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻	17.168.957	4,64
USD	69.827	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility UCITS ETF (Acc) ⁻	3.283.652	0,89				344.630.709	93,18
USD	183.037	iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF ⁻	9.364.068	2,53	Total des Fonds négociés en bourse			344.630.709	93,18
USD	340.010	iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF ⁻	14.754.932	3,99	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			344.630.709	93,18
USD	264.190	iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF ⁻	9.685.229	2,62	Organismes de placement collectif				
EUR	311.911	iShares Edge MSCI World Value Factor UCITS ETF ⁻	9.546.036	2,58	Irlande				
EUR	422.006	iShares Edge S&P 500 Minimum Volatility UCITS ETF ⁻	25.531.363	6,90	273.858	iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF ⁻	6.309.414	1,71	
USD	194.680	iShares Global Water UCITS ETF ⁻	10.114.453	2,73	183.684	iShares MSCI China UCITS ETF (Acc) ⁻	1.124.319	0,30	
EUR	2.520.192	iShares MSCI China A UCITS ETF [^]	13.782.930	3,73	1.964.588	iShares MSCI Europe Financials Sector UCITS ETF 'A' ⁻	12.178.481	3,29	
EUR	4.422.235	iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	28.014.859	7,57	31.924	iShares MSCI Mexico Capped UCITS ETF ⁻	3.178.034	0,86	
EUR	476.358	iShares MSCI India UCITS ETF ⁻	2.764.306	0,75			22.790.248	6,16	
EUR	943.079	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	5.068.107	1,37	Total des organismes de placement collectif			22.790.248	6,16
					Portefeuille de titres à la valeur de marché			367.420.957	99,34
					Autres éléments de l'actif net			2.426.523	0,66
					Total de l'actif net (EUR)			369.847.480	100,00

⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.
[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	2.905.629	GBP	2.527.522	Bank of America Merrill Lynch	3/6/2021	(29.008)
EUR	5.396.149	GBP	4.693.970	Goldman Sachs	3/6/2021	(53.892)
EUR	5.426.636	GBP	4.665.046	Goldman Sachs	6/7/2021	13.399
EUR	6.954.447	USD	8.434.825	Goldman Sachs	3/6/2021	43.056
EUR	2.519.325	USD	3.087.619	JP Morgan	3/6/2021	(10.632)
EUR	2.382.397	USD	2.894.154	Standard Chartered Bank	3/6/2021	10.963
EUR	144.947.867	USD	174.589.851	State Street Bank & Trust Company	3/6/2021	1.891.099
EUR	2.567.672	USD	3.125.665	The Bank of New York Mellon	3/6/2021	6.540
EUR	153.930.885	USD	187.637.900	Morgan Stanley	6/7/2021	280.913

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
GBP	4.665.046	EUR	5.429.839	Goldman Sachs	3/6/2021	(13.381)
GBP	2.556.446	EUR	2.972.872	JP Morgan	3/6/2021	(4.652)
USD	192.132.114	EUR	157.747.268	Morgan Stanley	3/6/2021	(316.586)
						1.817.819
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	2.060.067	EUR	1.877.819	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(3.013)
EUR	71.347	CHF	78.469	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(65)
						(3.078)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	941.504	GBP	810.801	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	312
GBP	31.230.570	EUR	36.003.824	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	249.205
						<u>249.517</u>
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	2.098.581	USD	2.552.495	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	7.579
USD	60.373.285	EUR	49.953.441	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(495.688)
						<u>(488.109)</u>
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 581.383.125)						1.576.149

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Fonds négociés en bourse	99,34
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,34
Autres éléments de l'actif net	0,66
	<u>100,00</u>

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre		Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre		Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé					Irlande suite						
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE											
Irlande											
USD	659.686	iShares Agribusiness UCITS ETF ⁻	25.894.985	3,72	EUR	7.625.641	iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF (Acc) ⁻	43.565.287	6,27		
USD	822.996	iShares Automation & Robotics UCITS ETF 'A' ⁻	8.416.080	1,21	EUR	5.928.639	iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	37.557.928	5,40		
GBP	52.832	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP Acc ⁻	7.390.598	1,06	EUR	1.387.065	iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ^{-^}	7.454.087	1,07		
EUR	30.400	iShares Core S&P 500 UCITS ETF ⁻	10.605.040	1,53	EUR	19.284.415	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF 'A' ⁻	122.321.044	17,59		
USD	911.888	iShares Digital Security UCITS ETF 'A' ⁻	5.568.163	0,80	USD	371.165	iShares Physical Gold ETC ⁻	11.246.104	1,62		
USD	505.223	iShares Digitalisation UCITS ETF ⁻	4.398.551	0,63	EUR	261.744	iShares USD Corporate Bond UCITS ETF (Dist) ^{-^}	27.080.034	3,90		
USD	90.448	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility UCITS ETF (Acc) ⁻	4.253.366	0,61	EUR	152.063	iShares USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF (Dist) ⁻	12.770.251	1,84		
USD	233.241	iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF ⁻	11.932.476	1,72	EUR	149.983	iShares USD TIPS UCITS ETF ^{-^}	30.248.572	4,35		
USD	433.459	iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF ⁻	18.810.206	2,71	EUR	433.503	iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist) ⁻	47.685.330	6,86		
USD	336.935	iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF ⁻	12.352.068	1,78	EUR	3.262.783	iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻	13.866.828	1,99		
EUR	396.425	iShares Edge MSCI World Value Factor UCITS ETF ⁻	12.132.587	1,75	EUR	141.213	iShares USD Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF ⁻	16.199.955	2,33		
EUR	571.364	iShares Edge S&P 500 Minimum Volatility UCITS ETF ⁻	34.567.522	4,97				627.467.415	90,25		
EUR	40.595	iShares EUR Covered Bond UCITS ETF ⁻	6.382.549	0,92	Total des Fonds négociés en bourse				627.467.415	90,25	
EUR	130.819	iShares EUR Government Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻	12.745.695	1,83	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé					627.467.415	90,25
EUR	972.641	iShares EUR Government Bond 20yr Target Duration UCITS ETF ⁻	5.723.992	0,82	Organismes de placement collectif						
EUR	75.240	iShares EUR Government Bond 10-15yr UCITS ETF ^{-^}	14.512.291	2,09	Irlande						
EUR	160.496	iShares EUR High Yield Corporate Bond UCITS ETF ^{-^}	16.510.224	2,37	8.422.106	iShares China CNY Bond UCITS ETF (Dist) ⁻	38.540.399	5,54			
EUR	47.486	iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF ⁻	10.836.305	1,56	489.825	iShares Developed Markets Property Yield UCITS ETF ⁻	11.285.078	1,62			
USD	260.050	iShares Global Water UCITS ETF ⁻	13.510.702	1,94	2.203.777	iShares MSCI Europe Financials Sector UCITS ETF 'A' ⁻	13.661.214	1,97			
EUR	173.353	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻	8.164.926	1,17	Total des organismes de placement collectif				63.486.691	9,13	
EUR	2.611.813	iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF 'A' ⁻	12.763.669	1,84	Portefeuille de titres à la valeur de marché					690.954.106	99,38
					Autres éléments de l'actif net					4.299.835	0,62
					Total de l'actif net (EUR)					695.253.941	100,00
					~ Investissement dans un fonds de partie liée.						
					^ Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.						

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	2.577.725	GBP	2.242.288	Bank of America Merrill Lynch	3/6/2021	(25.735)
EUR	4.787.185	GBP	4.164.248	Goldman Sachs	3/6/2021	(47.810)
EUR	7.452.433	GBP	6.406.536	Goldman Sachs	6/7/2021	18.401
EUR	6.085.137	USD	7.318.534	Goldman Sachs	3/6/2021	88.421

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	26.485.002	USD	32.442.620	JP Morgan & Trust Company	3/6/2021	(98.081)
EUR	328.397.762	USD	395.555.433	State Street Bank	3/6/2021	4.284.524
EUR	331.399.918	USD	403.968.215	Morgan Stanley	6/7/2021	604.781
GBP	6.406.536	EUR	7.456.831	Goldman Sachs	3/6/2021	(18.376)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	19.289.588	EUR	15.842.823	Goldman Sachs	3/6/2021	(37.173)
USD	416.026.999	EUR	341.548.392	Morgan Stanley	3/6/2021	(661.004)
						<u>4.107.948</u>
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	5.200.754	EUR	4.740.487	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(7.433)
EUR	80.632	CHF	88.638	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(35)
						<u>(7.468)</u>
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	2.309.286	GBP	1.990.152	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(923)
GBP	90.778.436	EUR	104.584.498	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	792.812
						<u>791.889</u>
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	5.648.598	USD	6.866.597	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	23.487
USD	172.112.521	EUR	142.426.654	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1.432.200)
						<u>(1.408.713)</u>
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 1.325.612.954)						<u>3.483.656</u>

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Fonds négociés en bourse	99,38
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,38
Autres éléments de l'actif net	0,62
	<u>100,00</u>

BlackRock Style Advantage Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
OBLIGATIONS			
Allemagne			
USD 9.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,50% 15/2/2022	9.150.595	5,20
		<u>9.150.595</u>	<u>5,20</u>
Supranational			
USD 16.000.000	African Development Bank 1,25% 26/7/2021	16.028.226	9,10
USD 15.000.000	Asian Development Bank 1,75% 8/6/2021	15.003.787	8,52
USD 16.000.000	European Investment Bank 2,25% 15/3/2022	16.274.263	9,24
USD 8.000.000	Inter-American Development Bank 1,75% 14/4/2022	8.113.627	4,60
USD 16.500.000	International Bank for Reconstruction & Development 2,125% 1/7/2022	16.855.322	9,57
		<u>72.275.225</u>	<u>41,03</u>
États-Unis			
USD 5.000.000	United States Treasury Bill 17/6/2021 (Zero Coupon)	4.999.766	2,84
USD 34.000	United States Treasury Bill 15/7/2021 (Zero Coupon)	33.997	0,02
USD 9.000.000	United States Treasury Bill 7/10/2021 (Zero Coupon)	8.996.672	5,11
USD 10.000.000	United States Treasury Bill 2/12/2021 (Zero Coupon)	9.996.243	5,67
USD 14.500.000	United States Treasury Bill 24/2/2022 (Zero Coupon)	14.494.132	8,23
USD 5.000.000	United States Treasury Bill 24/3/2022 (Zero Coupon)	4.998.047	2,84
USD 6.000.000	United States Treasury Bill 21/4/2022 (Zero Coupon)	5.997.678	3,40
		<u>49.516.535</u>	<u>28,11</u>
Total des obligations		<u>130.942.355</u>	<u>74,34</u>
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		<u>130.942.355</u>	<u>74,34</u>
Portefeuille de titres à la valeur de marché		<u>130.942.355</u>	<u>74,34</u>
Autres éléments de l'actif net		45.208.256	25,66
Total de l'actif net (USD)		<u>176.150.611</u>	<u>100,00</u>

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				Australie suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(99.359)	Insurance Australia Group Ltd	Barclays Bank	(10.766)
Australie				6.565	James Hardie Industries Plc - CDI	Barclays Bank	2.620
(160)	Afterpay Ltd	Barclays Bank	(110)	299	James Hardie Industries Plc - CDI	Citibank	391
(843)	Afterpay Ltd	Deutsche Bank	(4.123)	5.491	James Hardie Industries Plc - CDI	Deutsche Bank	6.961
(2.380)	Afterpay Ltd	Goldman Sachs	(11.641)	4.965	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldman Sachs	3.420
(136)	Afterpay Ltd	HSBC	497	(13.997)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Goldman Sachs	(3.683)
(160.490)	AMP Ltd	HSBC	—	(173)	Macquarie Group Ltd	Deutsche Bank	(179)
1.445	Ampol Ltd	Deutsche Bank	1.163	(878)	Magellan Financial Group Ltd	Deutsche Bank	(1.223)
(5.603)	APA Group (Unit)	Deutsche Bank	338	(319)	Magellan Financial Group Ltd	HSBC	(220)
837	Aristocrat Leisure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.380	(70.739)	Medibank Pvt Ltd	Goldman Sachs	(8.212)
2.303	Aristocrat Leisure Ltd	Citibank	624	(1.012)	National Australia Bank Ltd	Barclays Bank	(235)
1.227	Aristocrat Leisure Ltd	Credit Suisse	2.896	(7.627)	National Australia Bank Ltd	Deutsche Bank	(5.313)
3.641	Aristocrat Leisure Ltd	Deutsche Bank	6.002	(1.355)	Newcrest Mining Ltd	Deutsche Bank	(237)
7.949	Aristocrat Leisure Ltd	Goldman Sachs	13.104	(9.291)	Newcrest Mining Ltd	Goldman Sachs	216
844	Aristocrat Leisure Ltd	HSBC	1.992	(16.722)	Northern Star Resources Ltd	Deutsche Bank	(5.302)
581	ASX Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.079	(7.716)	Northern Star Resources Ltd	Goldman Sachs	(2.866)
150	ASX Ltd	Barclays Bank	224	(3.204)	Northern Star Resources Ltd	JP Morgan	(893)
384	ASX Ltd	Credit Suisse	1.290	(28.642)	Oil Search Ltd	Goldman Sachs	4.655
650	ASX Ltd	Goldman Sachs	1.207	(6.662)	Orica Ltd	Credit Suisse	1.959
34.293	Aurizon Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	—	(27.071)	Orica Ltd	Deutsche Bank	12.361
23.419	Aurizon Holdings Ltd	Barclays Bank	1.269	(6.055)	Orica Ltd	Goldman Sachs	2.765
27.555	Aurizon Holdings Ltd	Credit Suisse	(1.706)	(6.853)	Qantas Airways Ltd	Deutsche Bank	(849)
24.796	Aurizon Holdings Ltd	Deutsche Bank	—	(5.100)	QBE Insurance Group Ltd	HSBC	(1.066)
38.593	Aurizon Holdings Ltd	Goldman Sachs	—	(5.172)	Ramsay Health Care Ltd	Barclays Bank	2.682
13.941	Aurizon Holdings Ltd	HSBC	(863)	199	REA Group Ltd	Barclays Bank	1.305
22.402	Aurizon Holdings Ltd	JP Morgan	(1.387)	3.257	REA Group Ltd	Goldman Sachs	35.215
(32.257)	AusNet Services Ltd	Deutsche Bank	405	992	Rio Tinto Ltd	Barclays Bank	3.248
(13.502)	AusNet Services Ltd	Goldman Sachs	366	(3.018)	Santos Ltd	Barclays Bank	(70)
(527)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Barclays Bank	(224)	(9.578)	Santos Ltd	Deutsche Bank	2.298
(2.713)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Deutsche Bank	(2.940)	(2.646)	Santos Ltd	Goldman Sachs	635
(2.373)	BlueScope Steel Ltd	Barclays Bank	(2.498)	(6.177)	SEEK Ltd	Barclays Bank	(8.127)
(1.675)	BlueScope Steel Ltd	Goldman Sachs	389	3.841	Sonic Healthcare Ltd	Barclays Bank	1.486
5.781	Brambles Ltd	Bank of America Merrill Lynch	805	354	Sonic Healthcare Ltd	Deutsche Bank	(85)
6.423	Brambles Ltd	Barclays Bank	693	594	Sonic Healthcare Ltd	Goldman Sachs	(143)
4.733	Brambles Ltd	Citibank	608	22.960	Suncorp Group Ltd	Barclays Bank	7.996
9.367	Brambles Ltd	Credit Suisse	1.667	(21.723)	Sydney Airport (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(1.681)
43.710	Brambles Ltd	Deutsche Bank	6.268	(40.765)	Sydney Airport (Unit)	Barclays Bank	(3.430)
29.135	Brambles Ltd	Goldman Sachs	4.059	(6.489)	Sydney Airport (Unit)	Deutsche Bank	(453)
5.284	Brambles Ltd	HSBC	941	(3.090)	Sydney Airport (Unit)	Goldman Sachs	(226)
(13.476)	CIMIC Group Ltd	Barclays Bank	1.356	11.548	Tabcorp Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	268
(3.914)	CIMIC Group Ltd	Goldman Sachs	(1.333)	11.536	Tabcorp Holdings Ltd	Barclays Bank	982
(2.709)	CIMIC Group Ltd	HSBC	(3.711)	61.214	Tabcorp Holdings Ltd	Citibank	5.211
607	Cochlear Ltd	Barclays Bank	2.978	21.476	Tabcorp Holdings Ltd	Credit Suisse	(665)
(2.624)	Coles Group Ltd	Deutsche Bank	(487)	16.046	Tabcorp Holdings Ltd	Deutsche Bank	373
(1.598)	Commonwealth Bank of Australia	Deutsche Bank	(2.387)	27.840	Tabcorp Holdings Ltd	HSBC	(862)
(1.192)	Computershare Ltd	Deutsche Bank	(747)	24.299	Tabcorp Holdings Ltd	JP Morgan	(752)
(11.195)	Crown Resorts Ltd	Barclays Bank	227	23.066	Telstra Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.607
(20.903)	Crown Resorts Ltd	Deutsche Bank	4.165	4.817	Telstra Corp Ltd	Credit Suisse	112
(1.314)	Crown Resorts Ltd	JP Morgan	122	43.339	Telstra Corp Ltd	Deutsche Bank	3.019
(48)	CSL Ltd	Barclays Bank	(35)	13.146	Telstra Corp Ltd	Goldman Sachs	916
(449)	CSL Ltd	Deutsche Bank	(4.740)	19.678	Telstra Corp Ltd	HSBC	457
(209)	CSL Ltd	Goldman Sachs	(2.206)	(16.585)	TPG Telecom Ltd	Barclays Bank	(3.851)
(1)	Deterra Royalties Ltd ^{††}	Bank of America Merrill Lynch	—	(38.853)	TPG Telecom Ltd	Deutsche Bank	(4.596)
(31.315)	Evolution Mining Ltd	Deutsche Bank	(5.439)	(14.684)	TPG Telecom Ltd	Goldman Sachs	(320)
(2.520)	Evolution Mining Ltd	Goldman Sachs	(129)	(45.731)	Transurban Group (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	7.787
(885)	Fortescue Metals Group Ltd	Barclays Bank	(712)	(1.358)	Transurban Group (Unit)	Barclays Bank	(192)
(3.149)	Fortescue Metals Group Ltd	Deutsche Bank	(1.736)				
(7.474)	Fortescue Metals Group Ltd	Goldman Sachs	3.876				
(972)	Fortescue Metals Group Ltd	HSBC	(415)				
(2)	Iluka Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Canada suite				Canada suite			
904	Canadian National Railway Co	Citibank	6.869	1.365	Gildan Activewear Inc	Bank of America Merrill Lynch	816
38	Canadian National Railway Co	Goldman Sachs	171	596	Gildan Activewear Inc	Citibank	577
137	Canadian National Railway Co	JP Morgan	(45)	2.362	Gildan Activewear Inc	Goldman Sachs	(137)
(466)	Canadian Pacific Railway Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(197)	651	Gildan Activewear Inc	HSBC	(38)
(172)	Canadian Pacific Railway Ltd	Citibank	38	842	Gildan Activewear Inc	JP Morgan	56
433	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.989)	(328)	Great-West Lifeco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(170)
1.009	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Citibank	67	20.302	Hydro One Ltd	Goldman Sachs	14.284
497	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Credit Suisse	3.332	19.743	Hydro One Ltd	HSBC	7.844
293	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Goldman Sachs	(1.346)	2.792	iA Financial Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.668)
382	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	HSBC	2.561	693	iA Financial Corp Inc	Citibank	(459)
200	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	JP Morgan	1.341	(5.748)	IGM Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.522
(15.296)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3.798	1.601	Intact Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.467
(906)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Goldman Sachs	225	(16.464)	Inter Pipeline Ltd	Goldman Sachs	4.770
353	CCL Industries Inc 'B'	Credit Suisse	(622)	(1.037)	Keyera Corp	Bank of America Merrill Lynch	386
578	CGI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(256)	37.556	Kinross Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.839)
274	CGI Inc	Goldman Sachs	(90)	(4.385)	Kirkland Lake Gold Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.003
263	CGI Inc	HSBC	(62)	(2.195)	Kirkland Lake Gold Ltd	Goldman Sachs	601
125	CGI Inc	JP Morgan	(85)	(709)	Kirkland Lake Gold Ltd	HSBC	(1.678)
33	Constellation Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(327)	4.743	Loblaw Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.420
34	Constellation Software Inc	Credit Suisse	(852)	(1.948)	Lundin Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.032
373	Constellation Software Inc	Goldman Sachs	4.671	798	Magna International Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.730
16	Constellation Software Inc	JP Morgan	(140)	678	Magna International Inc	Goldman Sachs	(308)
(7.121)	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.799	8.855	Manulife Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.932)
(277)	Dollarama Inc	Citibank	177	5.863	Manulife Financial Corp	Citibank	2.329
(1.431)	Dollarama Inc	Credit Suisse	1.139	(11.669)	Metro Inc	Goldman Sachs	(4.733)
(1.052)	Dollarama Inc	Goldman Sachs	409	1.138	National Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	1.403
400	Empire Co Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	377	254	National Bank of Canada	Citibank	(10)
10.811	Empire Co Ltd 'A'	Goldman Sachs	10.201	2.345	National Bank of Canada	Goldman Sachs	2.892
(2.291)	Enbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	910	682	National Bank of Canada	HSBC	2.004
(1.617)	Enbridge Inc	Credit Suisse	2.797	(3.313)	Northland Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.410)
(2.420)	Enbridge Inc	Goldman Sachs	961	(530)	Northland Power Inc	Citibank	(254)
(148)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	728	(1.729)	Northland Power Inc	Credit Suisse	(2.247)
(1.520)	First Quantum Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	881	(3.502)	Northland Power Inc	Goldman Sachs	(6.870)
(1.216)	First Quantum Minerals Ltd	Citibank	(2.416)	(379)	Northland Power Inc	HSBC	(492)
(4.097)	First Quantum Minerals Ltd	Credit Suisse	7.393	(1.053)	Northland Power Inc	JP Morgan	(1.368)
(788)	FirstService Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.050)	193	Nutrien Ltd	Bank of America Merrill Lynch	192
(157)	FirstService Corp	Citibank	(220)	477	Nutrien Ltd	Credit Suisse	118
(319)	FirstService Corp	HSBC	(40)	1.951	Nutrien Ltd	Goldman Sachs	1.938
(9.887)	Fortis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(492)	718	Nutrien Ltd	HSBC	178
(1.209)	Fortis Inc	Citibank	115	168	Onex Corp	Bank of America Merrill Lynch	217
(362)	Fortis Inc	Credit Suisse	55	157	Onex Corp	Citibank	234
(9.826)	Fortis Inc	Goldman Sachs	(2.074)	1.822	Onex Corp	Goldman Sachs	2.353
(7.386)	Fortis Inc	JP Morgan	(80)	786	Onex Corp	HSBC	3.032
(144)	Franco-Nevada Corp	Bank of America Merrill Lynch	39	5.902	Open Text Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.790
5.004	George Weston Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13.668	1.496	Open Text Corp	HSBC	(74)
739	George Weston Ltd	HSBC	2.275	3.358	Open Text Corp	JP Morgan	(167)
(3.999)	GFL Environmental Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.803)	(6.244)	Pan American Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	932
(1.413)	GFL Environmental Inc	Citibank	(199)	(862)	Pan American Silver Corp	Citibank	342
(1.599)	GFL Environmental Inc	Goldman Sachs	(1.407)	(628)	Pan American Silver Corp	Goldman Sachs	94
(8.258)	GFL Environmental Inc	HSBC	(5.058)	(743)	Pan American Silver Corp	HSBC	726
(206)	GFL Environmental Inc	JP Morgan	(126)	(573)	Pan American Silver Corp	JP Morgan	560
				6.535	Parkland Corp	Goldman Sachs	(5.680)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Canada suite				Canada suite			
(2.424)	Pembina Pipeline Corp	Bank of America Merrill Lynch	40	(2.019)	TELUS Corp	HSBC	(1.571)
(1.839)	Pembina Pipeline Corp	Citibank	(1.324)	(182)	Thomson Reuters Corp	Bank of America Merrill Lynch	(575)
(367)	Pembina Pipeline Corp	Credit Suisse	(349)	(171)	Thomson Reuters Corp	Goldman Sachs	(541)
3.828	Power Corp of Canada	Bank of America Merrill Lynch	4.975	(770)	Thomson Reuters Corp	HSBC	(1.115)
814	Power Corp of Canada	Credit Suisse	1.759	418	TMX Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	301
1.408	Power Corp of Canada	Goldman Sachs	1.830	282	TMX Group Ltd	HSBC	(324)
556	Power Corp of Canada	HSBC	1.201	197	Toromont Industries Ltd	Citibank	215
744	Power Corp of Canada	JP Morgan	1.607	118	Toromont Industries Ltd	Goldman Sachs	260
1.045	Quebecor Inc 'B'	Credit Suisse	(1.622)	(2.794)	Toronto-Dominion Bank	Citibank	2.382
6.274	Quebecor Inc 'B'	HSBC	(9.737)	1.565	West Fraser Timber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.150
11.619	Quebecor Inc 'B'	JP Morgan	(18.032)	1.492	West Fraser Timber Co Ltd	Goldman Sachs	2.050
(284)	Restaurant Brands International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(156)	2.857	Wheaton Precious Metals Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.111
(147)	Restaurant Brands International Inc	Citibank	(251)	2.931	Wheaton Precious Metals Corp	Goldman Sachs	1.140
(163)	Restaurant Brands International Inc	Goldman Sachs	(366)	37	Wheaton Precious Metals Corp 159	JP Morgan	
(174)	Restaurant Brands International Inc	HSBC	(203)	(810)	WSP Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.629)
(783)	Restaurant Brands International Inc	JP Morgan	(408)	(232)	WSP Global Inc	Goldman Sachs	(467)
471	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.442)				(38.691)
377	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Goldman Sachs	(1.155)	Danemark			
(36)	Rogers Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(32)	(3.714)	Ambu A/S 'B'	Deutsche Bank	2.194
(1.401)	Rogers Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	(1.241)	(499)	Ambu A/S 'B'	Goldman Sachs	295
1.661	Royal Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	3.328	9	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Barclays Bank	(332)
271	Royal Bank of Canada	Citibank	460	10	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Citibank	(369)
760	Royal Bank of Canada	Credit Suisse	2.784	82	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Deutsche Bank	16.619
(7.600)	Saputo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16.167)	21	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Goldman Sachs	4.256
(733)	Saputo Inc	Citibank	(959)	6	AP Moller - Maersk A/S 'B'	HSBC	350
(983)	Saputo Inc	HSBC	(1.766)	24	AP Moller - Maersk A/S 'B'	JP Morgan	1.398
2.249	Shaw Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	261	194	Carlsberg A/S 'B'	Barclays Bank	96
742	Shaw Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	86	1.313	Carlsberg A/S 'B'	Deutsche Bank	(147)
(161)	Shopify Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(22.324)	(276)	Chr Hansen Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	199
(36)	Shopify Inc 'A'	Citibank	3	(218)	Chr Hansen Holding A/S	Barclays Bank	429
(16)	Shopify Inc 'A'	HSBC	(2.577)	(319)	Chr Hansen Holding A/S	Credit Suisse	366
(15.173)	SSR Mining Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.885)	(5.473)	Chr Hansen Holding A/S	Deutsche Bank	3.332
(1.975)	SSR Mining Inc	Citibank	82	(543)	Chr Hansen Holding A/S	Goldman Sachs	392
(1.548)	SSR Mining Inc	Goldman Sachs	(192)	2.521	Coloplast A/S 'B'	Deutsche Bank	(5.889)
(3.385)	SSR Mining Inc	HSBC	(5.884)	294	Coloplast A/S 'B'	Goldman Sachs	(685)
(7.278)	SSR Mining Inc	JP Morgan	(12.651)	1.671	Danske Bank A/S	Bank of America Merrill Lynch	(644)
483	Sun Life Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(236)	(237)	Demant A/S	Credit Suisse	(685)
358	Sun Life Financial Inc	Citibank	308	(1.290)	Demant A/S	Deutsche Bank	(7.473)
1.068	Sun Life Financial Inc	Credit Suisse	(583)	(1.015)	DSV PANALPINA A/S	Deutsche Bank	(17.740)
3.062	Sun Life Financial Inc	Goldman Sachs	(1.495)	1.092	Genmab A/S	Deutsche Bank	20.788
663	Sun Life Financial Inc	HSBC	(362)	583	GN Store Nord AS	Bank of America Merrill Lynch	2.535
249	Sun Life Financial Inc	JP Morgan	(136)	190	GN Store Nord AS	Barclays Bank	56
(5.099)	TC Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	872	118	GN Store Nord AS	Citibank	35
(2.048)	TC Energy Corp	Citibank	(763)	494	GN Store Nord AS	Deutsche Bank	1.563
(473)	TC Energy Corp	Credit Suisse	294	(1.651)	H Lundbeck A/S	Barclays Bank	1.707
(227)	TC Energy Corp	Goldman Sachs	34	(510)	H Lundbeck A/S	Credit Suisse	404
(1.841)	TC Energy Corp	HSBC	1.143	(6.988)	H Lundbeck A/S	Deutsche Bank	9.498
(1.227)	TC Energy Corp	JP Morgan	762	(522)	H Lundbeck A/S	Goldman Sachs	42
(1.297)	TELUS Corp	Bank of America Merrill Lynch	(78)	1.952	Novo Nordisk A/S 'B'	Barclays Bank	(2.338)
				13.307	Novo Nordisk A/S 'B'	Deutsche Bank	(25.004)
				274	Novozymes A/S 'B'	Credit Suisse	(279)
				7.415	Novozymes A/S 'B'	Deutsche Bank	(4.502)
				182	Novozymes A/S 'B'	Goldman Sachs	(110)
				475	Novozymes A/S 'B'	HSBC	(483)
				(306)	Orsted A/S	Barclays Bank	783
				(92)	Orsted A/S	Credit Suisse	(812)
				(210)	Orsted A/S	Deutsche Bank	(794)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
France suite				France suite			
1.017	La Francaise des Jeux SAEM	Bank of America Merrill Lynch	3.637	(3.056)	TOTAL SE	Deutsche Bank	7.067
483	La Francaise des Jeux SAEM	Barclays Bank	914	(134)	TOTAL SE	Goldman Sachs	310
43	La Francaise des Jeux SAEM	Credit Suisse	143	(1.156)	Ubisoft Entertainment SA	Deutsche Bank	(7.703)
6.745	La Francaise des Jeux SAEM	Deutsche Bank	24.119	(823)	Valeo SA	Deutsche Bank	(1.105)
1.863	La Francaise des Jeux SAEM	JP Morgan	6.207	(1.000)	Valeo SA	Goldman Sachs	(1.342)
(644)	Legrand SA	Barclays Bank	1.399	(69)	Valeo SA	HSBC	(3)
(526)	Legrand SA	Deutsche Bank	231	(2.761)	Veolia Environnement SA	Bank of America Merrill Lynch	(231)
101	L'Oreal SA	Barclays Bank	530	(780)	Veolia Environnement SA	Deutsche Bank	126
(843)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Deutsche Bank	(32.407)	(855)	Veolia Environnement SA	JP Morgan	123
6.784	Natixis SA	Deutsche Bank	(166)	159	Vinci SA	Bank of America Merrill Lynch	(91)
18.973	Orange SA	Bank of America Merrill Lynch	(5.835)	630	Vinci SA	Barclays Bank	(477)
30.997	Orange SA	Barclays Bank	(3.934)	120	Vinci SA	Citibank	(91)
1.695	Orange SA	Citibank	(215)	114	Vinci SA	Deutsche Bank	(85)
865	Orange SA	Credit Suisse	(177)	3.981	Vivendi SE	Barclays Bank	1.846
20.560	Orange SA	Deutsche Bank	(6.323)	1.094	Vivendi SE	Deutsche Bank	908
12.465	Orange SA	Goldman Sachs	(3.833)	3.400	Wendel SE	Barclays Bank	2.075
1.173	Orange SA	JP Morgan	(240)	(2.259)	Worldline SA	Bank of America Merrill Lynch	(8.629)
(334)	Orpea SA	Bank of America Merrill Lynch	1.916	(445)	Worldline SA	Barclays Bank	(695)
(3.388)	Orpea SA	Deutsche Bank	19.433	(3.833)	Worldline SA	Deutsche Bank	(14.641)
(166)	Pernod Ricard SA	Barclays Bank	(122)	(373)	Worldline SA	Goldman Sachs	(1.425)
(182)	Pernod Ricard SA	Deutsche Bank	(911)	(185)	Worldline SA	JP Morgan	(352)
(8)	Pernod Ricard SA	Goldman Sachs	(40)				(65.623)
596	Publicis Groupe SA	Bank of America Merrill Lynch	407	Allemagne			
1.059	Publicis Groupe SA	Barclays Bank	595	(17)	adidas AG	Bank of America Merrill Lynch	(73)
1.008	Publicis Groupe SA	Citibank	566	(41)	adidas AG	Credit Suisse	(693)
4.468	Publicis Groupe SA	Deutsche Bank	3.054	(562)	adidas AG	Deutsche Bank	(2.401)
296	Publicis Groupe SA	HSBC	(246)	(53)	adidas AG	JP Morgan	(896)
863	Publicis Groupe SA	JP Morgan	(716)	221	Allianz SE Reg	Barclays Bank	217
(1.606)	Remy Cointreau SA	Deutsche Bank	(7.644)	729	Allianz SE Reg	Deutsche Bank	(1.690)
(2.164)	Renault SA	Bank of America Merrill Lynch	(977)	302	Allianz SE Reg	Goldman Sachs	(700)
(971)	Renault SA	Barclays Bank	(1.238)	71	Allianz SE Reg	JP Morgan	48
(585)	Renault SA	Credit Suisse	921	686	BASF SE	Bank of America Merrill Lynch	(1.892)
(5.570)	Renault SA	Deutsche Bank	(2.515)	1.375	BASF SE	Barclays Bank	(1.577)
(995)	Renault SA	Goldman Sachs	(449)	130	BASF SE	Credit Suisse	(60)
(567)	Sanofi	Barclays Bank	477	3.855	BASF SE	Deutsche Bank	(10.632)
(131)	Sanofi	Deutsche Bank	(54)	1.665	BASF SE	Goldman Sachs	(4.592)
(86)	Sartorius Stedim Biotech	Goldman Sachs	(52)	(513)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(2.254)
2.030	Schneider Electric SE	Goldman Sachs	(52)	(1.371)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Deutsche Bank	(6.023)
(804)	SCOR SE	Barclays Bank	608	848	Bechtle AG	Barclays Bank	3.984
(301)	SCOR SE	Deutsche Bank	334	299	Bechtle AG	Deutsche Bank	2.317
207	SEB SA	Bank of America Merrill Lynch	(606)	(218)	Beiersdorf AG	Bank of America Merrill Lynch	16
108	SEB SA	Barclays Bank	(79)	(99)	Beiersdorf AG	Barclays Bank	106
99	SEB SA	Credit Suisse	(290)	(186)	Beiersdorf AG	Credit Suisse	32
302	SEB SA	Deutsche Bank	(885)	(1.425)	Beiersdorf AG	Deutsche Bank	104
45	SEB SA	HSBC	(132)	3.824	Brenntag SE	Deutsche Bank	6.440
4.461	SES SA	Barclays Bank	5.499	(352)	Carl Zeiss Meditec AG	Deutsche Bank	(5.155)
14.941	SES SA	Deutsche Bank	10.539	(2.823)	Commerzbank AG	Bank of America Merrill Lynch	(493)
1.199	SES SA	HSBC	1.168	(2.906)	Commerzbank AG	Barclays Bank	(418)
1.218	SES SA	JP Morgan	1.186	(21.999)	Commerzbank AG	Deutsche Bank	(3.839)
3.553	Societe Generale SA	Deutsche Bank	564	(730)	Continental AG	Bank of America Merrill Lynch	(6.147)
(324)	Sodexo SA	Barclays Bank	(593)	(809)	Continental AG	Deutsche Bank	(6.812)
(252)	Sodexo SA	Deutsche Bank	554	(503)	Continental AG	Goldman Sachs	(4.236)
946	STMicroelectronics NV	Deutsche Bank	2.015	(344)	Covestro AG	Citibank	(714)
857	Suez SA	Barclays Bank	5	753	Daimler AG	Barclays Bank	358
2.265	Suez SA	Deutsche Bank	(41)	(101)	Delivery Hero SE	Bank of America Merrill Lynch	(1.116)
463	Teleperformance	Deutsche Bank	1.695	(510)	Delivery Hero SE	Barclays Bank	(5.104)
45	Teleperformance	HSBC	(104)	(384)	Delivery Hero SE	Citibank	(1.382)
(1.237)	TOTAL SE	Bank of America Merrill Lynch	2.861	(3.166)	Delivery Hero SE	Deutsche Bank	(34.333)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Allemagne suite				Allemagne suite			
(317)	Delivery Hero SE	Goldman Sachs	(3.501)	245	LANXESS AG	Deutsche Bank	(413)
(1.306)	Deutsche Bank AG	Barclays Bank	(252)	1.255	LEG Immobilien SE	Barclays Bank	3.216
(9.835)	Deutsche Bank AG	Goldman Sachs	(5.905)	240	Merck KGaA	Barclays Bank	491
148	Deutsche Boerse AG	Barclays Bank	(424)	162	Merck KGaA	Deutsche Bank	887
905	Deutsche Boerse AG	Deutsche Bank	(5.357)	(55)	MTU Aero Engines AG	Bank of America	
93	Deutsche Boerse AG	HSBC	(760)			Merrill Lynch	(242)
121	Deutsche Boerse AG	JP Morgan	(989)	(59)	MTU Aero Engines AG	Barclays Bank	(439)
(7.486)	Deutsche Lufthansa AG			(77)	MTU Aero Engines AG	Credit Suisse	(94)
	Reg	Barclays Bank	(4.605)	(339)	MTU Aero Engines AG	Deutsche Bank	(1.651)
(2.043)	Deutsche Lufthansa AG			(96)	Muenchener		
	Reg	HSBC	1.780		Rueckversicherungs-		
1.679	Deutsche Post AG Reg	Bank of America			Gesellschaft AG in		
		Merrill Lynch	9.835		Muenchen Reg	JP Morgan	1.259
7.879	Deutsche Post AG Reg	Barclays Bank	35.097	(34)	Muenchener		
199	Deutsche Post AG Reg	Credit Suisse	1.047		Rueckversicherungs-		
17.230	Deutsche Post AG Reg	Deutsche Bank	99.475		Gesellschaft AG in	Bank of America	
823	Deutsche Post AG Reg	Goldman Sachs	4.821	(34)	Muenchen Reg	Merrill Lynch	212
3.113	Deutsche Post AG Reg	HSBC	16.374		Muenchener		
(9.192)	Deutsche Telekom AG Reg	Barclays Bank	1.638		Rueckversicherungs-		
(2.152)	Deutsche Telekom AG Reg	Citibank	383		Gesellschaft AG in		
(735)	Deutsche Telekom AG Reg	Credit Suisse	(337)	(212)	Muenchen Reg	Barclays Bank	131
(5.942)	Deutsche Telekom AG Reg	Deutsche Bank	1.798		Muenchener		
(1.665)	Deutsche Wohnen SE	Deutsche Bank	(14.881)		Rueckversicherungs-		
(215)	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs	(2.241)	(133)	Gesellschaft AG in	Credit Suisse	2.781
3.345	E.ON SE	Barclays Bank	(1.200)		Muenchen Reg		
17.784	E.ON SE	Deutsche Bank	(12.552)		Muenchener		
8.465	E.ON SE	Goldman Sachs	(6.154)		Rueckversicherungs-		
539	E.ON SE	HSBC	(507)		Gesellschaft AG in		
(873)	Evonik Industries AG	Barclays Bank	(330)	1.323	Muenchen Reg	Deutsche Bank	828
(1.489)	Evonik Industries AG	Deutsche Bank	(145)		Nemetschek SE	Bank of America	
(797)	Fresenius Medical Care			2.043	Nemetschek SE	Merrill Lynch	6.749
	AG & Co KGaA	Deutsche Bank	1.595	(565)	Porsche Automobil Holding	Deutsche Bank	10.422
(966)	Fresenius SE & Co KGaA	Barclays Bank	2.487		SE (Pref)	Barclays Bank	(4.634)
(1.618)	Fresenius SE & Co KGaA	Deutsche Bank	2.024	(930)	Porsche Automobil Holding	Credit Suisse	(5.652)
185	FUCHS PETROLUB SE				SE (Pref)		
	(Pref)	Goldman Sachs	(181)	(1.934)	Porsche Automobil Holding	Deutsche Bank	(16.427)
307	FUCHS PETROLUB SE			(176)	Porsche Automobil Holding		
	(Pref)	JP Morgan	(824)	(264)	Porsche Automobil Holding	Goldman Sachs	(1.495)
9.570	GEA Group AG	Deutsche Bank	7.942	(93)	Puma SE	HSBC	(1.604)
256	Hannover Rueck SE	Deutsche Bank	(750)	(194)	Puma SE	Barclays Bank	(238)
1.183	HeidelbergCement AG	Barclays Bank	2.021	(548)	Puma SE	Citibank	(275)
2.234	HeidelbergCement AG	Deutsche Bank	(818)	(3.147)	QIAGEN NV	Deutsche Bank	(2.488)
362	HeidelbergCement AG	Goldman Sachs	(133)	(24)	Rational AG	Goldman Sachs	(6.836)
178	HeidelbergCement AG	JP Morgan	(152)	(66)	Rational AG	Citibank	392
(435)	HelloFresh SE	Bank of America		98	SAP SE	Deutsche Bank	2.330
		Merrill Lynch	(2.920)	580	SAP SE	Bank of America	
(129)	HelloFresh SE	Goldman Sachs	(866)	(74)	Sartorius AG (Pref)	Merrill Lynch	115
51	Henkel AG & Co KGaA	Bank of America		(594)	Sartorius AG (Pref)	Deutsche Bank	680
	(Pref)	Merrill Lynch	(98)	(20)	Sartorius AG (Pref)	Bank of America	
2.152	Henkel AG & Co KGaA			(20)	Sartorius AG (Pref)	Merrill Lynch	(9)
	(Pref)	Barclays Bank	(1.366)	1.540	Scout24 AG	Deutsche Bank	(72)
522	Henkel AG & Co KGaA			632	Scout24 AG	Goldman Sachs	(2)
	(Pref)	Deutsche Bank	(1.007)	775	Siemens AG Reg	HSBC	447
(527)	HOCHTIEF AG	Deutsche Bank	1.659	169	Siemens AG Reg	Deutsche Bank	(8.153)
(3.332)	Infineon Technologies AG	Bank of America		272	Siemens AG Reg	Citibank	(532)
		Merrill Lynch	(8.397)	1.839	Siemens AG Reg	Credit Suisse	(3.651)
(5.616)	Infineon Technologies AG	Barclays Bank	(10.658)	421	Siemens AG Reg	Deutsche Bank	(18.247)
(11.152)	Infineon Technologies AG	Deutsche Bank	(28.104)	(691)	Siemens Energy AG	Goldman Sachs	(4.429)
(4.633)	Infineon Technologies AG	Goldman Sachs	(11.676)	(676)	Siemens Energy AG	Citibank	(177)
(898)	Infineon Technologies AG	JP Morgan	(2.038)	(744)	Siemens Energy AG	Deutsche Bank	(411)
(494)	KION Group AG	Barclays Bank	(1.242)	(549)	Siemens Healthineers AG	Goldman Sachs	(1.289)
(315)	KION Group AG	Credit Suisse	(1.192)	(445)	Siemens Healthineers AG	Barclays Bank	74
(236)	KION Group AG	Deutsche Bank	(651)	(11.950)	Siemens Healthineers AG	Citibank	22
(1.788)	KION Group AG	HSBC	(6.764)			Deutsche Bank	10.114
(150)	KION Group AG	JP Morgan	(567)				
(226)	Knorr-Bremse AG	Barclays Bank	290				
(1.966)	Knorr-Bremse AG	Deutsche Bank	3.239				
(185)	Knorr-Bremse AG	Goldman Sachs	305				
(179)	Knorr-Bremse AG	JP Morgan	546				
174	LANXESS AG	Citibank	153				

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Allemagne suite				Hong Kong suite			
(735)	Siemens Healthineers AG	Goldman Sachs	655	38.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22.819
(179)	Siemens Healthineers AG	HSBC	221	6.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Goldman Sachs	3.556
442	Symrise AG	Barclays Bank	539	7.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	HSBC	(541)
451	Symrise AG	Deutsche Bank	1.509	87.000	Swire Pacific Ltd 'A'	HSBC	(57.170)
(1.024)	TeamViewer AG	Barclays Bank	(1.950)	(108.400)	Swire Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(698)
(5.332)	TeamViewer AG	Deutsche Bank	(9.221)	(51.400)	Swire Properties Ltd	Barclays Bank	993
(562)	TeamViewer AG	Goldman Sachs	(448)	7.500	Techtronic Industries Co Ltd	Credit Suisse	(6.571)
9.317	Telefonica Deutschland Holding AG	Goldman Sachs	(4.264)	1.500	Techtronic Industries Co Ltd	HSBC	(1.314)
526	Uniper SE	Barclays Bank	353	2.000	Techtronic Industries Co Ltd	JP Morgan	(1.752)
611	Uniper SE	Citibank	507	(81.000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Citibank	(6.784)
2.129	Uniper SE	Deutsche Bank	(3.352)	(7.200)	Wynn Macau Ltd	Goldman Sachs	(241)
428	Uniper SE	Goldman Sachs	(674)	(8.000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	HSBC	(2.938)
270	Uniper SE	HSBC	(260)				24.498
256	United Internet AG Reg	Barclays Bank	(172)	Irlande			
244	United Internet AG Reg	Deutsche Bank	12	2.032	CRH Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.579
93	Volkswagen AG	Deutsche Bank	2.792	4.264	CRH Plc	Barclays Bank	4.892
(1.505)	Vonovia SE	Bank of America Merrill Lynch	(8.377)	844	CRH Plc	Citibank	968
(10)	Vonovia SE	Barclays Bank	(625)	1.535	CRH Plc	Goldman Sachs	1.948
(928)	Zalando SE	Bank of America Merrill Lynch	(2.152)	328	CRH Plc	JP Morgan	280
(201)	Zalando SE	Barclays Bank	(235)	(151)	Flutter Entertainment Plc	Barclays Bank	(175)
(1.105)	Zalando SE	Deutsche Bank	(2.562)	(103)	Flutter Entertainment Plc	Credit Suisse	1.232
			(93.336)	(105)	Kerry Group Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(167)
Hong Kong				(366)	Kerry Group Plc 'A'	Barclays Bank	(447)
11.800	AIA Group Ltd	Barclays Bank	(3.497)	(1.515)	Kerry Group Plc 'A'	Citibank	(1.849)
(5.500)	ASM Pacific Technology Ltd	HSBC	6.945	(484)	Kingspan Group Plc	Barclays Bank	461
(257.000)	Bank of East Asia Ltd	Citibank	10.596	(26)	Kingspan Group Plc	JP Morgan	(19)
192.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(25.976)	1.654	Smurfit Kappa Group Plc	Barclays Bank	162
31.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Barclays Bank	1.218	366	Smurfit Kappa Group Plc	Citibank	36
(16.100)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Bank of America Merrill Lynch	726	336	Smurfit Kappa Group Plc	Goldman Sachs	(66)
(65.600)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Citibank	845	512	Smurfit Kappa Group Plc	JP Morgan	(450)
(29.400)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Goldman Sachs	1.326				9.385
109.500	CK Asset Holdings Ltd	HSBC	12.698	Israël			
(4.000)	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldman Sachs	465	2.406	Bank Hapoalim BM	Bank of America Merrill Lynch	67
(9.600)	ESR Cayman Ltd	Goldman Sachs	(1.237)	4.066	Bank Hapoalim BM	Barclays Bank	(263)
(5.000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Goldman Sachs	960	52.664	Israel Discount Bank Ltd 'A'	Goldman Sachs	2.595
(13.000)	Hang Lung Properties Ltd	Goldman Sachs	(201)	476	Mizrahi Tefahot Bank Ltd	Goldman Sachs	155
4.000	Henderson Land Development Co Ltd	Barclays Bank	696	146	Nice Ltd	Barclays Bank	(728)
200.000	Henderson Land Development Co Ltd	Goldman Sachs	57.982				1.826
(357.500)	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	Barclays Bank	(3.225)	Italie			
(141.000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(727)	(1.319)	Amplifon SpA	Deutsche Bank	(8.725)
(258.000)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Barclays Bank	(2.660)	(9.406)	Atlantia SpA	Barclays Bank	(7.289)
(900)	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Goldman Sachs	(4.731)	2.987	CNH Industrial NV	Bank of America Merrill Lynch	(91)
(177.952)	MTR Corp Ltd	Barclays Bank	20.636	804	CNH Industrial NV	Deutsche Bank	(25)
13.000	New World Development Co Ltd	Barclays Bank	1.759	(2.959)	Davide Campari-Milano NV	Barclays Bank	(253)
28.000	New World Development Co Ltd	Goldman Sachs	5.051	(28.691)	Davide Campari-Milano NV	Citibank	(2.451)
15.000	New World Development Co Ltd	HSBC	(966)	(96)	DiaSorin SpA	Deutsche Bank	(492)
2.000	New World Development Co Ltd	JP Morgan	(129)	27.408	Enel SpA	Deutsche Bank	(2.408)
(13.600)	Sands China Ltd	Goldman Sachs	(2.453)	20.611	Enel SpA	Goldman Sachs	(1.811)
(1)	Sisram Medical Ltd	JP Morgan	(1)	36.947	Eni SpA	Deutsche Bank	(17.405)
(128.000)	SJM Holdings Ltd	Goldman Sachs	(961)	1.924	EXOR NV	Barclays Bank	3.146
				1.355	EXOR NV	Deutsche Bank	3.473
				(188)	Ferrari NV	Bank of America Merrill Lynch	(1.916)
				(168)	Ferrari NV	Barclays Bank	92
				(100)	Ferrari NV	Citibank	55
				(77)	Ferrari NV	Credit Suisse	(785)
				(865)	Ferrari NV	Deutsche Bank	(8.815)
				(89)	Ferrari NV	Goldman Sachs	(907)
				(133)	Ferrari NV	HSBC	(554)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Italie suite				Japon suite			
1.138	FinecoBank Banca Fineco SpA	Deutsche Bank	277	(900)	Bandai Namco Holdings Inc	Bank of America	
(886)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Bank of America		(800)	Bandai Namco Holdings Inc	Merrill Lynch	(1.453)
(48.586)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Merrill Lynch	318	(1.300)	Bandai Namco Holdings Inc	Barclays Bank	(44)
(2.263)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Deutsche Bank	17.433	(300)	Bandai Namco Holdings Inc	Credit Suisse	2.964
266.098	Intesa Sanpaolo SpA	JP Morgan	895	(1.300)	Bandai Namco Holdings Inc	Goldman Sachs	(484)
(9.136)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Goldman Sachs	4.546	(1.300)	Bank of Kyoto Ltd	Barclays Bank	(3.557)
(1.809)	Moncler SpA	Deutsche Bank	(290)	(3.100)	Bank of Kyoto Ltd	Citibank	(8.482)
(3.217)	Moncler SpA	Bank of America	(14.527)	(1.100)	Bank of Kyoto Ltd	Credit Suisse	6.120
(265)	Moncler SpA	Merrill Lynch	(24.651)	(1.800)	Bank of Kyoto Ltd	JP Morgan	10.015
(10.340)	Nexi SpA	Deutsche Bank	(2.199)	2.200	Bridgestone Corp	Barclays Bank	742
12.181	Poste Italiane SpA	HSBC	(2.965)	6.200	Brother Industries Ltd	Credit Suisse	6.729
(627)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Bank of America	(497)	27.300	Brother Industries Ltd	JP Morgan	29.631
(355)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Merrill Lynch	182	16.800	Calbee Inc	Goldman Sachs	(13.024)
(299)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Barclays Bank	(237)	(2.400)	Canon Inc	Barclays Bank	1.029
(222)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Deutsche Bank	(176)	(1.100)	Canon Inc	Citibank	472
10.367	Snam SpA	Goldman Sachs	(25)	800	Capcom Co Ltd	Bank of America	
(3.239)	Stellantis NV	Deutsche Bank	(4.957)	1.200	Capcom Co Ltd	Merrill Lynch	1.934
(14.036)	Tenaris SA	Bank of America	7.057	400	Capcom Co Ltd	Barclays Bank	3.885
(21.795)	Tenaris SA	Merrill Lynch	(187)	600	Capcom Co Ltd	Citibank	1.295
(22.318)	Tenaris SA	Barclays Bank	9.914	1.300	Capcom Co Ltd	HSBC	1.313
22.601	Terna SpA	Deutsche Bank	166	(300)	Casio Computer Co Ltd	Citibank	1.020
24.332	Terna SpA	Goldman Sachs	178	(900)	Central Japan Railway Co	Bank of America	
(2.312)	UniCredit SpA	Deutsche Bank	(762)	(1.200)	Central Japan Railway Co	Merrill Lynch	(1.122)
			(53.478)	(100)	Central Japan Railway Co	Barclays Bank	(3.160)
				(1.200)	Chiba Bank Ltd	Goldman Sachs	(4.487)
				(100)	Chiba Bank Ltd	Barclays Bank	34
				(19.600)	Chiba Bank Ltd	Goldman Sachs	4.648
				2.500	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	1.072
				400	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	1.072
				2.400	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Goldman Sachs	438
				9.900	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Bank of America	
				(100)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Merrill Lynch	(1.138)
				(1.600)	CyberAgent Inc	HSBC	(2.438)
				1.300	Dai Nippon Printing Co Ltd	Barclays Bank	182
				1.200	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America	
				(200)	Daifuku Co Ltd	Merrill Lynch	(2.101)
				(100)	Daifuku Co Ltd	Barclays Bank	391
				(3.100)	Daifuku Co Ltd	HSBC	679
				(6.000)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Barclays Bank	1.131
				(400)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Citibank	565
				(1.100)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Credit Suisse	57.680
				(400)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Goldman Sachs	(10.398)
				(1.100)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Barclays Bank	166
				(400)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Goldman Sachs	1.033
				(600)	Daikin Industries Ltd	HSBC	1.432
				(1.200)	Daikin Industries Ltd	Barclays Bank	(2.271)
				(5.000)	Daiwa House Industry Co Ltd	Credit Suisse	16.527
				(11.000)	Daiwa Securities Group Inc	Barclays Bank	(1.368)
				(24.100)	Daiwa Securities Group Inc	Bank of America	
				(300)	Denso Corp	Merrill Lynch	(1.525)
				(2.800)	Denso Corp	Barclays Bank	1.231
				2.400	Dentsu Group Inc	Barclays Bank	(317)
				100	Disco Corp	Goldman Sachs	(8.708)
				(1.900)	East Japan Railway Co	Barclays Bank	3.065
				(3.200)	East Japan Railway Co	HSBC	(1.368)
				(300)	East Japan Railway Co	Barclays Bank	(2.045)
				(700)	East Japan Railway Co	Goldman Sachs	(3.123)
				(500)	Eisai Co Ltd	HSBC	90
				(300)	Eisai Co Ltd	JP Morgan	211
				17.900	ENEOS Holdings Inc	Bank of America	
				141.000	ENEOS Holdings Inc	Merrill Lynch	(2.166)
				2.300	ENEOS Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.300)
						Barclays Bank	
						Goldman Sachs	(1.551)
						Barclays Bank	(4.887)
						Goldman Sachs	(199)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
2.400	ENEOS Holdings Inc	HSBC	35	(200)	Japan Airlines Co Ltd	Credit Suisse	(332)
2.900	ENEOS Holdings Inc	JP Morgan	(1.455)	(5.700)	Japan Airlines Co Ltd	Goldman Sachs	(12.009)
(800)	FANUC Corp	Bank of America		(3.800)	Japan Airport Terminal		
		Merrill Lynch	(12.587)		Co Ltd	Goldman Sachs	(11.957)
(200)	FANUC Corp	Barclays Bank	(1.478)	(3.800)	Japan Airport Terminal		
(200)	FANUC Corp	Credit Suisse	511		Co Ltd	HSBC	(173)
(100)	FANUC Corp	Goldman Sachs	(1.573)	(3.600)	Japan Exchange Group Inc	Bank of America	
(100)	Fast Retailing Co Ltd	Barclays Bank	(2.198)			Merrill Lynch	(1.100)
(100)	Fast Retailing Co Ltd	Citibank	(2.198)	(2.200)	Japan Exchange Group Inc	Goldman Sachs	(672)
9.300	Fuji Electric Co Ltd	Barclays Bank	6.786	(2.600)	Japan Exchange Group Inc	HSBC	2.786
400	FUJIFILM Holdings Corp	Barclays Bank	989	(42.900)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America	
2.100	FUJIFILM Holdings Corp	Goldman Sachs	9.251			Merrill Lynch	11.738
100	Fujitsu Ltd	Bank of America		(2.900)	Japan Post Bank Co Ltd	Goldman Sachs	794
		Merrill Lynch	876	(5.700)	Japan Post Bank Co Ltd	HSBC	5.771
100	Fujitsu Ltd	Barclays Bank	(214)	9.200	Japan Post Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1.233)
3.500	Fujitsu Ltd	Goldman Sachs	30.646	(7.900)	Japan Post Insurance		
(21.400)	Fukuoka Financial Group				Co Ltd		12.537
	Inc	Barclays Bank	5.465	(1.000)	JFE Holdings Inc	Barclays Bank	
(1.900)	Fukuoka Financial Group					Bank of America	
	Inc	HSBC	(520)	(7.700)	JFE Holdings Inc	Merrill Lynch	684
(1.500)	GMO Payment Gateway	Bank of America		(600)	JFE Holdings Inc	Goldman Sachs	5.267
	Inc	Merrill Lynch	(10.808)	2.000	JSR Corp	HSBC	1.461
22.400	Hakuhodo DY Holdings Inc	Barclays Bank	(5.108)	900	JSR Corp	Barclays Bank	(757)
(300)	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America		600	JSR Corp	Citibank	(299)
		Merrill Lynch	(520)	700	JSR Corp	Goldman Sachs	(328)
(600)	Hamamatsu Photonics KK	Barclays Bank	766	21.700	Kajima Corp	HSBC	(894)
(200)	Hamamatsu Photonics KK	Goldman Sachs	(347)			Bank of America	
1.700	Hankyu Hanshin Holdings			10.600	Kajima Corp	Merrill Lynch	13.261
	Inc	Barclays Bank	1.395	2.500	Kajima Corp	Barclays Bank	(2.030)
(800)	Harmonic Drive Systems	Bank of America		7.600	Kajima Corp	Credit Suisse	(1.551)
	Inc	Merrill Lynch	876	1.700	Kajima Corp	Goldman Sachs	4.644
(1.800)	Harmonic Drive Systems Inc	Credit Suisse	24.954	3.500	Kajima Corp	HSBC	(1.054)
(300)	Harmonic Drive Systems Inc	HSBC	4.159	(1.800)	Kakaku.com Inc	JP Morgan	(2.038)
(700)	Hikari Tsushin Inc	Barclays Bank	4.597	(400)	Kao Corp	Goldman Sachs	(6.321)
(400)	Hikari Tsushin Inc	Goldman Sachs	255	(1.400)	Kao Corp	Barclays Bank	592
17.300	Hino Motors Ltd	Bank of America		(1)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	HSBC	3.282
		Merrill Lynch	8.205	4.500	KDDI Corp	Credit Suisse	2
3.500	Hisamitsu Pharmaceutical					Bank of America	
	Co Inc	Barclays Bank	(7.661)	9.200	KDDI Corp	Merrill Lynch	7.593
(10.600)	Hitachi Construction			400	KDDI Corp	Barclays Bank	3.132
	Machinery Co Ltd	HSBC	1.934	(14.600)	Keihan Holdings Co Ltd	HSBC	51
400	Hitachi Ltd	Barclays Bank	376	(7.500)	Keikyuu Corp	Credit Suisse	51.268
500	Hitachi Ltd	Citibank	470	(10.400)	Keikyuu Corp	Barclays Bank	(3.899)
1.200	Hitachi Ltd	Goldman Sachs	3.853	(5.900)	Keio Corp	Goldman Sachs	1.897
(2.200)	Hitachi Metals Ltd	Barclays Bank	—	(600)	Keisei Electric Railway	JP Morgan	22.063
(1.800)	Hitachi Metals Ltd	Credit Suisse	148		Co Ltd	Bank of America	
(1.700)	Hitachi Metals Ltd	Goldman Sachs	31	(200)	Keyence Corp	Merrill Lynch	(930)
4.700	Honda Motor Co Ltd	Bank of America		(1.000)	Keyence Corp	Barclays Bank	(2.098)
		Merrill Lynch	4.930	800	Kikkoman Corp	HSBC	(3.466)
5.000	Honda Motor Co Ltd	Barclays Bank	(274)			Bank of America	
400	Honda Motor Co Ltd	Citibank	(22)	1.000	Kikkoman Corp	Merrill Lynch	2.262
1.200	Honda Motor Co Ltd	Credit Suisse	(854)	300	Kikkoman Corp	Barclays Bank	3.466
6.100	Honda Motor Co Ltd	Goldman Sachs	6.398	400	Kikkoman Corp	Citibank	1.040
1.900	Honda Motor Co Ltd	JP Morgan	(1.352)	(6.600)	Kintetsu Group Holdings	Credit Suisse	1.099
(100)	Hoshizaki Corp	Barclays Bank	9		Co Ltd	Bank of America	
1.800	Hoya Corp	Bank of America		(3.600)	Kintetsu Group Holdings	Merrill Lynch	5.418
		Merrill Lynch	17.238		Co Ltd	Barclays Bank	(4.104)
(12.400)	Hulic Co Ltd	Bank of America		(2.200)	Kintetsu Group Holdings		
		Merrill Lynch	(3.845)		Co Ltd	Goldman Sachs	1.806
(17.800)	Hulic Co Ltd	Barclays Bank	649	(4.900)	Kirin Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(3.084)
(4.500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Bank of America		(4.100)	Kobayashi Pharmaceutical		
		Merrill Lynch	4.515		Co Ltd	Goldman Sachs	—
1.200	Iida Group Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(491)	(8.700)	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America	
2.000	Iida Group Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(498)			Merrill Lynch	6.269
(5.200)	Inpex Corp	Goldman Sachs	2.182	(1.300)	Kobe Bussan Co Ltd	Barclays Bank	540
3.400	Isuzu Motors Ltd	Bank of America		(1.100)	Kobe Bussan Co Ltd	Goldman Sachs	793
		Merrill Lynch	2.853	(4.810)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(12.284)
3.800	Isuzu Motors Ltd	Goldman Sachs	3.189	(300)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America	
1.400	Ito En Ltd	Citibank	(511)			Merrill Lynch	(985)
(7.100)	ITOCHU Corp	Citibank	2.590	(1.000)	Koito Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	(1.551)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
(300)	Koito Manufacturing Co Ltd	Credit Suisse	(328)	(16.300)	Mitsubishi Corp	Barclays Bank	(5.724)
(900)	Koito Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(2.812)	39.400	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America	
(800)	Komatsu Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	19.046
		Merrill Lynch	350	4.700	Mitsubishi Electric Corp	Barclays Bank	86
(700)	Komatsu Ltd	Goldman Sachs	306	30.800	Mitsubishi Electric Corp	Citibank	562
(3.100)	Komatsu Ltd	HSBC	6.588	11.900	Mitsubishi Electric Corp	Credit Suisse	(434)
(1.400)	Konami Holdings Corp	Goldman Sachs	(9.960)	700	Mitsubishi Electric Corp	Goldman Sachs	338
(700)	Kose Corp	Barclays Bank	(3.320)	3.200	Mitsubishi Electric Corp	HSBC	(117)
(300)	Kose Corp	Citibank	(1.423)	2.100	Mitsubishi Estate Co Ltd	Barclays Bank	(383)
(600)	Kose Corp	Credit Suisse	(4.792)	2.300	Mitsubishi Estate Co Ltd	Citibank	(420)
(200)	Kose Corp	Goldman Sachs	(2.390)	1.200	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America	
(7.900)	Kubota Corp	Bank of America				Merrill Lynch	843
		Merrill Lynch	5.080	4.800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Barclays Bank	2.977
(500)	Kubota Corp	Barclays Bank	344	800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Credit Suisse	(452)
10.800	Kuraray Co Ltd	Barclays Bank	(788)	2.800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	HSBC	(1.583)
9.400	Kuraray Co Ltd	HSBC	(9.945)	900	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JP Morgan	(509)
3.800	Kurita Water Industries Ltd	Bank of America		(20.000)	Mitsubishi HC Capital Inc	HSBC	5.655
		Merrill Lynch	11.784	(2.500)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America	
6.600	Kurita Water Industries Ltd	Goldman Sachs	20.467			Merrill Lynch	(1.095)
2.200	Kyocera Corp	Barclays Bank	1.505	(6.500)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Barclays Bank	1.773
(800)	Kyowa Kirin Co Ltd	Barclays Bank	292	(600)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Citibank	170
(400)	Kyowa Kirin Co Ltd	Citibank	146	(900)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	45
(800)	Kyowa Kirin Co Ltd	Goldman Sachs	182	(2.000)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	HSBC	(1.046)
(400)	Kyowa Kirin Co Ltd	JP Morgan	237	40.700	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Barclays Bank	(3.786)
(600)	Kyushu Railway Co	Bank of America		2.100	Mitsui & Co Ltd	Barclays Bank	(402)
		Merrill Lynch	(71)	500	Mitsui & Co Ltd	Citibank	(96)
(1.500)	Kyushu Railway Co	Barclays Bank	(1.560)	800	Mitsui & Co Ltd	Goldman Sachs	128
(600)	Kyushu Railway Co	HSBC	181	3.500	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America	
(300)	Lasertec Corp	Bank of America				Merrill Lynch	1.596
		Merrill Lynch	(7.437)	2.000	Mitsui Chemicals Inc	Barclays Bank	2.371
(1.400)	Lasertec Corp	Barclays Bank	(34.434)	3.900	Mitsui Chemicals Inc	Goldman Sachs	1.779
(100)	Lasertec Corp	Goldman Sachs	(3.055)	3.300	Mitsui Chemicals Inc	HSBC	301
(100)	Lasertec Corp	HSBC	(2.311)	2.500	Mitsui Chemicals Inc	JP Morgan	228
(1.200)	Lion Corp	Bank of America		(6.100)	Mitsui Fudosan Co Ltd	HSBC	(1.919)
		Merrill Lynch	539	(3.400)	Miura Co Ltd	HSBC	27.289
(600)	Lion Corp	Barclays Bank	443	19.590	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America	
(800)	Lion Corp	Credit Suisse	218			Merrill Lynch	2.323
(3.000)	Lion Corp	Goldman Sachs	3.658	(500)	MonotaRO Co Ltd	Bank of America	
(600)	Lion Corp	JP Morgan	446			Merrill Lynch	133
9.700	Lixil Corp	Bank of America		(8.200)	MonotaRO Co Ltd	Barclays Bank	(3.515)
		Merrill Lynch	(7.432)	(2.000)	MonotaRO Co Ltd	Goldman Sachs	(2.791)
(1.100)	M3 Inc	Barclays Bank	(2.548)	(600)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America	(115)
(1.400)	Makita Corp	Goldman Sachs	(4.725)	(1.200)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Barclays Bank	(219)
3.000	Marubeni Corp	Bank of America		(400)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Goldman Sachs	(77)
		Merrill Lynch	1.240	(800)	Murata Manufacturing Co Ltd	Bank of America	
(15.700)	Marui Group Co Ltd	Barclays Bank	(14.320)			Merrill Lynch	(839)
15.500	Mazda Motor Corp	Barclays Bank	6.644	(1.800)	Murata Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	(887)
3.300	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Bank of America		(400)	Murata Manufacturing Co Ltd	Citibank	(197)
		Merrill Lynch	(2.257)	(1.300)	Murata Manufacturing Co Ltd	Credit Suisse	4.980
100	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Barclays Bank	(23)	(600)	Murata Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(629)
500	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Barclays Bank	(114)	(900)	Murata Manufacturing Co Ltd	HSBC	3.448
1.500	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Goldman Sachs	(1.026)	(1.100)	Murata Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	4.214
800	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	HSBC	(328)				
5.500	MEIJI Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	2.508				
(500)	Mercari Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(1.779)				
(300)	Mercari Inc	Barclays Bank	(438)				
(2.100)	Mercari Inc	Credit Suisse	(2.107)				
(300)	Mercari Inc	Goldman Sachs	(1.067)				
4.100	MINEBEA MITSUMI Inc	Barclays Bank	4.263				
(1.200)	MISUMI Group Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(711)				
(1.400)	MISUMI Group Inc	Barclays Bank	64				
(700)	MISUMI Group Inc	Goldman Sachs	(415)				
4.600	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Barclays Bank	(800)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
(600)	Nagoya Railroad Co Ltd	Barclays Bank	(1.029)	3.200	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Credit Suisse	1.787
(1.600)	Nagoya Railroad Co Ltd	Goldman Sachs	(102)	11.100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Goldman Sachs	8.150
300	NEC Corp	Credit Suisse	(3.393)	3.800	Nippon Telegraph & Telephone Corp	HSBC	2.686
2.400	NEC Corp	Goldman Sachs	(876)	1.900	Nippon Telegraph & Telephone Corp	JP Morgan	1.343
1.300	NEC Corp	HSBC	(14.703)	5.800	Nippon Yusen KK	Bank of America	
900	NEC Corp	JP Morgan	(10.179)	800	Nippon Yusen KK	Merrill Lynch	12.696
(1.100)	Nexon Co Ltd	Bank of America		900	Nippon Yusen KK	Citibank	(620)
		Merrill Lynch	328	1.900	Nippon Yusen KK	HSBC	821
(2.300)	Nexon Co Ltd	Barclays Bank	462	500	Nissan Chemical Corp	JP Morgan	1.733
(500)	Nexon Co Ltd	HSBC	550	(37.600)	Nissan Motor Co Ltd	Goldman Sachs	547
(700)	Nexon Co Ltd	JP Morgan	(231)			Bank of America	
5.100	NGK Insulators Ltd	Barclays Bank	(837)			Merrill Lynch	(446)
23.600	NGK Insulators Ltd	Goldman Sachs	(13.130)	(1.900)	Nissan Motor Co Ltd	Barclays Bank	(109)
2.300	NGK Spark Plug Co Ltd	Bank of America		(28.300)	Nissan Motor Co Ltd	Credit Suisse	11.176
		Merrill Lynch	1.972	(18.200)	Nissan Motor Co Ltd	Goldman Sachs	(216)
3.900	NGK Spark Plug Co Ltd	Barclays Bank	1.636	700	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America	
900	NGK Spark Plug Co Ltd	Credit Suisse	131			Merrill Lynch	(1.124)
3.600	NGK Spark Plug Co Ltd	Goldman Sachs	3.086	700	Nisshin Seifun Group Inc	HSBC	(1.277)
1.500	NGK Spark Plug Co Ltd	HSBC	219	1.100	Nisshin Seifun Group Inc	JP Morgan	(2.007)
300	NH Foods Ltd	Barclays Bank	(107)	4.800	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Credit Suisse	1.313
800	NH Foods Ltd	Goldman Sachs	(1.042)	1.200	Nitori Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(3.831)
(700)	Nidec Corp	Bank of America		1.500	Nitto Denko Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.324)			Merrill Lynch	(547)
(600)	Nidec Corp	Barclays Bank	(23)	1.200	Nitto Denko Corp	Barclays Bank	150
(100)	Nidec Corp	Citibank	(187)	300	Nitto Denko Corp	Citibank	246
(100)	Nidec Corp	Credit Suisse	(221)	500	Nitto Denko Corp	Credit Suisse	(2.463)
(400)	Nidec Corp	HSBC	(146)	2.300	Nitto Denko Corp	Goldman Sachs	(67)
(300)	Nidec Corp	JP Morgan	(372)	300	Nitto Denko Corp	HSBC	(1.478)
(1.500)	Nihon M&A Center Inc	Bank of America		8.400	Nitto Denko Corp	JP Morgan	(41.372)
		Merrill Lynch	82	2.900	Nomura Holdings Inc	Bank of America	
(1.300)	Nihon M&A Center Inc	Barclays Bank	949			Merrill Lynch	23
(5.500)	Nihon M&A Center Inc	HSBC	7.575	15.700	Nomura Holdings Inc	Barclays Bank	358
(400)	Nihon M&A Center Inc	JP Morgan	551	3.700	Nomura Holdings Inc	Goldman Sachs	655
(100)	Nintendo Co Ltd	Citibank	(2.463)	(2.300)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Barclays Bank	2.601
1.200	Nippon Express Co Ltd	Bank of America		(100)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Goldman Sachs	25
		Merrill Lynch	1.423	1.000	Nomura Research Institute Ltd	Credit Suisse	2.119
2.500	Nippon Express Co Ltd	Barclays Bank	(5.480)	35.500	NSK Ltd	Barclays Bank	324
200	Nippon Express Co Ltd	Citibank	(529)	3.200	NTT Data Corp	Bank of America	
1.300	Nippon Express Co Ltd	Goldman Sachs	1.254			Merrill Lynch	3.619
400	Nippon Express Co Ltd	HSBC	(447)	(3.100)	Obayashi Corp	HSBC	3.365
300	Nippon Express Co Ltd	JP Morgan	(465)	(4.000)	Obayashi Corp	JP Morgan	4.341
(13.000)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America		(800)	Obic Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	12.568			Merrill Lynch	(1.824)
(6.500)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(3.735)	(17.100)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	(6.862)
(6.300)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	6.091	(2.000)	Oji Holdings Corp	Barclays Bank	657
(6.600)	Nippon Sanso Holdings Corp	Bank of America		(29.700)	Oji Holdings Corp	Goldman Sachs	14.899
(3.100)	Nippon Sanso Holdings Corp	Merrill Lynch	3.853	6.500	Olympus Corp	Goldman Sachs	15.859
(2.600)	Nippon Sanso Holdings Corp	Citibank	1.810	(200)	Omnron Corp	Credit Suisse	(164)
(2.600)	Nippon Sanso Holdings Corp	Credit Suisse	(617)	10.900	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(4.474)
(2.300)	Nippon Sanso Holdings Corp	Goldman Sachs	1.343	(1.200)	Oracle Corp Japan	Goldman Sachs	3.065
(2.400)	Nippon Sanso Holdings Corp	HSBC	(569)	(1.700)	Oriental Land Co Ltd	Bank of America	
(1.100)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(15.970)
		Merrill Lynch	(6.822)	(300)	Oriental Land Co Ltd	Barclays Bank	(2.890)
(600)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Barclays Bank	(328)	(700)	Oriental Land Co Ltd	Goldman Sachs	(7.037)
(900)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Credit Suisse	(3.530)	(300)	Oriental Land Co Ltd	HSBC	(2.058)
(3.100)	Nippon Steel Corp	Barclays Bank	1.711	2.000	ORIX Corp	Barclays Bank	192
(3.900)	Nippon Steel Corp	Goldman Sachs	3.699	28.400	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America	
1.400	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(40.409)
		Merrill Lynch	1.028	9.800	Osaka Gas Co Ltd	Barclays Bank	(7.687)
16.100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Barclays Bank	1.434	600	Osaka Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(10)
900	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Citibank	94				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
	Japon suite				Japon suite		
7.200	Osaka Gas Co Ltd	HSBC	(5.617)	(8.900)	Sharp Corp	Goldman Sachs	(13.800)
600	Osaka Gas Co Ltd	JP Morgan	(493)	900	Shimadzu Corp	Barclays Bank	47
(3.600)	Otsuka Corp	Bank of America		600	Shimadzu Corp	Goldman Sachs	—
		Merrill Lynch	(3.283)	100	Shimadzu Corp	JP Morgan	(137)
(4.100)	Otsuka Corp	Goldman Sachs	(3.740)	300	Shimamura Co Ltd	Credit Suisse	(1.560)
2.800	Otsuka Holdings Co Ltd	Bank of America		(500)	Shimano Inc	Barclays Bank	(2.645)
		Merrill Lynch	2.579	10.500	Shimizu Corp	Bank of America	
400	Otsuka Holdings Co Ltd	Barclays Bank	168			Merrill Lynch	766
1.400	Otsuka Holdings Co Ltd	HSBC	1.686	5.900	Shimizu Corp	Credit Suisse	(2.045)
(8.900)	Pan Pacific International Holdings Corp			12.600	Shimizu Corp	Goldman Sachs	919
		Barclays Bank	7.306	(500)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America	
(2.800)	Pan Pacific International Holdings Corp					Merrill Lynch	(3.420)
19.000	Panasonic Corp	Goldman Sachs	26	(700)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Barclays Bank	(2.681)
		Bank of America		(200)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Citibank	(766)
		Merrill Lynch	6.585	(500)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Credit Suisse	(1.277)
5.500	Panasonic Corp	Barclays Bank	3.236	(1.000)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	(6.841)
1.000	Panasonic Corp	Citibank	588	(7.500)	Shinsei Bank Ltd	Bank of America	
900	Panasonic Corp	Credit Suisse	(357)			Merrill Lynch	(2.736)
6.600	Panasonic Corp	Goldman Sachs	2.287	(700)	Shionogi & Co Ltd	Barclays Bank	467
6.800	Panasonic Corp	HSBC	(2.698)	(2.000)	Shiseido Co Ltd	Bank of America	
3.100	Panasonic Corp	JP Morgan	(1.230)			Merrill Lynch	(4.232)
(5.700)	PeptiDream Inc	Barclays Bank	(10.658)	(3.600)	Shiseido Co Ltd	Barclays Bank	(9.982)
(800)	PeptiDream Inc	Goldman Sachs	(2.007)	(1.700)	Shiseido Co Ltd	Credit Suisse	(140)
(300)	PeptiDream Inc	HSBC	(711)	(300)	Shiseido Co Ltd	Goldman Sachs	(635)
800	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America		(1.200)	Shiseido Co Ltd	HSBC	(99)
		Merrill Lynch	628	2.500	Shizuoka Bank Ltd	Bank of America	
1.400	Persol Holdings Co Ltd	Citibank	38			Merrill Lynch	(958)
200	Persol Holdings Co Ltd	JP Morgan	(78)	2.500	Shizuoka Bank Ltd	Barclays Bank	(980)
(400)	Pigeon Corp	Barclays Bank	353	1.400	Shizuoka Bank Ltd	Citibank	(549)
(10.300)	Pigeon Corp	Goldman Sachs	34.289	5.900	Shizuoka Bank Ltd	HSBC	—
3.000	Pola Orbis Holdings Inc	Barclays Bank	(383)	(400)	SMC Corp	Bank of America	
(2.200)	Rakuten Group Inc	Barclays Bank	482			Merrill Lynch	(15.432)
(1.200)	Rakuten Group Inc	Credit Suisse	865	(100)	SMC Corp	JP Morgan	(264)
(23.800)	Rakuten Group Inc	Goldman Sachs	15.846	(4.800)	SoftBank Corp	Barclays Bank	285
600	Recruit Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	4.203	(4.700)	SoftBank Corp	Goldman Sachs	943
(2.700)	Renesas Electronics Corp	Goldman Sachs	1.330	(1.100)	SoftBank Group Corp	Barclays Bank	592
(7.600)	Resona Holdings Inc	Goldman Sachs	354	(1.800)	SoftBank Group Corp	HSBC	31.423
11.600	Ricoh Co Ltd	Barclays Bank	1.693	400	Sohgo Security Services Co Ltd	Bank of America	
100	Rinnai Corp	Credit Suisse	(20)			Merrill Lynch	(146)
400	Rohm Co Ltd	Citibank	1.678	300	Sohgo Security Services Co Ltd	Goldman Sachs	(25)
(600)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Bank of America		(3.600)	Sompo Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.740)
		Merrill Lynch	684	(800)	Sompo Holdings Inc	HSBC	(1.087)
(1.900)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Barclays Bank	1.646	600	Sony Group Corp	Bank of America	
(7.000)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Goldman Sachs	7.981			Merrill Lynch	2.490
16.000	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	2.335	4.200	Sony Group Corp	Barclays Bank	10.534
		Goldman Sachs	(399)	200	Sony Group Corp	Citibank	502
(1.900)	SBI Holdings Inc	HSBC	13.881	300	Sony Group Corp	Credit Suisse	14
(5.700)	SBI Holdings Inc	Barclays Bank	(2.298)	200	Sony Group Corp	Goldman Sachs	830
(2.100)	SCSK Corp	Bank of America		1.200	Sony Group Corp	HSBC	55
1.300	Secom Co Ltd	Merrill Lynch	(344)	(1.400)	Square Enix Holdings Co Ltd	Barclays Bank	1.149
300	Secom Co Ltd	Citibank	47				
300	Secom Co Ltd	Credit Suisse	(2.044)	(200)	Square Enix Holdings Co Ltd	Credit Suisse	235
700	Secom Co Ltd	Goldman Sachs	(185)	(400)	Square Enix Holdings Co Ltd	HSBC	1.022
200	Secom Co Ltd	HSBC	(1.363)	5.600	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America	
300	Secom Co Ltd	JP Morgan	(2.044)			Merrill Lynch	12.769
9.200	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America		100	Stanley Electric Co Ltd	JP Morgan	59
		Merrill Lynch	503	600	Subaru Corp	Bank of America	
4.000	Sega Sammy Holdings Inc	Barclays Bank	(876)			Merrill Lynch	351
7.700	Sega Sammy Holdings Inc	Goldman Sachs	421	4.500	Subaru Corp	Barclays Bank	2.770
(1.000)	Seibu Holdings Inc	Bank of America		8.900	Subaru Corp	Goldman Sachs	6.413
		Merrill Lynch	(921)	(1.900)	SUMCO Corp	Bank of America	
(10.400)	Seibu Holdings Inc	Barclays Bank	(9.391)			Merrill Lynch	(1.594)
(2.500)	Seibu Holdings Inc	Citibank	(2.257)	(700)	SUMCO Corp	Barclays Bank	(830)
(3.800)	Seibu Holdings Inc	Credit Suisse	(3.431)	(5.800)	SUMCO Corp	Citibank	(6.877)
(3.100)	Seibu Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.856)	(4.900)	SUMCO Corp	Credit Suisse	4.827
13.800	Seiko Epson Corp	Barclays Bank	629	(1.800)	SUMCO Corp	Goldman Sachs	(1.510)
35.800	Sekisui Chemical Co Ltd	Credit Suisse	(45.387)	(17.500)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Barclays Bank	(479)
28.500	Sekisui House Ltd	HSBC	(10.398)				
(2.300)	SG Holdings Co Ltd	HSBC	1.217				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
(24.600)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	(4.487)	(14.700)	Tobu Railway Co Ltd	Barclays Bank	(2.950)
(18.300)	Sumitomo Corp	Goldman Sachs	(3.505)	(200)	Tobu Railway Co Ltd	Goldman Sachs	182
(1.300)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(688)	(12.100)	Toho Co Ltd	HSBC	(13.795)
(1.400)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Citibank	702	(1.000)	Tokio Marine Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.426
(1.400)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Credit Suisse	(1.686)	(500)	Tokio Marine Holdings Inc	Citibank	451
(4.200)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.950)	(2.500)	Tokio Marine Holdings Inc	Goldman Sachs	6.065
(4.900)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Barclays Bank	(2.302)	(300)	Tokio Marine Holdings Inc	HSBC	802
(2.000)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Credit Suisse	(784)	(2.100)	Tokio Marine Holdings Inc	JP Morgan	5.612
(500)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Barclays Bank	(141)	(3.200)	Tokyo Century Corp	Goldman Sachs	876
(300)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Credit Suisse	(692)	200	Tokyo Electron Ltd	Barclays Bank	4.743
(800)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Goldman Sachs	(1.561)	3.400	Tokyo Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.869)
10.600	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Credit Suisse	(1.837)	14.700	Tokyo Gas Co Ltd	Barclays Bank	(7.843)
700	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(645)	900	Tokyo Gas Co Ltd	Citibank	(480)
500	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Barclays Bank	(305)	900	Tokyo Gas Co Ltd	Credit Suisse	(1.379)
300	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Credit Suisse	23	3.600	Tokyo Gas Co Ltd	HSBC	(5.516)
600	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Goldman Sachs	(236)	1.100	Tokyo Gas Co Ltd	JP Morgan	(1.686)
(1.000)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Barclays Bank	(55)	(7.900)	Tokyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(648)
12.700	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.371)	(7.500)	Tokyu Corp	Barclays Bank	(2.736)
(3.400)	Suzuken Co Ltd	Goldman Sachs	3.411	(3.900)	Tokyu Corp	Credit Suisse	(213)
700	Suzuki Motor Corp	Barclays Bank	990	(2.300)	Tokyu Corp	Goldman Sachs	(189)
700	Sysmex Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.895	(1.400)	Tokyu Corp	JP Morgan	(77)
600	Sysmex Corp	Citibank	2.599	(28.400)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	HSBC	(1.813)
100	Sysmex Corp	Credit Suisse	—	11.900	Toppa Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9.551
200	Sysmex Corp	HSBC	—	2.800	Toppa Printing Co Ltd	Barclays Bank	409
1.900	T&D Holdings Inc	Goldman Sachs	1.456	1.300	Toppa Printing Co Ltd	Goldman Sachs	1.043
15.300	Taiheiyō Cement Corp	Goldman Sachs	(9.768)	1.400	Toppa Printing Co Ltd	JP Morgan	(447)
5.600	Taisei Corp	Barclays Bank	(6.895)	2.100	Toray Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	500
800	Taisei Corp	Credit Suisse	(2.992)	2.100	Toray Industries Inc	Barclays Bank	86
1.500	Taisei Corp	Goldman Sachs	(752)	69.800	Toray Industries Inc	Goldman Sachs	16.616
5.800	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Barclays Bank Bank of America Merrill Lynch	(4.761)	(1.400)	Toshiba Corp	HSBC	(1.022)
(600)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	268	2.500	Tosoh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.147)
(5.200)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	2.039	2.400	Tosoh Corp	Goldman Sachs	(3.021)
(4.700)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	1.843	2.100	Tosoh Corp	HSBC	(2.394)
(27.800)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	12.424	4.500	TOTO Ltd	Barclays Bank	9.440
(1.200)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	120	8.900	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	—
400	TDK Corp	Citibank	219	19.600	Toyoda Gosei Co Ltd	Goldman Sachs	19.843
700	TDK Corp	Goldman Sachs	3.192	(600)	Toyota Industries Corp	Goldman Sachs	(284)
1.000	TDK Corp	HSBC	(8.026)	(1.100)	Toyota Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.250)
18.100	Teijin Ltd	Credit Suisse	(17.994)	(400)	Toyota Motor Corp	Credit Suisse	(2.222)
8.200	Teijin Ltd	HSBC	(8.152)	(600)	Toyota Motor Corp	Goldman Sachs	(2.556)
29.100	Teijin Ltd	JP Morgan	(28.930)	400	Toyota Tsusho Corp	Bank of America Merrill Lynch	91
4.300	Terumo Corp	Barclays Bank	3.216	600	Toyota Tsusho Corp	Citibank	(575)
(1.400)	THK Co Ltd	Credit Suisse	4.022	300	Toyota Tsusho Corp	Credit Suisse	(561)
(1.700)	TIS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.031)	800	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.532
(8.000)	TIS Inc	HSBC	(9.777)	200	Trend Micro Inc	Barclays Bank	—
(3.500)	Tobu Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.192	500	Tsuruha Holdings Inc	Barclays Bank	775
				(3.300)	Unicharm Corp	Barclays Bank	8.698
				(1.100)	Unicharm Corp	HSBC	(692)
				(3.000)	USS Co Ltd	Barclays Bank	(1.067)
				(3.300)	USS Co Ltd	Credit Suisse	2.619
				(300)	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	123
				(1.200)	Welcia Holdings Co Ltd	Barclays Bank	219
				(1.900)	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(2.409)
				(900)	West Japan Railway Co	Barclays Bank	(804)
				(300)	West Japan Railway Co	Credit Suisse	(25)
				(1.900)	West Japan Railway Co	Goldman Sachs	(2.409)
				1.700	Yakult Honsha Co Ltd	Barclays Bank	1.240

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Suède suite				Suède suite			
13.499	Electrolux AB 'B'	Deutsche Bank	(7.651)	(2.576)	Svenska Cellulosa AB		
3.257	Electrolux AB 'B'	Goldman Sachs	(1.846)		SCA 'B'	Credit Suisse	1.663
1.447	Electrolux AB 'B'	HSBC	(297)	(24.539)	Svenska Cellulosa AB		
1.438	Electrolux AB 'B'	JP Morgan	(295)		SCA 'B'	Deutsche Bank	23.572
(2.814)	EQT AB	Deutsche Bank	(12.217)	(13.641)	Svenska Cellulosa AB		
(3.292)	Essity AB 'B'	Bank of America			SCA 'B'	Goldman Sachs	14.724
		Merrill Lynch	2.025	(3.659)	Svenska Handelsbanken		
(1.216)	Essity AB 'B'	Barclays Bank	1.874		AB 'A'	Barclays Bank	1.995
(1.961)	Essity AB 'B'	Credit Suisse	1.508	1.554	Swedbank AB 'A'	Goldman Sachs	(457)
(8.727)	Essity AB 'B'	Deutsche Bank	4.797	6.499	Tele2 AB 'B'	Deutsche Bank	1.058
(333)	Essity AB 'B'	Goldman Sachs	205	10.853	Telefonaktiebolaget LM		
(304)	Essity AB 'B'	HSBC	70		Ericsson 'B'	Barclays Bank	(2.120)
(123)	Evolution AB	Barclays Bank	(1.602)	15.312	Telefonaktiebolaget LM		
(91)	Evolution AB	Credit Suisse	(11)		Ericsson 'B'	Deutsche Bank	(28)
(157)	Evolution AB	Deutsche Bank	(3.683)	14.867	Telia Co AB	Barclays Bank	(1.981)
(736)	Fastighets AB Balder	Bank of America		5.806	Telia Co AB	Credit Suisse	(484)
		Merrill Lynch	(2.024)	67.948	Telia Co AB	Deutsche Bank	(3.655)
(1.618)	Fastighets AB Balder	Deutsche Bank	(4.449)	14.980	Telia Co AB	Goldman Sachs	(587)
(745)	Fastighets AB Balder	Goldman Sachs	(2.049)	4.934	Telia Co AB	HSBC	62
(172)	Fastighets AB Balder	JP Morgan	(452)	7.887	Telia Co AB	JP Morgan	100
(9.070)	H & M Hennes & Mauritz AB 'B'	Deutsche Bank	(1.149)	(1.143)	Volvo AB 'B'	Bank of America	
		Credit Suisse	(10.348)			Merrill Lynch	62
(20.055)	Hexagon AB 'B'	Deutsche Bank	(1.024)	(471)	Volvo AB 'B'	Deutsche Bank	26
(1.697)	Hexagon AB 'B'	Goldman Sachs	1.274				5.463
(4.788)	Hexagon AB 'B'	HSBC	(5.411)	Suisse			
(10.486)	Hexagon AB 'B'	Barclays Bank	12.120	(12.418)	ABB Ltd Reg	Barclays Bank	(8.137)
27.533	Husqvarna AB 'B'	Deutsche Bank	1.182	(1.130)	ABB Ltd Reg	Citibank	(740)
5.765	Husqvarna AB 'B'	Barclays Bank	2.199	(994)	ABB Ltd Reg	HSBC	(431)
(8.681)	ICA Gruppen AB	Deutsche Bank	(2.084)	3.082	Adecco Group AG Reg	Bank of America	
(768)	Investment AB Latour 'B'	Goldman Sachs	(64.971)		820 Adecco Group AG Reg	Merrill Lynch	5.390
(23.944)	Investment AB Latour 'B'	Deutsche Bank	1.149	405	Adecco Group AG Reg	Barclays Bank	903
1.550	Investor AB 'B'	JP Morgan	25.239	1.082	Adecco Group AG Reg	Citibank	504
26.160	Investor AB 'B'	Bank of America		2.670	Adecco Group AG Reg	Goldman Sachs	1.789
496	Kinnevik AB	Merrill Lynch	9.451	2.670	Adecco Group AG Reg	JP Morgan	2.847
		Citibank	(331)	(1.711)	Alcon Inc	Goldman Sachs	(1.558)
686	Kinnevik AB	Deutsche Bank	25.362	374	Baloise Holding AG Reg	Bank of America	
1.331	Kinnevik AB	Bank of America				Merrill Lynch	(665)
496	Kinnevik AB 'B'	Merrill Lynch	3.670	527	Baloise Holding AG Reg	Barclays Bank	1.756
		Citibank	3.342	418	Baloise Holding AG Reg	Citibank	1.393
686	Kinnevik AB 'B'	Deutsche Bank	9.848	403	Baloise Holding AG Reg	HSBC	(1.164)
1.331	Kinnevik AB 'B'			(1.187)	Banque Cantonale Vaudoise Reg	Bank of America	
(1.724)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Barclays Bank	(6.487)	(4.777)	Banque Cantonale Vaudoise Reg	Merrill Lynch	4.482
(2.653)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Deutsche Bank	(12.318)		230 Banque Cantonale Vaudoise Reg	Barclays Bank	3.714
299	Lundin Energy AB	Bank of America	79		(146) Barry Callebaut AG Reg	Deutsche Bank	(868)
		Merrill Lynch	9.894	(24)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Barclays Bank	(6.161)
11.555	Lundin Energy AB	Barclays Bank	359	(16.806)	Clariant AG Reg	Citibank	(2.665)
444	Lundin Energy AB	Credit Suisse	784			Bank of America	
2.955	Lundin Energy AB	Deutsche Bank	1	2.040	Credit Suisse Group AG	Merrill Lynch	(2.520)
(2)	NCC AB 'B'	Credit Suisse	12.259	(913)	Credit Suisse Group AG Reg	Barclays Bank	—
40.989	Nordea Bank Abp	Deutsche Bank	(369)	(7.489)	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America	(9)
(2.040)	Sandvik AB	Barclays Bank	(138)	(3.764)	Credit Suisse Group AG Reg	Barclays Bank	(1.697)
(761)	Sandvik AB	Citibank	4.463	(3.759)	Credit Suisse Group AG Reg	Citibank	(853)
(4.459)	Sandvik AB	Deutsche Bank	565	(6.542)	Credit Suisse Group AG Reg	Goldman Sachs	(1.456)
(564)	Sandvik AB	Goldman Sachs	4.601	(1.154)	Credit Suisse Group AG Reg	HSBC	(4.882)
(4.653)	Securitas AB 'B'	Deutsche Bank	(590)	(265)	EMS-Chemie Holding AG Reg	JP Morgan	(494)
1.813	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Deutsche Bank	(473)	(87)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Barclays Bank	(5.445)
912	Skanska AB 'B'	Bank of America	(3.317)			Barclays Bank	(5.445)
		Merrill Lynch	(830)			Citibank	(1.787)
6.876	Skanska AB 'B'	Barclays Bank	(2.892)				
1.251	Skanska AB 'B'	Credit Suisse	(407)				
5.577	Skanska AB 'B'	Deutsche Bank	(480)				
613	Skanska AB 'B'	HSBC	76				
(663)	SKF AB 'B'	Barclays Bank	322				
(983)	SKF AB 'B'	Deutsche Bank					
(1.179)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Bank of America					
		Merrill Lynch					

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Suisse suite				Suisse suite			
(170)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Credit Suisse	1.510	546	Swiss Re AG	Goldman Sachs	(728)
(4)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Goldman Sachs	(169)	878	Swisscom AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1.365
242	Geberit AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	7.090	(1.104)	Temenos AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(8.031)
45	Geberit AG Reg	Barclays Bank	470	(85)	Temenos AG Reg	Barclays Bank	(217)
16	Geberit AG Reg	Citibank	147	(69)	Temenos AG Reg	Goldman Sachs	(502)
7	Givaudan SA Reg	JP Morgan	(118)	5.736	UBS Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	4.236
760	Holcim Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(304)	14.739	UBS Group AG Reg	Barclays Bank	3.928
5.454	Holcim Ltd	Barclays Bank	1.211	1.244	UBS Group AG Reg	Credit Suisse	774
4.003	Holcim Ltd	Credit Suisse	(6.846)	5.286	UBS Group AG Reg	Goldman Sachs	3.904
392	Holcim Ltd	Goldman Sachs	(157)	2.314	UBS Group AG Reg	HSBC	1.439
462	Holcim Ltd	HSBC	(790)	(2.782)	Vifor Pharma AG	Bank of America Merrill Lynch	(16.335)
170	Holcim Ltd	JP Morgan	(291)	(2.419)	Vifor Pharma AG	Barclays Bank	(12.098)
201	Julius Baer Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	464	(150)	Vifor Pharma AG	Citibank	(808)
205	Julius Baer Group Ltd	Barclays Bank	310	(168)	Vifor Pharma AG	Credit Suisse	(699)
157	Julius Baer Group Ltd	Credit Suisse	729	(902)	Vifor Pharma AG	Goldman Sachs	(5.434)
580	Julius Baer Group Ltd	Goldman Sachs	1.225	622	Zurich Insurance Group AG	Barclays Bank	1.658
1.740	Kuehne + Nagel International AG Reg	Barclays Bank	13.527				56.251
1.918	Logitech International SA Reg	Barclays Bank	17.999	Taiwan			
164	Logitech International SA Reg	Citibank	1.539	(415)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(22)
297	Logitech International SA Reg	Credit Suisse	4.542				(22)
308	Logitech International SA Reg	Goldman Sachs	5.764	Royaume-Uni			
1.159	Logitech International SA Reg	HSBC	17.724	2.349	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	699
(329)	Lonza Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(5.408)	8.501	3i Group Plc	Barclays Bank	(1.205)
(17)	Lonza Group AG Reg	Barclays Bank	(102)	4.995	3i Group Plc	Citibank	(708)
(33)	Lonza Group AG Reg	Citibank	(198)	12.367	3i Group Plc	Deutsche Bank	3.680
(390)	Lonza Group AG Reg	Goldman Sachs	(6.410)	1.210	3i Group Plc	Goldman Sachs	360
(22)	Lonza Group AG Reg	HSBC	(411)	6.043	3i Group Plc	HSBC	814
1.526	Nestle SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	1.546	(1.250)	Admiral Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	159
146	Nestle SA Reg	HSBC	321	(6.572)	Admiral Group Plc	Barclays Bank	(2.887)
161	Nestle SA Reg	JP Morgan	354	(3.326)	Admiral Group Plc	Deutsche Bank	424
3.716	Novartis AG Reg	Credit Suisse	(1.527)	(4.619)	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	10.309
3.511	Novartis AG Reg	JP Morgan	(1.443)	(238)	Antofagasta Plc	Barclays Bank	(66)
(103)	Partners Group Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(10.123)	(10.811)	Antofagasta Plc	Deutsche Bank	18.538
97	Roche Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	937	(638)	Antofagasta Plc	Goldman Sachs	1.424
102	Roche Holding AG	Barclays Bank	125	236	Ashtead Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	575
1.270	Roche Holding AG	Credit Suisse	16.431	184	Ashtead Group Plc	Citibank	130
(616)	Schindler Holding AG	Barclays Bank	(2.668)	910	Ashtead Group Plc	Deutsche Bank	2.218
51	SGS SA Reg	Goldman Sachs	4.644	337	Ashtead Group Plc	Goldman Sachs	821
(1.053)	Sika AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(17.424)	(1.452)	Associated British Foods Plc	Barclays Bank	185
(63)	Sika AG Reg	Barclays Bank	(231)	(972)	Associated British Foods Plc	Deutsche Bank	(606)
662	Sonova Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	45.655	(1.043)	Associated British Foods Plc	Goldman Sachs	(650)
25	Straumann Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	2.224	(289)	AstraZeneca Plc	Barclays Bank	426
52	Straumann Holding AG Reg	Barclays Bank	1.863	(2.303)	AstraZeneca Plc	Deutsche Bank	(4.928)
10	Straumann Holding AG Reg	Citibank	383	(147)	AstraZeneca Plc	JP Morgan	(685)
9	Straumann Holding AG Reg	Goldman Sachs	855	27.801	Auto Trader Group Plc	Barclays Bank	(2.442)
45	Straumann Holding AG Reg	HSBC	2.524	2.023	Auto Trader Group Plc	Citibank	(178)
262	Swiss Life Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1.804	8.633	Auto Trader Group Plc	Goldman Sachs	1.713
508	Swiss Life Holding AG Reg	Goldman Sachs	3.498	(834)	AVEVA Group Plc	Barclays Bank	(2.647)
69	Swiss Life Holding AG Reg	JP Morgan	452	(9.038)	AVEVA Group Plc	Deutsche Bank	(32.092)
521	Swiss Re AG	Bank of America Merrill Lynch	(694)	(643)	AVEVA Group Plc	Goldman Sachs	(2.824)
				(354)	AVEVA Group Plc	JP Morgan	(1.244)
				43.143	Aviva Plc	Barclays Bank	3.362
				2.737	Aviva Plc	Credit Suisse	(78)
				30.378	Aviva Plc	Deutsche Bank	1.937
				8.551	Aviva Plc	Goldman Sachs	545
				(53.727)	Barclays Plc	Deutsche Bank	(2.954)
				937	Barratt Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	98
				15.614	Barratt Developments Plc	Barclays Bank	1.253

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
2.480	Barratt Developments Plc	Citibank	155	(42.418)	HSBC Holdings Plc	Deutsche Bank	(7.153)
11.693	Barratt Developments Plc	Deutsche Bank	(497)	(1.789)	Informa Plc	Bank of America	
1.289	Barratt Developments Plc	HSBC	(453)			Merrill Lynch	117
925	Barratt Developments Plc	JP Morgan	(325)	(4.506)	Informa Plc	Citibank	(359)
(85.926)	Barrick Gold Corp	HSBC	71.715	(15.677)	Informa Plc	Deutsche Bank	1.022
310	Berkeley Group Holdings Plc	Barclays Bank	206	(1.263)	Informa Plc	Goldman Sachs	82
1.016	Berkeley Group Holdings Plc	Deutsche Bank	144	(5.463)	InterContinental Hotels Group Plc	Deutsche Bank	(3.483)
233	Berkeley Group Holdings Plc	Goldman Sachs	33	(1.197)	InterContinental Hotels Group Plc	Goldman Sachs	(763)
5.184	BP Plc	Barclays Bank	(753)	3.719	Intertek Group Plc	Deutsche Bank	(19.831)
2.396	BP Plc	Credit Suisse	(324)	484	Intertek Group Plc	Goldman Sachs	(2.316)
15.946	BP Plc	Deutsche Bank	(2.090)	293	Intertek Group Plc	HSBC	(2.308)
(24.684)	BT Group Plc	Deutsche Bank	(3.026)	493	Intertek Group Plc	JP Morgan	(3.884)
561	Bunzl Plc	Barclays Bank	(24)	9.065	J Sainsbury Plc	Deutsche Bank	105
3.469	Bunzl Plc	Goldman Sachs	(1.720)	6.366	J Sainsbury Plc	Goldman Sachs	99
1.747	Burberry Group Plc	Barclays Bank	593	8.630	JD Sports Fashion Plc	Barclays Bank	3.889
476	Burberry Group Plc	Deutsche Bank	(46)	533	Johnson Matthey Plc	Bank of America	
1.066	Coca-Cola HBC AG	Barclays Bank	277	1.092	Johnson Matthey Plc	Merrill Lynch	(1.201)
8.672	Coca-Cola HBC AG	Deutsche Bank	7.990	55.501	Kingfisher Plc	Barclays Bank	(2.383)
(781)	Compass Group Plc	Barclays Bank	(288)	3.449	Legal & General Group Plc	Deutsche Bank	(6.097)
(568)	Compass Group Plc	Deutsche Bank	(749)	3.710	Legal & General Group Plc	Barclays Bank	48
(3.097)	Compass Group Plc	Goldman Sachs	(4.081)	52.390	Legal & General Group Plc	Citibank	311
(1.041)	Croda International Plc	Barclays Bank	(1.918)	(1.529)	London Stock Exchange Group Plc	Deutsche Bank	3.188
(1.118)	Croda International Plc	Deutsche Bank	(5.565)	(478)	London Stock Exchange Group Plc	Bank of America	
505	DCC Plc	Deutsche Bank	(773)	(932)	London Stock Exchange Group Plc	Merrill Lynch	(8.580)
(207)	Diageo Plc	Barclays Bank	(41)	(1.164)	London Stock Exchange Group Plc	Barclays Bank	(230)
(242)	Diageo Plc	Deutsche Bank	(147)	(206)	London Stock Exchange Group Plc	Citibank	(449)
(4.063)	Direct Line Insurance Group Plc	Barclays Bank	(288)	3.339	M&G Plc	Deutsche Bank	(6.532)
(5.746)	Direct Line Insurance Group Plc	Credit Suisse	(277)	3.413	M&G Plc	HSBC	(1.454)
(4.005)	Direct Line Insurance Group Plc	Deutsche Bank	(250)	24.511	M&G Plc	Citibank	284
2.642	Entain Plc	Barclays Bank	1.310	8.880	M&G Plc	Credit Suisse	1.108
1.073	Entain Plc	Deutsche Bank	1.513	3.754	M&G Plc	Deutsche Bank	2.779
9.336	Evraz Plc	Bank of America		(32.246)	Melrose Industries Plc	Goldman Sachs	1.007
3.899	Evraz Plc	Merrill Lynch	(5.053)	(10.279)	Melrose Industries Plc	JP Morgan	1.218
3.757	Evraz Plc	Barclays Bank	(1.558)	(4.322)	Melrose Industries Plc	Barclays Bank	(4.272)
(128)	Experian Plc	Deutsche Bank	(2.034)	365	Mondi Plc	Deutsche Bank	(1.612)
(1.935)	Experian Plc	Barclays Bank	51	876	Mondi Plc	Goldman Sachs	(594)
644	Ferguson Plc	Deutsche Bank	(1.837)	5.876	Mondi Plc	Bank of America	
365	Ferguson Plc	Bank of America		1.345	Mondi Plc	Merrill Lynch	(153)
579	Ferguson Plc	Merrill Lynch	3.541	(5.793)	National Grid Plc	Barclays Bank	(168)
3.591	Ferguson Plc	Barclays Bank	(724)	(1.934)	National Grid Plc	Deutsche Bank	(222)
135	Ferguson Plc	Deutsche Bank	1.331	(25.680)	Natwest Group Plc	Barclays Bank	(1.492)
(1.053)	Fresnillo Plc	HSBC	7.429	318	Next Plc	Barclays Bank	324
(6.392)	Fresnillo Plc	JP Morgan	(109)	80	Next Plc	Deutsche Bank	86
(6.299)	Fresnillo Plc	Credit Suisse	337	1.219	Next Plc	HSBC	(2.798)
(4.859)	GlaxoSmithKline Plc	Deutsche Bank	1.648	(2.783)	Ocado Group Plc	Bank of America	
(2.917)	GlaxoSmithKline Plc	Goldman Sachs	1.624	(3.043)	Ocado Group Plc	Merrill Lynch	3.037
(37.435)	Glencore Plc	Credit Suisse	(836)	(771)	Ocado Group Plc	Barclays Bank	3.169
(5.430)	Glencore Plc	Deutsche Bank	(1.720)	(8.462)	Ocado Group Plc	Credit Suisse	901
(15.029)	Glencore Plc	Deutsche Bank	(1.720)	(725)	Ocado Group Plc	Deutsche Bank	9.233
(2.457)	Glencore Plc	Goldman Sachs	(530)	(1.657)	Ocado Group Plc	HSBC	848
(5.090)	Halma Plc	Bank of America		2.496	Pearson Plc	Barclays Bank	657
(2.586)	Halma Plc	Merrill Lynch	(8.944)	641	Persimmon Plc	Bank of America	
(399)	Halma Plc	Barclays Bank	(1.283)	553	Persimmon Plc	Merrill Lynch	1.839
(3.880)	Halma Plc	Credit Suisse	(243)	512	Persimmon Plc	Barclays Bank	817
(736)	Halma Plc	Deutsche Bank	(6.817)	3.290	Persimmon Plc	Citibank	705
(1.438)	Hargreaves Lansdown Plc	Goldman Sachs	(1.293)	347	Persimmon Plc	Credit Suisse	(152)
(8.044)	Hargreaves Lansdown Plc	Deutsche Bank	289	227	Persimmon Plc	Deutsche Bank	2.424
(439)	Hikma Pharmaceuticals Plc	HSBC	13.108		Persimmon Plc	HSBC	(103)
(3.194)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Bank of America			Persimmon Plc	JP Morgan	(68)
		Merrill Lynch	(373)				
		Barclays Bank	2.082				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
4.031	Phoenix Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	343	(4.564)	Wm Morrison Supermarkets Plc	HSBC	401
1.004	Phoenix Group Holdings Plc	Credit Suisse	51	1.428	WPP Plc	Bank of America Merrill Lynch	49
11.670	Phoenix Group Holdings Plc	Deutsche Bank	992	6.482	WPP Plc	Barclays Bank	(1.056)
1.640	Phoenix Group Holdings Plc	JP Morgan	84	3.251	WPP Plc	Citibank	(645)
(2.734)	Prudential Plc	Bank of America Merrill Lynch	(213)	4.392	WPP Plc	Credit Suisse	(1.083)
(1.884)	Prudential Plc	Barclays Bank	133	41.964	WPP Plc	Deutsche Bank	1.402
(417)	Prudential Plc	Deutsche Bank	(32)	3.777	WPP Plc	Goldman Sachs	128
(1.366)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(116)	5.184	WPP Plc	HSBC	(1.278)
(1.644)	Reckitt Benckiser Group Plc	Barclays Bank	2.749	2.687	WPP Plc	JP Morgan	(662)
(2.453)	Reed Elsevier Plc	Barclays Bank	1.564				
4.483	Rentokil Initial Plc	Deutsche Bank	337		États-Unis		
933	Rentokil Initial Plc	Goldman Sachs	70	(116)	10X Genomics Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4.196)
1.819	Rio Tinto Plc	Barclays Bank	1.856	(451)	10X Genomics Inc 'A'	Barclays Bank	(6.237)
(75.710)	Rolls-Royce Holdings Plc	Deutsche Bank	(3.669)	(243)	3M Co	Bank of America Merrill Lynch	503
(29.568)	Rolls-Royce Holdings Plc	Goldman Sachs	(1.693)	(392)	3M Co	Barclays Bank	(42)
(35.470)	Rolls-Royce Holdings Plc	HSBC	1.337	(97)	3M Co	Goldman Sachs	201
(12.714)	Rolls-Royce Holdings Plc	JP Morgan	479	(108)	3M Co	HSBC	463
2.067	RSA Insurance Group LTD	Deutsche Bank	(5)	335	A O Smith Corp	Bank of America Merrill Lynch	67
3.979	Sage Group Plc	Citibank	(823)	359	A O Smith Corp	Barclays Bank	679
1.169	Sage Group Plc	Deutsche Bank	(236)	1.416	A O Smith Corp	Credit Suisse	(1.671)
1.720	Sage Group Plc	JP Morgan	609	747	A O Smith Corp	Goldman Sachs	149
4.595	Schroders Plc	Deutsche Bank	1.432	(276)	Abbott Laboratories	Bank of America Merrill Lynch	25
299	Severn Trent Plc	Deutsche Bank	(201)	(921)	Abbott Laboratories	Barclays Bank	589
423	Severn Trent Plc	JP Morgan	(270)	(350)	Abbott Laboratories	Citibank	224
(2.227)	Smith & Nephew Plc	Deutsche Bank	(757)	(103)	Abbott Laboratories	Credit Suisse	236
(1.302)	Smiths Group Plc	Deutsche Bank	(175)	(514)	Abbott Laboratories	Goldman Sachs	46
(959)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Barclays Bank	(3.737)	(75)	Abbott Laboratories	HSBC	172
1.468	SSE Plc	Barclays Bank	146	(335)	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	943
6.736	SSE Plc	Deutsche Bank	2.100	(460)	AbbVie Inc	Barclays Bank	931
(1.548)	St James's Place Plc	Deutsche Bank	(855)	(198)	AbbVie Inc	Credit Suisse	365
(580)	St James's Place Plc	Goldman Sachs	(321)	(481)	AbbVie Inc	Goldman Sachs	1.775
(2.093)	Standard Chartered Plc	Barclays Bank	(53)	(178)	AbbVie Inc	HSBC	209
(13.028)	Standard Chartered Plc	Deutsche Bank	(1.772)	464	ABIOMED Inc	Barclays Bank	2.320
4.874	Standard Life Aberdeen Plc	Bank of America Merrill Lynch	490	235	ABIOMED Inc	Goldman Sachs	3.908
3.673	Standard Life Aberdeen Plc	Barclays Bank	312	378	Accenture Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.830)
1.867	Standard Life Aberdeen Plc	Credit Suisse	(40)	2.691	Accenture Plc 'A'	Barclays Bank	(7.239)
118	Standard Life Aberdeen Plc	JP Morgan	(3)	61	Accenture Plc 'A'	Citibank	(164)
(26.397)	Taylor Wimpey Plc	Deutsche Bank	1.590	382	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	(1.849)
(446)	Unilever Plc	Bank of America Merrill Lynch	531	30	Accenture Plc 'A'	HSBC	(254)
(11.717)	Unilever Plc	Deutsche Bank	13.947	81	Accenture Plc 'A'	JP Morgan	(684)
(1.508)	Unilever Plc	Goldman Sachs	1.795	577	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs	2.856
3.686	United Utilities Group Plc	Barclays Bank	(525)	461	Adobe Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.068
868	United Utilities Group Plc	Citibank	(74)	647	Adobe Inc	Barclays Bank	4.367
9.014	United Utilities Group Plc	Deutsche Bank	8	64	Adobe Inc	Citibank	315
1.573	United Utilities Group Plc	HSBC	(98)	762	Adobe Inc	Credit Suisse	18.759
26.592	Vodafone Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.049)	156	Adobe Inc	Goldman Sachs	3.407
142.513	Vodafone Group Plc	Deutsche Bank	(27.060)	61	Adobe Inc	HSBC	1.537
19.676	Vodafone Group Plc	Goldman Sachs	(3.736)	47	Adobe Inc	JP Morgan	1.184
8.193	Vodafone Group Plc	HSBC	(1.639)	92	Advance Auto Parts Inc	Barclays Bank	(85)
(2.060)	Whitbread Plc	Barclays Bank	(934)	81	Advance Auto Parts Inc	Citibank	(75)
(1.610)	Whitbread Plc	Deutsche Bank	(2.213)	23	Advance Auto Parts Inc	HSBC	(434)
(23.406)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.288	(125)	Advanced Micro Devices Inc	Barclays Bank	(330)
(8.042)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Barclays Bank	285	(531)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	(2.883)
(5.415)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Citibank	192	(282)	Advanced Micro Devices Inc	HSBC	(1.153)
(20.594)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Credit Suisse	1.809	116	Aflac Inc	Bank of America Merrill Lynch	30
(227.574)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Deutsche Bank	21.273	8.425	Aflac Inc	Citibank	2.612
(15.002)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Goldman Sachs	1.467	115	Aflac Inc	Goldman Sachs	30
				1.375	Agilent Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.801

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
824	Agilent Technologies Inc	Barclays Bank	3.032	6	Alphabet Inc 'C'	Barclays Bank	29
148	Agilent Technologies Inc	Citibank	592	7	Alphabet Inc 'C'	Credit Suisse	489
323	Agilent Technologies Inc	Credit Suisse	2.378	19	Alphabet Inc 'C'	Goldman Sachs	1.713
1.014	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs	8.132	610	Altice USA Inc 'A'	Barclays Bank	(702)
924	Agilent Technologies Inc	HSBC	5.602	13	Amazon.com Inc	Bank of America	
628	Agilent Technologies Inc	JP Morgan	3.572			Merrill Lynch	(173)
(1.383)	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America		11	Amazon.com Inc	Barclays Bank	(185)
		Merrill Lynch	2.752	7	Amazon.com Inc	Goldman Sachs	(172)
(348)	Air Products and Chemicals Inc	Barclays Bank	(95)	6	Amazon.com Inc	HSBC	195
(78)	Air Products and Chemicals Inc	Citibank	(7)	32	Amazon.com Inc	JP Morgan	1.043
(142)	Air Products and Chemicals Inc	Credit Suisse	(870)	122	AMERCO	Bank of America	
(304)	Air Products and Chemicals Inc	Goldman Sachs	605			Merrill Lynch	(5.281)
(144)	Air Products and Chemicals Inc	HSBC	(883)	212	AMERCO	Barclays Bank	(655)
(35)	Air Products and Chemicals Inc	JP Morgan	(215)	74	AMERCO	Citibank	(229)
61	Airbnb Inc	Bank of America		128	AMERCO	Credit Suisse	(7.291)
		Merrill Lynch	482	191	AMERCO	Goldman Sachs	(8.268)
171	Airbnb Inc	Barclays Bank	768	5	AMERCO	HSBC	(285)
127	Airbnb Inc	HSBC	(804)	79	AMERCO	JP Morgan	(4.500)
4	Airbnb Inc	JP Morgan	(25)	(538)	American Express Co	Bank of America	
(449)	Akamai Technologies Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.759)
		Merrill Lynch	(323)	(589)	American Financial Group Inc	Barclays Bank	(777)
(776)	Akamai Technologies Inc	Barclays Bank	124	(585)	American Financial Group Inc	JP Morgan	(3.060)
(158)	Akamai Technologies Inc	Credit Suisse	(471)	(511)	American International Group Inc	Barclays Bank	(491)
(152)	Akamai Technologies Inc	Goldman Sachs	(109)	(1.405)	American Water Works Co Inc	Bank of America	
(536)	Akamai Technologies Inc	HSBC	(1.597)			Merrill Lynch	(3.582)
(727)	Albemarle Corp	Barclays Bank	(5.445)	(708)	American Water Works Co Inc	Barclays Bank	(101)
(73)	Albemarle Corp	Goldman Sachs	(678)	(126)	American Water Works Co Inc	Citibank	(23)
(378)	Alexion Pharmaceuticals Inc	Bank of America		(358)	American Water Works Co Inc	HSBC	351
		Merrill Lynch	(680)	307	Ameriprise Financial Inc	Bank of America	
(96)	Alexion Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(173)			Merrill Lynch	826
17	Align Technology Inc	Barclays Bank	(243)	78	Ameriprise Financial Inc	Barclays Bank	334
19	Align Technology Inc	Credit Suisse	677	54	Ameriprise Financial Inc	Citibank	227
262	Align Technology Inc	Goldman Sachs	7.417	41	Ameriprise Financial Inc	Credit Suisse	(175)
(15)	Alleghany Corp	Barclays Bank	(32)	202	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs	543
(24)	Alleghany Corp	Goldman Sachs	(37)	93	Ameriprise Financial Inc	HSBC	(396)
(23)	Alleghany Corp	HSBC	156	562	Ameriprise Financial Inc	JP Morgan	(1.666)
144	Allegion Plc	Bank of America		1.624	AmerisourceBergen Corp	Barclays Bank	(6.139)
		Merrill Lynch	223	144	AmerisourceBergen Corp	Citibank	(544)
1.110	Allegion Plc	Barclays Bank	1.911	608	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs	(2.049)
196	Allegion Plc	Citibank	264	186	AmerisourceBergen Corp	HSBC	(1.583)
125	Allegion Plc	Credit Suisse	(259)	72	AmerisourceBergen Corp	JP Morgan	(613)
73	Allegion Plc	Goldman Sachs	203	(423)	AMETEK Inc	Bank of America	
216	Allegion Plc	HSBC	(447)			Merrill Lynch	(247)
1.865	Allstate Corp	Bank of America		(453)	AMETEK Inc	Barclays Bank	(432)
		Merrill Lynch	(4.495)	(319)	AMETEK Inc	Goldman Sachs	(995)
27	Allstate Corp	Barclays Bank	(17)	1.120	Amgen Inc	Bank of America	
354	Ally Financial Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(16.173)
		Merrill Lynch	188	191	Amgen Inc	Goldman Sachs	(2.758)
4.409	Ally Financial Inc	Barclays Bank	5.291	31	Amgen Inc	HSBC	(455)
202	Ally Financial Inc	Citibank	242	59	Amgen Inc	JP Morgan	(866)
294	Ally Financial Inc	Credit Suisse	306	(764)	Amphenol Corp 'A'	Bank of America	
188	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	251			Merrill Lynch	(95)
1.170	Ally Financial Inc	HSBC	1.229	(3.176)	Amphenol Corp 'A'	Barclays Bank	(585)
230	Ally Financial Inc	JP Morgan	286	(681)	Amphenol Corp 'A'	Citibank	(129)
(289)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1.763)	(456)	Amphenol Corp 'A'	Credit Suisse	(378)
		Bank of America		(420)	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	(319)
74	Alphabet Inc 'A'	Merrill Lynch	5.027	(174)	Amphenol Corp 'A'	JP Morgan	(31)
		Barclays Bank	(788)	(2.068)	Analog Devices Inc	Bank of America	
188	Alphabet Inc 'A'	Citibank	(25)			Merrill Lynch	(34.122)
6	Alphabet Inc 'A'	Credit Suisse	911	(2.158)	Analog Devices Inc	Barclays Bank	(4.510)
14	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	1.609	(143)	Analog Devices Inc	Citibank	(299)
41	Alphabet Inc 'A'	HSBC	1.237	(258)	Analog Devices Inc	Credit Suisse	(3.563)
19	Alphabet Inc 'A'			(581)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	(9.586)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(100)	Analog Devices Inc	HSBC	(1.381)	1.039	Athene Holding Ltd 'A'	Bank of America	
(245)	ANSYS Inc	Bank of America				Merrill Lynch	447
		Merrill Lynch	(4.094)	969	Athene Holding Ltd 'A'	Barclays Bank	(68)
(294)	ANSYS Inc	Barclays Bank	244	651	Athene Holding Ltd 'A'	Citibank	(46)
(175)	ANSYS Inc	Credit Suisse	(2.585)	452	Athene Holding Ltd 'A'	Goldman Sachs	194
(234)	ANSYS Inc	Goldman Sachs	(3.910)	(767)	Atmos Energy Corp	Bank of America	
(210)	ANSYS Inc	HSBC	(3.102)			Merrill Lynch	(502)
(81)	ANSYS Inc	JP Morgan	(1.196)	(3.083)	Atmos Energy Corp	Barclays Bank	(906)
(30)	Anthem Inc	Credit Suisse	(86)	(987)	Atmos Energy Corp	Credit Suisse	2.613
(250)	Anthem Inc	Goldman Sachs	(1.140)	(240)	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	(158)
(1.024)	Aon Plc 'A'	Barclays Bank	(195)	181	Autodesk Inc	Bank of America	
(431)	Aon Plc 'A'	Goldman Sachs	789			Merrill Lynch	1.584
1	Apartment Income Corp (REIT)	Bank of America		1.662	Autodesk Inc	Barclays Bank	(2.721)
		Merrill Lynch	2	69	Autodesk Inc	Citibank	(112)
1	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT) ^{††}	Bank of America	—	280	Autodesk Inc	Credit Suisse	1.853
		Merrill Lynch		313	Autodesk Inc	Goldman Sachs	3.159
(1.913)	Apollo Global Management Inc	Bank of America		42	Autodesk Inc	HSBC	(165)
		Merrill Lynch	77	37	Autodesk Inc	JP Morgan	363
(3.322)	Apollo Global Management Inc	Barclays Bank	332	88	Automatic Data Processing Inc	Bank of America	
(991)	Apollo Global Management Inc	Citibank	99	620	Automatic Data Processing Inc	Merrill Lynch	128
2.025	Apple Inc	Bank of America		113	Automatic Data Processing Inc	Barclays Bank	(632)
		Merrill Lynch	(3.361)			Citibank	(115)
409	Apple Inc	Barclays Bank	(1.018)	95	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	138
567	Apple Inc	Citibank	(1.390)	72	AutoZone Inc	Barclays Bank	(3.010)
97	Apple Inc	Credit Suisse	(217)	8	AutoZone Inc	Credit Suisse	(124)
2.397	Apple Inc	Goldman Sachs	(3.979)	7	AutoZone Inc	Goldman Sachs	(83)
185	Apple Inc	HSBC	(414)	(243)	Avalara Inc	Bank of America	
87	Applied Materials Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.909)
		Merrill Lynch	1.267	(1.954)	Avalara Inc	Barclays Bank	(6.311)
727	Applied Materials Inc	Barclays Bank	2.581	(216)	Avalara Inc	Citibank	(698)
97	Applied Materials Inc	Credit Suisse	1.304	(142)	Avalara Inc	Credit Suisse	(1.336)
3.539	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	51.528	(946)	Avalara Inc	Goldman Sachs	(5.724)
138	Applied Materials Inc	HSBC	2.036	(256)	Avalara Inc	HSBC	(2.409)
146	Applied Materials Inc	JP Morgan	1.962	(3.849)	Avantor Inc	Barclays Bank	(1.732)
(281)	Aptiv Plc	Bank of America		819	Avery Dennison Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.198)			Merrill Lynch	(352)
(1.465)	Aptiv Plc	Barclays Bank	(13.126)	1.709	Avery Dennison Corp	Barclays Bank	3.127
(349)	Aptiv Plc	Credit Suisse	(2.317)	801	Avery Dennison Corp	Goldman Sachs	(344)
(949)	Aptiv Plc	Goldman Sachs	(10.800)	113	Avery Dennison Corp	HSBC	(119)
(317)	Aptiv Plc	HSBC	(2.105)	124	Avery Dennison Corp	JP Morgan	(130)
(72)	Aptiv Plc	JP Morgan	(478)	9.128	Axalta Coating Systems Ltd	Barclays Bank	7.759
(3.645)	Aramark	Barclays Bank	328	(1.927)	Baker Hughes Co	Bank of America	
566	Arch Capital Group Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(98)
		Merrill Lynch	(300)	(9.209)	Baker Hughes Co	Barclays Bank	1.953
2.558	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America		(509)	Baker Hughes Co	Goldman Sachs	(8)
		Merrill Lynch	(2.839)	(2.660)	Baker Hughes Co	JP Morgan	1.187
7.286	Archer-Daniels-Midland Co	Barclays Bank	(656)	(240)	Ball Corp	Bank of America	
340	Archer-Daniels-Midland Co	Credit Suisse	(374)			Merrill Lynch	1.553
4.097	Archer-Daniels-Midland Co	Goldman Sachs	(4.548)	(639)	Ball Corp	Barclays Bank	3.163
160	Archer-Daniels-Midland Co	HSBC	(176)	(943)	Ball Corp	Goldman Sachs	6.101
496	Arista Networks Inc	Barclays Bank	1.448	506	Bank of America Corp	Goldman Sachs	(177)
407	Arrow Electronics Inc	Bank of America		1.751	Bank of New York Mellon Corp	Barclays Bank	595
		Merrill Lynch	(370)			Citibank	225
2.921	Arrow Electronics Inc	Barclays Bank	(9.698)	663	Bank of New York Mellon Corp		
223	Arrow Electronics Inc	Citibank	(740)	1.151	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs	(12)
150	Arrow Electronics Inc	Credit Suisse	452	(17.184)	Bank OZK	JP Morgan	3.952
243	Arrow Electronics Inc	Goldman Sachs	(221)	(1.163)	Baxter International Inc	Bank of America	
697	Arrow Electronics Inc	HSBC	2.098			Merrill Lynch	849
(799)	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America		(1.304)	Baxter International Inc	Barclays Bank	430
		Merrill Lynch	(88)	(2.337)	Baxter International Inc	Citibank	1.519
(433)	Arthur J Gallagher & Co	Barclays Bank	(525)	(577)	Baxter International Inc	Goldman Sachs	421
(73)	Arthur J Gallagher & Co	Goldman Sachs	(8)	(280)	Becton Dickinson and Co	Bank of America	
(365)	Arthur J Gallagher & Co	HSBC	1.526			Merrill Lynch	(137)
150	Assurant Inc	Barclays Bank	302	(415)	Becton Dickinson and Co	Barclays Bank	706
373	Assurant Inc	Citibank	750				
7.821	AT&T Inc	Barclays Bank	(2.503)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(607)	Becton Dickinson and Co	Citibank	984	1	Brookfield Property Partners LP	JP Morgan	1
(63)	Becton Dickinson and Co	Credit Suisse	12	(865)	Brown & Brown Inc	Bank of America	
(48)	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	93			Merrill Lynch	(251)
(208)	Becton Dickinson and Co	HSBC	418	(1.090)	Brown & Brown Inc	Barclays Bank	(376)
858	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Bank of America		(122)	Brown & Brown Inc	Citibank	(44)
		Merrill Lynch	189	(691)	Brown & Brown Inc	Credit Suisse	587
476	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Barclays Bank	(138)	(600)	Brown & Brown Inc	HSBC	510
350	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Goldman Sachs	77	(2.660)	Brown-Forman Corp 'B'	Bank of America	
17	Berkshire Hathaway Inc 'B'	HSBC	(49)			Merrill Lynch	(6.384)
2.698	Best Buy Co Inc	Bank of America		1.336	Bunge Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(10.441)			Merrill Lynch	(3.634)
426	Best Buy Co Inc	Barclays Bank	670	1.273	Bunge Ltd	Barclays Bank	25
117	Best Buy Co Inc	Citibank	180	1.712	Bunge Ltd	Goldman Sachs	(4.657)
321	Best Buy Co Inc	Credit Suisse	(2.209)	810	Bunge Ltd	HSBC	(3.013)
69	Best Buy Co Inc	HSBC	(659)	31	Bunge Ltd	JP Morgan	(115)
113	Biogen Inc	Bank of America		(48)	Burlington Stores Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.460)			Merrill Lynch	612
450	Biogen Inc	Barclays Bank	(5.121)	(639)	Burlington Stores Inc	Barclays Bank	(1.764)
38	Biogen Inc	Goldman Sachs	(491)	(36)	Burlington Stores Inc	Credit Suisse	190
20	Biogen Inc	HSBC	(163)	(88)	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	1.123
(562)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America		(45)	Cable One Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	22			Merrill Lynch	(4.548)
(1.051)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Barclays Bank	263	(77)	Cable One Inc	Barclays Bank	(657)
(219)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Citibank	55	(8)	Cable One Inc	Citibank	(68)
(2.765)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	111	(25)	Cable One Inc	Credit Suisse	(1.827)
(333)	BioMarin Pharmaceutical Inc	JP Morgan	(303)	(34)	Cable One Inc	Goldman Sachs	(3.436)
(547)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Barclays Bank	(5.093)	(15)	Cable One Inc	HSBC	(1.096)
(596)	Black Knight Inc	Bank of America		(2)	Cable One Inc	JP Morgan	(146)
		Merrill Lynch	(1.120)	(2.018)	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs	3.854
(1.053)	Black Knight Inc	Barclays Bank	(232)	178	Cadence Design Systems Inc	Bank of America	
(369)	Black Knight Inc	Citibank	(81)			Merrill Lynch	918
(566)	Black Knight Inc	Credit Suisse	923	190	Cadence Design Systems Inc	Barclays Bank	(83)
(5.849)	Black Knight Inc	Goldman Sachs	(10.996)	6.718	Cadence Design Systems Inc	Citibank	4.434
(216)	Black Knight Inc	JP Morgan	352	47	Cadence Design Systems Inc	Credit Suisse	134
(1.437)	Blackstone Group Inc	Credit Suisse	(5.834)	79	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs	407
(32)	Booking Holdings Inc	Bank of America		177	Cadence Design Systems Inc	HSBC	504
		Merrill Lynch	(4.429)	166	Cadence Design Systems Inc	JP Morgan	473
(20)	Booking Holdings Inc	Barclays Bank	(326)	(3.032)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	2.092
(6)	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs	(315)	1.160	Capital One Financial Corp	Barclays Bank	46
(4)	Booking Holdings Inc	JP Morgan	(286)	552	Cardinal Health Inc	Bank of America	
1.711	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(210)
		Merrill Lynch	2.857	7.875	Cardinal Health Inc	Barclays Bank	(4.410)
704	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Barclays Bank	(487)	915	Cardinal Health Inc	HSBC	(2.068)
130	Booz Allen Hamilton Holding Corp	HSBC	204	(369)	CarMax Inc	Bank of America	
(1.547)	BorgWarner Inc	Bank of America				Merrill Lynch	3.413
		Merrill Lynch	557	(843)	CarMax Inc	Barclays Bank	(1.104)
(988)	BorgWarner Inc	Barclays Bank	(1.126)	(112)	CarMax Inc	Citibank	(147)
(2.073)	BorgWarner Inc	Citibank	(2.363)	(762)	CarMax Inc	Goldman Sachs	7.049
(1.464)	BorgWarner Inc	Goldman Sachs	527	(4.825)	Carnival Corp	Barclays Bank	(8.009)
(1.168)	BorgWarner Inc	HSBC	1.916	(2.326)	Carnival Corp	Citibank	(3.861)
(1.339)	BorgWarner Inc	JP Morgan	2.196	(6.599)	Carnival Corp	Goldman Sachs	(13.462)
(8.744)	Boston Scientific Corp	Barclays Bank	2.186	(517)	Carnival Corp	HSBC	(1.976)
(1.445)	Bristol-Myers Squibb Co	Bank of America		(259)	Carrier Global Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(303)			Merrill Lynch	(456)
(461)	Bristol-Myers Squibb Co	Barclays Bank	653	(715)	Carrier Global Corp	Barclays Bank	(1.108)
(402)	Bristol-Myers Squibb Co	Credit Suisse	(68)	(828)	Carvana Co	Bank of America	
(1.097)	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs	(65)			Merrill Lynch	(31.903)
(102)	Broadcom Inc	Bank of America		(232)	Carvana Co	Barclays Bank	(2.619)
		Merrill Lynch	(3.304)	(13)	Carvana Co	Citibank	(147)
(1.425)	Broadcom Inc	Barclays Bank	(18.513)	(87)	Carvana Co	Credit Suisse	(1.993)
(25)	Broadcom Inc	Citibank	(329)	(76)	Carvana Co	Goldman Sachs	(2.928)
(37)	Broadcom Inc	Credit Suisse	(1.341)	(3.601)	Catalent Inc	Bank of America	
(140)	Broadcom Inc	Goldman Sachs	(4.535)			Merrill Lynch	(10.119)
(96)	Broadcom Inc	HSBC	(3.478)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.326)	Catalent Inc	Barclays Bank	(2.829)	197	Check Point Software Technologies Ltd	HSBC	(565)
(301)	Catalent Inc	Credit Suisse	(9)	(171)	Cheniére Energy Inc	Bank of America	
(109)	Catalent Inc	Goldman Sachs	(143)	(233)	Cheniére Energy Inc	Merrill Lynch	(137)
(217)	Catalent Inc	HSBC	(7)	(3.205)	Cheniére Energy Inc	Barclays Bank	(184)
(548)	Catalent Inc	JP Morgan	(16)	(285)	Cheniére Energy Inc	Goldman Sachs	(2.564)
(353)	Caterpillar Inc	Barclays Bank	(717)	(231)	Chevron Corp	JP Morgan	(918)
(90)	Caterpillar Inc	Credit Suisse	50	(4.996)	Chevron Corp	Bank of America	
(12)	Caterpillar Inc	Goldman Sachs	45	(1.426)	Chevron Corp	Merrill Lynch	838
(339)	Cboe Global Markets Inc	Bank of America		(593)	Chevron Corp	Barclays Bank	6.869
		Merrill Lynch	454	(394)	Chevy Inc 'A'	Goldman Sachs	10.011
443	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America		(377)	Chevy Inc 'A'	JP Morgan	841
		Merrill Lynch	487	(1.768)	Chevy Inc 'A'	Bank of America	
602	CBRE Group Inc 'A'	Barclays Bank	(590)	(1.405)	Chevy Inc 'A'	Merrill Lynch	(1.344)
435	CBRE Group Inc 'A'	Citibank	(426)	85	Chipotle Mexican Grill Inc	Barclays Bank	(720)
240	CBRE Group Inc 'A'	Credit Suisse	286	(642)	Church & Dwight Co Inc	Citibank	(3.377)
1.204	CBRE Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1.324	(2.911)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	(4.791)
543	CBRE Group Inc 'A'	HSBC	665	(549)	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	2.518
257	CBRE Group Inc 'A'	JP Morgan	306	(665)	Church & Dwight Co Inc	Bank of America	
74	CDW Corp	Bank of America		(2.755)	Church & Dwight Co Inc	Merrill Lynch	1.644
		Merrill Lynch	(253)	(176)	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	3.430
182	CDW Corp	Goldman Sachs	(677)	307	Cigna Corp	Citibank	807
(2.220)	Centene Corp	Credit Suisse	(8.969)	94	Cigna Corp	Credit Suisse	2.194
(1.623)	CenterPoint Energy Inc	Bank of America		122	Cigna Corp	Goldman Sachs	6.397
		Merrill Lynch	(531)	56	Cigna Corp	JP Morgan	644
(10.008)	CenterPoint Energy Inc	Barclays Bank	(2.067)	422	Cigna Corp	Bank of America	
(713)	CenterPoint Energy Inc	Citibank	(193)	(1.461)	Cincinnati Financial Corp	Merrill Lynch	(1.802)
(408)	CenterPoint Energy Inc	Credit Suisse	(258)	409	Cintas Corp	Barclays Bank	(252)
(6.416)	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs	(1.732)	98	Cintas Corp	Citibank	(327)
(310)	Ceridian HCM Holding Inc	Bank of America		164	Cintas Corp	Credit Suisse	(451)
		Merrill Lynch	(502)	86	Cintas Corp	Goldman Sachs	(2.477)
(1.079)	Ceridian HCM Holding Inc	Barclays Bank	(239)	(2.279)	Cisco Systems Inc - CDI	HSBC	(1.476)
(390)	Ceridian HCM Holding Inc	Citibank	(43)	(101)	Cisco Systems Inc - CDI	Barclays Bank	1.117
(830)	Ceridian HCM Holding Inc	Credit Suisse	(4.590)	(919)	Cisco Systems Inc - CDI	Citibank	49
(183)	Ceridian HCM Holding Inc	Goldman Sachs	(296)	(2.455)	Cisco Systems Inc - CDI	Credit Suisse	239
(5.189)	Ceridian HCM Holding Inc	HSBC	(28.695)	353	Citigroup Inc	Goldman Sachs	98
(324)	Ceridian HCM Holding Inc	JP Morgan	(1.191)	2.776	Citigroup Inc	Bank of America	
8.356	Cerner Corp	Bank of America		157	Citigroup Inc	Merrill Lynch	455
		Merrill Lynch	13.717	506	Citigroup Inc	Barclays Bank	1.888
321	Cerner Corp	Barclays Bank	401	5.173	Citizens Financial Group Inc	HSBC	1.811
508	Cerner Corp	Citibank	635	217	Citrix Systems Inc	Barclays Bank	3.000
468	Cerner Corp	Credit Suisse	176			Bank of America	
1.092	Cerner Corp	Goldman Sachs	1.589	458	Citrix Systems Inc	Merrill Lynch	(414)
217	Cerner Corp	HSBC	195	372	Citrix Systems Inc	Barclays Bank	(403)
498	CF Industries Holdings Inc	Barclays Bank	753	(463)	Clorox Co	Goldman Sachs	(711)
372	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America		(410)	Clorox Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	(748)	(152)	Clorox Co	Merrill Lynch	1.829
641	CH Robinson Worldwide Inc	Barclays Bank	(449)	(364)	Clorox Co	Barclays Bank	543
120	CH Robinson Worldwide Inc	Credit Suisse	(565)	(96)	Clorox Co	Citibank	318
529	CH Robinson Worldwide Inc	HSBC	(2.492)	(150)	Clorox Co	Goldman Sachs	1.438
(2.029)	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs	(1.725)	(1.120)	Cloudflare Inc 'A'	HSBC	467
(318)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America		(134)	Cloudflare Inc 'A'	JP Morgan	1.689
		Merrill Lynch	(2.442)	(128)	Cloudflare Inc 'A'	Bank of America	
(132)	Charter Communications Inc 'A'	Barclays Bank	1.135	(690)	Cloudflare Inc 'A'	Merrill Lynch	(12.432)
(57)	Charter Communications Inc 'A'	Citibank	490	(509)	CME Group Inc	Barclays Bank	(426)
(60)	Charter Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	(461)	(157)	CME Group Inc	Credit Suisse	(1.688)
(20)	Charter Communications Inc 'A'	HSBC	4	(980)	CME Group Inc	Goldman Sachs	(7.659)
(19)	Charter Communications Inc 'A'	JP Morgan	4	(59)	CME Group Inc	Bank of America	
703	Check Point Software Technologies Ltd	Bank of America		320	Coca-Cola Co	Merrill Lynch	208
		Merrill Lynch	28				
1.256	Check Point Software Technologies Ltd	Barclays Bank	(2.575)				
119	Check Point Software Technologies Ltd	Citibank	(244)				
585	Check Point Software Technologies Ltd	Goldman Sachs	23				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
819	Coca-Cola Co	Barclays Bank	82	75	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs	(486)
809	Coca-Cola Co	Citibank	396	108	Costco Wholesale Corp	JP Morgan	(670)
1.126	Coca-Cola Co	Goldman Sachs	732	(343)	Coupa Software Inc	Bank of America	
1.023	Coca-Cola Co	HSBC	389			Merrill Lynch	(3.697)
166	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Barclays Bank	30	(1.342)	Coupa Software Inc	Barclays Bank	1.160
617	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Citibank	(160)	(142)	Coupa Software Inc	Credit Suisse	(464)
479	Cognex Corp	Bank of America		(325)	Coupa Software Inc	Goldman Sachs	(3.588)
		Merrill Lynch	2.529	(61)	Coupa Software Inc	HSBC	143
257	Cognex Corp	Barclays Bank	524	(47)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Bank of America	
480	Cognex Corp	Goldman Sachs	2.534	(216)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	(385)
73	Cognex Corp	HSBC	221	(282)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(1.685)
1.089	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Bank of America		(221)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(9.481)
		Merrill Lynch	1.007	(71)	Crown Holdings Inc	JP Morgan	(7.640)
514	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Barclays Bank	236	(2.166)	Crown Holdings Inc	Bank of America	
3.761	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Goldman Sachs	3.479	125	CSX Corp	Merrill Lynch	578
128	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	HSBC	(314)	2.316	CSX Corp	Barclays Bank	16.223
745	Colgate-Palmolive Co	Bank of America		113	CSX Corp	Barclays Bank	1.783
		Merrill Lynch	171	112	CSX Corp	Citibank	96
(812)	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	(1.531)	113	CSX Corp	Goldman Sachs	(32)
(590)	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs	(224)	112	CSX Corp	HSBC	(37)
(1.856)	ConocoPhillips	Bank of America		127	CSX Corp	JP Morgan	(386)
		Merrill Lynch	3.829	1.405	Cummins Inc	Bank of America	
(2.287)	ConocoPhillips	Barclays Bank	(208)			Merrill Lynch	(12.701)
(1.063)	ConocoPhillips	Citibank	383	1.337	CVS Health Corp	Barclays Bank	(4.372)
(259)	ConocoPhillips	Credit Suisse	463	1.613	CVS Health Corp	Goldman Sachs	3.032
(1.322)	ConocoPhillips	Goldman Sachs	3.384	339	CVS Health Corp	HSBC	200
(14.613)	ConocoPhillips	JP Morgan	18.412	(1.517)	CyberArk Software Ltd	Bank of America	
(2.357)	Consolidated Edison Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(15.519)
		Merrill Lynch	839	(315)	CyberArk Software Ltd	Barclays Bank	(79)
(905)	Consolidated Edison Inc	Barclays Bank	670	(246)	CyberArk Software Ltd	Citibank	55
(401)	Consolidated Edison Inc	Credit Suisse	1.047	(552)	CyberArk Software Ltd	Goldman Sachs	(5.647)
51	Constellation Brands Inc 'A'	Bank of America		(187)	CyberArk Software Ltd	HSBC	(1.270)
		Merrill Lynch	3	(86)	CyberArk Software Ltd	JP Morgan	(584)
557	Constellation Brands Inc 'A'	Barclays Bank	1.805	(1.280)	Danaher Corp	Bank of America	
49	Constellation Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	189			Merrill Lynch	(5.741)
(560)	Cooper Cos Inc	Bank of America		(184)	Danaher Corp	Barclays Bank	(410)
		Merrill Lynch	(2.929)	(384)	Danaher Corp	Credit Suisse	1.110
(189)	Cooper Cos Inc	Goldman Sachs	(988)	(3.054)	Danaher Corp	Goldman Sachs	(15.671)
255	Copart Inc	Bank of America		(213)	Danaher Corp	HSBC	616
		Merrill Lynch	1.545	(96)	Danaher Corp	JP Morgan	(436)
1.233	Copart Inc	Barclays Bank	536	1.530	Darden Restaurants Inc	Barclays Bank	2.861
204	Copart Inc	Citibank	177	(449)	Datadog Inc 'A'	Bank of America	
669	Copart Inc	Goldman Sachs	3.630			Merrill Lynch	(4.499)
109	Copart Inc	HSBC	643	(1.222)	Datadog Inc 'A'	Barclays Bank	(1.576)
309	Copart Inc	JP Morgan	440	(301)	Datadog Inc 'A'	Credit Suisse	(4.271)
2.596	Corning Inc	Barclays Bank	(986)	(1.481)	Datadog Inc 'A'	Goldman Sachs	(14.840)
348	Corning Inc	Citibank	(132)	(20)	Datadog Inc 'A'	JP Morgan	(284)
518	Corning Inc	Goldman Sachs	(290)	1.219	DaVita Inc	Bank of America	
231	Corning Inc	HSBC	(372)			Merrill Lynch	(4.825)
1.520	Corteva Inc	Bank of America		404	DaVita Inc	Barclays Bank	(624)
		Merrill Lynch	(1.094)	110	DaVita Inc	Credit Suisse	(870)
3.154	Corteva Inc	Barclays Bank	1.104	83	DaVita Inc	Goldman Sachs	3
494	Corteva Inc	Citibank	173	157	DaVita Inc	HSBC	(1.242)
1.026	Corteva Inc	Credit Suisse	(1.529)	528	Deere & Co	Barclays Bank	919
1.158	Corteva Inc	Goldman Sachs	(834)	29	Deere & Co	Credit Suisse	(879)
829	Corteva Inc	HSBC	(1.235)	364	Dell Technologies Inc 'C'	Bank of America	
416	Corteva Inc	JP Morgan	(620)			Merrill Lynch	91
(141)	CoStar Group Inc	Bank of America		533	Dell Technologies Inc 'C'	Barclays Bank	(799)
		Merrill Lynch	(5.082)	52	Dell Technologies Inc 'C'	Credit Suisse	(54)
(163)	CoStar Group Inc	Barclays Bank	(1.318)	140	Dell Technologies Inc 'C'	Goldman Sachs	35
(51)	CoStar Group Inc	Citibank	(493)	127	Dell Technologies Inc 'C'	JP Morgan	(132)
(248)	CoStar Group Inc	Credit Suisse	(3.541)	347	Delta Air Lines Inc	Barclays Bank	524
(131)	CoStar Group Inc	Goldman Sachs	(4.721)	1.409	Delta Air Lines Inc	Goldman Sachs	1.310
(18)	CoStar Group Inc	HSBC	(586)	1.398	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldman Sachs	(2.838)
(12)	CoStar Group Inc	JP Morgan	(134)	970	Devon Energy Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(611)
				8.012	Devon Energy Corp	Barclays Bank	4.887
				520	Devon Energy Corp	Goldman Sachs	(328)
				(69)	Dexcom Inc	Citibank	(966)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(30)	Dexcom Inc	Goldman Sachs	(768)	1.735	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America	
105	Discover Financial Services	Barclays Bank	260			Merrill Lynch	10.497
(328)	Discovery Inc 'A'	Bank of America		3.877	Edwards Lifesciences Corp	Barclays Bank	1.745
		Merrill Lynch	(97)	335	Edwards Lifesciences Corp	Citibank	151
(1.328)	Discovery Inc 'A'	Barclays Bank	(1.102)	920	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs	5.566
(279)	Discovery Inc 'A'	Credit Suisse	1.437	354	Edwards Lifesciences Corp	HSBC	1.947
(799)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America		(2.328)	Elanco Animal Health Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	965			Merrill Lynch	(2.258)
(1.079)	DISH Network Corp 'A'	Barclays Bank	971	(9.618)	Elanco Animal Health Inc	Barclays Bank	(1.924)
(342)	DISH Network Corp 'A'	Credit Suisse	1.005	(507)	Elanco Animal Health Inc	Credit Suisse	(1.896)
(696)	DISH Network Corp 'A'	HSBC	2.046	(572)	Elanco Animal Health Inc	Goldman Sachs	(555)
(398)	DocuSign Inc	Barclays Bank	(2.416)	(591)	Elanco Animal Health Inc	HSBC	(2.210)
(474)	DocuSign Inc	Citibank	(2.877)	(754)	Elanco Animal Health Inc	JP Morgan	(2.820)
(190)	Dollar General Corp	Goldman Sachs	236	1.977	Electronic Arts Inc	Bank of America	
389	Dollar Tree Inc	Bank of America				Merrill Lynch	9.938
		Merrill Lynch	(4.581)	1.884	Electronic Arts Inc	Barclays Bank	1.324
316	Dollar Tree Inc	Barclays Bank	(3.068)	64	Electronic Arts Inc	Credit Suisse	146
346	Dollar Tree Inc	Citibank	(3.356)	3.598	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs	19.429
173	Dollar Tree Inc	Credit Suisse	(3.207)	814	Electronic Arts Inc	HSBC	2.408
295	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs	(2.166)	186	Electronic Arts Inc	JP Morgan	424
32	Dollar Tree Inc	HSBC	(593)	(234)	Eli Lilly & Co	Bank of America	
491	Domino's Pizza Inc	Barclays Bank	2.931			Merrill Lynch	(985)
4.298	Dover Corp	Bank of America		(299)	Eli Lilly & Co	Barclays Bank	213
		Merrill Lynch	731	(60)	Eli Lilly & Co	Citibank	11
772	Dow Inc	Bank of America		(122)	Eli Lilly & Co	Credit Suisse	(608)
		Merrill Lynch	(1.922)	(160)	Eli Lilly & Co	HSBC	(453)
185	Dow Inc	Barclays Bank	(209)	434	Emerson Electric Co	Bank of America	
198	Dow Inc	Goldman Sachs	(493)			Merrill Lynch	74
222	DR Horton Inc	Barclays Bank	930	4.015	Emerson Electric Co	Barclays Bank	6.745
291	DR Horton Inc	Goldman Sachs	(105)	136	Emerson Electric Co	Credit Suisse	42
384	DR Horton Inc	HSBC	(3.517)	195	Emerson Electric Co	Goldman Sachs	33
(1.068)	DraftKings Inc 'A'	Bank of America		346	Emerson Electric Co	HSBC	107
		Merrill Lynch	(6.878)	(405)	Enphase Energy Inc	Bank of America	
(566)	DraftKings Inc 'A'	Barclays Bank	(1.183)			Merrill Lynch	(9.975)
(356)	DraftKings Inc 'A'	Citibank	(744)	(657)	Enphase Energy Inc	Barclays Bank	(1.432)
(272)	DraftKings Inc 'A'	Credit Suisse	(452)	(460)	Enphase Energy Inc	Goldman Sachs	(11.330)
(653)	DraftKings Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.205)	(68)	Enphase Energy Inc	JP Morgan	(1.695)
(672)	DraftKings Inc 'A'	JP Morgan	(3.098)	204	EPAM Systems Inc	Bank of America	
5.797	Dropbox Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	6.087
		Merrill Lynch	6.854	219	EPAM Systems Inc	Barclays Bank	(1.494)
3.401	Dropbox Inc 'A'	Barclays Bank	767	(377)	Equifax Inc	Barclays Bank	927
17	Dropbox Inc 'A'	Citibank	3	653	Equitable Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.371)
761	Dropbox Inc 'A'	Goldman Sachs	951	2.469	Equitable Holdings Inc	HSBC	(6.370)
327	DuPont de Nemours Inc	Bank of America		(740)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(232)			Merrill Lynch	1.033
767	DuPont de Nemours Inc	Barclays Bank	(514)	(1.055)	Erie Indemnity Co 'A'	Barclays Bank	(4.508)
404	DuPont de Nemours Inc	Citibank	(271)	(142)	Erie Indemnity Co 'A'	Credit Suisse	1.065
147	DuPont de Nemours Inc	Credit Suisse	428	(198)	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	227
863	DuPont de Nemours Inc	Goldman Sachs	(286)	(8.855)	Essential Utilities Inc	Bank of America	
559	DuPont de Nemours Inc	HSBC	1.627			Merrill Lynch	(14.168)
578	DuPont de Nemours Inc	JP Morgan	1.373	(3.609)	Essential Utilities Inc	Barclays Bank	(947)
(1.058)	Dynatrace Inc	Bank of America		(368)	Essential Utilities Inc	Citibank	(110)
		Merrill Lynch	(5.396)	(2.984)	Essential Utilities Inc	Credit Suisse	(3.103)
(56)	Dynatrace Inc	Citibank	(59)	(1.448)	Essential Utilities Inc	Goldman Sachs	(2.317)
(668)	Dynatrace Inc	Goldman Sachs	(3.407)	(1.939)	Essential Utilities Inc	JP Morgan	(2.017)
1.765	eBay Inc	Barclays Bank	(181)	(158)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Bank of America	
302	eBay Inc	Citibank	(27)			Merrill Lynch	(227)
4.441	eBay Inc	Credit Suisse	(2.487)	(268)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Barclays Bank	(930)
590	eBay Inc	HSBC	(330)	(67)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Credit Suisse	(599)
345	eBay Inc	JP Morgan	(193)	(42)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Goldman Sachs	(415)
54	Ecolab Inc	Bank of America		(153)	Etsy Inc	HSBC	367
		Merrill Lynch	(354)	(287)	Everest Re Group Ltd	Citibank	1.036
337	Ecolab Inc	Barclays Bank	(74)	(369)	Eversource Energy	Bank of America	
55	Ecolab Inc	Citibank	(12)			Merrill Lynch	421
334	Ecolab Inc	Goldman Sachs	(2.191)	(1.254)	Eversource Energy	Barclays Bank	151
106	Ecolab Inc	HSBC	(329)	(425)	Eversource Energy	Credit Suisse	1.811
(476)	Edison International	Bank of America		(603)	Exact Sciences Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	904			Merrill Lynch	(9.564)
(5.215)	Edison International	Barclays Bank	7.503	(1.725)	Exact Sciences Corp	Barclays Bank	(1.811)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(136)	Exact Sciences Corp	Citibank	(143)	(286)	Fortive Corp	Barclays Bank	(160)
(114)	Exact Sciences Corp	Credit Suisse	(1.333)	120	Fortune Brands Home & Security Inc	Bank of America	
(144)	Exact Sciences Corp	Goldman Sachs	(2.284)			Merrill Lynch	(382)
(78)	Exact Sciences Corp	HSBC	(912)	1.544	Fortune Brands Home & Security Inc	Barclays Bank	(1.729)
3.234	Exelon Corp	Bank of America		108	Fortune Brands Home & Security Inc	Citibank	(121)
		Merrill Lynch	97	(677)	Fox Corp 'A'	Credit Suisse	1.002
(58)	Expedia Group Inc	Bank of America		(1.910)	Franklin Resources Inc	Barclays Bank	(1.375)
		Merrill Lynch	(435)	(193)	Garmin Ltd	Barclays Bank	(434)
(104)	Expedia Group Inc	Barclays Bank	(608)	392	Gartner Inc	Bank of America	
(1.170)	Expedia Group Inc	Credit Suisse	(4.516)			Merrill Lynch	1.231
229	Expeditors International of Washington Inc	Barclays Bank	380	497	Gartner Inc	Barclays Bank	(432)
173	Expeditors International of Washington Inc	Credit Suisse	976	128	Gartner Inc	Credit Suisse	87
315	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs	766	158	Gartner Inc	Goldman Sachs	496
8.869	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	49.642	106	Gartner Inc	HSBC	72
		Bank of America		127	Gartner Inc	JP Morgan	86
(284)	Exxon Mobil Corp	Merrill Lynch	1.085	(56)	Generac Holdings Inc	Bank of America	
		Barclays Bank	3.755	(1.710)	General Electric Co	Merrill Lynch	(213)
(3.028)	Exxon Mobil Corp	Bank of America				Bank of America	
(183)	F5 Networks Inc	Merrill Lynch	(875)	(18.455)	General Electric Co	Merrill Lynch	(1.556)
		Barclays Bank	8	(2.506)	General Electric Co	Barclays Bank	(13.373)
(90)	F5 Networks Inc	Credit Suisse	(282)	(1.289)	General Electric Co	Citibank	(2.217)
(114)	F5 Networks Inc	Bank of America		(763)	General Electric Co	Goldman Sachs	(1.173)
760	Facebook Inc 'A'	Merrill Lynch	10.085	(869)	General Mills Inc	HSBC	(626)
		Barclays Bank	2.468			Bank of America	
602	Facebook Inc 'A'	Citibank	734	(3.876)	General Mills Inc	Merrill Lynch	(61)
179	Facebook Inc 'A'	Goldman Sachs	876	(2.064)	General Mills Inc	Barclays Bank	736
66	Facebook Inc 'A'	JP Morgan	2.663	(631)	General Mills Inc	Citibank	392
117	Facebook Inc 'A'	Barclays Bank	558	(449)	General Motors Co	Goldman Sachs	(44)
103	FactSet Research Systems Inc	Barclays Bank	151	815	Genuine Parts Co	Barclays Bank	(1.217)
25	Fair Isaac Corp	Bank of America	552			Bank of America	
		Merrill Lynch	151	772	Genuine Parts Co	Merrill Lynch	(1.002)
973	Fair Isaac Corp	Barclays Bank	5.183	614	Genuine Parts Co	Barclays Bank	(191)
41	Fair Isaac Corp	Credit Suisse	552	1.723	Genuine Parts Co	Citibank	(106)
159	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs	2.206	539	Genuine Parts Co	Goldman Sachs	(2.119)
21	Fair Isaac Corp	HSBC	349	286	Genuine Parts Co	HSBC	(816)
38	Fair Isaac Corp	JP Morgan	135	959	Gilead Sciences Inc	JP Morgan	(709)
2.622	Fasterenal Co	Barclays Bank	498			Bank of America	
19	FedEx Corp	Bank of America		1.752	Gilead Sciences Inc	Merrill Lynch	(1.906)
		Merrill Lynch	105	101	Gilead Sciences Inc	Barclays Bank	(2.101)
909	FedEx Corp	Barclays Bank	2.700	452	Gilead Sciences Inc	Citibank	(133)
104	FedEx Corp	Credit Suisse	576	478	Gilead Sciences Inc	Credit Suisse	(619)
60	FedEx Corp	Goldman Sachs	333	2.971	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs	(1.415)
60	FedEx Corp	JP Morgan	332	(1.445)	Global Payments Inc	HSBC	(4.070)
(152)	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America		155	Globe Life Inc	Barclays Bank	2.225
		Merrill Lynch	(5)			Bank of America	
(3.042)	Fidelity National Information Services Inc	Barclays Bank	6.267	221	Globe Life Inc	Merrill Lynch	(57)
(303)	Fidelity National Information Services Inc	Citibank	624	122	Globe Life Inc	Barclays Bank	18
1.579	Fifth Third Bancorp	Goldman Sachs	(1.200)	7	Globe Life Inc	Goldman Sachs	(45)
337	First Republic Bank	Barclays Bank	330	2.953	GoDaddy Inc 'A'	HSBC	(3)
(862)	Fiserv Inc	Bank of America		41	GoDaddy Inc 'A'	Barclays Bank	2.835
		Merrill Lynch	(1.082)	42	GoDaddy Inc 'A'	Citibank	39
(4.459)	Fiserv Inc	Barclays Bank	2.934	(167)	Guidewire Software Inc	HSBC	3
(767)	Fiserv Inc	Goldman Sachs	(1.825)			Bank of America	
(804)	Fiserv Inc	HSBC	541	(1.094)	Guidewire Software Inc	Merrill Lynch	(103)
(156)	FleetCor Technologies Inc	Barclays Bank	(222)	(288)	Guidewire Software Inc	Barclays Bank	(504)
212	FMC Corp	Bank of America		(103)	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs	(232)
		Merrill Lynch	(367)	(12.670)	Halliburton Co	JP Morgan	(158)
2.657	FMC Corp	Barclays Bank	(133)	(1.145)	Halliburton Co	Barclays Bank	38
(5.999)	Ford Motor Co	Barclays Bank	(8.819)	(465)	Hartford Financial Services Group Inc	Credit Suisse	(151)
(1.259)	Ford Motor Co	Goldman Sachs	(2.996)			Barclays Bank	(51)
1.761	Fortinet Inc	Bank of America		(2.186)	Hasbro Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	25.006	(127)	Hasbro Inc	Merrill Lynch	(37)
(654)	Fortive Corp	Bank of America		151	HCA Healthcare Inc	Barclays Bank	(158)
		Merrill Lynch	(1.269)	1.337	HCA Healthcare Inc	Barclays Bank	1.309
				141	HCA Healthcare Inc	Citibank	11.592
						Goldman Sachs	746

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(112)	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(595)	(200)	IDEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(55)
(130)	HEICO Corp	Barclays Bank	(251)	(384)	IDEX Corp	Barclays Bank	(559)
(183)	HEICO Corp	Credit Suisse	(1.381)	(50)	IDEX Corp	Credit Suisse	(53)
(1.498)	HEICO Corp	Goldman Sachs	(9.992)	287	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.125
488	Henry Schein Inc	Barclays Bank	(756)	72	IDEXX Laboratories Inc	Barclays Bank	605
1.750	Hershey Co	Barclays Bank	(1.776)	44	IDEXX Laboratories Inc	Credit Suisse	1.445
63	Hershey Co	Citibank	(66)	601	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	19.762
107	Hershey Co	Goldman Sachs	60	35	IDEXX Laboratories Inc	HSBC	1.084
108	Hershey Co	HSBC	(109)	85	IDEXX Laboratories Inc	JP Morgan	2.792
(126)	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	(36)	(228)	IHS Markit Ltd	Barclays Bank	(41)
(3.490)	Hess Corp	Barclays Bank	1.506	300	Illinois Tool Works Inc	Barclays Bank	(93)
(192)	Hess Corp	Credit Suisse	(242)	113	Illinois Tool Works Inc	Citibank	(70)
(465)	Hess Corp	Goldman Sachs	1.209	3.148	Illinois Tool Works Inc	Credit Suisse	(22.980)
6.313	Hewlett Packard Enterprise Co	Barclays Bank	(2.525)	(26)	Illumina Inc	Bank of America Merrill Lynch	(680)
2.396	Hewlett Packard Enterprise Co	HSBC	(1.078)	(214)	Illumina Inc	Barclays Bank	(1.209)
816	Hewlett Packard Enterprise Co	JP Morgan	(367)	(25)	Illumina Inc	Citibank	(141)
(714)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.542)	(8)	Illumina Inc	HSBC	(201)
(94)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Citibank	(158)	1.069	Incyte Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.541
(563)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.004)	732	Incyte Corp	Barclays Bank	573
(225)	Hilton Worldwide Holdings Inc	HSBC	(830)	122	Incyte Corp	Credit Suisse	191
2.161	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	908	161	Incyte Corp	Goldman Sachs	98
820	Hologic Inc	Barclays Bank	262	914	Incyte Corp	HSBC	2.184
242	Hologic Inc	Citibank	99	(6.290)	Ingersoll Rand Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.535)
319	Hologic Inc	Credit Suisse	(648)	(1.849)	Ingersoll Rand Inc	Barclays Bank	(92)
237	Hologic Inc	Goldman Sachs	100	(388)	Ingersoll Rand Inc	Citibank	(19)
1.793	Home Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.625)	(554)	Ingersoll Rand Inc	Credit Suisse	147
750	Home Depot Inc	Barclays Bank	2.242	(619)	Ingersoll Rand Inc	Goldman Sachs	(545)
65	Home Depot Inc	Goldman Sachs	(72)	(410)	Insulet Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16.908)
248	Home Depot Inc	HSBC	(1.932)	(116)	Insulet Corp	Barclays Bank	(1.496)
80	Home Depot Inc	JP Morgan	(1.777)	(34)	Insulet Corp	Citibank	(439)
(1.029)	Horizon Therapeutics Plc	Barclays Bank	3.663	(45)	Insulet Corp	Goldman Sachs	(844)
(228)	Horizon Therapeutics Plc	Citibank	812	1.165	Intel Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.085
(159)	Horizon Therapeutics Plc	Goldman Sachs	339	2.133	Intel Corp	Barclays Bank	341
(10.317)	Hormel Foods Corp	Barclays Bank	7.428	71	Intel Corp	Barclays Bank	11
(3.181)	Howmet Aerospace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.630)	(405)	Intercontinental Exchange Inc	Barclays Bank	(26)
(352)	Howmet Aerospace Inc	Barclays Bank	(507)	(128)	International Business Machines Corp	Bank of America Merrill Lynch	175
(3.034)	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs	(5.370)	(947)	International Business Machines Corp	Barclays Bank	928
(306)	Howmet Aerospace Inc	HSBC	(887)	(472)	International Flavors & Fragrances Inc	Barclays Bank	90
7.508	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28.605)	(108)	International Flavors & Fragrances Inc	Citibank	21
6.484	HP Inc	Barclays Bank	(19.971)	(3.092)	International Flavors & Fragrances Inc	Credit Suisse	3.216
1.315	HP Inc	Credit Suisse	(7.916)	(56)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs	60
1.753	HP Inc	Goldman Sachs	(6.679)	(237)	International Flavors & Fragrances Inc	JP Morgan	246
901	HP Inc	JP Morgan	(5.424)	5.077	International Paper Co	Barclays Bank	(6.600)
(19)	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	(408)	313	International Paper Co	Credit Suisse	319
(23)	HubSpot Inc	Barclays Bank	59	1.936	International Paper Co	Goldman Sachs	(1.936)
(1)	HubSpot Inc	Credit Suisse	(18)	356	International Paper Co	JP Morgan	363
(116)	HubSpot Inc	Goldman Sachs	(2.491)	1.187	Interpublic Group of Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.329
(139)	Humana Inc	Barclays Bank	708	7.832	Interpublic Group of Cos Inc	Barclays Bank	2.910
(5.058)	Huntington Bancshares Inc	Barclays Bank	(1.113)	1.117	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs	1.251
(79)	IAC Via InterActive Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.152	404	Interpublic Group of Cos Inc	HSBC	364
(924)	IAC Via InterActive Corp	Barclays Bank	86.080	1.333	Interpublic Group of Cos Inc	JP Morgan	1.114
(382)	IAC Via InterActive Corp	Citibank	35.587	600	Intuit Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.802
(611)	IAC Via InterActive Corp	Goldman Sachs	39.843				
(198)	IAC Via InterActive Corp	HSBC	14.786				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
358	Intuit Inc	Citibank	(473)	1.553	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs	4.411
(218)	Intuitive Surgical Inc	Barclays Bank	(1.544)	(1.766)	Kimberly-Clark Corp	Barclays Bank	2.316
(33)	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs	(831)	(1.068)	Kimberly-Clark Corp	Credit Suisse	6.102
377	Invesco Ltd	Barclays Bank	577	(1.061)	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs	3.037
1.558	Invesco Ltd	Credit Suisse	483	(111)	Kimberly-Clark Corp	HSBC	696
417	Invesco Ltd	Goldman Sachs	321	1.108	Kinder Morgan Inc	Bank of America	
382	Invesco Ltd	HSBC	118			Merrill Lynch	(510)
(268)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America		7.070	Kinder Morgan Inc	Barclays Bank	(3.464)
		Merrill Lynch	19	1.266	KKR & Co Inc	Barclays Bank	468
(1.300)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(2.366)	184	KKR & Co Inc	Credit Suisse	(48)
(770)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Citibank	(1.401)	218	KLA Corp	Bank of America	
(234)	Ionis Pharmaceuticals Inc	HSBC	(236)			Merrill Lynch	3.466
(256)	IPG Photonics Corp	Bank of America		52	KLA Corp	Credit Suisse	883
		Merrill Lynch	(3.295)	90	KLA Corp	Goldman Sachs	1.725
(618)	IPG Photonics Corp	Barclays Bank	(1.148)	47	KLA Corp	JP Morgan	799
(113)	IPG Photonics Corp	Citibank	(194)	595	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America	
(63)	IPG Photonics Corp	Credit Suisse	(408)	8.053	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Barclays Bank	(5.798)
(188)	IPG Photonics Corp	Goldman Sachs	(1.492)	861	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs	(493)
(144)	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.250)	648	Kroger Co	Bank of America	
272	J M Smucker Co	Barclays Bank	(631)			Merrill Lynch	(266)
83	J M Smucker Co	HSBC	(140)	2.726	Kroger Co	Barclays Bank	1.036
(65)	Jack Henry & Associates Inc	Barclays Bank	173	(992)	L3Harris Technologies Inc	Bank of America	
(84)	Jack Henry & Associates Inc	Goldman Sachs	197	(632)	L3Harris Technologies Inc	Merrill Lynch	40
(119)	Jack Henry & Associates Inc	HSBC	560	(243)	L3Harris Technologies Inc	Barclays Bank	(768)
273	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America		(315)	L3Harris Technologies Inc	Credit Suisse	(361)
		Merrill Lynch	363	(305)	L3Harris Technologies Inc	Goldman Sachs	13
331	Jazz Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	(275)	(102)	L3Harris Technologies Inc	HSBC	(317)
23	Jazz Pharmaceuticals Plc	Citibank	(19)	247	Laboratory Corp of America Holdings	JP Morgan	(106)
607	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs	807	48	Laboratory Corp of America Holdings	Bank of America	
14	Jazz Pharmaceuticals Plc	HSBC	28	371	Laboratory Corp of America Holdings	Merrill Lynch	1.292
501	Jazz Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	1.017	49	Laboratory Corp of America Holdings	Barclays Bank	154
2.274	JB Hunt Transport Services Inc	Barclays Bank	1.023	289	Lam Research Corp	Goldman Sachs	2.653
59	JB Hunt Transport Services Inc	JP Morgan	(527)	48	Lam Research Corp	Bank of America	
(519)	Johnson & Johnson	Bank of America		22	Lam Research Corp	Merrill Lynch	16.698
		Merrill Lynch	125	277	Lam Research Corp	Barclays Bank	730
(974)	Johnson & Johnson	Barclays Bank	1.266	(1.970)	Lamb Weston Holdings Inc	Credit Suisse	600
(102)	Johnson & Johnson	Credit Suisse	138	(2.114)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	16.005
(750)	Johnson & Johnson	Goldman Sachs	855	(6.718)	Las Vegas Sands Corp	Bank of America	
(539)	Johnson & Johnson	HSBC	550	(1.059)	Las Vegas Sands Corp	Merrill Lynch	(2.093)
(115)	Johnson & Johnson	JP Morgan	(13)	(594)	Las Vegas Sands Corp	Barclays Bank	(67)
4.933	Johnson Controls International Plc	Bank of America		(287)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	(1.048)
		Merrill Lynch	3.108	(315)	Lear Corp	HSBC	(362)
862	Johnson Controls International Plc	Barclays Bank	1.332	(191)	Lear Corp	JP Morgan	(175)
458	Johnson Controls International Plc	Credit Suisse	304	(394)	Lear Corp	Barclays Bank	(1.994)
724	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs	456	(321)	Lear Corp	Citibank	(1.209)
160	Johnson Controls International Plc	HSBC	114	796	Lennar Corp 'A'	Goldman Sachs	(3.294)
796	Johnson Controls International Plc	JP Morgan	565			HSBC	(876)
(75)	JPMorgan Chase & Co	Barclays Bank	(53)	177	Lennar Corp 'A'	Bank of America	
(181)	JPMorgan Chase & Co	Goldman Sachs	78	128	Lennar Corp 'A'	Merrill Lynch	732
(3.145)	Juniper Networks Inc	Barclays Bank	1.604	271	Lennar Corp 'A'	Credit Suisse	(1.584)
(83)	Kansas City Southern	Barclays Bank	(189)	299	Lennox International Inc	Goldman Sachs	118
(68)	Kansas City Southern	Citibank	(330)			HSBC	(2.425)
(120)	Kansas City Southern	Goldman Sachs	(429)	372	Lennox International Inc	Bank of America	
695	Kellogg Co	Citibank	(424)	34	Lennox International Inc	Merrill Lynch	478
(13.738)	Keurig Dr Pepper Inc	Bank of America		170	Lennox International Inc	Barclays Bank	2.671
		Merrill Lynch	(13.601)	(1.082)	Liberty Broadband Corp	Credit Suisse	(122)
(3.821)	Keurig Dr Pepper Inc	Barclays Bank	(382)	461)	Liberty Broadband Corp	Goldman Sachs	272
372	KeyCorp	Bank of America		(901)	Liberty Broadband Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(179)			Merrill Lynch	(3.376)
18.504	KeyCorp	Barclays Bank	—			Barclays Bank	1.422
						Citibank	313
						Credit Suisse	(451)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.499)	Liberty Broadband Corp	Goldman Sachs	(4.677)	(1.382)	Marvell Technology Inc	Goldman Sachs	(7.587)
(84)	Liberty Broadband Corp	HSBC	(42)	(1.122)	Marvell Technology Inc	JP Morgan	(4.466)
(282)	Liberty Broadband Corp	JP Morgan	(141)	5.731	Masco Corp	Bank of America	
(3.980)	Liberty Global Plc 'A'	Barclays Bank	(40)			Merrill Lynch	(20.058)
(3.887)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(2.954)	2.488	Masco Corp	Barclays Bank	(984)
(2.763)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Barclays Bank	939	725	Masco Corp	Citibank	(247)
(1.025)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Barclays Bank	(1.302)	178	Masco Corp	Credit Suisse	(1.210)
(945)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	HSBC	(1.276)	1.271	Masco Corp	Goldman Sachs	(3.448)
(313)	Lincoln National Corp	Barclays Bank	(160)	741	Masco Corp	HSBC	(1.818)
(93)	Linde Plc	Bank of America Merrill Lynch	26	182	Masimo Corp	Bank of America Merrill Lynch	466
(74)	Linde Plc	Barclays Bank	50	159	Masimo Corp	Barclays Bank	(415)
(1.689)	Linde Plc	Goldman Sachs	473	61	Masimo Corp	Citibank	(159)
(40)	Linde Plc	HSBC	16	88	Masimo Corp	Goldman Sachs	225
(1.655)	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.251)	255	Masimo Corp	HSBC	(326)
(896)	Live Nation Entertainment Inc	Barclays Bank	1.443	(534)	Match Group Inc	Barclays Bank	2.093
(125)	Live Nation Entertainment Inc	Goldman Sachs	(699)	(23)	Match Group Inc	Citibank	90
695	LKQ Corp	Bank of America Merrill Lynch	265	(40)	Match Group Inc	Goldman Sachs	(136)
2.685	LKQ Corp	Barclays Bank	1.578	1.588	Maxim Integrated Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	16.801
537	LKQ Corp	Citibank	381	892	Maxim Integrated Products Inc	Barclays Bank	1.169
2.314	LKQ Corp	Goldman Sachs	(231)	673	Maxim Integrated Products Inc	Goldman Sachs	7.120
277	LKQ Corp	HSBC	277	4.306	Maxim Integrated Products Inc	HSBC	40.304
553	LKQ Corp	JP Morgan	553	106	Maxim Integrated Products Inc	JP Morgan	992
3.320	Loews Corp	Barclays Bank	(664)	(434)	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	35
2.183	Lowe's Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.528	(555)	McCormick & Co Inc	Barclays Bank	855
596	Lowe's Cos Inc	Barclays Bank	2.176	(202)	McCormick & Co Inc	Citibank	311
64	Lowe's Cos Inc	Credit Suisse	(1.055)	(198)	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs	16
227	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs	159	339	McDonald's Corp	Bank of America Merrill Lynch	677
578	Lowe's Cos Inc	HSBC	(6.775)	336	McDonald's Corp	Barclays Bank	291
(48)	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	(412)	224	McDonald's Corp	Goldman Sachs	495
(12.129)	Lumen Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.612	42	McDonald's Corp	JP Morgan	(135)
(1.075)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Barclays Bank	(1.096)	259	McKesson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.805)
343	M&T Bank Corp	Barclays Bank	(305)	1.521	McKesson Corp	Barclays Bank	(11.027)
(906)	Marathon Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(712)	91	McKesson Corp	Citibank	(660)
(427)	Marathon Petroleum Corp	Barclays Bank	(457)	204	McKesson Corp	Goldman Sachs	(1.422)
(963)	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs	(270)	295	McKesson Corp	HSBC	(2.873)
36	Markel Corp	Citibank	(162)	215	McKesson Corp	JP Morgan	(2.094)
(294)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.366)	(1.342)	Medtronic Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.076)
(93)	MarketAxess Holdings Inc	Barclays Bank	(786)	(4.014)	Medtronic Plc	Barclays Bank	6.034
(21)	MarketAxess Holdings Inc	Credit Suisse	(562)	(843)	Medtronic Plc	Citibank	1.273
(40)	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs	(458)	(595)	Medtronic Plc	Credit Suisse	127
(23)	MarketAxess Holdings Inc	HSBC	(74)	(1.673)	Medtronic Plc	Goldman Sachs	(1.773)
(519)	Marriott International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.931)	(209)	Medtronic Plc	HSBC	(111)
(1.537)	Marriott International Inc 'A'	Barclays Bank	(2.598)	(5.831)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	573
(145)	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(560)	(6.136)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Barclays Bank	(127)
(889)	Marsh & McLennan Cos Inc	Barclays Bank	(1.707)	(848)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Citibank	(51)
(843)	Marsh & McLennan Cos Inc	Citibank	(1.619)	(1.340)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	HSBC	1.755
(501)	Marsh & McLennan Cos Inc	Credit Suisse	(281)	(7)	MercadoLibre Inc	Bank of America Merrill Lynch	(153)
(453)	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs	(1.749)	(127)	MercadoLibre Inc	Barclays Bank	1.100
(103)	Martin Marietta Materials Inc	Barclays Bank	289	(969)	Merck & Co Inc	Barclays Bank	491
(2.145)	Marvell Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.776)	287	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98)
(437)	Marvell Technology Inc	Barclays Bank	(297)	7.955	MetLife Inc	Barclays Bank	(80)
				45	MetLife Inc	Credit Suisse	(50)
				1.809	MetLife Inc	Goldman Sachs	(615)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
160	MetLife Inc	JP Morgan	(178)	482	Morgan Stanley	Barclays Bank	607
262	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.782	141	Morgan Stanley	Citibank	178
215	Mettler-Toledo International Inc	Barclays Bank	4.036	2.354	Morgan Stanley	Goldman Sachs	6.732
45	Mettler-Toledo International Inc	Credit Suisse	1.661	599	Morgan Stanley	HSBC	2.684
75	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	2.530	2.142	Mosaic Co	Bank of America Merrill Lynch	(1.971)
16	Mettler-Toledo International Inc	JP Morgan	902	795	Mosaic Co	Barclays Bank	350
697	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	2.872	588	Mosaic Co	Citibank	259
276	MGM Resorts International	Credit Suisse	941	364	Mosaic Co	Credit Suisse	229
(2.045)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27.464)	1.167	Mosaic Co	Goldman Sachs	(1.074)
(998)	Microchip Technology Inc	Barclays Bank	(2.844)	353	Mosaic Co	JP Morgan	222
(392)	Microchip Technology Inc	Credit Suisse	(4.364)	194	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	904
(406)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	(5.453)	973	Motorola Solutions Inc	Barclays Bank	2.403
(118)	Micron Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(443)	4	Motorola Solutions Inc	JP Morgan	20
(682)	Micron Technology Inc	Barclays Bank	(846)	(220)	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.717)
(287)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs	(1.076)	(32)	MSCI Inc	Barclays Bank	(169)
406	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.827	(67)	MSCI Inc	Citibank	(354)
716	Microsoft Corp	Barclays Bank	(788)	(33)	MSCI Inc	Goldman Sachs	(408)
147	Microsoft Corp	Goldman Sachs	662	(54)	MSCI Inc	HSBC	473
114	Microsoft Corp	HSBC	285	(77)	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	(286)
2.287	Microsoft Corp	JP Morgan	5.718	(636)	Nasdaq Inc	Barclays Bank	(1.296)
62	Moderna Inc	Barclays Bank	1.292	(66)	Nasdaq Inc	Credit Suisse	(259)
98	Moderna Inc	JP Morgan	2.617	(230)	Nasdaq Inc	Goldman Sachs	(853)
91	Mohawk Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(689)	(62)	Nasdaq Inc	HSBC	(227)
757	Mohawk Industries Inc	Barclays Bank	1.817	(80)	Nasdaq Inc	JP Morgan	(142)
80	Mohawk Industries Inc	Goldman Sachs	(606)	1.967	NetApp Inc	Barclays Bank	(3.187)
122	Mohawk Industries Inc	HSBC	(1.928)	160	NetApp Inc	Citibank	(259)
120	Mohawk Industries Inc	JP Morgan	(1.896)	310	NetApp Inc	Credit Suisse	(462)
290	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.100)	1.911	NetApp Inc	Goldman Sachs	(2.045)
590	Molina Healthcare Inc	Citibank	(1.558)	41	NetApp Inc	HSBC	(61)
115	Molina Healthcare Inc	Credit Suisse	(1.999)	134	NetApp Inc	JP Morgan	(200)
48	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs	(513)	(292)	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.050)
59	Molina Healthcare Inc	JP Morgan	(1.025)	(73)	Netflix Inc	Barclays Bank	(29)
269	Molson Coors Beverage Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	105	(294)	Netflix Inc	Goldman Sachs	(4.078)
735	Molson Coors Beverage Co 'B'	Barclays Bank	419	(35)	Netflix Inc	HSBC	(4)
1.761	Molson Coors Beverage Co 'B'	Goldman Sachs	687	(318)	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(999)
349	Mondelez International Inc 'A'	Goldman Sachs	370	(711)	Neurocrine Biosciences Inc	Barclays Bank	(292)
630	Mondelez International Inc 'A'	HSBC	920	(380)	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs	(1.193)
(371)	MongoDB Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.299)	(288)	Neurocrine Biosciences Inc	HSBC	(1.434)
(414)	MongoDB Inc	Barclays Bank	(2.140)	(301)	Neurocrine Biosciences Inc	JP Morgan	(1.499)
(72)	MongoDB Inc	Citibank	(372)	1.003	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	600
681	Monolithic Power Systems Inc	Barclays Bank	9.003	(159)	Newmont Corp	Bank of America Merrill Lynch	83
29	Monolithic Power Systems Inc	Citibank	383	(5.551)	Newmont Corp	Barclays Bank	1.369
157	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	458	(417)	Newmont Corp	Credit Suisse	(2.139)
1.861	Monster Beverage Corp	Barclays Bank	1.707	(1.256)	Newmont Corp	Goldman Sachs	653
135	Monster Beverage Corp	Citibank	176	(246)	Newmont Corp	JP Morgan	(1.262)
563	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs	1.644	375	News Corp 'A'	Barclays Bank	56
1.988	Monster Beverage Corp	HSBC	5.308	3.393	News Corp 'A'	Goldman Sachs	271
(200)	Moody's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.132)	624	News Corp 'A'	HSBC	(281)
520	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	1.487	(2.538)	NextEra Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.023)
				(4.358)	NextEra Energy Inc	Barclays Bank	1.782
				(2.211)	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs	(2.919)
				(293)	NextEra Energy Inc	HSBC	463
				886	NIKE Inc 'B'	Barclays Bank	2.126
				209	Nordson Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.699
				256	Nordson Corp	Barclays Bank	4.920
				190	Nordson Corp	Citibank	3.652
				997	Nordson Corp	Goldman Sachs	17.647
				112	Nordson Corp	HSBC	1.457
				146	Nordson Corp	JP Morgan	1.899

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
59	Norfolk Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	(286)	32	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs	(63)
189	Norfolk Southern Corp	Barclays Bank	79	259	Otis Worldwide Corp	Citibank	52
424	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	(2.052)	366	Otis Worldwide Corp	Goldman Sachs	(249)
341	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	194	979	Owens Corning	Bank of America Merrill Lynch	352
739	Northern Trust Corp	Barclays Bank	392	1.021	Owens Corning	Barclays Bank	1.521
167	Northern Trust Corp	Citibank	89	341	Owens Corning	Citibank	504
181	Northern Trust Corp	Credit Suisse	183	278	Owens Corning	Credit Suisse	(22)
660	Northern Trust Corp	Goldman Sachs	376	353	Owens Corning	Goldman Sachs	127
910	NortonLifeLock Inc	HSBC	2.017	2.102	Owens Corning	HSBC	(3.300)
34	Novocure Ltd	Barclays Bank	638	111	Owens Corning	JP Morgan	(174)
154	Novocure Ltd	Goldman Sachs	4.466	311	PACCAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(697)
(131)	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(132)	705	PACCAR Inc	Barclays Bank	(197)
(3.198)	Nucor Corp	Barclays Bank	2.622	544	PACCAR Inc	Goldman Sachs	(1.219)
(518)	Nucor Corp	JP Morgan	358	(37)	Packaging Corp of America	Bank of America Merrill Lynch	240
(52)	NVIDIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.292)	(361)	Packaging Corp of America	Barclays Bank	1.029
(98)	NVIDIA Corp	Barclays Bank	(2.479)	(136)	Palo Alto Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.733)
(157)	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	(13.056)	(67)	Palo Alto Networks Inc	Barclays Bank	85
2	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	31	(465)	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs	(12.764)
49	NVR Inc	Barclays Bank	11.491	561	Parker-Hannifin Corp	Barclays Bank	1.279
8	NVR Inc	Credit Suisse	(2.629)	(117)	Paychex Inc	Barclays Bank	88
707	NXP Semiconductors NV	Barclays Bank	4.977	(122)	Paycom Software Inc	Barclays Bank	834
60	NXP Semiconductors NV	Citibank	422	(155)	Paycom Software Inc	Goldman Sachs	(1.147)
(179)	Occidental Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	77	(521)	PayPal Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.159)
(1.280)	Occidental Petroleum Corp	Barclays Bank	(887)	(561)	PayPal Holdings Inc	Barclays Bank	(1.599)
(2.962)	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs	1.274	(88)	PayPal Holdings Inc	Citibank	(251)
(418)	Occidental Petroleum Corp	HSBC	280	(10)	PayPal Holdings Inc	HSBC	(164)
(114)	Okta Inc	Bank of America Merrill Lynch	285	1	Pebblebrook Hotel Trust (REIT) ^{††}	Credit Suisse	—
(416)	Okta Inc	Barclays Bank	8.370	(650)	Peloton Interactive Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10.011)
(1.254)	Okta Inc	Goldman Sachs	3.135	(473)	Peloton Interactive Inc 'A'	Barclays Bank	(4.328)
399	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America Merrill Lynch	(676)	(99)	Peloton Interactive Inc 'A'	Credit Suisse	(2.259)
268	Old Dominion Freight Line Inc	Barclays Bank	129	(737)	Peloton Interactive Inc 'A'	Goldman Sachs	(13.281)
37	Old Dominion Freight Line Inc	Citibank	28	4.802	Pentair Plc	Barclays Bank	4.370
1.173	Old Dominion Freight Line Inc	Goldman Sachs	(4.852)	3.873	PepsiCo Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.855
1.237	Old Dominion Freight Line Inc	HSBC	(5.789)	883	PepsiCo Inc	Barclays Bank	13
38	Old Dominion Freight Line Inc	JP Morgan	63	131	PepsiCo Inc	Citibank	12
580	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(505)	69	PepsiCo Inc	Credit Suisse	84
4.746	Omnicom Group Inc	Barclays Bank	(4.556)	484	PepsiCo Inc	Goldman Sachs	857
483	Omnicom Group Inc	Citibank	(464)	(2.167)	PerkinElmer Inc	Barclays Bank	(997)
723	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs	(629)	(1.749)	Pfizer Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.266
204	Omnicom Group Inc	HSBC	(522)	(2.917)	Pfizer Inc	Barclays Bank	3.150
491	Omnicom Group Inc	JP Morgan	(1.257)	(173)	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(3.693)	ON Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12.187)	(410)	Phillips 66	Barclays Bank	529
(789)	ON Semiconductor Corp	Barclays Bank	(552)	(263)	Phillips 66	HSBC	360
(385)	ON Semiconductor Corp	Credit Suisse	(359)	868	Pinterest Inc 'A'	Barclays Bank	2.075
(377)	ONEOK Inc	Barclays Bank	528	300	Pinterest Inc 'A'	Citibank	717
(2.949)	Oracle Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.061	1.094	Pinterest Inc 'A'	Goldman Sachs	7.877
(520)	Oracle Corp	Barclays Bank	333	172	Pinterest Inc 'A'	HSBC	1.085
(312)	Oracle Corp	Credit Suisse	440	(908)	Pioneer Natural Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	3.816
(2.072)	Oracle Corp	Goldman Sachs	704	(67)	Pioneer Natural Resources Co	Barclays Bank	(155)
84	O'Reilly Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.054)	(161)	Pioneer Natural Resources Co	Citibank	(89)
469	O'Reilly Automotive Inc	Barclays Bank	(583)	(863)	Pioneer Natural Resources Co	Goldman Sachs	1.603
52	O'Reilly Automotive Inc	Citibank	(92)	(1.074)	Plug Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.186)
61	O'Reilly Automotive Inc	Credit Suisse	(49)	(2.528)	Plug Power Inc	Barclays Bank	(8.426)
				(2.617)	Plug Power Inc	Citibank	(9.159)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.512)	Plug Power Inc	Credit Suisse	(11.403)	30	Regeneron		
(1.020)	Plug Power Inc	Goldman Sachs	(5.875)		Pharmaceuticals Inc	HSBC	3
(1.708)	Plug Power Inc	HSBC	(18.156)	1.435	Regions Financial Corp	Bank of America	
104	PNC Financial Services Group Inc	Citibank	72		Merrill Lynch		14
61	PNC Financial Services Group Inc	Goldman Sachs	(265)	3.631	Regions Financial Corp	Barclays Bank	1.961
807	Pool Corp	Barclays Bank	4.689	2.403	Regions Financial Corp	Goldman Sachs	24
45	Pool Corp	Citibank	261	5.984	Regions Financial Corp	HSBC	4.548
45	Pool Corp	Goldman Sachs	40	1.126	Regions Financial Corp	JP Morgan	856
(354)	PPD Inc	Barclays Bank	—	(196)	Reinsurance Group of America Inc	Barclays Bank	(443)
(374)	PPG Industries Inc	Bank of America		(680)	Reinsurance Group of America Inc	Citibank	(1.537)
		Merrill Lynch	90	(394)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Barclays Bank	(13)
(597)	PPG Industries Inc	Barclays Bank	(90)	(130)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Citibank	(31)
(389)	PPG Industries Inc	Goldman Sachs	93	(252)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Credit Suisse	1.479
416	Principal Financial Group Inc	Citibank	(154)	(1.747)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Goldman Sachs	2.274
(585)	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs	1.685	(2.945)	Republic Services Inc	Bank of America	
(2.703)	Progressive Corp	Bank of America		(107)	Republic Services Inc	Merrill Lynch	2.503
		Merrill Lynch	20.218	(3.740)	Republic Services Inc	Credit Suisse	(79)
(611)	Progressive Corp	Barclays Bank	(582)	(366)	Republic Services Inc	Goldman Sachs	3.179
(132)	Progressive Corp	Credit Suisse	879	(322)	Republic Services Inc	HSBC	1.050
(234)	Progressive Corp	Goldman Sachs	1.750	(243)	ResMed Inc	JP Morgan	924
(416)	Progressive Corp	JP Morgan	2.771	(55)	ResMed Inc	Bank of America	
2.422	Prudential Financial Inc	Barclays Bank	1.550	(212)	ResMed Inc	Merrill Lynch	(2.536)
800	PTC Inc	Barclays Bank	1.056	(158)	ResMed Inc	Barclays Bank	26
182	PTC Inc	Goldman Sachs	1.179	(92)	ResMed Inc	Citibank	102
(2.341)	Public Service Enterprise Group Inc	Barclays Bank	60	(200)	RingCentral Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.714)
(351)	Public Service Enterprise Group Inc	Goldman Sachs	60	(457)	RingCentral Inc 'A'	HSBC	(1.163)
529	PulteGroup Inc	Bank of America		(43)	RingCentral Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(106)	(57)	RingCentral Inc 'A'	Merrill Lynch	(5.388)
2.667	PulteGroup Inc	Barclays Bank	4.721	(312)	RingCentral Inc 'A'	Barclays Bank	(7.230)
246	PulteGroup Inc	Citibank	435	(117)	RingCentral Inc 'A'	Citibank	(436)
427	PulteGroup Inc	Goldman Sachs	(85)	(157)	RingCentral Inc 'A'	Credit Suisse	(119)
22	PulteGroup Inc	HSBC	(100)	249	Robert Half International Inc	Goldman Sachs	(8.405)
72	Qorvo Inc	Bank of America		3.583	Robert Half International Inc	HSBC	(243)
		Merrill Lynch	838	88	Robert Half International Inc	JP Morgan	(934)
532	Qorvo Inc	Barclays Bank	2.176		Robert Half International Inc	Bank of America	
226	Qorvo Inc	Goldman Sachs	1.849		Robert Half International Inc	Merrill Lynch	(234)
171	Qorvo Inc	HSBC	1.924		Rockwell Automation Inc	Barclays Bank	2.759
68	Qorvo Inc	JP Morgan	744				
1.564	QUALCOMM Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	7.413				
1.238	QUALCOMM Inc	Barclays Bank	2.018				
302	QUALCOMM Inc	Citibank	492				
179	QUALCOMM Inc	Credit Suisse	272				
1.709	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs	6.897				
1.193	QUALCOMM Inc	HSBC	6.681				
338	QUALCOMM Inc	JP Morgan	1.893				
124	Quest Diagnostics Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(42)				
602	Quest Diagnostics Inc	Barclays Bank	722				
376	Raymond James Financial Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(500)				
286	Raymond James Financial Inc	Barclays Bank	(555)				
361	Raymond James Financial Inc	Citibank	(700)				
186	Raymond James Financial Inc	Credit Suisse	(458)				
489	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	(650)				
79	Raymond James Financial Inc	HSBC	(194)				
233	Raymond James Financial Inc	JP Morgan	(573)				
32	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	63				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
499	Ross Stores Inc	Goldman Sachs	(689)	33.867	Sirius XM Holdings Inc	Barclays Bank	3.725
(300)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.619)	729	Skyworks Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.257
(1.086)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Barclays Bank	(8.036)	53	Skyworks Solutions Inc	Barclays Bank	59
(234)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Citibank	(990)	1	Skyworks Solutions Inc	JP Morgan	4
(801)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs	(6.993)	(321)	Slack Technologies Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(368)
(183)	Royal Caribbean Cruises Ltd	HSBC	(1.709)	(1.244)	Slack Technologies Inc 'A'	Citibank	(1.344)
(2.074)	Royalty Pharma Plc 'A'	Barclays Bank	1.244	(1.985)	Slack Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	(5.128)
(236)	RPM International Inc	Bank of America Merrill Lynch	701	(896)	Snap Inc 'A'	Barclays Bank	(1.792)
(218)	RPM International Inc	Barclays Bank	150	(604)	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.959)
(42)	S&P Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(190)	(65)	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)
(585)	S&P Global Inc	Barclays Bank	(246)	(54)	Snowflake Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.371)
(1.029)	salesforce.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20.840)	(531)	Snowflake Inc 'A'	Barclays Bank	(2.182)
(1.855)	salesforce.com Inc	Barclays Bank	(20.604)	(74)	Snowflake Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.878)
(316)	salesforce.com Inc	Citibank	(3.511)	(59)	Snowflake Inc 'A'	HSBC	(2.608)
(298)	salesforce.com Inc	Credit Suisse	(5.843)	(79)	SolarEdge Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.160)
(587)	salesforce.com Inc	Goldman Sachs	(11.995)	(328)	SolarEdge Technologies Inc	Barclays Bank	(1.063)
(50)	salesforce.com Inc	HSBC	(1.122)	(395)	SolarEdge Technologies Inc	Credit Suisse	(17.505)
(253)	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	906	(211)	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs	(8.440)
(1.824)	Sarepta Therapeutics Inc	Barclays Bank	2.610	(83)	SolarEdge Technologies Inc	HSBC	(3.708)
(228)	Sarepta Therapeutics Inc	Citibank	356	(57)	SolarEdge Technologies Inc	JP Morgan	(2.546)
(358)	Sarepta Therapeutics Inc	Credit Suisse	(1.998)	(258)	Southwest Airlines Co	Bank of America Merrill Lynch	165
(1.923)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(257)	(1.989)	Southwest Airlines Co	Barclays Bank	(1.551)
(150)	Sarepta Therapeutics Inc	HSBC	(843)	(566)	Southwest Airlines Co	Credit Suisse	(62)
(3.265)	Schlumberger NV	Bank of America Merrill Lynch	139	(1.315)	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	842
(7.562)	Schlumberger NV	Barclays Bank	1.133	(395)	Southwest Airlines Co	HSBC	(43)
(1.600)	Schlumberger NV	JP Morgan	508	(38.622)	Spectrum Brands Holdings Inc	JP Morgan	233.663
(330)	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs	2.798	(1.512)	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.327)
(341)	Seagen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.513)	(457)	Splunk Inc	Barclays Bank	(466)
(480)	Seagen Inc	Barclays Bank	(806)	(152)	Splunk Inc	Citibank	(326)
(1.308)	Seagen Inc	Goldman Sachs	(9.640)	(107)	Splunk Inc	HSBC	(798)
1.644	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	526	(786)	Square Inc 'A'	Barclays Bank	(9.094)
1.791	Sealed Air Corp	Barclays Bank	681	(58)	Square Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.137)
555	Sealed Air Corp	Citibank	211	(104)	Square Inc 'A'	HSBC	(633)
564	Sealed Air Corp	Credit Suisse	23	(403)	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	97
3.114	Sealed Air Corp	Goldman Sachs	996	(611)	SS&C Technologies Holdings Inc	Barclays Bank	385
1.250	Sealed Air Corp	JP Morgan	50	(255)	SS&C Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs	61
(609)	SEI Investments Co	Bank of America Merrill Lynch	(311)	(448)	SS&C Technologies Holdings Inc	HSBC	(246)
(413)	SEI Investments Co	Barclays Bank	(85)	157	Stanley Black & Decker Inc	Barclays Bank	818
(513)	SEI Investments Co	Goldman Sachs	(156)	48	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	95
(481)	Sempra Energy	Bank of America Merrill Lynch	110	162	Starbucks Corp	Bank of America Merrill Lynch	11
(199)	Sempra Energy	Barclays Bank	(24)	2.678	Starbucks Corp	Barclays Bank	3.399
(296)	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch	(210)	4.671	Starbucks Corp	Citibank	6.353
36	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119)	137	Starbucks Corp	Credit Suisse	(58)
645	ServiceNow Inc	Barclays Bank	(1.611)	593	Starbucks Corp	Goldman Sachs	1.720
25	ServiceNow Inc	Goldman Sachs	487	180	Starbucks Corp	HSBC	(76)
649	Sherwin-Williams Co	Bank of America Merrill Lynch	(426)	106	Starbucks Corp	JP Morgan	66
1.205	Sherwin-Williams Co	Barclays Bank	(1.922)	47	State Street Corp	Bank of America Merrill Lynch	28
238	Sherwin-Williams Co	Credit Suisse	(1.219)	1.599	State Street Corp	Barclays Bank	911
625	Sherwin-Williams Co	Goldman Sachs	(441)	317	State Street Corp	Goldman Sachs	190
62	Sherwin-Williams Co	HSBC	(317)	120	State Street Corp	HSBC	(102)
174	Sherwin-Williams Co	JP Morgan	(316)	(576)	Steel Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	684
				(1.064)	Steel Dynamics Inc	Barclays Bank	(391)
				(914)	Steel Dynamics Inc	HSBC	1.417

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(91)	STERIS Plc	Bank of America		96	Texas Instruments Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	520			Merrill Lynch	863
(368)	STERIS Plc	Barclays Bank	(57)	340	Texas Instruments Inc	Barclays Bank	384
(75)	STERIS Plc	Credit Suisse	1.259	679	Texas Instruments Inc	Credit Suisse	5.276
(93)	STERIS Plc	JP Morgan	1.561	781	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs	5.562
(1.738)	Sunrun Inc	Bank of America		(504)	Thermo Fisher Scientific Inc	Barclays Bank	(3.548)
		Merrill Lynch	(4.089)	(110)	Thermo Fisher Scientific Inc	Citibank	(774)
(1.921)	Sunrun Inc	Barclays Bank	250	(143)	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldman Sachs	(2.371)
(367)	Sunrun Inc	Citibank	199	684	TJX Cos Inc	Bank of America	
(636)	Sunrun Inc	Credit Suisse	(2.493)			Merrill Lynch	(3.057)
(485)	Sunrun Inc	Goldman Sachs	(2.289)	3.591	TJX Cos Inc	Barclays Bank	3.586
(538)	Sunrun Inc	HSBC	(2.209)	230	TJX Cos Inc	Credit Suisse	208
(2.392)	Sunrun Inc	JP Morgan	(9.377)	528	TJX Cos Inc	Goldman Sachs	(576)
39	SVB Financial Group	Citibank	298	142	TJX Cos Inc	HSBC	(774)
1.098	Synchrony Financial	Bank of America		159	TJX Cos Inc	JP Morgan	(867)
		Merrill Lynch	549	(688)	T-Mobile US Inc	Bank of America	
385	Synchrony Financial	Barclays Bank	389			Merrill Lynch	(1.292)
336	Synchrony Financial	Goldman Sachs	168	(3.872)	T-Mobile US Inc	Barclays Bank	(14.616)
255	Synopsys Inc	Bank of America		(557)	T-Mobile US Inc	Credit Suisse	(3.034)
		Merrill Lynch	4.677	(3.218)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	(4.395)
433	Synopsys Inc	Barclays Bank	1.479	(98)	T-Mobile US Inc	HSBC	(214)
3.102	Synopsys Inc	Citibank	17.868	43	Tractor Supply Co	Bank of America	
64	Synopsys Inc	Credit Suisse	1.405			Merrill Lynch	(202)
288	Synopsys Inc	Goldman Sachs	3.326	816	Tractor Supply Co	Barclays Bank	(65)
166	Synopsys Inc	HSBC	3.644	55	Tractor Supply Co	Citibank	(4)
250	Synopsys Inc	JP Morgan	2.718	72	Tractor Supply Co	Credit Suisse	(1.008)
247	Sysco Corp	Bank of America		65	Tractor Supply Co	HSBC	(910)
		Merrill Lynch	138	57	Tractor Supply Co	JP Morgan	(798)
116	T Rowe Price Group Inc	Bank of America		(34)	Trade Desk Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(14)			Merrill Lynch	(2.737)
231	T Rowe Price Group Inc	Barclays Bank	802	(107)	Trade Desk Inc 'A'	Barclays Bank	(3.235)
5	T Rowe Price Group Inc	Citibank	17	(22)	Trade Desk Inc 'A'	Citibank	(211)
90	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs	(11)	(191)	Trade Desk Inc 'A'	Goldman Sachs	(14.546)
515	Take-Two Interactive Software Inc	Barclays Bank	278	(14)	Trade Desk Inc 'A'	JP Morgan	(1.380)
210	Target Corp	Bank of America		(557)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.549			Merrill Lynch	(6)
851	Target Corp	Barclays Bank	1.164	(302)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Citibank	(788)
335	Target Corp	HSBC	4.318	(1.936)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	(19)
(2.391)	TE Connectivity Ltd	Barclays Bank	(2.726)	166	Trane Technologies Plc	Bank of America	
(575)	Teladoc Health Inc	Bank of America				Merrill Lynch	475
		Merrill Lynch	(7.237)	952	Trane Technologies Plc	Barclays Bank	4.094
(911)	Teladoc Health Inc	Barclays Bank	(6.917)	83	Trane Technologies Plc	Credit Suisse	(22)
(91)	Teladoc Health Inc	Citibank	(751)	125	Trane Technologies Plc	Goldman Sachs	440
(1.002)	Teladoc Health Inc	Goldman Sachs	(13.246)	148	Trane Technologies Plc	HSBC	693
(93)	Teledyne Technologies Inc	Bank of America		(394)	TransUnion	Bank of America	
		Merrill Lynch	(462)	(1.445)	TransUnion	Merrill Lynch	410
(470)	Teledyne Technologies Inc	Barclays Bank	(3.882)	(576)	TransUnion	Barclays Bank	3.309
(71)	Teledyne Technologies Inc	Citibank	(625)	(1.195)	TransUnion	Citibank	1.319
(33)	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs	(105)	(683)	Travelers Cos Inc	Goldman Sachs	376
(30)	Teledyne Technologies Inc	JP Morgan	(402)	(371)	Travelers Cos Inc	HSBC	731
(454)	Teleflex Inc	Bank of America		427	Trimble Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.063)			Merrill Lynch	176
(299)	Teleflex Inc	Barclays Bank	383	408	Trimble Inc	Barclays Bank	(61)
(48)	Teleflex Inc	Goldman Sachs	(430)	669	Trimble Inc	Citibank	(100)
376	Teradyne Inc	Bank of America		280	Trimble Inc	Credit Suisse	483
		Merrill Lynch	4.696	143	Trimble Inc	Goldman Sachs	(68)
1.444	Teradyne Inc	Barclays Bank	6.729	438	Trimble Inc	HSBC	477
94	Teradyne Inc	Citibank	438	293	Trimble Inc	JP Morgan	15
155	Teradyne Inc	Credit Suisse	1.629	877	Truist Financial Corp	Bank of America	
92	Teradyne Inc	Goldman Sachs	1.149			Merrill Lynch	(210)
(37)	Tesla Inc	Bank of America		1.253	Truist Financial Corp	Barclays Bank	714
		Merrill Lynch	(1.790)	242	Truist Financial Corp	Goldman Sachs	(58)
(256)	Tesla Inc	Barclays Bank	(4.808)	(797)	Twilio Inc 'A'	Bank of America	
(21)	Tesla Inc	Citibank	(394)			Merrill Lynch	(30.924)
(39)	Tesla Inc	Credit Suisse	(2.009)	(289)	Twilio Inc 'A'	Barclays Bank	(3.062)
(19)	Tesla Inc	Goldman Sachs	(919)	(80)	Twilio Inc 'A'	Citibank	(953)
(52)	Tesla Inc	JP Morgan	199	(355)	Twilio Inc 'A'	Goldman Sachs	(12.516)
(10.748)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Bank of America		(29)	Twilio Inc 'A'	HSBC	(1.198)
		Merrill Lynch	3.869				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(552)	Twitter Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.981)	339	Vail Resorts Inc	Barclays Bank	2.109
(387)	Twitter Inc	Barclays Bank	(364)	85	Vail Resorts Inc	Credit Suisse	754
(1.389)	Twitter Inc	Citibank	(1.306)	34	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs	292
(1.254)	Twitter Inc	Goldman Sachs	(4.504)	80	Vail Resorts Inc	HSBC	710
(597)	Twitter Inc	JP Morgan	(925)	9	Vail Resorts Inc	JP Morgan	80
(66)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(754)	(273)	Valero Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(812)
(611)	Tyler Technologies Inc	Barclays Bank	409	(1.090)	Valero Energy Corp	Barclays Bank	(1.564)
(134)	Tyler Technologies Inc	Goldman Sachs	(1.530)	(202)	Valero Energy Corp	Citibank	(422)
(26)	Tyler Technologies Inc	JP Morgan	(284)	(138)	Valero Energy Corp	Credit Suisse	(105)
987	Tyson Foods Inc 'A'	Barclays Bank	(1.046)	(1.705)	Valero Energy Corp	Goldman Sachs	2.080
391	Tyson Foods Inc 'A'	Citibank	(414)	(295)	Valero Energy Corp	HSBC	(103)
962	Tyson Foods Inc 'A'	Credit Suisse	654	(638)	Valero Energy Corp	JP Morgan	(1.363)
1.312	Tyson Foods Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.456)	889	Veeva Systems Inc 'A'	Barclays Bank	25.363
214	Tyson Foods Inc 'A'	HSBC	146	86	Veeva Systems Inc 'A'	Citibank	2.454
(1.389)	Uber Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.396)	90	Veeva Systems Inc 'A'	Credit Suisse	3.798
(603)	Uber Technologies Inc	Barclays Bank	(482)	56	Veeva Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	2.432
(661)	Uber Technologies Inc	HSBC	(3.253)	42	Veeva Systems Inc 'A'	JP Morgan	1.772
(229)	Uber Technologies Inc	JP Morgan	(1.154)	1.077	VeriSign Inc	Barclays Bank	(4.933)
1.798	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.028	(632)	Verisk Analytics Inc	Bank of America Merrill Lynch	84
4.709	UGI Corp	Barclays Bank	5.839	(625)	Verisk Analytics Inc	Barclays Bank	838
484	UGI Corp	Citibank	600	(81)	Verisk Analytics Inc	Citibank	109
334	UGI Corp	Credit Suisse	(53)	(939)	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs	103
2.052	UGI Corp	Goldman Sachs	4.596	(213)	Verisk Analytics Inc	HSBC	1.433
772	UGI Corp	HSBC	(124)	(239)	Verisk Analytics Inc	JP Morgan	1.608
43	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Bank of America Merrill Lynch	669	3.074	Verizon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.457)
97	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Barclays Bank	2.865	2.423	Verizon Communications Inc	Barclays Bank	(1.187)
19	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Citibank	561	2.067	Verizon Communications Inc	Credit Suisse	(6.263)
191	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Goldman Sachs	2.970	761	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs	(1.103)
123	Union Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4)	1.638	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.645)
336	Union Pacific Corp	Barclays Bank	393	845	Vertex Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(2.189)
51	Union Pacific Corp	Citibank	60	247	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1.907)
54	Union Pacific Corp	Credit Suisse	(200)	147	Vertex Pharmaceuticals Inc	HSBC	(628)
184	Union Pacific Corp	Goldman Sachs	(6)	(129)	VF Corp	Barclays Bank	13
119	Union Pacific Corp	HSBC	(441)	(738)	VF Corp	Goldman Sachs	5.114
157	United Parcel Service Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(265)	(299)	ViacomCBS Inc 'B'	Barclays Bank	(263)
437	United Parcel Service Inc 'B'	Barclays Bank	511	(643)	ViacomCBS Inc 'B'	Credit Suisse	(2.025)
40	United Rentals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(80)	(1.938)	Viatis Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.764
69	United Rentals Inc	Barclays Bank	555	(8.978)	Viatis Inc	Barclays Bank	941
79	United Rentals Inc	Citibank	635	(1.786)	Viatis Inc	Citibank	214
127	United Rentals Inc	Goldman Sachs	(899)	(4.339)	Viatis Inc	Credit Suisse	(868)
142	United Rentals Inc	HSBC	(2.014)	(7.421)	Viatis Inc	Goldman Sachs	6.753
(56)	UnitedHealth Group Inc	Barclays Bank	(54)	(5.653)	Viatis Inc	HSBC	(1.131)
(585)	UnitedHealth Group Inc	Citibank	(567)	(2.121)	Viatis Inc	JP Morgan	(424)
(31)	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs	(102)	(128)	Vimeo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.376)
253	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(245)	(1.500)	Vimeo Inc	Barclays Bank	(63.000)
1.375	Universal Health Services Inc 'B'	Barclays Bank	866	(620)	Vimeo Inc	Citibank	(26.040)
72	Universal Health Services Inc 'B'	Citibank	45	(991)	Vimeo Inc	Goldman Sachs	(41.622)
121	Universal Health Services Inc 'B'	Credit Suisse	312	(321)	Vimeo Inc	HSBC	(13.482)
568	Universal Health Services Inc 'B'	Goldman Sachs	(551)	(4.037)	Visa Inc 'A'	Barclays Bank	7.479
152	Universal Health Services Inc 'B'	HSBC	392	(203)	Visa Inc 'A'	Credit Suisse	40
130	Vail Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.115	(1.007)	Visa Inc 'A'	Goldman Sachs	(866)
				524	VMware Inc 'A'	Barclays Bank	(2.253)
				630	Voya Financial Inc	Credit Suisse	(1.896)
				88	Vulcan Materials Co	Bank of America Merrill Lynch	(862)
				(336)	W R Berkley Corp	Barclays Bank	84
				(139)	W R Berkley Corp	HSBC	402
				(311)	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	821

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(181)	Walgreens Boots Alliance Inc	Barclays Bank	393	(120)	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	(2.379)
(1.661)	Walt Disney Co	Barclays Bank	(7.209)	(59)	Wix.com Ltd	JP Morgan	(145)
(139)	Walt Disney Co	Credit Suisse	785	189	Workday Inc 'A'	Bank of America	
(225)	Walt Disney Co	Goldman Sachs	(1.928)	443	Workday Inc 'A'	Merrill Lynch	(300)
(203)	Walt Disney Co	HSBC	1.147	134	Workday Inc 'A'	Barclays Bank	(2.339)
(114)	Walt Disney Co	JP Morgan	644	55	Workday Inc 'A'	Goldman Sachs	(332)
(387)	Waste Connections Inc	Bank of America		82	Workday Inc 'A'	HSBC	81
		Merrill Lynch	209	829	WW Grainger Inc	JP Morgan	(293)
(2.400)	Waste Connections Inc	Barclays Bank	(1.403)	(575)	Wynn Resorts Ltd	HSBC	(9.998)
(542)	Waste Connections Inc	JP Morgan	1.182			Bank of America	
(3.361)	Waste Management Inc	Bank of America		(926)	Wynn Resorts Ltd	Merrill Lynch	(4.105)
		Merrill Lynch	2.679	(168)	Wynn Resorts Ltd	Barclays Bank	(2.012)
(1.436)	Waste Management Inc	Barclays Bank	617	(143)	Wynn Resorts Ltd	Credit Suisse	(741)
(1.271)	Waste Management Inc	Citibank	547	261	Xilinx Inc	Goldman Sachs	(346)
(38)	Waste Management Inc	Goldman Sachs	32			Bank of America	
(206)	Waste Management Inc	JP Morgan	531	84	Xilinx Inc	Merrill Lynch	2.267
36	Waters Corp	Bank of America		283	Xilinx Inc	Barclays Bank	271
		Merrill Lynch	479	1.541	Xilinx Inc	Credit Suisse	1.392
760	Waters Corp	Barclays Bank	3.689	113	Xilinx Inc	Goldman Sachs	13.653
62	Waters Corp	Citibank	313	183	Xilinx Inc	HSBC	837
32	Waters Corp	Credit Suisse	148	160	XPO Logistics Inc	JP Morgan	951
229	Waters Corp	HSBC	1.142			Bank of America	
33	Waters Corp	JP Morgan	149	126	XPO Logistics Inc	Merrill Lynch	429
(83)	Wayfair Inc 'A'	Goldman Sachs	(408)	(511)	Xylem Inc	Barclays Bank	401
(27)	Wayfair Inc 'A'	HSBC	393	209	Yum! Brands Inc	Citibank	(1.134)
(1.458)	Wells Fargo & Co	Barclays Bank	(700)			Bank of America	
(765)	Wells Fargo & Co	Citibank	(367)	3.805	Yum! Brands Inc	Merrill Lynch	276
(4.276)	Wells Fargo & Co	Goldman Sachs	5.046	174	Yum! Brands Inc	Barclays Bank	(2.093)
1.746	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America		684	Yum! Brands Inc	Credit Suisse	(339)
		Merrill Lynch	34.722	159	Zebra Technologies Corp 'A'	Goldman Sachs	903
132	West Pharmaceutical Services Inc	Barclays Bank	1.055	263	Zebra Technologies Corp 'A'	Barclays Bank	(727)
30	West Pharmaceutical Services Inc	Citibank	240	23	Zebra Technologies Corp 'A'	Goldman Sachs	3.956
134	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	1.056	(583)	Zendesk Inc	HSBC	299
31	West Pharmaceutical Services Inc	JP Morgan	70	(537)	Zendesk Inc	Bank of America	
(3.018)	Western Digital Corp	JP Morgan	(19.949)	(301)	Zendesk Inc	Merrill Lynch	(2.571)
3.066	Western Union Co	Bank of America		(148)	Zendesk Inc	Barclays Bank	200
		Merrill Lynch	(1.288)	(926)	Zendesk Inc	Citibank	78
2.734	Western Union Co	Barclays Bank	(629)	(630)	Zillow Group Inc 'C'	Goldman Sachs	(653)
427	Western Union Co	Credit Suisse	(568)	(291)	Zillow Group Inc 'C'	HSBC	(4.380)
1.150	Western Union Co	Goldman Sachs	(483)	(630)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America	
(1.559)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Bank of America		(315)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Merrill Lynch	(4.504)
		Merrill Lynch	(3.679)	122	Zimmer Biomet Holdings Inc	Barclays Bank	(1.277)
(588)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Barclays Bank	(1.094)	(545)	Zoetis Inc	Citibank	(522)
(877)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs	(2.070)	(789)	Zoetis Inc	Goldman Sachs	(2.603)
(156)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	JP Morgan	(296)	(120)	Zoetis Inc	Bank of America	
176	Westrock Co	Bank of America		(500)	Zoetis Inc	Merrill Lynch	794
		Merrill Lynch	(614)	(117)	Zoetis Inc	HSBC	(442)
1.034	Westrock Co	Barclays Bank	62	(49)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Bank of America	
337	Westrock Co	Goldman Sachs	(1.176)	(498)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Merrill Lynch	(1.107)
198	Whirlpool Corp	Bank of America		(47)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Barclays Bank	(4.626)
		Merrill Lynch	(1.669)	(238)	Zoom Video Communications Inc 'A'	HSBC	(469)
787	Whirlpool Corp	Barclays Bank	1.645	(51)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Citibank	(469)
64	Whirlpool Corp	Citibank	134	(238)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.878)
469	Whirlpool Corp	Goldman Sachs	(3.954)	(31)	Zoom Video Communications Inc 'A'	HSBC	(2.195)
(1.726)	Williams Cos Inc	Credit Suisse	(1.381)	(239)	Zscaler Inc	JP Morgan	(151)
(875)	Willis Towers Watson Plc	Barclays Bank	1.365			Bank of America	
(83)	Willis Towers Watson Plc	JP Morgan	624	(279)	Zscaler Inc	Merrill Lynch	(7.390)
(179)	Wix.com Ltd	Bank of America		(117)	Zscaler Inc	Barclays Bank	(5.524)
		Merrill Lynch	(6.279)			Citibank	(2.317)
(294)	Wix.com Ltd	Barclays Bank	(3.719)				
(147)	Wix.com Ltd	Credit Suisse	3.194				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite			
(114)	Zscaler Inc	Credit Suisse	(3.241)
(618)	Zscaler Inc	Goldman Sachs	(19.109)
(151)	Zscaler Inc	HSBC	(4.293)
			<hr/>
			(446.150)
			<hr/>
	Total (Exposition brute sous-jacente - USD 374.412.412)		(596.770)

™ Les montants inférieurs à 0,5 USD ont été arrondis à zéro.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCDS	USD 13.914.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	29.593	339.004
CCDS	EUR 12.050.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	26.677	372.398
CCDS	USD 2.925.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.25 Version 8	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	9.921	283.270
CCDS	EUR 2.435.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2026	21.050	352.096
CCIRS	EUR 1.069.000	Fund receives Fixed 0,074% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(12.651)	(12.626)
CCIRS	EUR 1.395.000	Fund receives Fixed 0,083% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(15.346)	(14.891)
CCIRS	EUR 7.478.000	Fund receives Fixed 0,087% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(75.166)	(76.382)
CCIRS	EUR 4.144.000	Fund receives Fixed 0,099% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(35.412)	(36.044)
CCIRS	EUR 798.000	Fund receives Fixed 0,117% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(5.295)	(5.162)
CCIRS	EUR 1.935.000	Fund receives Fixed 0,139% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(7.343)	(7.298)
CCIRS	EUR 2.920.000	Fund receives Fixed 0,151% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(5.585)	(6.690)
CCIRS	EUR 602.000	Fund receives Fixed 0,229% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	4.416	4.431
CCIRS	GBP 20.829.000	Fund receives Fixed 0,731% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(39.123)	(32.590)
CCIRS	SEK 56.751.000	Fund receives Fixed 0,875% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(9.028)	(11.027)
CCIRS	HKD 10.105.000	Fund receives Fixed 0,931% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	2.348	2.367
CCIRS	USD 1.271.000	Fund receives Fixed 0,978% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	384	198
CCIRS	USD 1.303.000	Fund receives Fixed 1,002% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1.940	1.811
CCIRS	USD 2.745.000	Fund receives Fixed 1,014% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	5.781	5.306
CCIRS	USD 1.849.000	Fund receives Fixed 1,034% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	5.373	5.400
CCIRS	USD 1.354.000	Fund receives Fixed 1,045% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	4.703	4.723
CCIRS	USD 1.323.000	Fund receives Fixed 1,076% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	6.620	6.639
CCIRS	HKD 21.315.000	Fund receives Fixed 1,113% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	29.687	29.727
CCIRS	USD 2.807.000	Fund receives Fixed 1,140% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	22.307	22.955
CCIRS	USD 2.314.000	Fund receives Fixed 1,182% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	23.194	23.778
CCIRS	USD 2.457.000	Fund receives Fixed 1,220% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	29.372	29.796
CCIRS	USD 495.000	Fund receives Fixed 1,222% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	5.991	6.064
CCIRS	CAD 1.411.000	Fund receives Fixed 1,488% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	319	420
CCIRS	CAD 18.079.000	Fund receives Fixed 1,600% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	86.733	87.144
CCIRS	CAD 5.636.000	Fund receives Fixed 1,615% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	30.966	30.581
CCIRS	AUD 878.000	Fund receives Fixed 1,872% and pays Floating AUD 6 Month BBSW	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	3.479	3.492
CCIRS	AUD 4.956.400	Fund receives Fixed 1,979% and pays Floating AUD 6 Month BBSW	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	53.447	58.341

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCIRS	ZAR 5.804.000	Fund receives Fixed 6,295% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	3.390	3.396
CCIRS	ZAR 47.313.000	Fund receives Fixed 6,461% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	52.255	52.302
CCIRS	ZAR 151.154.000	Fund receives Fixed 6,478% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	174.766	174.910
CCIRS	AUD 1.717.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 0,981%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1.646	1.743
CCIRS	AUD 8.923.943	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 1,167%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(50.440)	(54.198)
CCIRS	CAD 749.000	Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,040%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(2.187)	(2.125)
CCIRS	CAD 9.587.000	Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,110%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(76.347)	(78.930)
CCIRS	CAD 2.978.000	Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,164%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(36.469)	(36.915)
CCIRS	GBP 10.818.500	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,025%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	65.260	65.538
CCIRS	MXN 165.341.000	Fund receives Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate and pays Fixed 5,735%	Bank of America Merrill Lynch	9/9/2026	206.274	206.386
CCIRS	PLN 100.269.196	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 1,315%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	412.158	412.533
CCIRS	SEK 109.613.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 0,464%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(12.972)	(11.258)
CCIRS	SGD 1.119.000	Fund receives Floating SGD 6 Month SORF6 and pays Fixed 1,037%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1.166	1.178
CCIRS	SGD 3.005.000	Fund receives Floating SGD 6 Month STIBOR and pays Fixed 1,191%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(14.148)	(14.115)
CCIRS	SGD 837.000	Fund receives Floating SGD 6 Month STIBOR and pays Fixed 1,198%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(4.159)	(4.150)
CCIRS	SGD 3.037.000	Fund receives Floating SGD 6 Month STIBOR and pays Fixed 1,286%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(25.071)	(25.038)
CCIRS	SGD 2.546.000	Fund receives Floating SGD 6 Month STIBOR and pays Fixed 1,326%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(24.820)	(24.793)
CCIRS	USD 1.444.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,628%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(1.737)	(1.332)
CCIRS	USD 966.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,650%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(2.882)	(2.863)
CCIRS	USD 1.386.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,666%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(3.015)	(6.345)
CCIRS	USD 1.386.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,668%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(6.793)	(6.476)
CCIRS	USD 1.479.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,770%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(21.318)	(21.303)
CCIRS	USD 1.226.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,807%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(21.424)	(21.965)
CCIRS	USD 1.300.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,836%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(26.517)	(26.932)
CCIRS	USD 279.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,881%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(6.842)	(6.959)
IRS	GBP 3.537.000	Fund receives Fixed 0,509% and pays Floating GBP 12 Month SONIA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(422)	603
IRS	USD 1.250.000	Fund receives Fixed 0,537% and pays Floating USD 6 Month LIBOR FEDL SOFR	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2030	(81.655)	(81.655)
IRS	KRW 2.837.421.000	Fund receives Fixed 1,566% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(12.987)	(12.987)
IRS	EUR 5.717.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	7.730	9.055
IRS	EUR 1.139.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(3.264)	(3.244)
IRS	EUR 14.858.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,251%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	36.258	36.621

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
IRS	EUR 3.801.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,253%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	9.832	9.896
IRS	EUR 1.552.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,268%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	5.530	5.498
IRS	EUR 8.212.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,28 %	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	34.116	34.862
IRS	EUR 2.059.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,291%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	10.004	10.257
IRS	EUR 2.767.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed -0,301%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	15.385	15.432
IRS	GBP 1.828.000	Fund receives Floating GBP 12 Month SONIA and pays Fixed 0,808%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	1.402	(138)
IRS	INR 6.669.000	Fund receives Floating INR 6 Month India National Stock Exchange NSE Interbank Offer Rate and pays Fixed 5,350%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(382)	(382)
IRS	THB 21.250.000	Fund receives Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate and pays Fixed 1,053%	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1.150	1.150
IRS	USD 1.250.000	Fund receives Floating USD 6 Month LIBOR FEDL and pays Fixed 0,554%	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2030	85.972	85.972
IRS	KRW 911.021.000	Fund receives Fixed 1,575% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Citibank	15/9/2026	(3.806)	(3.806)
IRS	INR 40.707.520	Fund receives Floating INR 6 Month MIBOR and pays Fixed 5,250%	Goldman Sachs	15/9/2026	61	61
IRS	THB 123.654.000	Fund receives Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate and pays Fixed 1,270%	Goldman Sachs	15/9/2026	(35.211)	(35.211)
IRS	KRW 1.606.941.000	Fund receives Fixed 1,504% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	HSBC	15/9/2026	(11.781)	(11.781)
IRS	KRW 9.525.697.000	Fund receives Fixed 1,508% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	HSBC	15/9/2026	(68.354)	(68.354)
IRS	INR 93.487.000	Fund receives Floating INR 6 Month MIBOR and pays Fixed 5,180%	HSBC	15/9/2026	3.984	3.984
IRS	INR 126.354.000	Fund receives Floating INR 6 Month MIBOR and pays Fixed 5,352%	HSBC	15/9/2026	(7.421)	(7.421)
IRS	KRW 1.413.114.000	Fund receives Fixed 1,472% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	JP Morgan	15/9/2026	(12.368)	(12.368)
IRS	KRW 3.573.387.000	Fund receives Fixed 1,585% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	JP Morgan	15/9/2026	(13.340)	(13.340)
IRS	KRW 2.946.870.000	Fund receives Fixed 1,608% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	JP Morgan	15/9/2026	(8.056)	(8.056)
IRS	INR 79.020.480	Fund receives Floating INR 6 Month MIBOR and pays Fixed 5,240%	JP Morgan	15/9/2026	582	582
IRS	KRW 1.699.380.000	Fund receives Fixed 1,556% and pays Floating KRW 3 Month KSDA	Morgan Stanley	15/9/2026	(8.533)	(8.533)
IRS	CNY 40.804.000	Fund receives Fixed 2,959% and pays Floating CNY 3 Month China Fixing Repo Rates	Standard Chartered Bank	15/9/2026	56.618	56.618
TRS	BRL 41	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(59.101)	(59.101)
TRS	BRL 9	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(9.230)	(9.230)
TRS	BRL 20	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(11.862)	(11.862)
TRS	KRW 500.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	1.646	1.646
TRS	KRW 750.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	5.310	5.310
TRS	KRW 3.500.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	8.812	8.812
TRS	TWD 18.800	Fund receives TAIEX Futures Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	872.191	872.191
TRS	TWD 3.800	Fund receives TAIEX Futures Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	131.172	131.172
TRS	TWD 11.600	Fund receives TAIEX Futures Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	107.323	107.323

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
TRS	THB 23.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Futures Index	Credit Suisse	29/6/2021	(22.208)	(22.208)
TRS	THB 24.000	Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Futures Index	Credit Suisse	29/6/2021	(14.459)	(14.459)
TRS	THB 27.400	Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Futures Index	Credit Suisse	29/6/2021	(13.859)	(13.859)
TRS	THB 31.400	Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Futures Index	Credit Suisse	29/6/2021	(2.809)	(2.809)
TRS	PLN 720	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	37.936	37.936
TRS	PLN 840	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	31.824	31.824
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 385.483.502)					1.842.856	3.105.521

CCCDs : Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)

CCIRS : Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(50)	EUR	Amsterdam Index Futures June 2021	Juin 2021	8.680.100	(107.896)
722	AUD	Australian 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	78.202.582	388.482
141	EUR	CAC 40 Index Futures June 2021	Juin 2021	11.116.142	289.473
(359)	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures September 2021	Septembre 2021	42.833.961	(82.490)
5	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.051.400	17.775
(194)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	40.203.831	362.935
(143)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2021	Juin 2021	14.231.794	(342.886)
213	USD	FTSE China A50 Futures June 2021	Juin 2021	3.867.654	55.278
104	EUR	FTSE MIB Index Futures June 2021	Juin 2021	16.020.688	425.601
(227)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index Futures June 2021	Juin 2021	10.219.458	(28.612)
(70)	EUR	IBEX 35 Index Futures June 2021	Juin 2021	7.827.772	(14.286)
1	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	1.381.430	91
148	USD	MSCI Hong Kong Index Futures June 2021	Juin 2021	11.967.280	(19.240)
13	SGD	MSCI Singapore Index Futures June 2021	Juin 2021	353.633	2.239
(494)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures June 2021	Juin 2021	13.406.057	(133.340)
(54)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures June 2021	Juin 2021	10.626.131	(437.937)
(345)	USD	SGX NIFTY 50 Futures June 2021	Juin 2021	10.750.200	(210.702)
(128)	AUD	SPI 200 Index Futures June 2021	Juin 2021	17.747.604	(825.805)
155	CHF	Swiss Market Index Futures June 2021	Juin 2021	19.594.258	970.600
55	JPY	Topix Index Futures June 2021	Juin 2021	9.674.161	(41.728)
(463)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	Septembre 2021	83.485.071	(160.745)
417	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	54.965.813	19.701
Total				468.207.020	126.508

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	2.277.275	USD	1.770.373	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(7.768)
AUD	2.115.000	USD	1.638.784	Barclays Bank	16/6/2021	(1.780)
AUD	1.488.000	USD	1.153.530	Deutsche Bank	16/6/2021	(1.822)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	182.000	USD	140.348	Goldman Sachs	16/6/2021	520
AUD	543.000	USD	415.665	JP Morgan	16/6/2021	4.615
AUD	950.000	USD	732.026	Morgan Stanley	16/6/2021	3.272

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	1.227.000	USD	936.441	Standard Chartered Bank	16/6/2021	13.254
AUD	726.000	USD	566.006	UBS	16/6/2021	(4.084)
AUD	1.487.000	USD	1.152.944	Deutsche Bank	21/7/2021	(1.828)
AUD	82.000	USD	63.161	JP Morgan	21/7/2021	317
AUD	5.352.850	USD	4.194.022	Deutsche Bank	18/8/2021	(49.872)
BRL	14.693.148	USD	2.603.252	BNP Paribas	16/6/2021	210.752
BRL	10.351.000	USD	1.850.093	Citibank	16/6/2021	132.312
BRL	11.091.769	USD	1.972.590	Deutsche Bank	16/6/2021	151.687
BRL	1.591.851	USD	274.646	Goldman Sachs	16/6/2021	30.222
BRL	379.231	USD	67.446	JP Morgan	16/6/2021	5.183
BRL	16.063.000	USD	2.829.565	UBS	16/6/2021	246.792
BRL	20.509.000	USD	3.743.065	Barclays Bank	21/7/2021	171.757
BRL	10.323.000	USD	1.849.314	Citibank	21/7/2021	121.173
BRL	3.557.000	USD	640.982	Goldman Sachs	21/7/2021	37.989
BRL	7.738.000	USD	1.416.412	HSBC	21/7/2021	60.642
BRL	15.287.000	USD	2.697.928	JP Morgan	21/7/2021	220.102
BRL	914.000	USD	172.774	UBS	21/7/2021	1.693
BRL	8.983.550	USD	1.689.109	Citibank	18/8/2021	20.552
BRL	459.000	USD	86.512	Goldman Sachs	18/8/2021	840
BRL	1.893.000	USD	357.885	HSBC	18/8/2021	2.372
CAD	49.889.000	USD	39.537.143	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	1.755.431
CAD	1.587.000	USD	1.315.009	BNP Paribas	16/6/2021	(1.466)
CAD	3.023.000	USD	2.422.792	Goldman Sachs	16/6/2021	79.312
CAD	457.000	USD	363.923	JP Morgan	16/6/2021	14.331
CAD	2.613.000	USD	2.082.675	Morgan Stanley	16/6/2021	80.077
CAD	302.000	USD	242.064	Standard Chartered Bank	16/6/2021	7.898
CAD	465.000	USD	370.456	UBS	16/6/2021	14.419
CAD	1.586.000	USD	1.314.155	BNP Paribas	21/7/2021	(1.502)
CAD	294.000	USD	234.635	Morgan Stanley	21/7/2021	8.695
CAD	1.586.000	USD	1.314.135	BNP Paribas	18/8/2021	(1.526)
CAD	1.213.000	USD	1.007.151	JP Morgan	18/8/2021	(3.245)
CHF	21.000	EUR	18.990	Standard Chartered Bank	16/6/2021	149
CHF	1.181.083	USD	1.278.707	Deutsche Bank	16/6/2021	33.424
CLP	171.038.000	USD	233.633	BNP Paribas	16/6/2021	3.476
CLP	369.250.000	USD	513.732	Citibank	16/6/2021	(1.844)
CLP	325.295.000	USD	455.755	Credit Suisse	16/6/2021	(4.800)
CLP	3.036.932.000	USD	4.307.717	Deutsche Bank	16/6/2021	(97.636)
CLP	83.001.000	USD	113.624	Goldman Sachs	16/6/2021	1.440
CLP	171.049.000	USD	233.536	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	3.524
CLP	325.345.000	USD	455.646	Credit Suisse	21/7/2021	(4.743)
CLP	1.258.849.000	USD	1.789.790	Deutsche Bank	21/7/2021	(45.124)
CLP	43.720.000	USD	62.607	HSBC	21/7/2021	(2.015)
CLP	171.075.000	USD	233.575	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	3.461
CLP	325.427.000	USD	455.755	Credit Suisse	18/8/2021	(4.853)
CLP	43.728.000	USD	62.617	HSBC	18/8/2021	(2.029)
CNH	10.170.000	USD	1.584.692	Deutsche Bank	16/6/2021	10.562
CNH	10.171.000	USD	1.581.207	Deutsche Bank	21/7/2021	10.673
CNH	10.170.000	USD	1.578.108	UBS	18/8/2021	10.954
EUR	482.761	CHF	533.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(2.820)
EUR	416.419	CHF	459.000	BNP Paribas	16/6/2021	(1.594)
EUR	366.944	CHF	405.000	JP Morgan	16/6/2021	(1.998)
EUR	487.225	CHF	534.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	1.519
EUR	161.268	HUF	58.131.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(6.910)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	531.000	USD	632.793	JP Morgan	16/6/2021	15.414
EUR	169.000	USD	202.481	Standard Chartered Bank	16/6/2021	3.822
EUR	5.292.149	USD	6.309.268	UBS	16/6/2021	151.006
EUR	12.396.000	USD	14.765.152	Standard Chartered Bank	21/7/2021	377.205
EUR	1.113.000	USD	1.362.601	Deutsche Bank	18/8/2021	(2.290)
EUR	1.903.000	USD	2.328.526	UBS	18/8/2021	(2.675)
GBP	466.000	USD	642.623	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	17.707
GBP	48.000	USD	67.951	Citibank	16/6/2021	66
GBP	1.899.000	USD	2.631.579	Deutsche Bank	16/6/2021	59.339
GBP	2.963.000	USD	4.145.381	JP Morgan	16/6/2021	53.246
GBP	444.000	USD	621.383	Morgan Stanley	16/6/2021	7.773
GBP	1.811.000	USD	2.498.673	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	67.646
GBP	48.000	USD	67.955	Citibank	21/7/2021	64
GBP	876.000	USD	1.242.589	JP Morgan	21/7/2021	(1.234)
GBP	3.374.000	USD	4.696.702	Morgan Stanley	21/7/2021	84.502
GBP	1.450.000	USD	1.991.749	UBS	21/7/2021	63.007
GBP	2.823.270	USD	3.991.115	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	9.701
GBP	48.000	USD	67.957	Citibank	18/8/2021	63
GBP	876.000	USD	1.242.610	JP Morgan	18/8/2021	(1.243)
HKD	989.000	USD	127.353	HSBC	16/6/2021	82
HKD	7.777.000	USD	1.001.430	UBS	16/6/2021	655
HUF	196.878.000	EUR	546.054	Morgan Stanley	21/7/2021	23.560
HUF	71.582.000	USD	231.592	Citibank	16/6/2021	19.668
HUF	231.674.000	USD	758.731	HSBC	16/6/2021	54.465
HUF	236.256.000	USD	808.884	Morgan Stanley	16/6/2021	20.396
HUF	698.774.000	USD	2.376.112	Standard Chartered Bank	16/6/2021	76.647
HUF	259.063.000	USD	911.154	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(2.434)
HUF	196.819.000	USD	654.135	Citibank	21/7/2021	36.251
HUF	462.993.000	USD	1.537.299	HSBC	21/7/2021	86.751
HUF	163.663.000	USD	573.701	Morgan Stanley	21/7/2021	383
HUF	148.091.000	USD	516.427	Standard Chartered Bank	21/7/2021	3.034
HUF	259.225.000	USD	911.182	HSBC	18/8/2021	(2.477)
HUF	163.761.000	USD	573.680	Morgan Stanley	18/8/2021	379
HUF	148.179.000	USD	516.347	Standard Chartered Bank	18/8/2021	3.089
INR	13.989.776	USD	186.183	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	6.212
INR	1.341.221.000	USD	18.085.260	Barclays Bank	16/6/2021	359.895
INR	297.660.305	USD	3.973.376	BNP Paribas	16/6/2021	120.201
INR	14.614.000	USD	198.593	Deutsche Bank	16/6/2021	2.386
INR	29.641.729	USD	399.167	Goldman Sachs	16/6/2021	8.482
INR	29.338.919	USD	386.272	JP Morgan	16/6/2021	17.212
INR	16.015.271	USD	215.635	Morgan Stanley	16/6/2021	4.615
INR	553.082.000	USD	7.477.870	UBS	16/6/2021	128.396
INR	1.390.917.570	USD	18.363.701	BNP Paribas	22/7/2021	655.624
INR	5.664.000	USD	77.388	UBS	22/7/2021	61
INR	5.688.000	USD	77.401	Deutsche Bank	18/8/2021	56
INR	1.225.753.740	USD	16.434.871	JP Morgan	18/8/2021	256.908
JPY	62.388.000	USD	569.838	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(753)
JPY	69.685.000	USD	640.185	Barclays Bank	16/6/2021	(4.539)
JPY	20.028.000	USD	184.455	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.765)
JPY	762.531.000	USD	6.962.986	JP Morgan	16/6/2021	(7.403)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
JPY	148.579.000	USD	1.354.695	Standard Chartered Bank	16/6/2021	598
JPY	291.992.000	USD	2.687.937	UBS	16/6/2021	(24.472)
JPY	48.850.000	USD	446.004	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(288)
JPY	2.877.635.000	USD	26.274.109	Goldman Sachs	21/7/2021	(18.095)
JPY	1.887.415.650	USD	17.364.504	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	(139.877)
KRW	3.908.095.762	USD	3.451.856	BNP Paribas	16/6/2021	74.441
KRW	675.816.330	USD	605.261	Citibank	16/6/2021	4.532
KRW	272.945.074	USD	244.315	Deutsche Bank	16/6/2021	1.964
KRW	632.814.000	USD	568.137	Goldman Sachs	16/6/2021	2.854
KRW	63.480.331	USD	56.818	Morgan Stanley	16/6/2021	460
KRW	1.768.653.503	USD	1.583.866	UBS	16/6/2021	11.999
KRW	93.440.000	USD	83.417	UBS	21/7/2021	900
KRW	93.437.000	USD	83.415	UBS	18/8/2021	904
MXN	712.086.000	USD	33.071.147	Goldman Sachs	16/6/2021	2.647.351
MXN	5.370.000	USD	263.288	Standard Chartered Bank	16/6/2021	6.073
MXN	18.231.000	USD	882.940	UBS	16/6/2021	31.534
MXN	3.423.000	USD	170.474	JP Morgan	21/7/2021	558
MXN	3.434.000	USD	170.495	JP Morgan	18/8/2021	556
NOK	4.800.000	USD	566.283	Barclays Bank	16/6/2021	8.902
NOK	7.477.000	USD	896.433	Citibank	16/6/2021	(463)
NOK	1.215.000	USD	141.724	Deutsche Bank	16/6/2021	3.869
NOK	7.749.000	USD	909.376	Goldman Sachs	16/6/2021	19.187
NOK	8.696.000	USD	1.041.063	JP Morgan	16/6/2021	980
NOK	951.000	USD	112.855	Morgan Stanley	16/6/2021	1.104
NOK	1.320.000	USD	159.856	UBS	16/6/2021	(1.680)
NOK	7.475.000	USD	896.244	Citibank	21/7/2021	(464)
NOK	6.927.000	USD	831.603	JP Morgan	21/7/2021	(1.493)
NOK	1.320.000	USD	159.865	UBS	21/7/2021	(1.681)
NOK	5.422.000	USD	650.950	JP Morgan	18/8/2021	(1.178)
NOK	1.320.000	USD	159.873	UBS	18/8/2021	(1.684)
NZD	1.818.000	USD	1.306.852	Barclays Bank	16/6/2021	14.521
NZD	1.030.000	USD	732.635	JP Morgan	16/6/2021	15.998
NZD	5.305.000	USD	3.766.544	Morgan Stanley	16/6/2021	89.277
NZD	2.571.000	USD	1.862.499	Barclays Bank	18/8/2021	5.804
NZD	756.000	USD	547.771	Standard Chartered Bank	18/8/2021	1.602
PLN	46.248.000	USD	12.006.759	JP Morgan	16/6/2021	579.735
PLN	4.834.000	USD	1.254.400	Morgan Stanley	16/6/2021	61.184
PLN	2.497.000	USD	656.545	UBS	16/6/2021	23.019
PLN	3.438.000	USD	909.298	JP Morgan	21/7/2021	26.516
PLN	4.847.000	USD	1.277.831	Societe Generale	21/7/2021	41.508
PLN	2.496.000	USD	656.454	UBS	21/7/2021	22.950
RUB	100.060.993	USD	1.349.150	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	12.799
RUB	361.760.000	USD	4.830.545	BNP Paribas	16/6/2021	93.437
RUB	13.854.007	USD	184.320	Goldman Sachs	16/6/2021	4.248
RUB	269.063.000	USD	3.529.423	JP Morgan	16/6/2021	132.843
RUB	95.602.000	USD	1.283.002	Citibank	21/7/2021	11.940
RUB	562.804.490	USD	7.236.998	JP Morgan	21/7/2021	386.263
RUB	389.889.600	USD	5.185.185	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	74.686
SEK	4.894.000	USD	574.816	Barclays Bank	16/6/2021	15.462
SEK	3.854.000	USD	464.860	Citibank	16/6/2021	(19)
SEK	65.695.000	USD	7.700.852	Deutsche Bank	16/6/2021	222.788
SEK	14.374.000	USD	1.644.329	Goldman Sachs	16/6/2021	89.356
SEK	4.639.000	USD	545.292	JP Morgan	16/6/2021	14.230
SEK	7.882.000	USD	905.749	Standard Chartered Bank	16/6/2021	44.919

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
SEK	3.851.000	USD	464.638	Citibank	21/7/2021	(29)
SEK	3.851.000	USD	464.740	Citibank	18/8/2021	(32)
SGD	18.634.429	USD	13.849.257	BNP Paribas	16/6/2021	248.432
SGD	1.445.571	USD	1.087.190	Morgan Stanley	16/6/2021	6.442
SGD	1.448.000	USD	1.079.151	Standard Chartered Bank	16/6/2021	16.318
SGD	1.886.000	USD	1.423.862	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	2.832
SGD	1.881.000	USD	1.409.453	Barclays Bank	21/7/2021	13.458
SGD	122.429	USD	92.055	BNP Paribas	21/7/2021	558
SGD	583.000	USD	438.874	Citibank	21/7/2021	2.146
SGD	1.049.000	USD	782.124	HSBC	21/7/2021	11.408
SGD	2.548.000	USD	1.922.051	JP Morgan	21/7/2021	5.423
SGD	4.024.571	USD	3.031.541	Morgan Stanley	21/7/2021	12.908
SGD	122.429	USD	92.047	BNP Paribas	18/8/2021	560
SGD	8.139.560	USD	6.142.021	HSBC	18/8/2021	14.836
SGD	1.445.571	USD	1.087.000	Morgan Stanley	18/8/2021	6.447
SGD	1.274.000	USD	960.946	Standard Chartered Bank	18/8/2021	2.722
THB	7.492.000	USD	239.109	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	735
THB	38.378.795	USD	1.235.923	Barclays Bank	16/6/2021	(7.291)
THB	47.584.000	USD	1.543.447	Citibank	16/6/2021	(20.126)
THB	90.077.000	USD	2.880.319	Goldman Sachs	16/6/2021	3.344
THB	11.994.000	USD	381.888	JP Morgan	16/6/2021	2.079
THB	46.284.205	USD	1.471.506	Standard Chartered Bank	16/6/2021	10.203
THB	7.739.529	USD	247.435	Barclays Bank	21/7/2021	308
THB	37.549.000	USD	1.193.767	Goldman Sachs	21/7/2021	8.180
THB	11.347.000	USD	361.807	HSBC	21/7/2021	1.412
THB	29.004.471	USD	928.982	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(546)
THB	27.563.000	USD	875.592	Goldman Sachs	18/8/2021	6.613
THB	7.501.000	USD	238.972	HSBC	18/8/2021	1.111
TWD	10.663.378	USD	382.919	BNP Paribas	16/6/2021	4.665
TWD	8.698.000	USD	312.408	Citibank	16/6/2021	3.740
TWD	69.227.622	USD	2.470.298	Deutsche Bank	16/6/2021	45.930
TWD	25.917.000	USD	920.606	Standard Chartered Bank	16/6/2021	21.403
TWD	5.934.000	USD	214.666	Deutsche Bank	21/7/2021	2.116
TWD	5.912.000	USD	214.693	BNP Paribas	18/8/2021	2.137
USD	1.309.544	AUD	1.707.443	Barclays Bank	16/6/2021	(12.012)
USD	312.559	AUD	402.000	JP Morgan	16/6/2021	1.412
USD	22.515.507	AUD	29.235.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(112.310)
USD	48.369	AUD	62.557	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(50)
USD	6.321.754	AUD	8.286.000	HSBC	21/7/2021	(92.600)
USD	779.577	AUD	1.005.000	JP Morgan	18/8/2021	1.511
USD	2.676.860	BRL	15.722.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(334.190)
USD	1.053.058	BRL	5.928.000	BNP Paribas	16/6/2021	(82.262)
USD	329.276	BRL	1.842.000	JP Morgan	16/6/2021	(23.502)
USD	690.300	BRL	3.616.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(2.230)
USD	8.229.189	BRL	46.836.430	Citibank	21/7/2021	(711.094)
USD	115.852	BRL	613.000	UBS	21/7/2021	(1.159)
USD	115.873	BRL	615.000	UBS	18/8/2021	(1.168)
USD	614.538	CAD	750.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(6.228)
USD	1.771.772	CAD	2.223.000	Citibank	16/6/2021	(68.180)
USD	1.848.292	CAD	2.245.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(9.870)
USD	8.659.364	CAD	10.723.000	JP Morgan	16/6/2021	(215.946)
USD	4.201.808	CAD	5.213.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(112.934)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	105.957	CAD	133.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(4.121)
USD	9.998.382	CAD	12.090.970	Morgan Stanley	18/8/2021	(8.374)
USD	873.593	CHF	814.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(30.726)
USD	4.774.382	CLP	3.469.715.535	Deutsche Bank	16/6/2021	(35.663)
USD	172.636	CLP	126.403.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(2.596)
USD	63.365	CLP	44.435.465	Morgan Stanley	16/6/2021	1.765
USD	1.232.652	CLP	875.971.500	BNP Paribas	21/7/2021	18.623
USD	172.618	CLP	126.425.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(2.597)
USD	643.097	CLP	450.871.000	HSBC	21/7/2021	18.225
USD	92.336	CLP	64.153.500	Citibank	18/8/2021	3.447
USD	172.608	CLP	126.439.000	Goldman Sachs	18/8/2021	(2.582)
USD	488.262	CNH	3.117.000	Citibank	16/6/2021	(667)
USD	487.038	CNH	3.116.000	Citibank	21/7/2021	(652)
USD	486.165	CNH	3.116.000	HSBC	18/8/2021	(710)
USD	783.369	EUR	655.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(16.208)
USD	828.565	EUR	692.000	HSBC	16/6/2021	(16.180)
USD	2.394.315	EUR	2.012.000	JP Morgan	16/6/2021	(61.790)
USD	2.084.912	EUR	1.749.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(50.141)
USD	345.431	EUR	287.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(4.919)
USD	2.536.572	EUR	2.099.000	UBS	16/6/2021	(25.736)
USD	413.909	EUR	345.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(7.527)
USD	2.591.146	EUR	2.153.000	BNP Paribas	21/7/2021	(38.855)
USD	1.995.625	EUR	1.650.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(19.935)
USD	464.169	EUR	380.000	HSBC	21/7/2021	(20)
USD	2.537.389	EUR	2.083.000	JP Morgan	21/7/2021	(7.103)
USD	212.814	EUR	174.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	264
USD	35.655.202	EUR	29.268.937	JP Morgan	18/8/2021	(117.358)
USD	212.929	EUR	174.000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	266
USD	361.811	GBP	260.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(6.614)
USD	113.251	GBP	81.000	Barclays Bank	16/6/2021	(1.528)
USD	231.963	GBP	167.000	JP Morgan	16/6/2021	(4.679)
USD	4.142.764	GBP	2.961.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(53.030)
USD	960.121	GBP	683.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(7.702)
USD	5.778.686	GBP	4.208.000	HSBC	21/7/2021	(184.356)
USD	1.463.586	GBP	1.036.000	JP Morgan	21/7/2021	(4.502)
USD	541.619	GBP	381.000	UBS	21/7/2021	1.714
USD	541.641	GBP	381.000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	1.732
USD	1.335.853	GBP	944.000	UBS	18/8/2021	(1.876)
USD	1.642.733	HKD	12.757.000	Barclays Bank	16/6/2021	(1.039)
USD	1.004.120	HUF	309.817.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(83.366)
USD	739.255	HUF	221.827.000	Citibank	16/6/2021	(39.377)
USD	811.238	HUF	239.155.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(28.217)
USD	525.151	HUF	157.012.000	HSBC	16/6/2021	(25.975)
USD	249.272	HUF	75.206.000	JP Morgan	16/6/2021	(14.708)
USD	1.981.428	HUF	595.388.000	Citibank	21/7/2021	(107.026)
USD	810.948	HUF	239.223.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(28.179)
USD	301.549	HUF	89.729.000	HSBC	21/7/2021	(13.195)
USD	692.381	HUF	208.614.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(39.378)
USD	1.136.562	HUF	334.825.790	Goldman Sachs	18/8/2021	(37.159)
USD	15.637.288	INR	1.157.851.299	BNP Paribas	16/6/2021	(286.072)
USD	416.788	INR	30.704.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(5.470)
USD	521.963	INR	39.205.701	JP Morgan	16/6/2021	(17.213)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	231.752	INR	17.450.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(8.229)
USD	4.233.752	INR	317.459.000	BNP Paribas	22/7/2021	(107.164)
USD	389.629	INR	29.731.000	HSBC	22/7/2021	(16.911)
USD	21.986.965	JPY	2.387.461.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	209.247
USD	3.563.884	JPY	389.393.000	JP Morgan	16/6/2021	11.956
USD	595.665	JPY	64.758.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	4.961
USD	1.977.082	JPY	213.826.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	26.098
USD	13.588.552	KRW	15.465.811.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(366.330)
USD	870.177	KRW	983.171.000	BNP Paribas	16/6/2021	(16.943)
USD	90.113	KRW	101.585.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(1.548)
USD	737.734	KRW	836.981.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(17.477)
USD	2.201.555	KRW	2.465.742.000	JP Morgan	16/6/2021	(23.297)
USD	602.308	KRW	681.360.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(12.487)
USD	6.755.969	KRW	7.566.212.540	HSBC	21/7/2021	(71.473)
USD	4.335.369	KRW	4.886.715.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(74.204)
USD	460.251	KRW	519.278.000	Societe Generale	21/7/2021	(8.325)
USD	793.723	KRW	890.384.000	UBS	21/7/2021	(9.723)
USD	11.084.634	KRW	12.340.080.230	Citibank	18/8/2021	(51.252)
USD	460.363	KRW	519.239.000	Societe Generale	18/8/2021	(8.206)
USD	210.201	KRW	234.868.000	UBS	18/8/2021	(1.748)
USD	4.295.663	MXN	88.105.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(123.717)
USD	1.472.543	MXN	29.867.000	Barclays Bank	16/6/2021	(25.597)
USD	1.124.076	MXN	22.956.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(27.406)
USD	1.830.498	MXN	36.576.000	JP Morgan	16/6/2021	(4.168)
USD	1.031.676	MXN	20.765.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(9.905)
USD	174.519	MXN	3.496.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(842)
USD	10.394.361	MXN	211.767.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(186.708)
USD	174.486	MXN	3.509.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(844)
USD	15.502.540	MXN	311.665.360	Citibank	18/8/2021	(21.874)
USD	522.419	NOK	4.434.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(8.908)
USD	1.111.662	NOK	9.440.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(19.535)
USD	441.760	NOK	3.626.000	JP Morgan	16/6/2021	7.255
USD	559.164	NOK	4.667.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(83)
USD	1.489.259	NOK	12.696.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(32.104)
USD	441.650	NOK	3.625.000	JP Morgan	21/7/2021	7.242
USD	558.958	NOK	4.665.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(81)
USD	1.195.114	NOK	9.996.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(2.774)
USD	306.579	NOK	2.526.890	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	3.756
USD	321.254	NOK	2.636.000	JP Morgan	18/8/2021	5.356
USD	558.975	NOK	4.665.000	Morgan Stanley	18/8/2021	(78)
USD	1.039.349	NZD	1.442.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(8.737)
USD	659.625	NZD	938.000	BNP Paribas	16/6/2021	(22.139)
USD	240.978	NZD	334.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.783)
USD	557.590	NZD	775.000	JP Morgan	16/6/2021	(5.701)
USD	4.386.914	NZD	6.062.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(19.116)
USD	510.318	NZD	725.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(16.581)
USD	2.278.055	NZD	3.121.000	Morgan Stanley	21/7/2021	9.847
USD	4.292.956	NZD	5.890.400	JP Morgan	18/8/2021	12.500
USD	2.277.828	NZD	3.121.000	Morgan Stanley	18/8/2021	9.849
USD	351.885	PLN	1.346.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(14.432)
USD	4.605.715	PLN	17.613.000	Citibank	16/6/2021	(187.702)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	450.946	PLN	1.658.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(282)
USD	847.370	PLN	3.285.000	HSBC	16/6/2021	(46.650)
USD	3.810.310	PLN	14.113.000	JP Morgan	16/6/2021	(30.574)
USD	397.353	PLN	1.528.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(18.495)
USD	668.976	PLN	2.637.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(48.690)
USD	3.231.275	PLN	12.027.000	UBS	16/6/2021	(41.898)
USD	7.541.785	PLN	28.760.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(286.603)
USD	450.744	PLN	1.657.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(286)
USD	5.419.134	PLN	20.318.226	Barclays Bank	18/8/2021	(111.814)
USD	450.781	PLN	1.657.000	Goldman Sachs	18/8/2021	(281)
USD	567.322	RUB	41.992.000	Barclays Bank	16/6/2021	(4.239)
USD	2.222.422	RUB	167.782.000	Citibank	16/6/2021	(61.289)
USD	1.021.881	RUB	77.665.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(35.232)
USD	228.309	RUB	17.525.000	JP Morgan	16/6/2021	(10.227)
USD	1.298.714	RUB	99.962.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(61.887)
USD	343.120	RUB	25.446.000	UBS	16/6/2021	(3.230)
USD	191.289	RUB	14.163.000	BNP Paribas	21/7/2021	(551)
USD	119.367	RUB	8.968.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(2.106)
USD	523.162	RUB	40.838.000	HSBC	21/7/2021	(29.994)
USD	228.238	RUB	17.604.000	JP Morgan	21/7/2021	(10.210)
USD	1.297.996	RUB	100.413.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(62.111)
USD	2.099.006	RUB	157.823.000	UBS	21/7/2021	(38.729)
USD	211.277	RUB	15.688.000	Barclays Bank	18/8/2021	(365)
USD	191.283	RUB	14.220.000	BNP Paribas	18/8/2021	(554)
USD	567.341	RUB	42.359.000	Goldman Sachs	18/8/2021	(4.110)
USD	205.504	SEK	1.758.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(6.533)
USD	528.694	SEK	4.471.000	Barclays Bank	16/6/2021	(10.564)
USD	3.472.626	SEK	29.462.000	Citibank	16/6/2021	(80.861)
USD	112.163	SEK	964.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(4.107)
USD	2.249.724	SEK	18.683.000	JP Morgan	16/6/2021	(3.680)
USD	2.838.268	SEK	23.583.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(6.137)
USD	500.026	SEK	4.180.736	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(4.223)
USD	3.771.307	SEK	32.218.000	Societe Generale	21/7/2021	(115.675)
USD	4.583.851	SEK	38.126.140	Morgan Stanley	18/8/2021	(16.906)
USD	4.814.394	SGD	6.471.000	Barclays Bank	16/6/2021	(81.176)
USD	627.266	SGD	833.000	Citibank	16/6/2021	(2.932)
USD	802.666	SGD	1.082.000	HSBC	16/6/2021	(15.911)
USD	2.693.974	SGD	3.615.000	JP Morgan	16/6/2021	(40.918)
USD	896.398	SGD	1.187.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(1.614)
USD	627.196	SGD	833.000	Citibank	21/7/2021	(2.940)
USD	444.299	SGD	594.000	JP Morgan	21/7/2021	(5.041)
USD	895.553	SGD	1.186.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(1.615)
USD	1.523.384	SGD	2.020.000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(4.568)
USD	179.201	THB	5.595.000	Barclays Bank	16/6/2021	87
USD	6.371.588	THB	196.597.000	BNP Paribas	16/6/2021	77.871
USD	437.534	THB	13.732.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(2.073)
USD	179.182	THB	5.599.000	HSBC	21/7/2021	(42)
USD	1.721.120	THB	54.264.000	Societe Generale	21/7/2021	(15.876)
USD	278.858	THB	8.671.930	Goldman Sachs	18/8/2021	1.297
USD	989.169	TWD	27.697.000	BNP Paribas	16/6/2021	(17.538)
USD	9.347.828	TWD	262.880.000	Credit Suisse	16/6/2021	(207.116)
USD	1.660.031	TWD	46.964.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(46.979)
USD	204.573	TWD	5.745.636	JP Morgan	16/6/2021	(4.265)
USD	1.797.423	TWD	50.114.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(24.078)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	164.802	TWD	4.629.364	UBS	16/6/2021	(3.462)
USD	288.363	TWD	7.979.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(3.127)
USD	6.703.469	TWD	189.037.830	HSBC	21/7/2021	(202.478)
USD	1.714.337	TWD	47.590.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(24.225)
USD	81.381	TWD	2.262.000	UBS	21/7/2021	(1.254)
USD	7.478.630	TWD	204.667.660	BNP Paribas	18/8/2021	(27.800)
USD	1.713.826	TWD	47.413.000	Morgan Stanley	18/8/2021	(25.102)
USD	8.361.493	ZAR	130.181.000	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2021	(1.087.217)
USD	614.441	ZAR	9.227.000	Deutsche Bank	17/6/2021	(55.267)
USD	180.169	ZAR	2.711.000	Goldman Sachs	17/6/2021	(16.599)
USD	111.391	ZAR	1.631.000	JP Morgan	17/6/2021	(6.989)
USD	559.199	ZAR	8.187.000	Morgan Stanley	17/6/2021	(35.024)
USD	617.752	ZAR	9.317.000	Standard Chartered Bank	17/6/2021	(58.488)
USD	145.926	ZAR	2.092.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(5.232)
USD	630.777	ZAR	8.945.000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(13.180)
ZAR	78.100.000	USD	5.441.137	Morgan Stanley	17/6/2021	227.466
ZAR	20.613.000	USD	1.404.451	Standard Chartered Bank	17/6/2021	91.668
ZAR	11.479.114	USD	780.216	UBS	17/6/2021	52.953
ZAR	69.016.000	USD	4.665.492	UBS	21/7/2021	321.260
ZAR	95.891.750	USD	6.743.676	JP Morgan	18/8/2021	159.639
						4.359.247
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	31.444.803	USD	24.456.606	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(118.531)
USD	63.693	AUD	81.951	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	264
						(118.267)
Catégorie d'Actions couverte en BRL						
BRL	13.597	USD	2.535	State Street Bank & Trust Company	2/6/2021	72
BRL	13.633	USD	2.569	State Street Bank & Trust Company	2/7/2021	39
USD	2.570	BRL	13.597	State Street Bank & Trust Company	2/6/2021	(38)
						73
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	378.850	USD	417.203	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	3.672
						3.672
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	14.279.990	USD	17.252.919	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	178.723
USD	110.661	EUR	90.812	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(193)
						178.530
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	12.323.466	USD	17.150.241	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	312.309
USD	136.729	GBP	97.489	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1.413)
						310.896

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	9.041.541.201	USD	82.857.896	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(384.291)
						(384.291)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	185	USD	134	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1
						1
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	30.405	USD	3.621	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	46
						46
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 1.063.857.930)						4.349.907

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	69,14
Finance	5,20
Portefeuille de titres à la valeur de marché	74,34
Autres éléments de l'actif net	25,66
	100,00

BlackRock Style Advantage Screened Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
OBLIGATIONS			
France			
EUR 2.300.000	France Treasury Bill BTF RegS 4/11/2021 (Zero Coupon)	2.814.837	10,40
EUR 2.900.000	France Treasury Bill BTF RegS 23/2/2022 (Zero Coupon)	3.556.327	13,15
		6.371.164	23,55
Allemagne			
EUR 3.000.000	German Treasury Bill RegS 9/6/2021 (Zero Coupon)	3.661.678	13,54
EUR 2.800.000	German Treasury Bill RegS 25/8/2021 (Zero Coupon)	3.422.316	12,65
		7.083.994	26,19
États-Unis			
USD 1.200.000	United States Treasury Bill 24/2/2022 (Zero Coupon)	1.199.478	4,43
USD 1.100.000	United States Treasury Bill 24/3/2022 (Zero Coupon)	1.099.552	4,07
USD 1.400.000	United States Treasury Bill 21/4/2022 (Zero Coupon)	1.399.458	5,17
		3.698.488	13,67
Total des obligations		17.153.646	63,41
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		17.153.646	63,41
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
OBLIGATIONS			
Canada			
CAD 2.400.000	Canadian Treasury Bill 31/3/2022 (Zero Coupon)	1.983.687	7,33
		1.983.687	7,33
Total des obligations		1.983.687	7,33
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		1.983.687	7,33
Organismes de placement collectif			
Irlande			
25.300	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund 'TO'	2.573.852	9,51
		2.573.852	9,51
Total des organismes de placement collectif		2.573.852	9,51
Portefeuille de titres à la valeur de marché		21.711.185	80,25
Autres éléments de l'actif net		5.341.747	19,75
Total de l'actif net (USD)		27.052.932	100,00
- Investissement dans un fonds de partie liée.			

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				Australie suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				3.811	QBE Insurance Group Ltd	JP Morgan	796
	Australie			(481)	Ramsay Health Care Ltd	Citibank	249
(262)	Afterpay Ltd	Citibank	(180)	(48)	Ramsay Health Care Ltd	HSBC	(22)
(113)	Afterpay Ltd	HSBC	413	(225)	Ramsay Health Care Ltd	JP Morgan	(101)
(125)	Afterpay Ltd	JP Morgan	457	320	REA Group Ltd	Citibank	2.098
(17.644)	AMP Ltd	Citibank	(546)	242	REA Group Ltd	HSBC	603
(11.431)	AMP Ltd ^{tr}	HSBC	—	135	REA Group Ltd	JP Morgan	336
(336)	Ampol Ltd	Citibank	122	(220)	Rio Tinto Ltd	HSBC	(337)
(1.534)	APA Group (Unit)	JP Morgan	700	(835)	SEEK Ltd	HSBC	(200)
1.428	Aristocrat Leisure Ltd	Citibank	387	693	Sonic Healthcare Ltd	HSBC	(182)
667	Aristocrat Leisure Ltd	HSBC	1.575	1.625	Suncorp Group Ltd	HSBC	75
1.032	Aristocrat Leisure Ltd	JP Morgan	2.436	(6.706)	Sydney Airport (Unit)	JP Morgan	406
456	ASX Ltd	Citibank	681	20.727	Tabcorp Holdings Ltd	Citibank	1.765
316	ASX Ltd	JP Morgan	1.061	2.238	Tabcorp Holdings Ltd	HSBC	(69)
(6.482)	AusNet Services Ltd	Citibank	(125)	8.599	Tabcorp Holdings Ltd	JP Morgan	(266)
(16.713)	AusNet Services Ltd	HSBC	1.682	3.963	Telstra Corp Ltd	Citibank	276
(223)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Citibank	(95)	6.048	Telstra Corp Ltd	JP Morgan	140
(325)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	HSBC	(335)	(6.159)	Transurban Group (Unit)	Citibank	(143)
(402)	BlueScope Steel Ltd	Citibank	(423)	(779)	Transurban Group (Unit)	HSBC	277
(1.057)	BlueScope Steel Ltd	HSBC	1.759	(1.144)	Transurban Group (Unit)	JP Morgan	407
(543)	BlueScope Steel Ltd	JP Morgan	904	(1.714)	Treasury Wine Estates Ltd	HSBC	(2.056)
4.211	Brambles Ltd	Citibank	717	(1.040)	Treasury Wine Estates Ltd	JP Morgan	(1.248)
4.995	Brambles Ltd	HSBC	881	116	Wesfarmers Ltd	Citibank	59
9.969	Brambles Ltd	JP Morgan	1.686	792	Wesfarmers Ltd	HSBC	331
341	Cochlear Ltd	HSBC	2.264	1.089	Wesfarmers Ltd	JP Morgan	455
(455)	Coles Group Ltd	HSBC	(127)	(890)	Westpac Banking Corp	Citibank	(303)
(451)	Commonwealth Bank of Australia	Citibank	(335)	(2.068)	Westpac Banking Corp	HSBC	—
(3.284)	Crown Resorts Ltd	Citibank	51	(995)	Westpac Banking Corp	JP Morgan	—
(537)	Crown Resorts Ltd	HSBC	50	(487)	WiseTech Global Ltd	Citibank	(464)
(555)	Crown Resorts Ltd	JP Morgan	52	(305)	WiseTech Global Ltd	HSBC	(71)
(53)	CSL Ltd	HSBC	(609)	(194)	Woolworths Group Ltd	Citibank	(3)
(25)	CSL Ltd	JP Morgan	(287)	(597)	Woolworths Group Ltd	HSBC	(517)
(1.224)	Evolution Mining Ltd	Citibank	(127)	(161)	Woolworths Group Ltd	JP Morgan	(140)
(1.707)	Evolution Mining Ltd	HSBC	(161)				20.546
(2.004)	Evolution Mining Ltd	JP Morgan	(496)		Autriche		
(1.053)	Fortescue Metals Group Ltd	HSBC	(257)	207	Erste Group Bank AG	HSBC	583
(1.648)	Fortescue Metals Group Ltd	JP Morgan	3.010	1.352	Raiffeisen Bank International AG	Citibank	33
(12.428)	Insurance Australia Group Ltd	JP Morgan	770	1.046	Raiffeisen Bank International AG	JP Morgan	294
744	James Hardie Industries Plc - CDI	Citibank	722	(67)	Verbund AG	Citibank	82
704	James Hardie Industries Plc - CDI	HSBC	254	298	voestalpine AG	Citibank	378
632	James Hardie Industries Plc - CDI	JP Morgan	603				1.370
(495)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	HSBC	(57)		Belgique		
(132)	Magellan Financial Group Ltd	HSBC	(91)	(384)	Ageas SA	Citibank	(253)
(18.643)	Medibank Pvt Ltd	Citibank	(433)	100	Anheuser-Busch InBev SA	HSBC	25
(4.471)	Medibank Pvt Ltd	HSBC	(242)	(162)	Argenx SE	Citibank	(1.483)
(951)	National Australia Bank Ltd	Citibank	(221)	(67)	Argenx SE	HSBC	(1.333)
(750)	National Australia Bank Ltd	JP Morgan	81	(376)	Elia Group SA	Citibank	2.019
(507)	Newcrest Mining Ltd	Citibank	78	(371)	Elia Group SA	HSBC	543
(311)	Newcrest Mining Ltd	HSBC	(53)	(87)	Elia Group SA	JP Morgan	127
(1.200)	Newcrest Mining Ltd	JP Morgan	(204)	150	Etablissements Franz Colruyt NV	JP Morgan	(17)
(557)	Northern Star Resources Ltd	HSBC	(83)	194	Groupe Bruxelles Lambert SA	Citibank	355
(3.198)	Northern Star Resources Ltd	JP Morgan	(891)	246	KBC Group NV	Citibank	(120)
(517)	Orica Ltd	Citibank	56	254	KBC Group NV	HSBC	298
(2.150)	Orica Ltd	HSBC	632	56	KBC Group NV	JP Morgan	66
(2.238)	Orica Ltd	JP Morgan	658	1.420	Proximus SADP	Citibank	(823)
(1.919)	Qantas Airways Ltd	JP Morgan	—	1.689	Proximus SADP	HSBC	(1.731)
149	QBE Insurance Group Ltd	HSBC	31	1.268	Proximus SADP	JP Morgan	(1.300)
				(22)	Sofina SA	Citibank	(274)
				(84)	Sofina SA	HSBC	(2.173)
				(48)	Sofina SA	JP Morgan	(1.242)
				219	Solvay SA	HSBC	(1.029)
				92	UCB SA	Citibank	(101)

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Belgique suite				Canada suite			
112	UCB SA	HSBC	77	66	George Weston Ltd	Citibank	15
68	UCB SA	JP Morgan	46	751	George Weston Ltd	HSBC	2.312
(468)	Umicore SA	HSBC	1.342	262	George Weston Ltd	JP Morgan	807
			(6.981)	188	Gildan Activewear Inc	Citibank	182
				296	Gildan Activewear Inc	HSBC	92
				374	Gildan Activewear Inc	JP Morgan	(22)
(86)	Agnico Eagle Mines Ltd	HSBC	(264)	1.718	Hydro One Ltd	Citibank	427
(290)	Air Canada	Citibank	(329)	6.537	Hydro One Ltd	HSBC	2.597
(617)	Air Canada	HSBC	(1.169)	984	Hydro One Ltd	JP Morgan	391
(574)	Algonquin Power & Utilities Corp	Citibank	43	153	iA Financial Corp Inc	Citibank	(101)
(706)	Algonquin Power & Utilities Corp	HSBC	380	(382)	IGM Financial Inc	Citibank	(63)
(708)	Algonquin Power & Utilities Corp	JP Morgan	381	180	Intact Financial Corp	Citibank	790
(657)	Atco Ltd 'I'	JP Morgan	(680)	291	Intact Financial Corp	JP Morgan	(542)
9.029	B2Gold Corp	Citibank	75	(367)	Inter Pipeline Ltd	HSBC	46
6.469	B2Gold Corp	HSBC	428	879	Kinross Gold Corp	Citibank	22
881	B2Gold Corp	JP Morgan	58	586	Kinross Gold Corp	HSBC	199
(1.257)	Ballard Power Systems Inc	HSBC	(2.832)	(446)	Kirkland Lake Gold Ltd	Citibank	183
323	Bank of Montreal	Citibank	928	(813)	Kirkland Lake Gold Ltd	HSBC	(1.264)
484	Bank of Montreal	HSBC	3.710	(375)	Kirkland Lake Gold Ltd	JP Morgan	(888)
32	Bank of Montreal	JP Morgan	245	774	Loblaw Cos Ltd	Citibank	(346)
939	Bank of Nova Scotia	Citibank	1.500	(394)	Lundin Mining Corp	Citibank	(59)
76	Bank of Nova Scotia	HSBC	107	(424)	Lundin Mining Corp	HSBC	670
267	Bank of Nova Scotia	JP Morgan	508	69	Magna International Inc	Citibank	1
(1.198)	Bausch Health Cos Inc	Citibank	(873)	232	Magna International Inc	HSBC	408
(177)	Bausch Health Cos Inc	JP Morgan	(778)	(300)	Metro Inc	JP Morgan	30
(202)	BCE Inc	Citibank	(60)	248	National Bank of Canada	Citibank	(10)
(567)	BCE Inc	HSBC	(314)	603	National Bank of Canada	HSBC	1.772
(998)	BCE Inc	JP Morgan	(553)	72	National Bank of Canada	JP Morgan	212
(163)	CAE Inc	HSBC	(196)	240	Nutrien Ltd	Citibank	423
(515)	Cameco Corp	Citibank	(486)	85	Nutrien Ltd	JP Morgan	21
(736)	Cameco Corp	HSBC	(402)	152	Onex Corp	HSBC	586
(143)	Canadian Apartment Properties REIT (REIT)	Citibank	7	309	Open Text Corp	Citibank	256
327	Canadian Imperial Bank of Commerce	Citibank	1.938	349	Open Text Corp	HSBC	(17)
337	Canadian Imperial Bank of Commerce	HSBC	3.342	135	Open Text Corp	JP Morgan	(7)
265	Canadian Imperial Bank of Commerce	JP Morgan	2.628	(705)	Pan American Silver Corp	Citibank	280
54	Canadian National Railway Co	JP Morgan	(18)	(280)	Pan American Silver Corp	HSBC	273
(175)	Canadian Pacific Railway Ltd	Citibank	39	(850)	Pan American Silver Corp	JP Morgan	830
(155)	Canadian Pacific Railway Ltd	JP Morgan	(268)	195	Parkland Corp	Citibank	40
74	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Citibank	5	1.081	Parkland Corp	HSBC	(814)
259	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	HSBC	1.736	(180)	Pembina Pipeline Corp	Citibank	(130)
155	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	JP Morgan	1.039	(715)	Pembina Pipeline Corp	HSBC	(681)
(1.485)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Citibank	356	(184)	Pembina Pipeline Corp	JP Morgan	(175)
(1.134)	Canadian Utilities Ltd 'A'	HSBC	329	337	Power Corp of Canada	Citibank	181
(1.991)	Canadian Utilities Ltd 'A'	JP Morgan	577	733	Power Corp of Canada	HSBC	1.584
111	CGI Inc	HSBC	(75)	222	Quebecor Inc 'B'	Citibank	(41)
14	Constellation Software Inc	Citibank	(293)	257	Quebecor Inc 'B'	HSBC	(399)
9	Constellation Software Inc	HSBC	(217)	1.069	Quebecor Inc 'B'	JP Morgan	(1.659)
7	Constellation Software Inc	JP Morgan	(169)	(294)	Restaurant Brands International Inc	HSBC	(153)
(1.030)	Dollarama Inc	Citibank	656	87	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Citibank	(134)
(638)	Dollarama Inc	HSBC	563	218	Ritchie Bros Auctioneers Inc	HSBC	(1.689)
(241)	Dollarama Inc	JP Morgan	168	103	Ritchie Bros Auctioneers Inc	JP Morgan	(798)
(182)	Empire Co Ltd 'A'	JP Morgan	(101)	175	Rogers Communications Inc 'B'	HSBC	75
(373)	Enbridge Inc	Citibank	9	186	Royal Bank of Canada	Citibank	316
(711)	Enbridge Inc	JP Morgan	1.230	(685)	Saputo Inc	Citibank	(896)
(133)	Fairfax Financial Holdings Ltd	HSBC	1.073	(1.221)	Saputo Inc	HSBC	(2.193)
(956)	First Quantum Minerals Ltd	HSBC	1.725	(645)	Saputo Inc	JP Morgan	(1.159)
(395)	First Quantum Minerals Ltd	JP Morgan	713	(43)	Shaw Communications Inc 'B'	Citibank	(2)
(580)	Fortis Inc	Citibank	55	(140)	Shaw Communications Inc 'B'	HSBC	8
(1.106)	Fortis Inc	HSBC	(16)	(25)	Shopify Inc 'A'	Citibank	(24)
(1.802)	Fortis Inc	JP Morgan	(5)	(930)	SSR Mining Inc	Citibank	38
				(2.274)	SSR Mining Inc	HSBC	(3.953)
				(1.220)	SSR Mining Inc	JP Morgan	(2.121)
				33	Sun Life Financial Inc	Citibank	28
				1.634	Sun Life Financial Inc	HSBC	(893)
				248	Sun Life Financial Inc	JP Morgan	(135)
				(1.482)	TC Energy Corp	Citibank	(552)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Allemagne suite				Irlande suite			
189	Puma SE	Citibank	268	(346)	Kerry Group Plc 'A'	JP Morgan	(844)
(671)	QIAGEN NV	JP Morgan	(1.212)	(80)	Kingspan Group Plc	JP Morgan	(59)
57	SAP SE	Citibank	(79)	97	Smurfit Kappa Group Plc	Citibank	9
134	SAP SE	HSBC	(271)	115	Smurfit Kappa Group Plc	JP Morgan	(101)
303	SAP SE	JP Morgan	(453)				
(22)	Sartorius AG (Pref)	Citibank	(35)				1.036
(33)	Sartorius AG (Pref)	HSBC	737	Israël			
(48)	Sartorius AG (Pref)	JP Morgan	1.072	(74)	Azrieli Group Ltd	HSBC	(198)
351	Scout24 AG	Citibank	(180)	822	Bank Hapoalim BM	Citibank	(48)
42	Siemens AG Reg	Citibank	(132)	621	Bank Hapoalim BM	JP Morgan	176
214	Siemens AG Reg	HSBC	(2.714)	926	Bank Leumi Le-Israel BM	Citibank	148
224	Siemens AG Reg	JP Morgan	(3.007)	3.267	Bank Leumi Le-Israel BM	HSBC	1.077
(33)	Siemens Energy AG	HSBC	(12)	(4.407)	ICL Group Ltd	HSBC	(1.411)
(963)	Siemens Energy AG	JP Morgan	(341)	1.145	Israel Discount Bank Ltd 'A'	Citibank	56
(884)	Siemens Healthineers AG	Citibank	43	3.176	Israel Discount Bank Ltd 'A'	HSBC	704
(1.496)	Siemens Healthineers AG	HSBC	1.844	1.201	Israel Discount Bank Ltd 'A'	JP Morgan	266
(94)	Siemens Healthineers AG	JP Morgan	116				770
133	Symrise AG	Citibank	24	Italie			
(306)	TeamViewer AG	Citibank	(288)	460	Assicurazioni Generali SpA	Citibank	(14)
(133)	TeamViewer AG	HSBC	(164)	(482)	Atlantia SpA	Citibank	(374)
(283)	TeamViewer AG	JP Morgan	435	(2.108)	Atlantia SpA	HSBC	(64)
1.271	Telefonica Deutschland Holding AG	Citibank	(36)	(256)	Atlantia SpA	JP Morgan	(8)
12.852	Telefonica Deutschland Holding AG	JP Morgan	(3.937)	906	CNH Industrial NV	Citibank	464
(25)	Uniper SE	HSBC	24	(1.961)	Davide Campari-Milano NV	Citibank	(168)
(511)	Uniper SE	JP Morgan	493	75	DiaSorin SpA	HSBC	220
(139)	United Internet AG Reg	Citibank	61	1	DiaSorin SpA	JP Morgan	3
(926)	United Internet AG Reg	HSBC	633	76	EXOR NV	HSBC	111
(115)	Vonovia SE	Citibank	(321)	(187)	Ferrari NV	Citibank	103
(213)	Zalando SE	Citibank	478	(107)	Ferrari NV	HSBC	(1.090)
(54)	Zalando SE	JP Morgan	(232)	(467)	FinecoBank Banca Fineco SpA	JP Morgan	194
			(2.594)	(720)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	HSBC	285
				(8.219)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	JP Morgan	3.250
Hong Kong				34.630	Intesa Sanpaolo SpA	Citibank	2.578
(500)	ASM Pacific Technology Ltd	Citibank	(190)	49.266	Intesa Sanpaolo SpA	HSBC	2.074
(900)	ASM Pacific Technology Ltd	HSBC	1.136	1.710	Intesa Sanpaolo SpA	JP Morgan	72
(15.400)	Bank of East Asia Ltd	Citibank	635	(4.220)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Citibank	(608)
4.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Citibank	174	(255)	Moncler SpA	Citibank	(1.326)
19.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	HSBC	(3.643)	(193)	Moncler SpA	HSBC	(1.602)
4.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	JP Morgan	(747)	(265)	Moncler SpA	JP Morgan	(2.199)
6.500	CK Asset Holdings Ltd	Citibank	1.801	(1.135)	Nexi SpA	Citibank	(326)
(1.000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Citibank	(64)	(436)	Nexi SpA	HSBC	(649)
(3.000)	Hang Lung Properties Ltd	HSBC	259	1.041	Poste Italiane SpA	HSBC	432
(7.000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	HSBC	848	1.751	Poste Italiane SpA	JP Morgan	727
(3)	MTR Corp Ltd	Citibank	—	(104)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	JP Morgan	(104)
(22.802)	MTR Corp Ltd	HSBC	4.113	2.120	Snam SpA	HSBC	(8)
(1.000)	New World Development Co Ltd	HSBC	64	1.979	Snam SpA	JP Morgan	(7)
(6.264)	Sino Land Co Ltd	Citibank	97	(1.048)	Stellantis NV	Citibank	(1.233)
(25.000)	SJM Holdings Ltd	Citibank	354	(358)	Stellantis NV	HSBC	(547)
(34.000)	SJM Holdings Ltd	HSBC	1.139	(8.160)	Tenaris SA	Citibank	(4.579)
2.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Citibank	464	(3.466)	Tenaris SA	HSBC	611
2.500	Swire Pacific Ltd 'A'	Citibank	(177)	(812)	Tenaris SA	JP Morgan	69
3.500	Swire Pacific Ltd 'A'	HSBC	(2.300)	4.469	Terna SpA	Citibank	(229)
1.500	Techtronic Industries Co Ltd	Citibank	561	2.006	Terna SpA	HSBC	211
(12.000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	JP Morgan	2.551	5.391	Terna SpA	JP Morgan	566
(3.200)	Wynn Macau Ltd	Citibank	(25)	587	UniCredit SpA	Citibank	181
			7.050				(2.984)
Irlande				Japon			
1.322	CRH Plc	Citibank	1.517	(100)	ABC-Mart Inc	JP Morgan	(237)
144	CRH Plc	HSBC	123	(4.100)	Acom Co Ltd	Citibank	(112)
489	CRH Plc	JP Morgan	418	(7.300)	Acom Co Ltd	HSBC	(1.132)
(23)	Flutter Entertainment Plc	Citibank	(27)	(3.200)	Acom Co Ltd	JP Morgan	(496)
				(100)	Advantest Corp	JP Morgan	283
				(200)	Aeon Co Ltd	JP Morgan	285
				(700)	Aeon Mall Co Ltd	HSBC	(140)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
(100)	AGC Inc	HSBC	410	(100)	FANUC Corp	Citibank	(739)
(300)	Air Water Inc	JP Morgan	268	(100)	FANUC Corp	JP Morgan	255
(600)	Aisin Corp	HSBC	(3.124)	200	Fuji Electric Co Ltd	Citibank	146
600	Ajinomoto Co Inc	HSBC	1.059	200	FUJIFILM Holdings Corp	Citibank	494
400	Alfresa Holdings Corp	JP Morgan	(1.299)	200	FUJIFILM Holdings Corp	HSBC	620
2.900	Amada Co Ltd	Citibank	1.084	200	Fujitsu Ltd	Citibank	(429)
600	Amada Co Ltd	JP Morgan	(389)	500	Fujitsu Ltd	JP Morgan	4.606
(100)	ANA Holdings Inc	Citibank	(129)	(600)	Fukuoka Financial Group Inc	Citibank	153
(700)	Asahi Group Holdings Ltd	Citibank	(70)	(2.400)	Fukuoka Financial Group Inc	HSBC	(657)
(300)	Asahi Group Holdings Ltd	HSBC	(1.308)	(200)	GMO Payment Gateway Inc	Citibank	(383)
(200)	Asahi Intecc Co Ltd	Citibank	297	(100)	GMO Payment Gateway Inc	JP Morgan	192
(300)	Asahi Intecc Co Ltd	HSBC	711	600	Hakuhodo DY Holdings Inc	JP Morgan	(137)
1.100	Asahi Kasei Corp	HSBC	(25)	(300)	Hamamatsu Photonics KK	HSBC	(996)
1.300	Asahi Kasei Corp	JP Morgan	(30)	(200)	Hamamatsu Photonics KK	JP Morgan	(511)
5.100	Astellas Pharma Inc	Citibank	6.349	700	Hankyu Hanshin Holdings Inc	HSBC	(670)
(300)	Bandai Namco Holdings Inc	Citibank	(16)	(100)	Hikari Tsushin Inc	Citibank	657
(600)	Bandai Namco Holdings Inc	HSBC	1.368	(100)	Hikari Tsushin Inc	HSBC	365
(900)	Bank of Kyoto Ltd	Citibank	(2.463)	(700)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Citibank	(64)
(700)	Bank of Kyoto Ltd	HSBC	3.895	(300)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	HSBC	55
(500)	Bank of Kyoto Ltd	JP Morgan	2.782	(400)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	JP Morgan	73
500	Bridgestone Corp	JP Morgan	812	200	Hitachi Ltd	Citibank	188
900	Brother Industries Ltd	Citibank	(189)	(600)	Hitachi Metals Ltd	HSBC	49
5.500	Brother Industries Ltd	HSBC	5.970	600	Hitachi Motor Co Ltd	Citibank	(33)
400	Calbee Inc	Citibank	(270)	1.000	Honda Motor Co Ltd	HSBC	(711)
500	Calbee Inc	JP Morgan	(689)	2.100	Honda Motor Co Ltd	JP Morgan	(1.494)
(600)	Canon Inc	HSBC	337	100	Hoya Corp	JP Morgan	1.090
(500)	Canon Inc	JP Morgan	280	(500)	Iida Group Holdings Co Ltd	HSBC	(620)
300	Casio Computer Co Ltd	JP Morgan	(216)	1.100	Isuzu Motors Ltd	HSBC	2.879
(400)	Central Japan Railway Co	HSBC	18	200	Ito En Ltd	Citibank	(73)
(3.300)	Chiba Bank Ltd	HSBC	602	100	Ito En Ltd	HSBC	(164)
(1.400)	Chiba Bank Ltd	JP Morgan	255	(900)	Japan Airlines Co Ltd	JP Morgan	(1.494)
200	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	86	(700)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Citibank	(1.596)
500	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	123	(200)	Japan Airport Terminal Co Ltd	HSBC	(9)
100	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	25	(200)	Japan Airport Terminal Co Ltd	JP Morgan	(9)
700	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Citibank	26	(500)	Japan Exchange Group Inc	Citibank	472
1.400	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	HSBC	(345)	(600)	Japan Exchange Group Inc	JP Morgan	643
600	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	JP Morgan	(148)	(7.600)	Japan Post Bank Co Ltd	Citibank	1.386
(1.600)	Concordia Financial Group Ltd	JP Morgan	525	(4.000)	Japan Post Bank Co Ltd	HSBC	4.050
(100)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Citibank	182	(3.700)	Japan Post Bank Co Ltd	JP Morgan	3.746
400	CyberAgent Inc	Citibank	128	3.000	Japan Post Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.056)
100	CyberAgent Inc	HSBC	7	(700)	Japan Post Insurance Co Ltd	JP Morgan	670
800	Dai Nippon Printing Co Ltd	HSBC	452	(1.300)	JFE Holdings Inc	Citibank	474
(300)	Daifuku Co Ltd	Citibank	1.696	(1.800)	JFE Holdings Inc	JP Morgan	4.383
(200)	Daifuku Co Ltd	JP Morgan	3.721	600	JSR Corp	HSBC	(638)
300	Dai-ichi Life Holdings Inc	JP Morgan	104	900	Kajima Corp	Citibank	(172)
(200)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Citibank	83	3.600	Kajima Corp	HSBC	(2.233)
(100)	Daikin Industries Ltd	Citibank	(379)	400	Kajima Corp	JP Morgan	(248)
(100)	Daikin Industries Ltd	JP Morgan	1.377	(200)	Kakaku.com Inc	Citibank	(319)
(100)	Daito Trust Construction Co Ltd	HSBC	100	(500)	Kakaku.com Inc	HSBC	(2.066)
200	Daiwa House Industry Co Ltd	HSBC	110	100	Kao Corp	HSBC	(261)
(4.800)	Daiwa Securities Group Inc	HSBC	(206)	1.000	KDDI Corp	Citibank	328
(1.500)	Daiwa Securities Group Inc	JP Morgan	(64)	700	KDDI Corp	HSBC	1.769
(100)	Denso Corp	HSBC	(400)	1.600	KDDI Corp	JP Morgan	4.042
(100)	Denso Corp	JP Morgan	(269)	(500)	Keihan Holdings Co Ltd	Citibank	(889)
(200)	Dentsu Group Inc	Citibank	(255)	(200)	Keihan Holdings Co Ltd	HSBC	702
(100)	Disco Corp	HSBC	1.368	(600)	Keihan Holdings Co Ltd	JP Morgan	2.107
(500)	East Japan Railway Co	Citibank	(538)	(300)	Keikyuu Corp	Citibank	(156)
(100)	East Japan Railway Co	HSBC	30	(200)	Keio Corp	HSBC	748
100	Eisai Co Ltd	HSBC	99	200	Keisei Electric Railway Co Ltd	Citibank	237
100	Eisai Co Ltd	JP Morgan	99				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
(100)	Keyence Corp	HSBC	(347)	(200)	MonotaRO Co Ltd	HSBC	15
(100)	Keyence Corp	JP Morgan	(347)	400	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	HSBC	171
300	Kikkoman Corp	Citibank	1.040	(200)	Murata Manufacturing Co Ltd	Citibank	(99)
(600)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Citibank	(684)	(700)	Murata Manufacturing Co Ltd	HSBC	2.682
(100)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	HSBC	192	(100)	Murata Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	383
(400)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	766	100	Nabtesco Corp	HSBC	(18)
(200)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	201	(200)	Nagoya Railroad Co Ltd	HSBC	839
(500)	Kobe Bussan Co Ltd	Citibank	265	300	NEC Corp	Citibank	(547)
(1.300)	Kobe Bussan Co Ltd	JP Morgan	1.802	600	NEC Corp	HSBC	(6.786)
(600)	Koito Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(657)	200	NEC Corp	JP Morgan	(2.262)
(300)	Komatsu Ltd	Citibank	99	(400)	Nexon Co Ltd	HSBC	3.232
(100)	Konami Holdings Corp	JP Morgan	(255)	(400)	Nexon Co Ltd	JP Morgan	3.232
(100)	Kose Corp	Citibank	(474)	1.000	NGK Insulators Ltd	JP Morgan	(1.158)
(200)	Kose Corp	HSBC	(1.915)	1.100	NGK Spark Plug Co Ltd	Citibank	462
(1.600)	Kubota Corp	Citibank	1.036	700	NGK Spark Plug Co Ltd	HSBC	102
700	Kuraray Co Ltd	HSBC	(741)	800	NGK Spark Plug Co Ltd	JP Morgan	117
300	Kurita Water Industries Ltd	HSBC	27	(200)	NH Foods Ltd	JP Morgan	830
200	Kurita Water Industries Ltd	JP Morgan	18	(300)	Nidec Corp	HSBC	(109)
500	Kyocera Corp	Citibank	342	(100)	Nidec Corp	JP Morgan	(112)
200	Kyowa Kirin Co Ltd	HSBC	(119)	(600)	Nihon M&A Center Inc	Citibank	438
600	Kyushu Railway Co	Citibank	624	(200)	Nihon M&A Center Inc	HSBC	275
800	Kyushu Railway Co	JP Morgan	(241)	(600)	Nihon M&A Center Inc	JP Morgan	826
(100)	Lasertec Corp	Citibank	(2.517)	200	Nippon Express Co Ltd	Citibank	(339)
(300)	Lasertec Corp	JP Morgan	(4.953)	200	Nippon Express Co Ltd	HSBC	(310)
(600)	Lion Corp	JP Morgan	673	500	Nippon Express Co Ltd	JP Morgan	(505)
300	Lixil Corp	Citibank	(487)	(3.000)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Citibank	(1.724)
(200)	M3 Inc	HSBC	100	(500)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	HSBC	771
(100)	M3 Inc	JP Morgan	50	(1.000)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	JP Morgan	1.541
(1.100)	Makita Corp	Citibank	(2.809)	(1.000)	Nippon Sanso Holdings Corp	Citibank	584
(300)	Makita Corp	HSBC	(438)	(1.300)	Nippon Sanso Holdings Corp	HSBC	(308)
(200)	Makita Corp	JP Morgan	(292)	(700)	Nippon Sanso Holdings Corp	JP Morgan	(166)
(500)	Marui Group Co Ltd	HSBC	55	(100)	Nippon Shinyaku Co Ltd	HSBC	(392)
(2.200)	Marui Group Co Ltd	JP Morgan	241	2.300	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Citibank	185
5.200	Mazda Motor Corp	Citibank	2.229	2.000	Nippon Telegraph & Telephone Corp	HSBC	1.268
600	Mazda Motor Corp	JP Morgan	192	1.500	Nippon Telegraph & Telephone Corp	JP Morgan	1.060
600	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Citibank	(137)	1.200	Nippon Yusen KK	Citibank	(930)
200	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	HSBC	(82)	(300)	Nissan Chemical Corp	HSBC	848
300	Medipal Holdings Corp	Citibank	19	(6.100)	Nissan Motor Co Ltd	Citibank	(351)
600	Medipal Holdings Corp	HSBC	(115)	(900)	Nissan Motor Co Ltd	HSBC	355
(100)	MEIJI Holdings Co Ltd	Citibank	55	(12.200)	Nissan Motor Co Ltd	JP Morgan	4.818
(300)	Mercari Inc	Citibank	(438)	400	Nisshin Seifun Group Inc	JP Morgan	(730)
800	MINEBEA MITSUMI Inc	JP Morgan	839	300	Nissin Foods Holdings Co Ltd	JP Morgan	82
(300)	MISUMI Group Inc	JP Morgan	(137)	100	Nitori Holdings Co Ltd	Citibank	(333)
2.400	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	HSBC	138	900	Nitto Denko Corp	Citibank	739
5.300	Mitsubishi Electric Corp	HSBC	(193)	200	Nitto Denko Corp	HSBC	(985)
7.800	Mitsubishi Electric Corp	JP Morgan	(285)	1.100	Nitto Denko Corp	JP Morgan	(4.863)
300	Mitsubishi Estate Co Ltd	Citibank	(55)	2.100	Nomura Holdings Inc	HSBC	393
400	Mitsubishi Estate Co Ltd	HSBC	(361)	4.300	Nomura Holdings Inc	JP Morgan	804
800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	HSBC	(452)	300	Nomura Real Estate Holdings Inc	HSBC	(30)
1.300	Mitsubishi HC Capital Inc	HSBC	(368)	300	Nomura Research Institute Ltd	HSBC	301
(1.200)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	HSBC	1.300	100	NSK Ltd	Citibank	1
(200)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	JP Morgan	52	3.200	NSK Ltd	HSBC	(934)
400	Mitsui Chemicals Inc	Citibank	474	3.900	NSK Ltd	JP Morgan	(1.138)
300	Mitsui Chemicals Inc	HSBC	27	600	NTT Data Corp	HSBC	159
1.200	Mitsui Chemicals Inc	JP Morgan	109				
(300)	Mitsui Fudosan Co Ltd	JP Morgan	(94)				
(300)	Miura Co Ltd	HSBC	2.408				
80	Mizuho Financial Group Inc	Citibank	(25)				
1.430	Mizuho Financial Group Inc	HSBC	659				
(1.400)	MonotaRO Co Ltd	Citibank	(600)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
1.200	Obayashi Corp	JP Morgan	(1.302)	(200)	Shimamura Co Ltd	HSBC	1.040
(200)	Obic Co Ltd	Citibank	839	(200)	Shimano Inc	JP Morgan	739
(200)	Obic Co Ltd	JP Morgan	(1.022)	2.000	Shimizu Corp	HSBC	(693)
(1.000)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Citibank	(401)	2.600	Shimizu Corp	JP Morgan	(901)
(900)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	1.404	(300)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	HSBC	(766)
(2.200)	Oji Holdings Corp	Citibank	722	(200)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	JP Morgan	(511)
(900)	Oji Holdings Corp	HSBC	928	(1.300)	Shinsei Bank Ltd	Citibank	12
(900)	Oji Holdings Corp	JP Morgan	928	(700)	Shinsei Bank Ltd	HSBC	(492)
300	Olympus Corp	JP Morgan	197	300	Shionogi & Co Ltd	Citibank	(542)
600	Omron Corp	Citibank	1.751	300	Shionogi & Co Ltd	HSBC	(657)
100	Omron Corp	JP Morgan	82	100	Shionogi & Co Ltd	JP Morgan	(219)
100	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(41)	(300)	Shiseido Co Ltd	Citibank	(832)
1.300	Ono Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	(4.784)	(800)	Shiseido Co Ltd	HSBC	(66)
(200)	Oracle Corp Japan	HSBC	1.605	(400)	Shiseido Co Ltd	JP Morgan	(33)
(200)	Oriental Land Co Ltd	Citibank	(1.970)	700	Shizuoka Bank Ltd	Citibank	(275)
(100)	Oriental Land Co Ltd	JP Morgan	(919)	(200)	SMC Corp	HSBC	(529)
400	ORIX Corp	JP Morgan	403	(500)	SoftBank Corp	Citibank	30
(900)	Otsuka Corp	HSBC	(1.642)	(400)	SoftBank Corp	JP Morgan	155
100	Otsuka Holdings Co Ltd	Citibank	42	(500)	SoftBank Group Corp	HSBC	8.729
100	Otsuka Holdings Co Ltd	HSBC	120	100	Sohgo Security Services Co Ltd	HSBC	123
(1.300)	Pan Pacific International Holdings Corp	Citibank	1.067	300	Sompo Holdings Inc	Citibank	41
(1.500)	Pan Pacific International Holdings Corp	JP Morgan	2.805	200	Sony Group Corp	Citibank	502
3.100	Panasonic Corp	Citibank	1.824	1.000	Sony Group Corp	HSBC	46
900	Panasonic Corp	HSBC	(357)	(200)	Sony Group Corp	JP Morgan	9
3.900	Panasonic Corp	JP Morgan	(1.547)	(200)	Square Enix Holdings Co Ltd	HSBC	511
(900)	PeptiDream Inc	Citibank	(1.683)	400	Stanley Electric Co Ltd	Citibank	328
(600)	PeptiDream Inc	JP Morgan	(1.423)	400	Stanley Electric Co Ltd	JP Morgan	237
300	Persol Holdings Co Ltd	HSBC	(118)	400	Subaru Corp	JP Morgan	9
(900)	Pigeon Corp	Citibank	2.339	(1.300)	SUMCO Corp	HSBC	1.281
(1.200)	Pigeon Corp	HSBC	6.731	(1.700)	SUMCO Corp	JP Morgan	1.675
(600)	Pola Orbis Holdings Inc	HSBC	126	1.700	Sumitomo Chemical Co Ltd	Citibank	47
(1.700)	Rakuten Group Inc	Citibank	372	700	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	HSBC	843
(2.800)	Rakuten Group Inc	HSBC	2.018	(700)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Citibank	(329)
400	Recruit Holdings Co Ltd	HSBC	1.087	(500)	Sumitomo Electric Industries Ltd	HSBC	(199)
300	Recruit Holdings Co Ltd	JP Morgan	815	(600)	Sumitomo Electric Industries Ltd	JP Morgan	(357)
(1.700)	Renesas Electronics Corp	Citibank	713	(100)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	HSBC	275
3.600	Resona Holdings Inc	JP Morgan	(33)	(200)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	JP Morgan	(500)
2.000	Ricoh Co Ltd	Citibank	292	400	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Citibank	(288)
100	Ricoh Co Ltd	HSBC	60	1.200	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	HSBC	(208)
(100)	Rinnai Corp	JP Morgan	538	600	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	JP Morgan	(104)
100	Rohm Co Ltd	Citibank	420	300	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Citibank	(347)
(800)	Ryohin Keikaku Co Ltd	HSBC	1.875	800	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	JP Morgan	(628)
(700)	Ryohin Keikaku Co Ltd	JP Morgan	1.641	(400)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	HSBC	1.000
400	Santen Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	120	(400)	Sundrug Co Ltd	Citibank	(328)
(400)	SBI Holdings Inc	Citibank	(219)	1.400	Suntory Beverage & Food Ltd	Citibank	511
(1.100)	SBI Holdings Inc	HSBC	2.679	100	Suntory Beverage & Food Ltd	HSBC	237
(300)	SBI Holdings Inc	JP Morgan	731	1.300	Suntory Beverage & Food Ltd	JP Morgan	3.083
300	Secom Co Ltd	Citibank	47	(300)	Suzuken Co Ltd	Citibank	(205)
400	Secom Co Ltd	HSBC	(2.725)	(200)	Suzuken Co Ltd	HSBC	1.140
100	Sega Sammy Holdings Inc	Citibank	(22)	200	Systemex Corp	Citibank	866
900	Sega Sammy Holdings Inc	HSBC	(1.732)	100	Systemex Corp	HSBC	—
800	Sega Sammy Holdings Inc	JP Morgan	(1.540)	100	Systemex Corp	JP Morgan	—
(2.200)	Seibu Holdings Inc	HSBC	(1.986)	1.000	T&D Holdings Inc	JP Morgan	848
1.600	Seiko Epson Corp	Citibank	73				
700	Seiko Epson Corp	HSBC	281				
1.000	Seiko Epson Corp	JP Morgan	401				
1.600	Sekisui Chemical Co Ltd	Citibank	(817)				
2.300	Sekisui Chemical Co Ltd	HSBC	(2.916)				
6.000	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	(7.607)				
700	Sekisui House Ltd	Citibank	(166)				
5.100	Sekisui House Ltd	HSBC	(1.861)				
(300)	SG Holdings Co Ltd	HSBC	159				
(1.500)	Sharp Corp	JP Morgan	(2.408)				
200	Shimadzu Corp	Citibank	(9)				
900	Shimadzu Corp	HSBC	(1.231)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
600	Taiheiyo Cement Corp	Citibank	(109)	(200)	Yaskawa Electric Corp	HSBC	(255)
300	Taiheiyo Cement Corp	JP Morgan	(1.070)	800	Yokogawa Electric Corp	HSBC	(2.430)
600	Taisei Corp	Citibank	(739)	400	Yokogawa Electric Corp	JP Morgan	(1.215)
200	Taisei Corp	HSBC	(748)	(1.100)	Z Holdings Corp	Citibank	(443)
(100)	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	HSBC	91	(4.100)	Z Holdings Corp	HSBC	(1.473)
(4.000)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	1.569	200	ZOZO Inc	JP Morgan	201
(700)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	70				37.560
(1.700)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	171	Pays-Bas			
300	TDK Corp	Citibank	164	(1.807)	ABN AMRO Bank NV - CVA	Citibank	(437)
2.200	Teijin Ltd	Citibank	(742)	(1.137)	ABN AMRO Bank NV - CVA	HSBC	266
8.500	Teijin Ltd	HSBC	(8.450)	(1.739)	ABN AMRO Bank NV - CVA	JP Morgan	407
1.900	Teijin Ltd	JP Morgan	(1.889)	4	Adyen NV	Citibank	50
400	Terumo Corp	Citibank	299	6	Adyen NV	HSBC	442
(200)	THK Co Ltd	Citibank	(301)	(4.036)	Aegon NV	HSBC	537
(900)	TIS Inc	Citibank	107	332	Akzo Nobel NV	Citibank	284
(300)	TIS Inc	HSBC	(367)	344	Akzo Nobel NV	JP Morgan	630
(600)	TIS Inc	JP Morgan	(733)	(24)	ASM International NV	Citibank	(410)
(900)	Tobu Railway Co Ltd	Citibank	(181)	2	ASML Holding NV	HSBC	62
(300)	Toho Co Ltd	Citibank	(616)	54	ASML Holding NV	JP Morgan	1.674
(300)	Toho Co Ltd	HSBC	(342)	(199)	Galapagos NV	Citibank	(287)
(600)	Toho Co Ltd	JP Morgan	(684)	(175)	Galapagos NV	HSBC	(410)
(500)	Tokio Marine Holdings Inc	JP Morgan	1.336	(608)	Heineken NV	JP Morgan	1.113
(100)	Tokyo Century Corp	HSBC	246	(517)	ING Groep NV	Citibank	(174)
(600)	Tokyo Century Corp	JP Morgan	1.478	(795)	JDE Peet's NV	Citibank	49
100	Tokyo Electron Ltd	HSBC	(1.277)	(127)	JDE Peet's NV	HSBC	(40)
(900)	Tokyu Corp	JP Morgan	(49)	(120)	JDE Peet's NV	JP Morgan	(38)
(1.200)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Citibank	(252)	(179)	Just Eat Takeaway.com NV	Citibank	(321)
400	Toppa Printing Co Ltd	Citibank	58	(812)	Just Eat Takeaway.com NV	HSBC	5.728
300	Toppa Printing Co Ltd	HSBC	(96)	(266)	Just Eat Takeaway.com NV	JP Morgan	1.876
900	Toppa Printing Co Ltd	JP Morgan	(287)	186	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Citibank	(44)
5.400	Toray Industries Inc	Citibank	222	2.623	Koninklijke Ahold Delhaize NV	HSBC	1.457
14.200	Toray Industries Inc	HSBC	324	602	Koninklijke Ahold Delhaize NV	JP Morgan	334
500	Toray Industries Inc	JP Morgan	11	29	Koninklijke DSM NV	Citibank	55
(300)	Toshiba Corp	HSBC	(219)	27	Koninklijke DSM NV	JP Morgan	51
500	Tosoh Corp	HSBC	(570)	7.817	Koninklijke KPN NV	Citibank	(849)
200	TOTO Ltd	Citibank	420	4.384	Koninklijke KPN NV	HSBC	(427)
600	TOTO Ltd	HSBC	383	4.819	Koninklijke KPN NV	JP Morgan	(553)
600	TOTO Ltd	JP Morgan	383	153	Koninklijke Philips NV	Citibank	(135)
400	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Citibank	(219)	245	Koninklijke Philips NV	HSBC	(147)
400	Toyo Suisan Kaisha Ltd	JP Morgan	(602)	230	Koninklijke Vopak NV	Citibank	(34)
400	Toyoda Gosei Co Ltd	HSBC	274	335	Koninklijke Vopak NV	JP Morgan	188
700	Toyoda Gosei Co Ltd	JP Morgan	479	1.011	NN Group NV	HSBC	(2.172)
(500)	Toyota Industries Corp	HSBC	(1.435)	1.221	NN Group NV	JP Morgan	(2.623)
(400)	Toyota Industries Corp	JP Morgan	(1.167)	(313)	Prosus NV	Citibank	(504)
(200)	Trend Micro Inc	Citibank	—	(270)	Prosus NV	HSBC	74
(100)	Tsuruha Holdings Inc	HSBC	(265)	(536)	Prosus NV	JP Morgan	903
(500)	Unicharm Corp	HSBC	(315)	225	Randstad NV	Citibank	593
(300)	Unicharm Corp	JP Morgan	(189)	1.884	Randstad NV	HSBC	2.989
(600)	USS Co Ltd	Citibank	(213)	865	Randstad NV	JP Morgan	1.372
(300)	USS Co Ltd	HSBC	238	764	Wolters Kluwer NV	Citibank	(690)
(300)	USS Co Ltd	JP Morgan	238	141	Wolters Kluwer NV	HSBC	69
(200)	Welcia Holdings Co Ltd	HSBC	237				10.908
(100)	West Japan Railway Co	HSBC	(8)	Nouvelle-Zélande			
(300)	West Japan Railway Co	JP Morgan	(25)	(2.436)	a2 Milk Co Ltd	JP Morgan	1.346
100	Yakult Honsha Co Ltd	JP Morgan	328	(6.987)	Auckland International Airport Ltd	JP Morgan	984
1.800	Yamada Holdings Co Ltd	Citibank	(131)	1.389	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Citibank	(4.251)
100	Yamaha Corp	Citibank	201	1.559	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	HSBC	(4.657)
600	Yamaha Corp	HSBC	1.532	149	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	JP Morgan	(445)
1.000	Yamaha Motor Co Ltd	Citibank	730	(2.323)	Ryman Healthcare Ltd	HSBC	1.925
300	Yamaha Motor Co Ltd	HSBC	876				
1.600	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	4.670				
300	Yamato Holdings Co Ltd	Citibank	(82)				
(400)	Yamazaki Baking Co Ltd	Citibank	51				
(1.200)	Yamazaki Baking Co Ltd	HSBC	1.281				

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(610)	AVEVA Group Plc	Citibank	(1.368)	444	National Grid Plc	Citibank	(70)
(1.323)	AVEVA Group Plc	JP Morgan	(4.192)	26	National Grid Plc	JP Morgan	3
1.107	Aviva Plc	Citibank	86	(3.657)	Natwest Group Plc	Citibank	(212)
2.902	Aviva Plc	HSBC	(82)	59	Next Plc	Citibank	60
9.733	Aviva Plc	JP Morgan	(276)	63	Next Plc	HSBC	(145)
(4.412)	Barclays Plc	Citibank	(214)	113	Next Plc	JP Morgan	(259)
(12.951)	Barclays Plc	HSBC	433	(515)	NMC Health Plc ^{***}	HSBC	—
(2.143)	Barclays Plc	JP Morgan	72	(2.420)	NMC Health Plc [*]	JP Morgan	—
1.741	Barratt Developments Plc	Citibank	109	(1.455)	Ocado Group Plc	Citibank	1.515
974	Barratt Developments Plc	HSBC	(72)	(1.044)	Ocado Group Plc	HSBC	1.220
3.454	Barratt Developments Plc	JP Morgan	(1.214)	(308)	Ocado Group Plc	JP Morgan	360
414	Berkeley Group Holdings Plc	Citibank	276	(413)	Pearson Plc	Citibank	164
230	Berkeley Group Holdings Plc	HSBC	(710)	386	Persimmon Plc	Citibank	492
6	Berkeley Group Holdings Plc	JP Morgan	(19)	194	Persimmon Plc	HSBC	(58)
(3.411)	BT Group Plc	Citibank	152	312	Persimmon Plc	JP Morgan	(93)
(885)	BT Group Plc	HSBC	(50)	(822)	Prudential Plc	Citibank	58
(155)	Bunzl Plc	HSBC	68	(261)	Prudential Plc	JP Morgan	312
776	Burberry Group Plc	JP Morgan	(594)	(138)	Reckitt Benckiser Group Plc	Citibank	231
1.600	Coca-Cola HBC AG	JP Morgan	23	(138)	Reckitt Benckiser Group Plc	HSBC	(35)
(589)	Compass Group Plc	HSBC	(67)	(337)	Reckitt Benckiser Group Plc	JP Morgan	(86)
26	Croda International Plc	Citibank	48	827	Reed Elsevier Plc	Citibank	(527)
38	Croda International Plc	JP Morgan	155	98	Rentokil Initial Plc	Citibank	(16)
156	DCC Plc	Citibank	(641)	2.032	Rentokil Initial Plc	HSBC	(52)
279	Diageo Plc	JP Morgan	494	(81)	Rio Tinto Plc	Citibank	(83)
(1.706)	Direct Line Insurance Group Plc	HSBC	(82)	(84)	Rio Tinto Plc	HSBC	(201)
721	Entain Plc	Citibank	358	(111)	Rio Tinto Plc	JP Morgan	(145)
(260)	Experian Plc	Citibank	103	536	RSA Insurance Group LTD	Citibank	2
(601)	Experian Plc	HSBC	162	858	Sage Group Plc	Citibank	(177)
(154)	Experian Plc	JP Morgan	41	736	Sage Group Plc	JP Morgan	261
816	Ferguson Plc	Citibank	(1.619)	643	Schroders Plc	Citibank	(73)
143	Ferguson Plc	HSBC	296	23	Schroders Plc	HSBC	(13)
(757)	GlaxoSmithKline Plc	HSBC	146	610	Schroders Plc	JP Morgan	(354)
(342)	GlaxoSmithKline Plc	JP Morgan	37	(101)	Severn Trent Plc	Citibank	66
(684)	Halma Plc	Citibank	(339)	(252)	Severn Trent Plc	HSBC	161
(1.904)	Halma Plc	HSBC	(1.160)	(703)	Severn Trent Plc	JP Morgan	448
(358)	Halma Plc	JP Morgan	(218)	(550)	Smith & Nephew Plc	Citibank	175
(2.324)	Hargreaves Lansdown Plc	HSBC	3.787	(282)	Smith & Nephew Plc	HSBC	18
(520)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Citibank	339	(437)	Smith & Nephew Plc	JP Morgan	28
(179)	Hikma Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	(238)	(579)	Smiths Group Plc	JP Morgan	336
(6.236)	HSBC Holdings Plc	Citibank	(773)	(192)	Spirax-Sarco Engineering Plc	HSBC	(2.449)
(1.009)	Informa Plc	JP Morgan	349	298	St James's Place Plc	HSBC	59
(84)	InterContinental Hotels Group Plc	Citibank	1	(823)	Standard Chartered Plc	Citibank	(21)
(75)	InterContinental Hotels Group Plc	HSBC	63	1.979	Standard Life Aberdeen Plc	HSBC	(42)
(660)	InterContinental Hotels Group Plc	JP Morgan	552	(2.344)	Taylor Wimpey Plc	Citibank	(48)
462	Intertek Group Plc	Citibank	(3.064)	(2.585)	Taylor Wimpey Plc	HSBC	353
391	Intertek Group Plc	HSBC	(2.798)	(874)	Unilever Plc	HSBC	644
7.675	J Sainsbury Plc	JP Morgan	1.033	(1.738)	Unilever Plc	JP Morgan	1.281
1.168	JD Sports Fashion Plc	Citibank	526	397	United Utilities Group Plc	HSBC	72
494	Johnson Matthey Plc	HSBC	(1.358)	5.127	Vodafone Group Plc	Citibank	(78)
7.409	Kingfisher Plc	HSBC	(1.050)	6.503	Vodafone Group Plc	HSBC	(1.301)
4.002	Kingfisher Plc	JP Morgan	(567)	14.865	Vodafone Group Plc	JP Morgan	(2.974)
2.925	Legal & General Group Plc	HSBC	(170)	(190)	Whitbread Plc	HSBC	16
6.070	Legal & General Group Plc	JP Morgan	(157)	(17.410)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Citibank	617
(139)	London Stock Exchange Group Plc	Citibank	(67)	(4.919)	Wm Morrison Supermarkets Plc	HSBC	432
(87)	London Stock Exchange Group Plc	HSBC	(614)	(22.642)	Wm Morrison Supermarkets Plc	JP Morgan	1.989
(496)	London Stock Exchange Group Plc	JP Morgan	(3.500)	5.394	WPP Plc	Citibank	(1.070)
3.634	M&G Plc	JP Morgan	1.179	4.098	WPP Plc	HSBC	(1.010)
628	Mondi Plc	Citibank	(120)	2.220	WPP Plc	JP Morgan	(547)
184	Mondi Plc	HSBC	(139)				(8.707)
1.729	Mondi Plc	JP Morgan	(1.311)	États-Unis			
				101	3M Co	Citibank	43
				58	3M Co	HSBC	4
				9	3M Co	JP Morgan	(39)
				100	A O Smith Corp	Citibank	189
				89	A O Smith Corp	HSBC	(105)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(132)	Abbott Laboratories	Citibank	84	(81)	American Water Works Co Inc	HSBC	79
(185)	Abbott Laboratories	HSBC	424	(90)	American Water Works Co Inc	JP Morgan	88
(236)	Abbott Laboratories	JP Morgan	540	62	Ameriprise Financial Inc	Citibank	318
(49)	AbbVie Inc	Citibank	133	46	Ameriprise Financial Inc	HSBC	23
(116)	AbbVie Inc	HSBC	219	86	Ameriprise Financial Inc	JP Morgan	(202)
(162)	AbbVie Inc	JP Morgan	489	180	AmerisourceBergen Corp	Citibank	(680)
18	ABIOMED Inc	Citibank	90	307	AmerisourceBergen Corp	HSBC	(2.613)
53	ABIOMED Inc	HSBC	99	(217)	AMETEK Inc	Citibank	(306)
69	ABIOMED Inc	JP Morgan	128	(179)	AMETEK Inc	HSBC	356
205	Accenture Plc 'A'	Citibank	(551)	(505)	AMETEK Inc	JP Morgan	670
26	Accenture Plc 'A'	HSBC	(220)	101	Amgen Inc	Citibank	(991)
354	Accenture Plc 'A'	JP Morgan	(2.991)	142	Amgen Inc	HSBC	(2.085)
(55)	Activision Blizzard Inc	Citibank	(41)	49	Amgen Inc	JP Morgan	(719)
(68)	Activision Blizzard Inc	JP Morgan	(277)	(152)	Amphenol Corp 'A'	Citibank	(29)
326	Adobe Inc	Citibank	2.200	(672)	Amphenol Corp 'A'	HSBC	(268)
55	Adobe Inc	HSBC	1.326	(268)	Amphenol Corp 'A'	JP Morgan	(172)
12	Adobe Inc	JP Morgan	302	(527)	Analog Devices Inc	Citibank	(1.101)
30	Advance Auto Parts Inc	Citibank	(28)	(351)	Analog Devices Inc	HSBC	(5.002)
(170)	Advanced Micro Devices Inc	HSBC	(695)	(84)	Analog Devices Inc	JP Morgan	(1.215)
(47)	Advanced Micro Devices Inc	JP Morgan	(192)	(47)	ANSYS Inc	Citibank	39
94	Aflac Inc	Citibank	29	(72)	ANSYS Inc	HSBC	(1.063)
403	Aflac Inc	HSBC	60	(18)	ANSYS Inc	JP Morgan	(266)
666	Aflac Inc	JP Morgan	100	(52)	Anthem Inc	HSBC	191
671	Agilent Technologies Inc	Citibank	3.214	(131)	Aon Plc 'A'	HSBC	665
134	Agilent Technologies Inc	HSBC	839	(143)	Aon Plc 'A'	JP Morgan	726
292	Agilent Technologies Inc	JP Morgan	1.828	(221)	Apollo Global Management Inc	Citibank	22
(97)	Air Products and Chemicals Inc	Citibank	(9)	(31)	Apollo Global Management Inc	HSBC	9
(265)	Air Products and Chemicals Inc	HSBC	(1.624)	(1.069)	Apollo Global Management Inc	JP Morgan	310
(33)	Air Products and Chemicals Inc	JP Morgan	(202)	472	Apple Inc	Citibank	(1.175)
(34)	Airbnb Inc	Citibank	(153)	139	Apple Inc	HSBC	(311)
(106)	Akamai Technologies Inc	Citibank	17	131	Apple Inc	JP Morgan	(293)
(100)	Akamai Technologies Inc	HSBC	(298)	564	Applied Materials Inc	Citibank	2.002
(64)	Akamai Technologies Inc	JP Morgan	(191)	250	Applied Materials Inc	HSBC	3.453
(197)	Albermarle Corp	HSBC	(1.497)	40	Applied Materials Inc	JP Morgan	588
(42)	Alexion Pharmaceuticals Inc	HSBC	(199)	(58)	Aptiv Plc	Citibank	(520)
51	Align Technology Inc	HSBC	1.818	(47)	Aptiv Plc	HSBC	(489)
(61)	Alleghany Corp	HSBC	414	(281)	Aptiv Plc	JP Morgan	(1.866)
(9)	Alleghany Corp	JP Morgan	61	(402)	Aramark	Citibank	36
80	Allegion Plc	Citibank	140	(219)	Aramark	JP Morgan	59
256	Allegion Plc	HSBC	(530)	(253)	Arch Capital Group Ltd	HSBC	8
174	Allstate Corp	Citibank	(110)	651	Archer-Daniels-Midland Co	Citibank	(59)
77	Allstate Corp	JP Morgan	163	1.393	Archer-Daniels-Midland Co	HSBC	(1.532)
649	Ally Financial Inc	Citibank	779	816	Archer-Daniels-Midland Co	JP Morgan	(898)
202	Ally Financial Inc	HSBC	210	52	Arista Networks Inc	HSBC	685
228	Ally Financial Inc	JP Morgan	233	69	Arrow Electronics Inc	Citibank	(229)
(152)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Citibank	(564)	88	Arrow Electronics Inc	HSBC	265
23	Alphabet Inc 'A'	Citibank	(96)	134	Arrow Electronics Inc	JP Morgan	403
19	Alphabet Inc 'A'	HSBC	1.133	(173)	Arthur J Gallagher & Co	HSBC	552
5	Alphabet Inc 'A'	JP Morgan	326	80	Assurant Inc	HSBC	95
1	Alphabet Inc 'C'	HSBC	70	(153)	AT&T Inc	HSBC	436
3	Alphabet Inc 'C'	JP Morgan	210	(211)	AT&T Inc	JP Morgan	554
(179)	Altice USA Inc 'A'	Citibank	206	118	Athene Holding Ltd 'A'	HSBC	40
3	Amazon.com Inc	Citibank	(66)	(204)	Atmos Energy Corp	Citibank	(136)
3	Amazon.com Inc	HSBC	(42)	(247)	Atmos Energy Corp	HSBC	744
35	AMERCO	Citibank	(108)	(189)	Atmos Energy Corp	JP Morgan	324
88	AMERCO	JP Morgan	(5.012)	72	Autodesk Inc	Citibank	(117)
144	American Express Co	Citibank	215	286	Autodesk Inc	HSBC	2.806
63	American Express Co	HSBC	91	86	Autodesk Inc	JP Morgan	844
(237)	American Financial Group Inc	Citibank	(313)	18	Autoliv Inc	Citibank	41
(187)	American Financial Group Inc	HSBC	(978)	66	Autoliv Inc	HSBC	265
(287)	American International Group Inc	Citibank	(276)	58	Automatic Data Processing Inc	Citibank	(59)
(210)	American Water Works Co Inc	Citibank	(38)	211	Automatic Data Processing Inc	HSBC	342
				(5)	AutoZone Inc	JP Morgan	565

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(196)	Avalara Inc	Citibank	(533)	66	Cadence Design Systems Inc	Citibank	44
(341)	Avalara Inc	HSBC	(2.999)				
(87)	Avalara Inc	JP Morgan	(819)	1.280	Cadence Design Systems Inc	JP Morgan	3.648
(338)	Avantor Inc	Citibank	(152)	(110)	Campbell Soup Co	HSBC	163
(278)	Avantor Inc	HSBC	(464)	(875)	Cardinal Health Inc	Citibank	(490)
385	Avery Dennison Corp	HSBC	(309)	730	Cardinal Health Inc	JP Morgan	(1.650)
126	Avery Dennison Corp	JP Morgan	(132)	(548)	Carlyle Group Inc	HSBC	477
637	Axalta Coating Systems Ltd	Citibank	541	(122)	Carlyle Group Inc	JP Morgan	106
466	Axalta Coating Systems Ltd	HSBC	(578)	(59)	CarMax Inc	Citibank	(77)
1.653	Axalta Coating Systems Ltd	JP Morgan	(2.050)	(258)	CarMax Inc	HSBC	3.282
(1.809)	Baker Hughes Co	HSBC	214	(582)	Carnival Corp	Citibank	(966)
(618)	Baker Hughes Co	JP Morgan	(28)	(1.403)	Carnival Corp	HSBC	(4.616)
(107)	Ball Corp	Citibank	530	(781)	Carnival Corp	JP Morgan	(2.664)
(150)	Ball Corp	HSBC	1.157	144	Carrier Global Corp	HSBC	178
(61)	Ball Corp	JP Morgan	470	(578)	Catalent Inc	Citibank	(1.312)
(374)	Bank of America Corp	Citibank	90	(178)	Catalent Inc	HSBC	(5)
647	Bank of New York Mellon Corp	Citibank	220	(137)	Catalent Inc	JP Morgan	(4)
(420)	Baxter International Inc	Citibank	273	(72)	Caterpillar Inc	JP Morgan	110
(312)	Baxter International Inc	HSBC	1.363	(60)	Cboe Global Markets Inc	HSBC	(40)
(83)	Baxter International Inc	JP Morgan	363	(64)	Cboe Global Markets Inc	JP Morgan	(43)
(91)	Becton Dickinson and Co	Citibank	167	320	CBRE Group Inc 'A'	Citibank	(314)
(80)	Becton Dickinson and Co	HSBC	278	409	CBRE Group Inc 'A'	HSBC	487
(94)	Becton Dickinson and Co	JP Morgan	342	237	CBRE Group Inc 'A'	JP Morgan	282
268	Best Buy Co Inc	HSBC	(2.559)	(2)	CDW Corp	Citibank	6
454	Best Buy Co Inc	JP Morgan	(4.336)	(45)	CDW Corp	HSBC	270
133	Biogen Inc	Citibank	(1.514)	(470)	Centene Corp	JP Morgan	(1.899)
5	Biogen Inc	HSBC	(41)	(999)	CenterPoint Energy Inc	Citibank	(263)
20	Biogen Inc	JP Morgan	(163)	(1.432)	CenterPoint Energy Inc	HSBC	(1.038)
(312)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Citibank	78	(515)	CenterPoint Energy Inc	JP Morgan	(412)
(390)	BioMarin Pharmaceutical Inc	HSBC	(355)	1.442	Cerner Corp	Citibank	1.753
(87)	BioMarin Pharmaceutical Inc	JP Morgan	(79)	623	Cerner Corp	HSBC	601
(59)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Citibank	(549)	(398)	CF Industries Holdings Inc	Citibank	(56)
(36)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	HSBC	46	255	CH Robinson Worldwide Inc	Citibank	(179)
(31)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	JP Morgan	40	113	CH Robinson Worldwide Inc	JP Morgan	(532)
(165)	Black Knight Inc	Citibank	(36)	(306)	Charles Schwab Corp	HSBC	(842)
(151)	Black Knight Inc	HSBC	246	(107)	Charles Schwab Corp	JP Morgan	(294)
(1.226)	Black Knight Inc	JP Morgan	1.998	(146)	Charter Communications Inc 'A'	Citibank	1.256
(191)	Blackstone Group Inc	Citibank	(277)	53	Check Point Software Technologies Ltd	Citibank	(109)
(382)	Blackstone Group Inc	HSBC	(1.551)	22	Check Point Software Technologies Ltd	HSBC	(63)
(5)	Booking Holdings Inc	Citibank	(65)	43	Check Point Software Technologies Ltd	JP Morgan	(123)
(2)	Booking Holdings Inc	HSBC	(30)	(89)	Cheniere Energy Inc	Citibank	(19)
(2)	Booking Holdings Inc	JP Morgan	(265)	(449)	Cheniere Energy Inc	HSBC	(1.446)
(663)	BorgWarner Inc	Citibank	(756)	(8)	Cheniere Energy Inc	JP Morgan	(26)
(373)	BorgWarner Inc	JP Morgan	612	18	Chipotle Mexican Grill Inc	Citibank	533
(1.968)	Boston Scientific Corp	Citibank	492	(569)	Church & Dwight Co Inc	Citibank	763
(385)	Bristol-Myers Squibb Co	HSBC	(373)	(594)	Church & Dwight Co Inc	HSBC	2.174
(77)	Bristol-Myers Squibb Co	JP Morgan	(17)	(177)	Church & Dwight Co Inc	JP Morgan	323
(315)	Broadcom Inc	Citibank	(4.139)	59	Cigna Corp	Citibank	(158)
(39)	Broadcom Inc	HSBC	(1.351)	96	Cigna Corp	HSBC	(774)
(15)	Broadcom Inc	JP Morgan	(534)	31	Cigna Corp	JP Morgan	(250)
(153)	Broadridge Financial Solutions Inc	HSBC	941	(79)	Cincinnati Financial Corp	Citibank	(62)
(20)	Broadridge Financial Solutions Inc	JP Morgan	123	(272)	Cincinnati Financial Corp	HSBC	(275)
(155)	Brown & Brown Inc	Citibank	(56)	58	Cintas Corp	Citibank	(58)
(281)	Brown & Brown Inc	HSBC	239	11	Cintas Corp	HSBC	(79)
(441)	Brown & Brown Inc	JP Morgan	375	377	Citigroup Inc	HSBC	1.350
(355)	Brown-Forman Corp 'B'	HSBC	(905)	299	Citigroup Inc	JP Morgan	1.070
365	Bunge Ltd	Citibank	7	930	Citizens Financial Group Inc	HSBC	512
306	Bunge Ltd	HSBC	(1.138)	3	Citrix Systems Inc	HSBC	(13)
328	Bunge Ltd	JP Morgan	(1.220)	207	Citrix Systems Inc	JP Morgan	(896)
(89)	Burlington Stores Inc	Citibank	(246)	(97)	Clorox Co	JP Morgan	1.092
(54)	Burlington Stores Inc	HSBC	285	(26)	CME Group Inc	Citibank	(38)
(16)	Cable One Inc	HSBC	(1.169)	(214)	CME Group Inc	HSBC	(2.292)
(3)	Cable One Inc	JP Morgan	(219)	(53)	CME Group Inc	JP Morgan	(568)
				589	Coca-Cola Co	Citibank	289

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
188	Coca-Cola Co	HSBC	71	(219)	Discovery Inc 'C'	HSBC	485
355	Coca-Cola Co	JP Morgan	169	(150)	DISH Network Corp 'A'	Citibank	135
435	Coca-Cola Europacific Partners Plc	JP Morgan	1.779	(166)	DISH Network Corp 'A'	HSBC	488
207	Cognex Corp	Citibank	422	(490)	DISH Network Corp 'A'	JP Morgan	1.441
65	Cognex Corp	JP Morgan	197	(195)	DocuSign Inc	JP Morgan	(2.266)
201	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	HSBC	(492)	(47)	Dollar General Corp	HSBC	373
669	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	JP Morgan	(1.639)	(86)	Dollar General Corp	JP Morgan	1.367
639	Colgate-Palmolive Co	Citibank	(396)	85	Dollar Tree Inc	JP Morgan	(1.576)
(172)	Comcast Corp 'A'	Citibank	(289)	18	Domino's Pizza Inc	Citibank	107
(67)	Comcast Corp 'A'	HSBC	11	29	Domino's Pizza Inc	HSBC	(122)
(91)	Comcast Corp 'A'	JP Morgan	15	51	Domino's Pizza Inc	JP Morgan	(214)
141	Conagra Brands Inc	JP Morgan	(21)	160	Dover Corp	Citibank	162
(125)	Consolidated Edison Inc	JP Morgan	326	48	Dover Corp	HSBC	(142)
21	Constellation Brands Inc 'A'	Citibank	23	149	Dover Corp	JP Morgan	(440)
(133)	Cooper Cos Inc	Citibank	140	198	Dow Inc	JP Morgan	61
243	Copart Inc	Citibank	182	160	DR Horton Inc	Citibank	670
52	Copart Inc	HSBC	307	243	Dropbox Inc 'A'	Citibank	49
189	Copart Inc	JP Morgan	544	847	Dropbox Inc 'A'	HSBC	1.626
436	Corning Inc	HSBC	(702)	255	Dropbox Inc 'A'	JP Morgan	112
160	Corning Inc	JP Morgan	(258)	234	DuPont de Nemours Inc	Citibank	(157)
392	Corteva Inc	Citibank	137	137	DuPont de Nemours Inc	HSBC	399
245	Corteva Inc	HSBC	(365)	142	DuPont de Nemours Inc	JP Morgan	413
392	Corteva Inc	JP Morgan	(584)	(447)	Dynatrace Inc	Citibank	(469)
(34)	CoStar Group Inc	Citibank	(329)	(118)	Dynatrace Inc	HSBC	(752)
(87)	CoStar Group Inc	HSBC	(1.240)	(40)	Dynatrace Inc	JP Morgan	(255)
(23)	CoStar Group Inc	JP Morgan	(486)	(111)	Eaton Corp Plc	HSBC	(281)
(4)	Costco Wholesale Corp	Citibank	21	524	eBay Inc	Citibank	(47)
(25)	Costco Wholesale Corp	HSBC	80	226	eBay Inc	HSBC	(127)
(39)	Costco Wholesale Corp	JP Morgan	125	579	eBay Inc	JP Morgan	(324)
(40)	Coupa Software Inc	Citibank	36	167	Ecolab Inc	Citibank	(37)
(146)	Coupa Software Inc	HSBC	(442)	134	Ecolab Inc	HSBC	(1.324)
(161)	Coupa Software Inc	JP Morgan	(492)	48	Ecolab Inc	JP Morgan	(474)
(30)	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	Citibank	(234)	(1.007)	Edison International	Citibank	2.517
(96)	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	HSBC	(3.319)	1.328	Edwards Lifesciences Corp	Citibank	598
(62)	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	JP Morgan	(2.143)	29	Edwards Lifesciences Corp	HSBC	160
(403)	Crown Holdings Inc	Citibank	3.018	78	Edwards Lifesciences Corp	JP Morgan	429
(272)	Crown Holdings Inc	HSBC	2.549	(1.843)	Elanco Animal Health Inc	Citibank	(369)
229	CSX Corp	Citibank	176	(190)	Elanco Animal Health Inc	HSBC	(711)
49	CSX Corp	HSBC	(149)	(232)	Elanco Animal Health Inc	JP Morgan	(868)
105	CSX Corp	JP Morgan	(319)	676	Electronic Arts Inc	Citibank	568
267	Cummins Inc	Citibank	467	453	Electronic Arts Inc	HSBC	1.033
263	CVS Health Corp	Citibank	(860)	132	Electronic Arts Inc	JP Morgan	234
179	CVS Health Corp	HSBC	106	(80)	Eli Lilly & Co	Citibank	102
67	CVS Health Corp	JP Morgan	40	(25)	Eli Lilly & Co	JP Morgan	6
(49)	CyberArk Software Ltd	Citibank	(12)	333	Emerson Electric Co	Citibank	559
(139)	CyberArk Software Ltd	HSBC	(944)	99	Emerson Electric Co	HSBC	31
(187)	CyberArk Software Ltd	JP Morgan	(1.270)	116	Emerson Electric Co	JP Morgan	36
(561)	Danaher Corp	Citibank	(1.251)	27	EPAM Systems Inc	HSBC	475
(248)	Danaher Corp	HSBC	717	(98)	Equifax Inc	HSBC	405
(94)	Danaher Corp	JP Morgan	272	(21)	Equifax Inc	JP Morgan	87
93	Darden Restaurants Inc	Citibank	174	640	Equitable Holdings Inc	JP Morgan	(1.651)
198	Darden Restaurants Inc	HSBC	503	(141)	Erie Indemnity Co 'A'	Citibank	(622)
(444)	Datadog Inc 'A'	Citibank	(573)	(158)	Erie Indemnity Co 'A'	JP Morgan	1.185
(158)	Datadog Inc 'A'	JP Morgan	(2.242)	(992)	Essential Utilities Inc	Citibank	(298)
103	DaVita Inc	Citibank	(182)	(915)	Essential Utilities Inc	HSBC	(952)
88	DaVita Inc	HSBC	(696)	(1.458)	Essential Utilities Inc	JP Morgan	(1.516)
126	DaVita Inc	JP Morgan	(997)	(55)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Citibank	(169)
90	Deere & Co	Citibank	157	(44)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	HSBC	(358)
106	Dell Technologies Inc 'C'	JP Morgan	(110)	(58)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	JP Morgan	(316)
141	Delta Air Lines Inc	Citibank	213	(137)	Everest Re Group Ltd	HSBC	1.760
105	Delta Air Lines Inc	HSBC	236	(29)	Everest Re Group Ltd	JP Morgan	373
250	Delta Air Lines Inc	JP Morgan	563	86	Eversource Energy	HSBC	(366)
405	DENTSPLY SIRONA Inc	Citibank	(296)	(213)	Exact Sciences Corp	Citibank	(224)
20	Dexcom Inc	Citibank	280	(145)	Exact Sciences Corp	HSBC	(1.695)
(76)	Discover Financial Services	HSBC	112	(81)	Exact Sciences Corp	JP Morgan	(947)
(160)	Discovery Inc 'A'	Citibank	(189)	1.125	Exelon Corp	JP Morgan	675
				(44)	Expedia Group Inc	Citibank	(257)
				(226)	Expedia Group Inc	JP Morgan	(872)

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
527	Expeditors International of Washington Inc	Citibank	875	(93)	Hasbro Inc	Citibank	(172)
744	Expeditors International of Washington Inc	HSBC	4.196	(108)	Hasbro Inc	HSBC	369
569	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	3.209	318	HCA Healthcare Inc	Citibank	2.757
(36)	F5 Networks Inc	Citibank	3	(417)	HEICO Corp	Citibank	(2.231)
5	Facebook Inc 'A'	Citibank	21	(2)	HEICO Corp	JP Morgan	(3)
113	Facebook Inc 'A'	HSBC	2.572	93	Henry Schein Inc	HSBC	(644)
47	Facebook Inc 'A'	JP Morgan	711	38	Henry Schein Inc	JP Morgan	(263)
34	FactSet Research Systems Inc	Citibank	184	68	Hershey Co	Citibank	(73)
95	FactSet Research Systems Inc	JP Morgan	(71)	41	Hershey Co	HSBC	112
56	Fair Isaac Corp	Citibank	323	37	Hershey Co	JP Morgan	101
128	Fair Isaac Corp	HSBC	1.684	1.448	Hewlett Packard Enterprise Co	Citibank	(579)
10	Fair Isaac Corp ^{II}	JP Morgan	—	335	Hewlett Packard Enterprise Co	HSBC	(151)
293	Fastenal Co	Citibank	56	843	Hewlett Packard Enterprise Co	JP Morgan	(379)
385	Fastenal Co	HSBC	(273)	(85)	Hilton Worldwide Holdings Inc	HSBC	(314)
13	Fastenal Co	JP Morgan	(9)	228	Hologic Inc	Citibank	73
113	FedEx Corp	Citibank	336	364	Hologic Inc	HSBC	(739)
24	FedEx Corp	JP Morgan	133	125	Hologic Inc	JP Morgan	(254)
(117)	Fidelity National Information Services Inc	Citibank	241	431	Home Depot Inc	Citibank	1.729
(572)	Fidelity National Information Services Inc	HSBC	275	93	Home Depot Inc	HSBC	(471)
(1)	Fidelity National Information Services Inc	JP Morgan	—	3	Home Depot Inc	JP Morgan	(67)
(137)	Fifth Third Bancorp	Citibank	(37)	(1.230)	Hormel Foods Corp	Citibank	886
(363)	Fifth Third Bancorp	HSBC	36	(203)	Howmet Aerospace Inc	Citibank	(292)
(369)	Fifth Third Bancorp	JP Morgan	37	(156)	Howmet Aerospace Inc	HSBC	(452)
(64)	First Republic Bank	HSBC	(179)	(751)	Howmet Aerospace Inc	JP Morgan	(2.178)
(1.014)	Fiserv Inc	Citibank	632	1.707	HP Inc	Citibank	(5.258)
(52)	Fiserv Inc	HSBC	49	410	HP Inc	HSBC	(2.468)
(46)	Fiserv Inc	JP Morgan	44	831	HP Inc	JP Morgan	(5.003)
(80)	FleetCor Technologies Inc	HSBC	700	(11)	Humana Inc	JP Morgan	200
(40)	FleetCor Technologies Inc	JP Morgan	350	844	Huntington Bancshares Inc	Citibank	186
232	FMC Corp	HSBC	(387)	(245)	IAC Via InterActive Corp	Citibank	22.824
(2.517)	Ford Motor Co	HSBC	(7.098)	(64)	IAC Via InterActive Corp	HSBC	4.819
286	Fortinet Inc	Citibank	1.564	(103)	IAC Via InterActive Corp	JP Morgan	7.755
310	Fortune Brands Home & Security Inc	HSBC	(2.728)	(68)	IDEX Corp	Citibank	(70)
174	Fortune Brands Home & Security Inc	JP Morgan	(1.531)	91	IDEXX Laboratories Inc	Citibank	764
(323)	Fox Corp 'A'	JP Morgan	478	78	IDEXX Laboratories Inc	HSBC	2.562
(140)	Franklin Resources Inc	Citibank	(101)	37	IDEXX Laboratories Inc	JP Morgan	1.166
(350)	Franklin Resources Inc	JP Morgan	165	77	IHS Markit Ltd	Citibank	14
(238)	Garmin Ltd	HSBC	33	122	Illinois Tool Works Inc	Citibank	(38)
77	Gartner Inc	Citibank	(67)	358	Illinois Tool Works Inc	HSBC	(2.613)
27	Gartner Inc	HSBC	18	(31)	llumina Inc	Citibank	(175)
80	Gartner Inc	JP Morgan	54	196	Incyte Corp	Citibank	171
(201)	General Mills Inc	HSBC	195	(115)	Ingersoll Rand Inc	Citibank	(6)
(626)	General Mills Inc	JP Morgan	607	(1.537)	Ingersoll Rand Inc	JP Morgan	738
(348)	General Motors Co	Citibank	(943)	(23)	Insulet Corp	Citibank	(297)
(106)	General Motors Co	HSBC	(201)	552	Intel Corp	Citibank	88
173	Genuine Parts Co	Citibank	(48)	104	Intel Corp	HSBC	120
386	Genuine Parts Co	HSBC	(957)	81	Intel Corp	JP Morgan	93
165	Genuine Parts Co	JP Morgan	(409)	(149)	Intercontinental Exchange Inc	Citibank	13
1.075	Gilead Sciences Inc	Citibank	(1.340)	(179)	Intercontinental Exchange Inc	HSBC	251
268	Gilead Sciences Inc	HSBC	(367)	57	International Business Machines Corp	HSBC	67
(311)	Global Payments Inc	HSBC	498	(228)	International Flavors & Fragrances Inc	HSBC	237
(50)	Globe Life Inc	JP Morgan	22	(291)	International Flavors & Fragrances Inc	JP Morgan	303
350	GoDaddy Inc 'A'	Citibank	336	438	International Paper Co	Citibank	(569)
261	GoDaddy Inc 'A'	HSBC	18	304	International Paper Co	HSBC	310
(126)	Guidewire Software Inc	Citibank	(74)	604	International Paper Co	JP Morgan	616
(1.791)	Halliburton Co	Citibank	(99)	668	Interpublic Group of Cos Inc	Citibank	240
(316)	Halliburton Co	HSBC	(45)	1.282	Interpublic Group of Cos Inc	HSBC	1.154
(667)	Halliburton Co	JP Morgan	34	646	Interpublic Group of Cos Inc	JP Morgan	581
(105)	Hartford Financial Services Group Inc	Citibank	(12)	69	Intuit Inc	Citibank	(91)
				166	Intuit Inc	HSBC	7.727
				(11)	Intuitive Surgical Inc	HSBC	(81)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(39)	Intuitive Surgical Inc	JP Morgan	(288)	(198)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	JP Morgan	(333)
628	Invesco Ltd	JP Morgan	195	(112)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Citibank	(142)
(217)	Ionis Pharmaceuticals Inc	HSBC	(219)	(131)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	HSBC	(177)
(135)	Ionis Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	(136)	97	Lincoln National Corp	HSBC	42
(168)	IPG Photonics Corp	HSBC	(3.656)	(186)	Linde Plc	Citibank	125
(52)	IPG Photonics Corp	JP Morgan	(412)	(41)	Linde Plc	HSBC	17
(136)	IQVIA Holdings Inc	HSBC	(1.179)	(422)	Live Nation Entertainment Inc	Citibank	679
105	J M Smucker Co	JP Morgan	(373)	(9)	Live Nation Entertainment Inc	JP Morgan	(63)
(43)	Jack Henry & Associates Inc	JP Morgan	203	378	LKQ Corp	Citibank	268
106	Jazz Pharmaceuticals Plc	Citibank	(88)	348	LKQ Corp	HSBC	348
33	Jazz Pharmaceuticals Plc	HSBC	67	249	LKQ Corp	JP Morgan	249
164	Jazz Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	333	263	Loews Corp	HSBC	(13)
(161)	Johnson & Johnson	Citibank	152	116	Low's Cos Inc	Citibank	484
(164)	Johnson & Johnson	HSBC	185	31	Low's Cos Inc	HSBC	(511)
(268)	Johnson & Johnson	JP Morgan	273	479	Low's Cos Inc	JP Morgan	(7.440)
666	Johnson Controls International Plc	Citibank	1.199	19	Lululemon Athletica Inc	Citibank	94
620	Johnson Controls International Plc	HSBC	440	12	Lululemon Athletica Inc	JP Morgan	(14)
752	Johnson Controls International Plc	JP Morgan	691	(2.428)	Lumen Technologies Inc	JP Morgan	1.093
(188)	JPMorgan Chase & Co	HSBC	(568)	(196)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Citibank	(200)
(1.057)	Juniper Networks Inc	JP Morgan	708	(135)	M&T Bank Corp	HSBC	294
333	Kellogg Co	Citibank	(203)	(70)	Marathon Petroleum Corp	Citibank	(75)
173	Kellogg Co	HSBC	(471)	(98)	Marathon Petroleum Corp	HSBC	(48)
331	Kellogg Co	JP Morgan	(900)	(200)	Marathon Petroleum Corp	JP Morgan	(398)
(1.998)	Keurig Dr Pepper Inc	Citibank	(200)	(5)	Markel Corp	HSBC	(48)
(521)	Keurig Dr Pepper Inc	HSBC	(302)	(10)	MarketAxess Holdings Inc	Citibank	(101)
3.575	KeyCorp	Citibank	—	(47)	MarketAxess Holdings Inc	HSBC	(1.257)
172	Keysight Technologies Inc	Citibank	272	(99)	Marriott International Inc 'A'	Citibank	(167)
280	Keysight Technologies Inc	HSBC	694	(260)	Marriott International Inc 'A'	HSBC	(759)
(96)	Kimberly-Clark Corp	Citibank	143	(111)	Marsh & McLennan Cos Inc	JP Morgan	(62)
(176)	Kimberly-Clark Corp	HSBC	1.104	(42)	Martin Marietta Materials Inc	Citibank	118
(84)	Kimberly-Clark Corp	JP Morgan	209	(689)	Marvell Technology Inc	Citibank	(469)
(4)	KLA Corp	Citibank	3	(126)	Marvell Technology Inc	JP Morgan	(501)
(14)	KLA Corp	JP Morgan	(238)	488	Masco Corp	Citibank	(166)
592	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Citibank	(426)	318	Masco Corp	HSBC	(1.605)
202	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	JP Morgan	(477)	877	Masco Corp	JP Morgan	(5.430)
(376)	Kraft Heinz Co	JP Morgan	11	52	Masimo Corp	JP Morgan	(67)
153	Kroger Co	Citibank	58	(139)	Match Group Inc	HSBC	(218)
540	Kroger Co	HSBC	(1.015)	(55)	Match Group Inc	JP Morgan	(86)
81	Laboratory Corp of America Holdings	HSBC	(143)	506	Maxim Integrated Products Inc	Citibank	663
63	Laboratory Corp of America Holdings	JP Morgan	(164)	267	Maxim Integrated Products Inc	HSBC	2.499
22	Lam Research Corp	Citibank	335	657	Maxim Integrated Products Inc	JP Morgan	6.150
23	Lam Research Corp	HSBC	1.458	(54)	McCormick & Co Inc	Citibank	83
76	Lam Research Corp	JP Morgan	4.818	79	McDonald's Corp	Citibank	156
(64)	Lamb Weston Holdings Inc	Citibank	(132)	53	McKesson Corp	Citibank	(384)
(69)	Lamb Weston Holdings Inc	HSBC	(248)	134	McKesson Corp	HSBC	(1.305)
(60)	Lamb Weston Holdings Inc	JP Morgan	(215)	171	McKesson Corp	JP Morgan	(1.666)
(1.618)	Las Vegas Sands Corp	Citibank	(16)	(691)	Medtronic Plc	Citibank	1.043
(203)	Las Vegas Sands Corp	HSBC	(124)	(650)	Medtronic Plc	HSBC	167
(197)	Lear Corp	HSBC	(538)	(299)	Medtronic Plc	JP Morgan	93
(26)	Lear Corp	JP Morgan	(71)	(852)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	HSBC	1.116
121	Lennar Corp 'A'	HSBC	(1.083)	(8)	MercadoLibre Inc	Citibank	69
45	Lennox International Inc	Citibank	323	(6)	MercadoLibre Inc	HSBC	155
65	Lennox International Inc	HSBC	(233)	(4)	MercadoLibre Inc	JP Morgan	103
21	Lennox International Inc	JP Morgan	(75)	(135)	Merck & Co Inc	HSBC	520
(410)	Liberty Broadband Corp	Citibank	279	620	MetLife Inc	Citibank	(6)
(507)	Liberty Broadband Corp	HSBC	(254)	1.433	MetLife Inc	HSBC	(1.591)
(193)	Liberty Broadband Corp	JP Morgan	(97)	59	Mettler-Toledo International Inc	Citibank	1.198
(1.290)	Liberty Global Plc 'A'	HSBC	581				
(139)	Liberty Global Plc 'A'	JP Morgan	63				
(919)	Liberty Global Plc 'C'	Citibank	(28)				
(1.284)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Citibank	437				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
38	Mettler-Toledo International Inc	HSBC	2.003	(166)	Okta Inc	JP Morgan	1.379
4	Mettler-Toledo International Inc	JP Morgan	132	177	Old Dominion Freight Line Inc	HSBC	(504)
137	MGM Resorts International	HSBC	467	223	Old Dominion Freight Line Inc	JP Morgan	(1.044)
(683)	Microchip Technology Inc	Citibank	(1.947)	409	Omnicom Group Inc	Citibank	(393)
(34)	Microchip Technology Inc	HSBC	(214)	676	Omnicom Group Inc	HSBC	(1.731)
(123)	Microchip Technology Inc	JP Morgan	(1.606)	112	Omnicom Group Inc	JP Morgan	(287)
(133)	Micron Technology Inc	Citibank	(165)	(433)	ON Semiconductor Corp	HSBC	(1.308)
(65)	Micron Technology Inc	JP Morgan	(214)	78	ONEOK Inc	Citibank	(109)
245	Microsoft Corp	Citibank	(270)	(646)	Oracle Corp	Citibank	413
495	Microsoft Corp	HSBC	1.238	(157)	Oracle Corp	HSBC	221
24	Mohawk Industries Inc	Citibank	58	(288)	Oracle Corp	JP Morgan	406
73	Mohawk Industries Inc	HSBC	(1.153)	50	O'Reilly Automotive Inc	Citibank	63
72	Mohawk Industries Inc	JP Morgan	(1.138)	(115)	Otis Worldwide Corp	Citibank	(23)
72	Molina Healthcare Inc	Citibank	(190)	755	Owens Corning	Citibank	1.125
22	Molina Healthcare Inc	HSBC	(382)	56	Owens Corning	HSBC	(88)
20	Molina Healthcare Inc	JP Morgan	(348)	49	Owens Corning	JP Morgan	(77)
39	Molson Coors Beverage Co 'B'	Citibank	22	58	PACCAR Inc	Citibank	(16)
661	Molson Coors Beverage Co 'B'	JP Morgan	(820)	(151)	Packaging Corp of America	JP Morgan	892
(17)	MongoDB Inc	Citibank	(88)	(112)	Palo Alto Networks Inc	Citibank	142
(102)	MongoDB Inc	HSBC	(3.830)	(27)	Palo Alto Networks Inc	HSBC	(592)
(44)	MongoDB Inc	JP Morgan	(1.652)	(56)	Palo Alto Networks Inc	JP Morgan	(1.227)
(415)	Monster Beverage Corp	JP Morgan	(1.660)	44	Parker-Hannifin Corp	HSBC	(359)
53	Moody's Corp	Citibank	184	(54)	Paychex Inc	Citibank	41
211	Morgan Stanley	Citibank	266	(40)	Paycom Software Inc	HSBC	(496)
610	Morgan Stanley	HSBC	2.733	(77)	PayPal Holdings Inc	Citibank	(219)
65	Morgan Stanley	JP Morgan	291	(83)	PayPal Holdings Inc	JP Morgan	(1.360)
192	Mosaic Co	Citibank	84	(137)	Peloton Interactive Inc 'A'	Citibank	(1.254)
177	Mosaic Co	HSBC	112	(72)	Peloton Interactive Inc 'A'	HSBC	(1.643)
379	Mosaic Co	JP Morgan	239	(186)	Peloton Interactive Inc 'A'	JP Morgan	(4.245)
27	Motorola Solutions Inc	Citibank	67	315	Pentair Plc	Citibank	287
190	Motorola Solutions Inc	JP Morgan	931	247	Pentair Plc	HSBC	(20)
(69)	MSCI Inc	Citibank	(364)	612	PepsiCo Inc	Citibank	55
(64)	MSCI Inc	HSBC	561	195	PepsiCo Inc	HSBC	238
(15)	MSCI Inc	JP Morgan	(56)	203	PepsiCo Inc	JP Morgan	248
(125)	Nasdaq Inc	HSBC	(429)	(117)	PerkinElmer Inc	Citibank	(54)
231	NetApp Inc	Citibank	(374)	(205)	PerkinElmer Inc	HSBC	(1.039)
179	NetApp Inc	HSBC	(267)	(110)	PerkinElmer Inc	JP Morgan	(558)
174	NetApp Inc	JP Morgan	(259)	(619)	Pfizer Inc	Citibank	669
(70)	Netflix Inc	Citibank	6	(185)	Pfizer Inc	HSBC	180
(25)	Netflix Inc	HSBC	(157)	(1.120)	Pfizer Inc	JP Morgan	1.266
(35)	Netflix Inc	JP Morgan	(564)	(225)	Phillips 66	JP Morgan	308
(62)	Neurocrine Biosciences Inc	Citibank	(25)	257	Pinterest Inc 'A'	HSBC	1.784
(165)	Neurocrine Biosciences Inc	HSBC	(822)	(1.424)	Plug Power Inc	Citibank	(4.882)
(53)	Neurocrine Biosciences Inc	JP Morgan	(264)	(212)	Plug Power Inc	HSBC	(2.254)
206	Newell Brands Inc	Citibank	91	82	PNC Financial Services Group Inc	Citibank	57
(166)	Newmont Corp	HSBC	(852)	(108)	PPD Inc	Citibank	—
(366)	News Corp 'A'	HSBC	165	(111)	PPG Industries Inc	Citibank	(17)
(132)	NextEra Energy Inc	Citibank	107	(234)	Principal Financial Group Inc	Citibank	87
(68)	NextEra Energy Inc	HSBC	4	(35)	Principal Financial Group Inc	HSBC	50
(384)	NextEra Energy Inc	JP Morgan	479	(202)	Procter & Gamble Co	JP Morgan	570
208	NIKE Inc 'B'	Citibank	499	(187)	Progressive Corp	Citibank	(303)
48	Nordson Corp	Citibank	923	(451)	Progressive Corp	JP Morgan	3.004
110	Nordson Corp	HSBC	1.431	79	Prudential Financial Inc	Citibank	51
42	Nordson Corp	JP Morgan	546	597	Prudential Financial Inc	JP Morgan	149
253	Northern Trust Corp	Citibank	134	43	PTC Inc	Citibank	57
203	Northern Trust Corp	HSBC	205	133	PTC Inc	HSBC	665
233	NortonLifeLock Inc	JP Morgan	1.533	169	Public Service Enterprise Group Inc	HSBC	(196)
(19)	NVIDIA Corp	Citibank	(481)	254	PulteGroup Inc	Citibank	450
1	NVR Inc	Citibank	235	93	PulteGroup Inc	HSBC	(424)
1	NVR Inc	HSBC	(329)	272	PulteGroup Inc	JP Morgan	(1.240)
5	NVR Inc	JP Morgan	(1.643)	54	Qorvo Inc	JP Morgan	608
25	NXP Semiconductors NV	Citibank	176	122	QUALCOMM Inc	Citibank	199
82	NXP Semiconductors NV	HSBC	1.836	371	QUALCOMM Inc	HSBC	1.904
24	NXP Semiconductors NV	JP Morgan	537	349	QUALCOMM Inc	JP Morgan	1.684
(20)	Okta Inc	Citibank	402				
(25)	Okta Inc	HSBC	208				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
44	Quest Diagnostics Inc	Citibank	53	108	Sherwin-Williams Co	Citibank	(156)
251	Quest Diagnostics Inc	HSBC	(2.462)	161	Sherwin-Williams Co	HSBC	(654)
43	Raymond James Financial Inc	Citibank	(83)	134	Sherwin-Williams Co	JP Morgan	(522)
79	Raymond James Financial Inc	HSBC	(194)	7.383	Sirius XM Holdings Inc	HSBC	2.141
112	Raymond James Financial Inc	JP Morgan	(276)	212	Skyworks Solutions Inc	JP Morgan	859
2.734	Regions Financial Corp	HSBC	2.078	(236)	Slack Technologies Inc 'A'	HSBC	(708)
1.597	Regions Financial Corp	JP Morgan	1.214	(138)	Slack Technologies Inc 'A'	JP Morgan	(414)
(213)	Reinsurance Group of America Inc	HSBC	420	(420)	Snap Inc 'A'	Citibank	(840)
(481)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Citibank	24	(34)	Snap-on Inc	HSBC	26
(458)	Republic Services Inc	Citibank	96	(48)	Snowflake Inc 'A'	Citibank	(197)
(626)	Republic Services Inc	HSBC	1.797	(22)	Snowflake Inc 'A'	HSBC	(973)
(510)	Republic Services Inc	JP Morgan	1.464	(43)	Snowflake Inc 'A'	JP Morgan	(1.901)
(42)	ResMed Inc	Citibank	20	(105)	Southwest Airlines Co	Citibank	(82)
(100)	RingCentral Inc 'A'	Citibank	(1.582)	(106)	Southwest Airlines Co	HSBC	(12)
(41)	RingCentral Inc 'A'	HSBC	(85)	(800)	Southwest Airlines Co	JP Morgan	(88)
(63)	RingCentral Inc 'A'	JP Morgan	(131)	(118)	Splunk Inc	Citibank	(178)
783	Robert Half International Inc	HSBC	(1.574)	(114)	Splunk Inc	HSBC	(850)
345	Robert Half International Inc	JP Morgan	(693)	(44)	Splunk Inc	JP Morgan	(91)
86	Rockwell Automation Inc	Citibank	114	(115)	Square Inc 'A'	Citibank	(1.331)
146	Rockwell Automation Inc	HSBC	(1.035)	(43)	Square Inc 'A'	HSBC	(262)
41	Rockwell Automation Inc	JP Morgan	(291)	(661)	SS&C Technologies Holdings Inc	Citibank	416
(12)	Roku Inc	Citibank	6	(117)	SS&C Technologies Holdings Inc	JP Morgan	(64)
(7)	Roku Inc	JP Morgan	(317)	(48)	Stanley Black & Decker Inc	JP Morgan	187
(1.470)	Rollins Inc	HSBC	4.601	702	Starbucks Corp	Citibank	955
(134)	Rollins Inc	JP Morgan	419	307	Starbucks Corp	HSBC	(129)
(258)	Roper Technologies Inc	Citibank	(1.437)	142	Starbucks Corp	JP Morgan	12
(48)	Roper Technologies Inc	HSBC	(269)	383	State Street Corp	Citibank	218
(11)	Roper Technologies Inc	JP Morgan	(65)	59	State Street Corp	HSBC	(50)
68	Ross Stores Inc	Citibank	196	63	State Street Corp	JP Morgan	(54)
42	Ross Stores Inc	JP Morgan	123	(641)	Steel Dynamics Inc	HSBC	994
(100)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Citibank	(740)	(55)	STERIS Plc	HSBC	50
(129)	Royal Caribbean Cruises Ltd	HSBC	(875)	(40)	Stryker Corp	Citibank	75
(208)	Royal Caribbean Cruises Ltd	JP Morgan	(1.943)	(49)	Stryker Corp	HSBC	35
(135)	Royalty Pharma Plc 'A'	Citibank	81	(48)	Stryker Corp	JP Morgan	34
(103)	Royalty Pharma Plc 'A'	JP Morgan	141	21	SVB Financial Group	JP Morgan	147
(272)	RPM International Inc	Citibank	188	192	Synopsys Inc	Citibank	979
(62)	RPM International Inc	JP Morgan	272	324	Synopsys Inc	HSBC	6.676
(20)	S&P Global Inc	HSBC	218	204	Synopsys Inc	JP Morgan	4.478
(40)	S&P Global Inc	JP Morgan	436	(106)	Sysco Corp	JP Morgan	492
(261)	salesforce.com Inc	Citibank	(2.850)	165	T Rowe Price Group Inc	HSBC	188
(22)	salesforce.com Inc	HSBC	(238)	41	Take-Two Interactive Software Inc	Citibank	22
(317)	salesforce.com Inc	JP Morgan	(7.658)	150	Target Corp	Citibank	227
(316)	Sarepta Therapeutics Inc	Citibank	493	125	Target Corp	HSBC	1.611
(362)	Sarepta Therapeutics Inc	HSBC	(2.034)	32	Target Corp	JP Morgan	321
(77)	Seagate Technology Holdings Plc	Citibank	185	(240)	TE Connectivity Ltd	Citibank	(274)
(64)	Seagen Inc	Citibank	(108)	(196)	TE Connectivity Ltd	HSBC	161
(137)	Seagen Inc	HSBC	(2.661)	(65)	Teladoc Health Inc	Citibank	(536)
(211)	Seagen Inc	JP Morgan	(4.098)	(204)	Teladoc Health Inc	HSBC	(1.944)
638	Sealed Air Corp	Citibank	242	(65)	Teladoc Health Inc	JP Morgan	(361)
279	Sealed Air Corp	HSBC	11	(62)	Teledyne Technologies Inc	Citibank	(531)
239	Sealed Air Corp	JP Morgan	10	(13)	Teledyne Technologies Inc	HSBC	163
(101)	SEI Investments Co	Citibank	(56)	(13)	Teledyne Technologies Inc	JP Morgan	163
(246)	SEI Investments Co	HSBC	(175)	(104)	Teleflex Inc	Citibank	133
(472)	SEI Investments Co	JP Morgan	(229)	(37)	Teleflex Inc	HSBC	202
60	Sempra Energy	HSBC	(212)	(5)	Teleflex Inc	JP Morgan	27
(95)	Sensata Technologies Holding Plc	HSBC	(128)	124	Teradyne Inc	Citibank	578
31	ServiceNow Inc	Citibank	(77)	26	Teradyne Inc	JP Morgan	273
104	ServiceNow Inc	HSBC	736	(9)	Tesla Inc	Citibank	(169)
				(30)	Tesla Inc	HSBC	(365)
				(24)	Tesla Inc	JP Morgan	92
				(1.175)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Citibank	447
				(2.061)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	HSBC	(309)
				547	Texas Instruments Inc	Citibank	618
				78	Texas Instruments Inc	JP Morgan	606

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(31)	Thermo Fisher Scientific Inc	HSBC	(187)	144	VF Corp	Citibank	448
(94)	Thermo Fisher Scientific Inc	JP Morgan	(567)	(158)	ViacomCBS Inc 'B'	Citibank	(139)
582	TJX Cos Inc	HSBC	(2.347)	(1.485)	Viatris Inc	Citibank	178
101	TJX Cos Inc	JP Morgan	(550)	(2.955)	Viatris Inc	HSBC	(591)
(722)	T-Mobile US Inc	HSBC	(4.055)	(845)	Viatris Inc	JP Morgan	(169)
(767)	T-Mobile US Inc	JP Morgan	(4.081)	(397)	Vimeo Inc	Citibank	(16.674)
75	Tractor Supply Co	HSBC	(1.050)	(103)	Vimeo Inc	HSBC	(4.326)
181	Tractor Supply Co	JP Morgan	(2.534)	(167)	Vimeo Inc	JP Morgan	(7.014)
(11)	Trade Desk Inc 'A'	Citibank	(106)	(791)	Visa Inc 'A'	Citibank	1.429
(66)	Trade Desk Inc 'A'	HSBC	(6.310)	84	VMware Inc 'A'	HSBC	(485)
(98)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Citibank	(256)	76	VMware Inc 'A'	JP Morgan	(439)
(590)	Tradeweb Markets Inc 'A'	HSBC	(431)	320	Voya Financial Inc	Citibank	(259)
33	Trane Technologies Plc	Citibank	142	(82)	Vulcan Materials Co	HSBC	610
169	Trane Technologies Plc	HSBC	(44)	(33)	W R Berkley Corp	HSBC	95
221	Trane Technologies Plc	JP Morgan	154	(288)	W R Berkley Corp	JP Morgan	832
(117)	TransUnion	Citibank	268	(175)	Walgreens Boots Alliance Inc	JP Morgan	429
(255)	TransUnion	HSBC	(122)	(248)	Walt Disney Co	Citibank	(1.076)
(219)	TransUnion	JP Morgan	(105)	(35)	Walt Disney Co	HSBC	198
(34)	Travelers Cos Inc	Citibank	(33)	(365)	Waste Connections Inc	Citibank	(212)
(113)	Travelers Cos Inc	HSBC	223	(140)	Waste Connections Inc	HSBC	305
92	Trimble Inc	Citibank	(14)	(31)	Waste Connections Inc	JP Morgan	68
202	Trimble Inc	HSBC	451	(552)	Waste Management Inc	Citibank	237
205	Trimble Inc	JP Morgan	87	(473)	Waste Management Inc	HSBC	1.220
92	Truist Financial Corp	Citibank	52	(57)	Waste Management Inc	JP Morgan	147
322	Truist Financial Corp	HSBC	287	135	Waters Corp	Citibank	682
(18)	Twilio Inc 'A'	Citibank	(214)	67	Waters Corp	HSBC	374
(158)	Twilio Inc 'A'	HSBC	(5.956)	104	Waters Corp	JP Morgan	480
(65)	Twilio Inc 'A'	JP Morgan	(2.685)	(23)	Wayfair Inc 'A'	Citibank	164
(509)	Twitter Inc	Citibank	(478)	(12)	Wayfair Inc 'A'	HSBC	175
(271)	Twitter Inc	HSBC	(860)	(1.522)	Wells Fargo & Co	HSBC	(183)
(117)	Tyler Technologies Inc	HSBC	(1.280)	308	West Pharmaceutical Services Inc	Citibank	2.461
(27)	Tyler Technologies Inc	JP Morgan	(295)	183	West Pharmaceutical Services Inc	HSBC	2.522
89	Tyson Foods Inc 'A'	Citibank	(94)	(608)	Western Digital Corp	JP Morgan	(4.019)
334	Tyson Foods Inc 'A'	JP Morgan	227	261	Western Union Co	Citibank	(60)
(182)	Uber Technologies Inc	Citibank	(146)	421	Western Union Co	HSBC	(560)
(333)	Uber Technologies Inc	HSBC	(1.678)	653	Western Union Co	JP Morgan	(868)
(172)	Uber Technologies Inc	JP Morgan	(817)	(377)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Citibank	(701)
580	UGI Corp	Citibank	719	(320)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	HSBC	(608)
680	UGI Corp	HSBC	(109)	(154)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	JP Morgan	(293)
360	UGI Corp	JP Morgan	(58)	104	Westrock Co	HSBC	(141)
18	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	JP Morgan	494	119	Whirlpool Corp	Citibank	249
40	United Parcel Service Inc 'B'	HSBC	(61)	21	Whirlpool Corp	HSBC	(309)
30	United Rentals Inc	HSBC	(425)	15	Whirlpool Corp	JP Morgan	(221)
(136)	UnitedHealth Group Inc	HSBC	1.220	(849)	Williams Cos Inc	HSBC	(679)
136	Universal Health Services Inc 'B'	Citibank	86	(26)	Willis Towers Watson Plc	Citibank	41
(721)	US Bancorp	Citibank	(260)	(101)	Willis Towers Watson Plc	HSBC	760
(117)	US Bancorp	JP Morgan	46	(41)	Willis Towers Watson Plc	JP Morgan	308
50	Vail Resorts Inc	Citibank	311	(42)	Wix.com Ltd	Citibank	(452)
110	Vail Resorts Inc	HSBC	976	(28)	Wix.com Ltd	HSBC	(1.141)
19	Vail Resorts Inc	JP Morgan	169	(18)	Wix.com Ltd	JP Morgan	391
(83)	Valero Energy Corp	Citibank	(173)	54	Workday Inc 'A'	Citibank	(285)
(508)	Valero Energy Corp	HSBC	(343)	89	Workday Inc 'A'	HSBC	(318)
(172)	Valero Energy Corp	JP Morgan	(326)	22	Workday Inc 'A'	JP Morgan	119
19	Veeva Systems Inc 'A'	Citibank	542	24	WW Grainger Inc	Citibank	52
23	Veeva Systems Inc 'A'	HSBC	971	121	WW Grainger Inc	HSBC	(1.459)
39	Veeva Systems Inc 'A'	JP Morgan	1.646	85	WW Grainger Inc	JP Morgan	(1.025)
79	VeriSign Inc	Citibank	(362)	(109)	Wynn Resorts Ltd	Citibank	(263)
154	VeriSign Inc	HSBC	(303)	(198)	Wynn Resorts Ltd	HSBC	(1.013)
(80)	Verisk Analytics Inc	Citibank	107	255	Xilinx Inc	Citibank	824
(171)	Verisk Analytics Inc	HSBC	1.151	(155)	XPO Logistics Inc	HSBC	194
(199)	Verisk Analytics Inc	JP Morgan	1.339	59	Xylem Inc	Citibank	131
551	Verizon Communications Inc	Citibank	(270)	95	Xylem Inc	HSBC	(160)
230	Verizon Communications Inc	HSBC	(697)	328	Xylem Inc	JP Morgan	(551)
292	Vertex Pharmaceuticals Inc	Citibank	(756)	342	Yum! Brands Inc	Citibank	(188)
163	Vertex Pharmaceuticals Inc	HSBC	(696)				
125	Vertex Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	(534)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite			
167	Yum! Brands Inc	HSBC	(326)
69	Yum! Brands Inc	JP Morgan	(135)
54	Zebra Technologies Corp 'A'	Citibank	(247)
28	Zebra Technologies Corp 'A'	HSBC	407
12	Zebra Technologies Corp 'A'	JP Morgan	156
(82)	Zillow Group Inc 'C'	Citibank	(360)
(72)	Zillow Group Inc 'C'	HSBC	(349)
(126)	Zillow Group Inc 'C'	JP Morgan	(611)
(40)	Zimmer Biomet Holdings Inc	HSBC	145
(91)	Zimmer Biomet Holdings Inc	JP Morgan	329
(33)	Zoetis Inc	Citibank	(9)
(68)	Zoetis Inc	HSBC	(375)
(63)	Zoom Video Communications Inc 'A'	HSBC	(2.712)
(89)	Zoom Video Communications Inc 'A'	JP Morgan	(3.831)
(116)	Zscaler Inc	Citibank	(2.297)
(70)	Zscaler Inc	HSBC	(1.990)
(54)	Zscaler Inc	JP Morgan	(1.535)
			<u>(107.184)</u>
	Total (Exposition brute sous-jacente - USD 57.487.250)		(23.802)
* Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.			
** Les montants inférieurs à 0,5 USD ont été arrondis à zéro.			

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Valeur de marché USD
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
CCCDs	USD 2.287.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	Morgan Stanley	20/6/2026	5.079	55.721
CCCDs	EUR 1.808.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1	Morgan Stanley	20/6/2026	4.565	55.875
CCCDs	USD 576.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.25 Version 8	Morgan Stanley	20/6/2026	2.073	55.783
CCCDs	EUR 470.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1	Morgan Stanley	20/6/2026	3.641	67.961
TRS	BRL 1	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(1.244)	(1.244)
TRS	BRL 14	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(8.303)	(8.303)
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	630	629
TRS	TWD 2.200	Fund receives TAIEX Futures Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	102.065	102.065
TRS	TWD 1.600	Fund receives TAIEX Futures Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	14.803	14.803
TRS	USD 1	Fund receives 3 Month LIBOR and pays MSCI Hong Kong Net Total Return US	Goldman Sachs	8/6/2021	(4.361)	(4.361)
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 8.755.943)					118.948	338.929
CCCDs : Swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Credit Default Swaps)						
TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)						

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(8)	EUR	Amsterdam Index Futures June 2021	Juin 2021	1.388.816	(16.625)
145	AUD	Australian 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	15.705.505	100.536
21	EUR	CAC 40 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.655.596	44.484
(31)	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures September 2021	Septembre 2021	3.698.754	(6.398)
3	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	630.840	5.877
(53)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	10.983.521	107.078
(32)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2021	Juin 2021	3.184.737	(87.627)
39	USD	FTSE China A50 Futures June 2021	Juin 2021	708.162	10.121
16	EUR	FTSE MIB Index Futures June 2021	Juin 2021	2.464.721	65.139
(13)	EUR	IBEX 35 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.453.729	(2.657)
17	USD	MSCI Hong Kong Index Futures June 2021	Juin 2021	1.374.620	(10.580)
(58)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.573.990	(13.070)
(11)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures June 2021	Juin 2021	2.164.582	(91.118)
(50)	USD	SGX NIFTY 50 Futures June 2021	Juin 2021	1.558.000	(29.283)
(19)	AUD	SPI 200 Index Futures June 2021	Juin 2021	2.634.410	(123.174)
24	CHF	Swiss Market Index Futures June 2021	Juin 2021	3.033.950	145.649
10	JPY	Topix Index Futures June 2021	Juin 2021	1.758.938	(11.355)
(87)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	Septembre 2021	15.687.260	(30.196)
68	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	Septembre 2021	8.963.250	3.301
Total				80.623.381	60.102

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	39.000	USD	29.695	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	491
AUD	234.000	USD	181.402	Deutsche Bank	16/6/2021	(287)
AUD	804.000	USD	623.024	Goldman Sachs	16/6/2021	(731)
AUD	162.000	USD	124.760	JP Morgan	16/6/2021	627
AUD	206.000	USD	159.161	Morgan Stanley	16/6/2021	282
AUD	234.000	USD	181.432	Deutsche Bank	21/7/2021	(288)
AUD	187.000	USD	144.354	Goldman Sachs	21/7/2021	406
AUD	162.000	USD	124.782	JP Morgan	21/7/2021	626
AUD	234.000	USD	181.451	Deutsche Bank	18/8/2021	(289)
BRL	728.000	USD	133.272	Barclays Bank	16/6/2021	6.153
BRL	1.878.938	USD	342.772	BNP Paribas	16/6/2021	17.078
BRL	3.796.000	USD	714.618	Citibank	16/6/2021	12.385
BRL	3.230.547	USD	574.528	Deutsche Bank	16/6/2021	44.180
BRL	3.468.062	USD	626.433	Goldman Sachs	16/6/2021	37.765
BRL	110.453	USD	19.644	JP Morgan	16/6/2021	1.510
BRL	477.000	USD	84.521	UBS	16/6/2021	6.833
BRL	730.000	USD	133.231	Barclays Bank	21/7/2021	6.114
BRL	3.808.000	USD	714.378	BNP Paribas	21/7/2021	12.505
BRL	1.025.005	USD	179.410	Citibank	21/7/2021	16.246
BRL	2.723.995	USD	496.517	Goldman Sachs	21/7/2021	23.448
BRL	1.246.000	USD	219.900	JP Morgan	21/7/2021	17.940
BRL	938.000	USD	177.717	UBS	21/7/2021	1.332
BRL	4.038.000	USD	755.602	Goldman Sachs	18/8/2021	12.871
BRL	722.000	USD	136.499	HSBC	18/8/2021	905
CAD	2.576.000	USD	2.043.065	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	89.061
CAD	84.000	USD	69.603	BNP Paribas	16/6/2021	(78)
CAD	869.000	USD	716.794	JP Morgan	16/6/2021	2.467
CAD	596.000	USD	475.475	Morgan Stanley	16/6/2021	17.829
CAD	81.000	USD	64.531	UBS	16/6/2021	2.512
CAD	169.000	USD	134.977	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	4.896
CAD	204.000	USD	169.034	BNP Paribas	21/7/2021	(193)
CAD	804.000	USD	665.013	JP Morgan	21/7/2021	418
CAD	1.109.500	USD	883.990	Morgan Stanley	21/7/2021	34.289
CAD	204.000	USD	169.031	BNP Paribas	18/8/2021	(196)
CAD	1.176.000	USD	972.763	JP Morgan	18/8/2021	521
CAD	246.000	USD	203.425	Morgan Stanley	18/8/2021	170
CHF	145.037	USD	158.945	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	2.185
CNH	7.178.000	USD	1.123.340	BNP Paribas	16/6/2021	2.592
CNY	7.178.000	USD	1.120.887	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	1.505
CNY	7.177.000	USD	1.118.817	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	1.317
EUR	143.000	USD	172.560	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	2.004
EUR	6.000	USD	7.332	Morgan Stanley	16/6/2021	(8)
EUR	82.000	USD	96.320	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	3.780
EUR	143.000	USD	172.693	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	1.989
EUR	314.000	USD	381.604	Citibank	21/7/2021	1.964
EUR	6.000	USD	7.338	Morgan Stanley	21/7/2021	(8)
EUR	6.000	USD	7.343	JP Morgan	18/8/2021	(10)
GBP	277.000	USD	382.323	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	10.191
GBP	180.000	USD	252.916	Citibank	16/6/2021	2.147
GBP	91.000	USD	125.317	Deutsche Bank	16/6/2021	3.631
GBP	98.000	USD	138.162	JP Morgan	16/6/2021	706
GBP	328.000	USD	457.752	Morgan Stanley	16/6/2021	7.031

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
GBP	192.000	USD	264.950	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	7.118
GBP	171.000	USD	235.932	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	6.387
GBP	180.000	USD	252.937	Citibank	21/7/2021	2.136
GBP	69.000	USD	97.875	JP Morgan	21/7/2021	(97)
GBP	170.000	USD	237.942	Morgan Stanley	21/7/2021	2.960
GBP	116.000	USD	160.594	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	3.786
GBP	76.000	USD	104.395	UBS	21/7/2021	3.302
GBP	289.000	USD	396.858	Westpac	21/7/2021	12.676
GBP	533.000	USD	753.475	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	1.831
GBP	112.000	USD	158.507	Citibank	18/8/2021	207
GBP	69.000	USD	97.877	JP Morgan	18/8/2021	(98)
HKD	31.000	USD	3.992	Barclays Bank	16/6/2021	3
INR	119.700.500	USD	1.614.063	Barclays Bank	16/6/2021	32.120
INR	6.787.521	USD	90.969	BNP Paribas	16/6/2021	2.377
INR	1.750.000	USD	23.856	Deutsche Bank	16/6/2021	212
INR	727.000	USD	9.576	Goldman Sachs	16/6/2021	422
INR	1.224.479	USD	16.121	JP Morgan	16/6/2021	718
INR	1.293.000	USD	17.619	Morgan Stanley	16/6/2021	163
INR	63.876.000	USD	863.481	UBS	16/6/2021	14.974
INR	133.673.500	USD	1.765.214	BNP Paribas	22/7/2021	62.629
INR	1.301.000	USD	17.620	Deutsche Bank	22/7/2021	170
INR	730.000	USD	9.567	Goldman Sachs	22/7/2021	415
INR	1.306.000	USD	17.612	Citibank	18/8/2021	172
INR	157.584.500	USD	2.112.888	JP Morgan	18/8/2021	33.028
JPY	55.694.000	USD	512.212	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(4.186)
JPY	24.275.000	USD	221.857	BNP Paribas	16/6/2021	(427)
JPY	24.720.000	USD	228.263	Goldman Sachs	16/6/2021	(2.774)
JPY	94.188.000	USD	859.550	JP Morgan	16/6/2021	(394)
JPY	48.818.000	USD	449.062	Morgan Stanley	16/6/2021	(3.759)
JPY	12.445.000	USD	114.581	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(1.061)
JPY	198.408.000	USD	1.811.458	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(1.150)
JPY	19.296.000	USD	178.348	Goldman Sachs	21/7/2021	(2.289)
JPY	31.987.000	USD	292.991	JP Morgan	21/7/2021	(1.136)
JPY	3.550.000	USD	32.688	Morgan Stanley	21/7/2021	(298)
JPY	3.016.000	USD	27.769	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	(251)
JPY	251.434.500	USD	2.313.188	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	(18.586)
JPY	7.907.000	USD	72.679	BNP Paribas	18/8/2021	(520)
KRW	27.758.155	USD	24.843	BNP Paribas	16/6/2021	204
KRW	41.014.000	USD	36.844	Citibank	16/6/2021	163
KRW	34.036.667	USD	30.466	Deutsche Bank	16/6/2021	245
KRW	106.160.000	USD	94.611	HSBC	16/6/2021	1.178
KRW	13.313.000	USD	11.929	JP Morgan	16/6/2021	83
KRW	48.704.094	USD	43.593	Morgan Stanley	16/6/2021	353
KRW	15.832.084	USD	14.171	UBS	16/6/2021	115
KRW	41.000.000	USD	36.832	Citibank	21/7/2021	165
KRW	13.308.000	USD	11.925	HSBC	21/7/2021	83
KRW	21.173.000	USD	18.959	Morgan Stanley	21/7/2021	146
KRW	125.722.000	USD	112.125	UBS	21/7/2021	1.321
KRW	21.173.000	USD	18.961	HSBC	18/8/2021	146
KRW	19.598.000	USD	17.540	UBS	18/8/2021	146
MXN	1.781.000	USD	85.244	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	4.091
MXN	23.487.000	USD	1.103.708	Goldman Sachs	16/6/2021	74.408

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
MXN	5.544.000	USD	273.282	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	4.808
MXN	442.000	USD	22.077	Goldman Sachs	21/7/2021	8
MXN	18.135.500	USD	890.129	HSBC	21/7/2021	16.022
MXN	3.186.000	USD	158.441	JP Morgan	21/7/2021	750
MXN	1.050.000	USD	52.426	Morgan Stanley	21/7/2021	38
MXN	2.902.000	USD	143.734	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	1.267
MXN	19.643.000	USD	977.062	Citibank	18/8/2021	1.379
MXN	1.622.000	USD	80.531	JP Morgan	18/8/2021	263
NOK	786.000	USD	92.597	Goldman Sachs	16/6/2021	1.589
NZD	15.000	USD	10.742	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	160
NZD	148.000	USD	107.238	Barclays Bank	16/6/2021	332
NZD	129.000	USD	92.010	Citibank	16/6/2021	1.751
NZD	48.000	USD	34.353	JP Morgan	16/6/2021	534
NZD	422.000	USD	298.027	Morgan Stanley	16/6/2021	8.695
NZD	27.000	USD	18.982	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	643
NZD	27.000	USD	19.473	UBS	16/6/2021	151
NZD	148.000	USD	107.227	Barclays Bank	21/7/2021	333
NZD	129.000	USD	91.999	Citibank	21/7/2021	1.753
NZD	119.000	USD	86.589	JP Morgan	21/7/2021	(105)
NZD	242.000	USD	175.164	Morgan Stanley	21/7/2021	711
NZD	27.000	USD	19.472	UBS	21/7/2021	151
NZD	27.000	USD	18.979	Westpac	21/7/2021	644
NZD	148.000	USD	107.215	Barclays Bank	18/8/2021	334
RUB	26.661.566	USD	359.182	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	3.713
RUB	49.979.000	USD	667.403	BNP Paribas	16/6/2021	12.870
RUB	3.760.434	USD	50.047	Goldman Sachs	16/6/2021	1.137
RUB	14.444.000	USD	187.427	JP Morgan	16/6/2021	9.173
RUB	34.444.000	USD	467.321	UBS	16/6/2021	1.502
RUB	23.200.000	USD	311.349	Citibank	21/7/2021	2.898
RUB	34.598.000	USD	467.182	Goldman Sachs	21/7/2021	1.453
RUB	51.449.500	USD	656.206	JP Morgan	21/7/2021	40.684
RUB	29.403.000	USD	391.034	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	5.632
RUB	34.738.000	USD	467.211	UBS	18/8/2021	1.428
SEK	667.000	USD	79.281	Goldman Sachs	16/6/2021	1.168
SEK	267.000	USD	32.226	HSBC	16/6/2021	(21)
SEK	237.000	USD	28.554	JP Morgan	16/6/2021	30
TWD	981.000	USD	35.287	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	369
TWD	3.133.635	USD	112.644	BNP Paribas	16/6/2021	1.255
TWD	2.245.000	USD	80.634	Citibank	16/6/2021	965
TWD	6.947.365	USD	249.424	Deutsche Bank	16/6/2021	3.093
TWD	1.044.000	USD	37.404	Morgan Stanley	16/6/2021	543
TWD	2.757.000	USD	99.298	UBS	16/6/2021	911
TWD	977.000	USD	35.309	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	383
TWD	2.236.000	USD	80.696	BNP Paribas	21/7/2021	990
TWD	6.119.000	USD	221.358	Deutsche Bank	21/7/2021	2.182
TWD	3.189.000	USD	115.203	Morgan Stanley	21/7/2021	1.297
TWD	2.980.000	USD	107.418	UBS	21/7/2021	1.447
TWD	6.097.000	USD	221.411	BNP Paribas	18/8/2021	2.204
TWD	2.228.000	USD	80.707	HSBC	18/8/2021	1.007
TWD	586.000	USD	21.262	Morgan Stanley	18/8/2021	230
USD	102.722	AUD	132.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	554
USD	87.993	AUD	115.000	Barclays Bank	16/6/2021	(1.017)
USD	44.435	AUD	57.000	Citibank	16/6/2021	317

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	40.521	AUD	52.000	JP Morgan	16/6/2021	273
USD	1.643.623	AUD	2.136.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(9.635)
USD	334.543	AUD	432.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	176
USD	15.509	AUD	20.000	UBS	16/6/2021	29
USD	102.739	AUD	132.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	556
USD	44.442	AUD	57.000	Citibank	21/7/2021	318
USD	302.473	AUD	390.000	Deutsche Bank	21/7/2021	566
USD	10.199	AUD	13.000	JP Morgan	21/7/2021	136
USD	64.530	AUD	83.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	279
USD	15.512	AUD	20.000	UBS	21/7/2021	29
USD	959.794	AUD	1.258.000	Westpac	21/7/2021	(14.049)
USD	44.447	AUD	57.000	Citibank	18/8/2021	318
USD	919.559	AUD	1.169.000	Deutsche Bank	18/8/2021	14.525
USD	302.533	AUD	390.000	JP Morgan	18/8/2021	597
USD	913.030	BRL	5.362.500	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(113.986)
USD	410.680	BRL	2.330.000	BNP Paribas	16/6/2021	(35.558)
USD	298.742	BRL	1.614.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(10.369)
USD	122.868	BRL	681.000	UBS	16/6/2021	(7.557)
USD	981.464	BRL	5.586.000	Citibank	21/7/2021	(84.809)
USD	218.873	BRL	1.150.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(643)
USD	203.743	BRL	1.075.500	Citibank	18/8/2021	(935)
USD	159.780	CAD	195.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(1.619)
USD	81.287	CAD	101.574	Citibank	16/6/2021	(2.785)
USD	252.751	CAD	307.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.350)
USD	993.743	CAD	1.229.000	JP Morgan	16/6/2021	(23.487)
USD	177.880	CAD	223.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(6.695)
USD	118.768	CAD	149.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(4.552)
USD	251.955	CAD	306.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(1.306)
USD	357.432	CAD	439.000	JP Morgan	21/7/2021	(5.906)
USD	59.128	CAD	74.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(2.118)
USD	36.530	CAD	44.000	JP Morgan	18/8/2021	115
USD	177.080	CHF	165.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(6.228)
USD	98.514	CHF	92.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(3.694)
USD	129.644	CHF	116.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	773
USD	329.951	CNH	2.111.000	UBS	21/7/2021	(445)
USD	330.542	CNY	2.110.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(197)
USD	329.212	CNY	2.110.000	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	(101)
USD	334.634	EUR	280.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(7.170)
USD	37.280	EUR	31.000	BNP Paribas	16/6/2021	(562)
USD	81.949	EUR	67.000	Citibank	16/6/2021	160
USD	254.091	EUR	210.000	HSBC	16/6/2021	(2.262)
USD	481.861	EUR	404.000	JP Morgan	16/6/2021	(11.313)
USD	593.639	EUR	497.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(13.063)
USD	13.427	EUR	11.000	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	(1)
USD	4.564.911	EUR	3.829.000	UBS	16/6/2021	(109.257)
USD	6.248.598	EUR	5.245.615	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(159.194)
USD	37.309	EUR	31.000	BNP Paribas	21/7/2021	(559)
USD	82.005	EUR	67.000	Citibank	21/7/2021	161
USD	140.052	EUR	115.000	JP Morgan	21/7/2021	(427)
USD	161.124	EUR	134.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(2.565)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	13.437	EUR	11.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	(1)
USD	82.048	EUR	67.000	Citibank	18/8/2021	161
USD	13.444	EUR	11.000	Deutsche Bank	18/8/2021	—
USD	6.520.717	EUR	5.353.000	JP Morgan	18/8/2021	(21.732)
USD	243.029	GBP	175.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(4.948)
USD	22.371	GBP	16.000	Barclays Bank	16/6/2021	(302)
USD	451.421	GBP	323.000	JP Morgan	16/6/2021	(6.275)
USD	132.734	GBP	95.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(1.883)
USD	144.987	GBP	102.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	452
USD	99.979	GBP	72.000	Barclays Bank	21/7/2021	(2.050)
USD	270.266	GBP	191.000	JP Morgan	21/7/2021	(395)
USD	308.845	GBP	222.411	Morgan Stanley	21/7/2021	(6.327)
USD	144.999	GBP	102.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	458
USD	415.288	GBP	293.000	JP Morgan	18/8/2021	81
USD	36.200	HKD	281.000	BNP Paribas	16/6/2021	(7)
USD	138.430	INR	10.384.000	BNP Paribas	16/6/2021	(4.376)
USD	15.816	INR	1.154.000	Citibank	16/6/2021	(54)
USD	10.795	INR	815.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(413)
USD	300.152	INR	22.250.000	JP Morgan	16/6/2021	(5.841)
USD	9.166	INR	667.000	UBS	16/6/2021	(7)
USD	10.794	INR	819.000	Deutsche Bank	22/7/2021	(405)
USD	24.970	INR	1.831.000	UBS	22/7/2021	(66)
USD	9.158	INR	673.000	Deutsche Bank	18/8/2021	(7)
USD	15.819	INR	1.166.000	UBS	18/8/2021	(59)
USD	60.657	JPY	6.561.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	809
USD	66.651	JPY	7.246.000	BNP Paribas	16/6/2021	555
USD	130.984	JPY	14.265.000	HSBC	16/6/2021	863
USD	76.647	JPY	8.281.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	1.110
USD	60.642	JPY	6.557.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	815
USD	130.940	JPY	14.256.000	Deutsche Bank	21/7/2021	866
USD	130.940	JPY	14.253.000	Morgan Stanley	18/8/2021	867
USD	1.364.978	KRW	1.553.097.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(36.390)
USD	240.328	KRW	271.336.000	BNP Paribas	16/6/2021	(4.501)
USD	11.772	KRW	13.170.000	Citibank	16/6/2021	(111)
USD	72.859	KRW	82.135.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(1.252)
USD	92.270	KRW	104.393.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.926)
USD	414.076	KRW	463.765.000	JP Morgan	16/6/2021	(4.382)
USD	99.435	KRW	113.209.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(2.714)
USD	13.682	KRW	15.243.000	BNP Paribas	21/7/2021	(73)
USD	11.769	KRW	13.166.000	Citibank	21/7/2021	(112)
USD	2.036.013	KRW	2.280.191.500	HSBC	21/7/2021	(21.540)
USD	41.696	KRW	46.999.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(714)
USD	68.503	KRW	77.288.000	Societe Generale	21/7/2021	(1.239)
USD	44.884	KRW	50.420.000	UBS	21/7/2021	(613)
USD	2.001.076	KRW	2.227.718.000	Citibank	18/8/2021	(9.252)
USD	68.519	KRW	77.282.000	Societe Generale	18/8/2021	(1.221)
USD	40.665	MXN	826.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(767)
USD	141.796	MXN	2.876.000	Barclays Bank	16/6/2021	(2.465)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	187.753	MXN	3.809.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(3.307)
USD	119.639	MXN	2.395.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(495)
USD	742.299	MXN	14.786.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	628
USD	28.298	MXN	578.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(582)
USD	141.728	MXN	2.886.000	Barclays Bank	21/7/2021	(2.472)
USD	117.941	MXN	2.360.000	Goldman Sachs	21/7/2021	22
USD	861.767	MXN	17.245.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	111
USD	712.954	MXN	14.289.000	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	1.202
USD	94.877	NOK	782.000	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	1.162
USD	49.303	NZD	70.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(1.575)
USD	263.318	NZD	361.000	Barclays Bank	16/6/2021	933
USD	76.934	NZD	109.000	BNP Paribas	16/6/2021	(2.290)
USD	38.960	NZD	54.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(288)
USD	762.013	NZD	1.056.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(5.516)
USD	74.612	NZD	106.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(2.424)
USD	263.292	NZD	361.000	JP Morgan	21/7/2021	932
USD	699.410	NZD	967.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(3.363)
USD	344.161	NZD	472.000	JP Morgan	18/8/2021	1.167
USD	351.053	NZD	481.000	Morgan Stanley	18/8/2021	1.518
USD	47.164	RUB	3.491.000	Barclays Bank	16/6/2021	(352)
USD	719.209	RUB	54.724.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(25.652)
USD	58.181	RUB	4.466.000	JP Morgan	16/6/2021	(2.606)
USD	205.531	RUB	15.755.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(8.914)
USD	344.784	RUB	25.985.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(7.187)
USD	64.489	RUB	5.034.000	HSBC	21/7/2021	(3.697)
USD	58.162	RUB	4.486.000	JP Morgan	21/7/2021	(2.602)
USD	165.447	RUB	12.799.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(7.917)
USD	134.987	RUB	10.195.000	UBS	21/7/2021	(3.107)
USD	15.191	RUB	1.128.000	Barclays Bank	18/8/2021	(26)
USD	204.861	RUB	15.361.000	Goldman Sachs	18/8/2021	(2.369)
USD	105.843	SEK	889.080	Citibank	16/6/2021	(1.390)
USD	92.136	SEK	786.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(2.666)
USD	11.472	SEK	95.000	JP Morgan	16/6/2021	13
USD	22.944	SEK	190.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	28
USD	41.502	SGD	55.000	HSBC	18/8/2021	(100)
USD	252.359	TWD	7.141.000	Barclays Bank	16/6/2021	(7.196)
USD	35.871	TWD	1.003.000	BNP Paribas	16/6/2021	(585)
USD	18.824	TWD	530.000	Citibank	16/6/2021	(440)
USD	331.217	TWD	9.377.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(9.612)
USD	37.385	TWD	1.049.997	JP Morgan	16/6/2021	(779)
USD	592.428	TWD	16.627.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(11.916)
USD	1.210.947	TWD	33.603.003	UBS	16/6/2021	(10.427)
USD	1.180.304	TWD	32.600.000	Deutsche Bank	21/7/2021	(10.642)
USD	1.127.179	TWD	31.791.500	HSBC	21/7/2021	(34.231)
USD	55.050	TWD	1.532.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(917)
USD	18.831	TWD	528.000	UBS	21/7/2021	(458)
USD	1.008.642	TWD	27.603.500	BNP Paribas	18/8/2021	(3.749)
USD	1.180.526	TWD	32.481.000	Deutsche Bank	18/8/2021	(10.753)
						(162.606)

BlackRock Style Advantage Screened Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	5.574.196	USD	4.335.496	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(21.104)
USD	48.075	AUD	62.223	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(85)
						(21.189)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	7.556	USD	9.130	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	93
USD	102	EUR	84	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
						93
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	6.840	USD	9.522	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	171
USD	106	GBP	74	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
						171
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 110.334.145)						(183.531)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	70,74
Organismes de placement collectif	9,51
Portefeuille de titres à la valeur de marché	80,25
Autres éléments de l'actif net	19,75
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché USD	% de l'actif net			Valeur de marché USD	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie				Îles Caïmans			
20.647	Alumina Ltd [*]	27.405	0,01	3.852	Herbalife Nutrition Ltd	202.500	0,06
9.516	APA Group (Unit)	67.978	0,02	10.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	58.626	0,01
14.070	Aristocrat Leisure Ltd	447.013	0,12			261.126	0,07
8.641	ASX Ltd	510.004	0,14	Danemark			
4.941	BlueScope Steel Ltd	81.185	0,02	219	AP Moller - Maersk A/S 'A'	577.550	0,16
2.821	Cochlear Ltd [*]	495.699	0,14	357	AP Moller - Maersk A/S 'B'	984.547	0,28
7.934	Commonwealth Bank of Australia	612.333	0,17	1.616	Coloplast A/S 'B'	255.227	0,07
1.938	CSL Ltd	435.290	0,12	38.422	Novo Nordisk A/S 'B'	3.039.181	0,85
3.544	Fortescue Metals Group Ltd	61.523	0,02	1.516	Orsted A/S	228.486	0,06
6.696	Goodman Group (REIT)	100.693	0,03	57	ROCKWOOL International A/S 'B'	28.437	0,01
1.983	IDP Education Ltd	34.532	0,01			5.113.428	1,43
3.205	Medibank Pvt Ltd	7.764	0,00	Finlande			
3.029	Mineral Resources Ltd	106.384	0,03	2.493	Neste Oyj [*]	163.623	0,05
197.495	Mirvac Group (REIT)	426.455	0,12	82.185	Nordea Bank Abp	886.180	0,25
10.371	Northern Star Resources Ltd	93.912	0,03	9.004	UPM-Kymmene Oyj	343.171	0,10
6.246	REA Group Ltd	791.148	0,22	3.743	Valmet Oyj [*]	161.797	0,04
8.590	Rio Tinto Ltd	822.586	0,23	994	Wartsila Oyj Abp	13.623	0,00
1.396	SEEK Ltd	33.018	0,01			1.568.394	0,44
273.689	Stockland (REIT)	989.207	0,28	France			
40.662	Tabcorp Holdings Ltd	160.814	0,04	2.971	Air Liquide SA	505.946	0,14
39.132	Westpac Banking Corp	800.162	0,22	1.549	Alstom SA	86.977	0,02
3.574	Worley Ltd	29.210	0,01	7.585	Amundi SA	675.742	0,19
		7.134.315	1,99	89.256	AXA SA	2.468.310	0,69
				10.756	BNP Paribas SA	736.535	0,21
Autriche				2.081	Casino Guichard Perrachon SA	67.072	0,02
1.778	ANDRITZ AG	103.199	0,03	2.949	Cie de Saint-Gobain	198.159	0,05
		103.199	0,03	3.799	CNP Assurances	68.872	0,02
Belgique				21.304	Constellium SE	380.490	0,11
32.660	Anheuser-Busch InBev SA	2.463.640	0,69	3.614	Electricite de France SA	50.302	0,01
4.047	Umicore SA	242.849	0,07	10.659	Engie SA	158.753	0,04
		2.706.489	0,76	687	Faurecia SE	37.318	0,01
Bermudes				991	Imerys SA	51.957	0,01
692	Athene Holding Ltd 'A'	43.340	0,01	773	Kering SA	707.150	0,20
20.476	Invesco Ltd	584.180	0,16	2.445	Legrand SA	257.091	0,07
28.000	Shangri-La Asia Ltd	26.120	0,01	6.449	L'Oreal SA	2.904.164	0,81
		653.640	0,18	6.660	Permod Ricard SA	1.469.925	0,41
Canada				1.133	Renault SA	47.088	0,01
34.896	ARC Resources Ltd	271.219	0,08	9.362	Rexel SA	191.033	0,05
9.239	Bank of Montreal	971.733	0,27	9.340	Rubis SCA	451.382	0,13
1.931	Bank of Nova Scotia	130.390	0,04	8.541	Schneider Electric SE	1.353.588	0,38
2.021	Canadian Western Bank	62.530	0,02	9.432	Valeo SA	308.720	0,09
1.000	CGI Inc	89.492	0,02	3.028	Vinci SA	344.446	0,10
450	Colliers International Group Inc	50.030	0,01			13.521.020	3,77
3.043	First Quantum Minerals Ltd	75.058	0,02	Allemagne			
365	FirstService Corp	59.205	0,02	3.332	adidas AG	1.221.132	0,34
44.001	Hydro One Ltd	1.121.012	0,31	1.505	Allianz SE Reg	396.269	0,11
364	Intact Financial Corp	49.628	0,01	5.317	BASF SE	434.105	0,12
1.258	National Bank of Canada	98.170	0,03	3.118	Bayerische Motoren Werke AG	331.243	0,09
16.455	Rogers Communications Inc 'B'	852.612	0,24	2.448	Beiersdorf AG	289.433	0,08
7.566	Royal Bank of Canada	786.002	0,22	1.067	Covestro AG	75.109	0,02
1.423	Shopify Inc 'A'	1.764.219	0,49	9.751	Daimler AG	911.907	0,25
13.298	Sun Life Financial Inc [*]	718.201	0,20	9.771	Deutsche Post AG Reg	664.912	0,19
324	TMX Group Ltd	35.880	0,01	13.012	E.ON SE	157.052	0,04
28.060	Toronto-Dominion Bank	2.022.717	0,56	819	HelloFresh SE	74.603	0,02
351	West Fraser Timber Co Ltd	27.310	0,01	7.561	Infineon Technologies AG	308.289	0,09
34.335	Wheaton Precious Metals Corp	1.644.067	0,46	431	Knorr-Bremse AG	53.625	0,02
		10.829.475	3,02	1.892	Rheinmetall AG	196.588	0,06
				126	SAP SE	17.521	0,01
				11.537	Siemens AG Reg	1.869.793	0,52

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Allemagne suite				Japon suite			
2.323	Siemens Energy AG	73.625	0,02	10.600	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	323.201	0,09
5.414	Zalando SE	576.813	0,16	2.000	Nidec Corp	228.566	0,06
		7.652.019	2,14	5.000	Nikon Corp	51.168	0,01
Hong Kong				1.000	Nintendo Co Ltd	617.475	0,17
67.600	AIA Group Ltd	864.048	0,24	8.100	Nippon Paint Holdings Co Ltd [^]	117.023	0,03
295.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd [^]	1.066.189	0,30	3.300	Nippon Telegraph & Telephone Corp	88.234	0,02
220.500	MTR Corp Ltd	1.227.360	0,34	800	Nippon Yusen KK	32.944	0,01
222.800	Swire Properties Ltd	655.965	0,19	5.300	Nitto Denko Corp	410.407	0,11
10.000	Vitasoy International Holdings Ltd	39.106	0,01	3.600	NOK Corp	44.163	0,01
		3.852.668	1,08	45.900	Nomura Holdings Inc	251.604	0,07
Irlande				7.000	Nomura Research Institute Ltd	222.820	0,06
10.870	Accenture Plc 'A'	3.067.079	0,85	12.000	Omron Corp	943.451	0,26
5.692	Allegion Plc	799.612	0,22	29.900	Panasonic Corp	340.070	0,09
1.294	Flutter Entertainment Plc	243.196	0,07	1.200	Persol Holdings Co Ltd	22.711	0,01
2.265	Kingspan Group Plc	212.844	0,06	23.800	Recruit Holdings Co Ltd	1.205.846	0,34
500	Linde Plc	150.300	0,04	900	Secom Co Ltd	70.348	0,02
244	Medtronic Plc	30.888	0,01	12.100	Sekisui House Ltd	251.403	0,07
14.583	Perrigo Co Plc	672.860	0,19	15.700	SoftBank Corp	201.405	0,06
4.767	Trane Technologies Plc	888.569	0,25	8.700	SoftBank Group Corp [^]	655.119	0,18
		6.065.348	1,69	1.300	Sohgo Security Services Co Ltd	59.404	0,02
Israël				6.900	Sompo Holdings Inc [^]	277.158	0,08
139.057	Bank Hapoalim BM	1.182.343	0,33	1.900	Sony Corp	186.898	0,05
24.925	Israel Discount Bank Ltd 'A'	124.040	0,04	3.500	Stanley Electric Co Ltd	104.068	0,03
390	Nice Ltd	85.488	0,02	335.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	1.833.273	0,51
1.003	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	10.629	0,00	5.200	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	232.776	0,07
		1.402.500	0,39	44.600	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	1.607.211	0,45
Italie				11.300	Sumitomo Rubber Industries Ltd	145.940	0,04
52.111	Enel SpA	514.176	0,14	2.300	Systemex Corp	234.112	0,07
181.143	Intesa Sanpaolo SpA	535.867	0,15	700	Taisei Corp	24.389	0,01
18	Italgas SpA	119	0,00	37.800	Takeda Pharmaceutical Co Ltd [^]	1.282.180	0,36
42.861	Pirelli & C SpA	254.476	0,07	9.100	Teijin Ltd	146.659	0,04
1.409	Prysmian SpA	48.818	0,02	3.200	Tokio Marine Holdings Inc	151.157	0,04
		1.353.456	0,38	2.300	Tokyo Electron Ltd	1.020.777	0,28
Japon				5.300	Tokyo Gas Co Ltd	104.729	0,03
3.600	Aeon Co Ltd [^]	96.271	0,03	67.000	Toray Industries Inc [^]	434.241	0,12
29.300	Alps Alpine Co Ltd	314.539	0,09	4.400	Toyota Motor Corp [^]	365.797	0,10
82.300	Asahi Kasei Corp	904.519	0,25	700	Yaskawa Electric Corp [^]	33.902	0,01
25.900	Astellas Pharma Inc	424.619	0,12	7.000	Z Holdings Corp	32.855	0,01
7.500	Azbil Corp [^]	299.959	0,08			25.544.311	7,13
4.200	Benesse Holdings Inc [^]	96.304	0,03	Jersey			
3.600	Bridgestone Corp	157.804	0,04	1.415	Aptiv Plc	212.844	0,06
14.800	Dai Nippon Printing Co Ltd	318.435	0,09	5.656	Ferguson Plc	768.115	0,21
5.100	Daikin Industries Ltd	1.004.975	0,28	128.455	Glencore Plc	585.106	0,16
3.600	Denso Corp	246.359	0,07	19.094	Janus Henderson Group Plc [^]	735.310	0,21
1.200	Dowa Holdings Co Ltd	49.635	0,01			2.301.375	0,64
1.300	Ebara Corp	64.028	0,02	Pays-Bas			
50.000	ENEOS Holdings Inc	206.357	0,06	7.754	Akzo Nobel NV	997.399	0,28
1.400	FANUC Corp	335.826	0,09	2.744	ASML Holding NV	1.845.512	0,52
1.100	Fast Retailing Co Ltd	894.628	0,25	5.949	Heineken NV	711.496	0,20
4.400	Hitachi Transport System Ltd	140.058	0,04	2.970	JDE Peet's NV	118.488	0,03
7.800	Honda Motor Co Ltd	238.539	0,07	18.420	Koninklijke Ahold Delhaize NV	532.883	0,15
123.100	Inpex Corp [^]	845.442	0,24	17.493	NN Group NV	886.389	0,25
6.000	Japan Post Holdings Co Ltd	49.843	0,01	7.464	PostNL NV	43.842	0,01
9.700	Kansai Paint Co Ltd	261.433	0,07	5.966	Randstad NV	466.998	0,13
57.000	KDDI Corp	1.932.406	0,54	5.886	Stellantis NV	117.461	0,03
1.500	Keyence Corp	737.003	0,21	3.697	STMicroelectronics NV [^]	138.851	0,04
13.800	Komatsu Ltd	403.150	0,11			5.859.319	1,64
800	Kyowa Exeo Corp	19.628	0,01	Nouvelle-Zélande			
1.400	Lintec Corp	30.876	0,01	51.462	Air New Zealand Ltd	62.467	0,02
11.500	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	91.841	0,03	11.035	Contact Energy Ltd	63.204	0,02
5.800	Mitsubishi Corp	157.855	0,04	23.671	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	512.545	0,14
38.300	Mitsubishi Materials Corp	810.434	0,23				
1.900	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	56.061	0,02				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Nouvelle-Zélande suite				Royaume-Uni suite			
64.253	Mercury NZ Ltd	306.133	0,09	10.747	British Land Co Plc (REIT)*		
42.534	Meridian Energy Ltd	161.690	0,04		77.665	0,02	
2.103	Xero Ltd	215.903	0,06	20.626	Compass Group Plc	470.117	0,13
		1.321.942	0,37	484	Croda International Plc	47.926	0,01
Norvège				7.650	Dunelm Group Plc	159.132	0,04
104.260	Equinor ASA	2.263.002	0,63	46.838	GlaxoSmithKline Plc	892.139	0,25
11.326	Norsk Hydro ASA	74.263	0,02	9.974	HomeServe Plc	132.074	0,04
		2.337.265	0,65	5.307	Howden Joinery Group Plc	59.935	0,02
Portugal				93.712	HSBC Holdings Plc	604.593	0,17
20.573	Galp Energia SGPS SA	255.718	0,07	580	InterContinental Hotels Group Plc	40.444	0,01
		255.718	0,07	6.947	International Game Technology Plc	168.534	0,05
Singapour				167.199	ITV Plc	304.207	0,09
10.400	DBS Group Holdings Ltd	236.287	0,07	238.294	J Sainsbury Plc*	896.832	0,25
37.508	Flex Ltd	685.271	0,19	62.680	John Wood Group Plc	217.514	0,06
149.400	Keppel Corp Ltd	602.461	0,17	10.037	Johnson Matthey Plc	433.215	0,12
9.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	84.161	0,02	153.909	Kingfisher Plc	785.775	0,22
202.700	Singapore Telecommunications Ltd	369.591	0,10	1.982.362	Lloyds Banking Group Plc	1.401.414	0,39
		1.977.771	0,55	6.464	Micro Focus International Plc	47.629	0,01
Espagne				1.236	National Grid Plc	16.449	0,01
207	Acciona SA	34.912	0,01	158.482	Natwest Group Plc	464.858	0,13
104.108	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	654.452	0,18	26.618	RELX Plc	693.629	0,19
36.400	Iberdrola SA	490.870	0,14	7.843	Rightmove Plc	67.015	0,02
5.221	Industria de Diseno Textil SA	202.174	0,06	2.412	Rio Tinto Plc	207.256	0,06
1.695	Naturgy Energy Group SA	44.454	0,01	2.810	Smiths Group Plc	61.698	0,02
8.843	Repsol SA	118.669	0,03	6.076	SSE Plc	132.762	0,04
1.391	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	45.648	0,01	84.475	Standard Chartered Plc	607.842	0,17
		1.591.179	0,44	21.193	Taylor Wimpey Plc	51.472	0,01
Suède				4.186	Unilever Plc	250.698	0,07
21.881	Assa Abloy AB 'B'	676.859	0,19	257.434	Vodafone Group Plc	468.018	0,13
18.076	Atlas Copco AB 'A'	1.102.617	0,31	159.779	Wm Morrison Supermarkets Plc	400.401	0,11
3.495	Atlas Copco AB 'B'	181.495	0,05			12.983.816	3,62
8.578	Epiroc AB 'B'	172.192	0,05	États-Unis			
8.578	Epiroc AB 'B'	3.093	0,00	11.115	AbbVie Inc	1.258.218	0,35
136	Evolution AB	26.009	0,01	1.566	ABIOMED Inc	445.652	0,12
10.418	Hennes & Mauritz AB 'B'	267.676	0,07	6.242	Adobe Inc	3.149.588	0,88
1.679	Intrum AB	58.883	0,02	518	Advanced Drainage Systems Inc	58.752	0,02
1.489	Kinnevik AB 'B'	56.727	0,01	13.628	Advanced Micro Devices Inc	1.091.330	0,30
1.489	Kinnevik AB 'B'	28.372	0,01	7.067	Agilent Technologies Inc	976.165	0,27
4.325	SKF AB 'B'	117.201	0,03	2.521	Alaska Air Group Inc*	174.453	0,05
51.045	Tele2 AB 'B'	692.239	0,19	353	Alexion Pharmaceuticals Inc	62.322	0,02
85.683	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	1.139.760	0,32	1.925	Align Technology Inc	1.136.039	0,32
8.132	Volvo AB 'B'	214.677	0,06	83	Alleghany Corp	59.475	0,02
		4.737.800	1,32	355	Allegiant Travel Co	78.618	0,02
Suisse				22.628	Ally Financial Inc	1.237.978	0,35
2.388	Adecco Group AG Reg	165.644	0,05	2.150	Alphabet Inc 'A'	5.067.228	1,41
363	Chubb Ltd	61.706	0,02	1.150	Alphabet Inc 'C'	2.773.294	0,77
521	Givaudan SA Reg	2.330.021	0,65	2.181	Amazon.com Inc	7.029.516	1,96
1.780	Kuehne + Nagel International AG Reg*	600.746	0,17	174	Amedisys Inc	44.956	0,01
6.228	Nestle SA Reg	767.598	0,21	17.740	American Express Co*	2.840.706	0,79
2.352	Roche Holding AG	818.609	0,23	5.253	American International Group Inc	277.569	0,08
10	SGS SA Reg	31.240	0,01	1.558	American Tower Corp (REIT)	398.007	0,11
1.679	Sika AG Reg*	540.741	0,15	628	Ameriprise Financial Inc	163.180	0,05
13.346	Swiss Re AG	1.284.726	0,36	4.323	Amgen Inc	1.028.615	0,29
43.195	UBS Group AG Reg	702.288	0,19	1.549	Anthem Inc	616.843	0,17
		7.303.319	2,04	107.192	Apple Inc	13.357.195	3,73
Royaume-Uni				13.198	Applied Materials Inc	1.823.040	0,51
1	Associated British Foods Plc	33	0,00	62.014	AT&T Inc	1.825.072	0,51
16.800	AstraZeneca Plc	1.915.399	0,53	2.724	Autodesk Inc	778.683	0,22
209.108	BP Plc	907.141	0,25	5.138	Automatic Data Processing Inc	1.007.151	0,28
				25.766	Baker Hughes Co	628.690	0,18
				6.867	Bank of America Corp	291.092	0,08
				20.041	Bank of New York Mellon Corp*	1.043.735	0,29
				6.108	Berkshire Hathaway Inc 'B'	1.767.900	0,49
				1.833	Best Buy Co Inc	213.068	0,06
				1.550	Biogen Inc	414.594	0,12

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de	% de			Valeur de	% de
Nombre	Description	marché	l'actif	Nombre	Description	marché	l'actif
		USD	net			USD	net
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.823	BioMarin Pharmaceutical Inc	140.918	0,04	8.645	Home Depot Inc	2.756.977	0,77
468	Booking Holdings Inc	1.105.205	0,31	9.330	HP Inc	272.716	0,08
11.287	BorgWarner Inc	578.910	0,16	1.122	HubSpot Inc	565.914	0,16
37.720	Bristol-Myers Squibb Co	2.478.958	0,69	2.300	Humana Inc	1.006.710	0,28
762	Builders FirstSource Inc	33.939	0,01	14.737	Huntington Bancshares Inc	233.729	0,06
4.278	Cadence Design Systems Inc	543.263	0,15	1.761	IDEXX Laboratories Inc	982.832	0,27
13.748	Carrier Global Corp	631.446	0,18	941	Illinois Tool Works Inc	218.086	0,06
5.057	Caterpillar Inc	1.219.142	0,34	1.346	Illumina Inc	545.991	0,15
22.969	CBRE Group Inc 'A'	2.016.219	0,56	147	Ingersoll Rand Inc	7.297	0,00
4.523	Centene Corp	332.893	0,09	2.373	Insulet Corp	639.927	0,18
4.324	Cerner Corp	338.353	0,09	52.473	Intel Corp	2.997.258	0,84
7.741	CH Robinson Worldwide Inc	751.032	0,21	7.203	International Business		
8.101	Charles Schwab Corp	598.259	0,17		Machines Corp	1.035.359	0,29
22.003	Chevron Corp	2.283.691	0,64	6.658	Intuit Inc [^]	2.923.461	0,82
39	Chipotle Mexican Grill Inc	53.507	0,01	1.712	Itron Inc	163.239	0,05
6.743	Cigna Corp	1.745.426	0,49	1.134	ITT Inc	106.483	0,03
4.459	Cisco Systems Inc	235.881	0,07	4.539	J M Smucker Co	605.003	0,17
4.656	Citigroup Inc	366.474	0,10	23.449	Johnson & Johnson	3.968.743	1,11
4.917	Clorox Co	868.981	0,24	16.525	JPMorgan Chase & Co	2.714.066	0,76
1.436	CME Group Inc	314.139	0,09	265	Kansas City Southern	78.885	0,02
38.914	Coca-Cola Co	2.151.555	0,60	28.664	Kellogg Co	1.877.205	0,52
5.239	Cognizant Technology			10.512	KeyCorp	242.196	0,07
	Solutions Corp 'A'	374.903	0,10	470	Keysight Technologies Inc	66.919	0,02
30.107	Colgate-Palmolive Co	2.522.364	0,70	85.720	Kinder Morgan Inc	1.572.105	0,44
1.022	Columbia Sportswear Co	104.990	0,03	225	Laboratory Corp of America		
27.359	Comcast Corp 'A'	1.568.765	0,44		Holdings	61.758	0,02
26.987	Conagra Brands Inc	1.028.205	0,29	1.421	Lam Research Corp	923.437	0,26
987	ConocoPhillips	55.015	0,02	3.084	Lennar Corp 'A'	305.347	0,08
15.843	Consolidated Edison Inc	1.223.713	0,34	566	Lennox International Inc	198.060	0,06
3.134	Corning Inc	136.736	0,04	825	LHC Group Inc	162.401	0,05
4.556	Costco Wholesale Corp	1.723.398	0,48	1.781	Lincoln National Corp	124.296	0,03
3.323	CSX Corp	332.699	0,09	4.559	LKQ Corp	232.327	0,06
2.896	Cummins Inc	745.083	0,21	7.879	Lowe's Cos Inc	1.535.066	0,43
33.678	CVS Health Corp	2.911.126	0,81	8.772	Marsh & McLennan Cos Inc	1.213.606	0,34
183	Danaher Corp	46.874	0,01	13.983	Masco Corp	843.315	0,24
613	Deckers Outdoor Corp	205.625	0,06	7.023	Mastercard Inc 'A'	2.532.353	0,71
3.146	Deere & Co	1.136.021	0,32	6.954	McDonald's Corp	1.626.471	0,45
12.517	Delta Air Lines Inc	596.811	0,17	2.618	McKesson Corp	503.677	0,14
910	DexCom Inc	336.145	0,09	2.201	MDU Resources Group Inc	74.086	0,02
1.347	Donaldson Co Inc	82.962	0,02	385	MercadoLibre Inc	523.088	0,15
970	DR Horton Inc	92.431	0,03	1.818	Mercury Systems Inc	118.988	0,03
5.693	eBay Inc	346.590	0,10	32.411	MetLife Inc [^]	2.118.383	0,59
3.551	Ecolab Inc	763.749	0,21	409	Mettler-Toledo International Inc	532.089	0,15
3.192	Edison International	178.337	0,05	751	MGM Resorts International	32.195	0,01
3.750	Edwards Lifesciences Corp	359.625	0,10	38.190	Microsoft Corp	9.535.279	2,66
3.113	Eli Lilly and Co	621.791	0,17	931	Moderna Inc	172.244	0,05
438	EMCOR Group Inc	55.236	0,02	7.684	Molson Coors Beverage Co 'B'	448.131	0,12
5.942	EOG Resources Inc	477.380	0,13	29.957	Morgan Stanley	2.724.589	0,76
2.020	Equinix Inc (REIT) [^]	1.488.174	0,42	1.250	Netflix Inc	628.513	0,18
6.406	Equity Residential (REIT)	496.145	0,14	13.414	New York Community Bancorp		
296	Estee Lauder Cos Inc 'A'	90.730	0,03		Inc	160.566	0,04
1.405	Etsy Inc	231.446	0,06	13.338	NextEra Energy Inc	976.608	0,27
11.191	Exelon Corp	504.938	0,14	6.671	NIKE Inc 'B'	910.325	0,25
19.751	Expeditors International of			4.920	NVIDIA Corp	3.196.918	0,89
	Washington Inc [^]	2.482.503	0,69	527	Okta Inc	117.226	0,03
11.014	Facebook Inc 'A'	3.620.632	1,01	1.618	Oshkosh Corp	212.670	0,06
76	FactSet Research Systems Inc	25.411	0,01	5.590	Otis Worldwide Corp	437.865	0,12
3.756	FedEx Corp	1.182.426	0,33	471	Owens Corning	50.232	0,01
15.184	Fidelity National Information			5.950	Paychex Inc	601.783	0,17
	Services Inc	2.262.112	0,63	11.408	PayPal Holdings Inc	2.966.308	0,83
6.296	Flowserve Corp [^]	266.887	0,07	17.657	PepsiCo Inc	2.612.177	0,73
9.439	Genuine Parts Co	1.237.642	0,35	9.372	Pfizer Inc	362.978	0,10
10.464	Gilead Sciences Inc	691.775	0,19	1.357	Phillips 66	114.287	0,03
1.356	Hartford Financial Services			1.942	PPG Industries Inc	349.016	0,10
	Group Inc	88.615	0,02	5.137	Procter & Gamble Co	692.724	0,19
2.486	Hasbro Inc	238.581	0,07	2.390	Progressive Corp	236.801	0,07
2.312	HCA Healthcare Inc	496.594	0,14	7.395	Prologis Inc (REIT)	871.427	0,24
69.099	Hewlett Packard Enterprise Co	1.102.820	0,31	2.882	PTC Inc	386.591	0,11
528	Hexcel Corp	31.395	0,01	4.936	PulteGroup Inc	285.251	0,08
3.497	Hilton Worldwide Holdings Inc	438.069	0,12	10.564	QUALCOMM Inc	1.421.281	0,40
13.208	Hologic Inc	832.897	0,23	872	Quidel Corp	102.992	0,03

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	8.793	USD	10.627	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	106
USD	345	EUR	284	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1)
						105
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	1.112.004.496	USD	10.187.536	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(44.241)
USD	287.170	JPY	31.329.593	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1.393
						(42.848)
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 10.440.152)						(42.743)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	20,97
Finance	19,20
Technologie	17,27
Communications	10,81
Biens de consommation cyclique	10,49
Valeurs industrielles	10,19
Matériaux de base	4,80
Énergie	3,07
Services aux collectivités	1,95
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,75
Autres éléments de l'actif net	1,25
	100,00

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Chine suite				France suite			
26.000	China Construction Bank Corp 'H'	21.373	0,01	31	Faurecia SE	1.684	0,00
98.400	China Everbright Bank Co Ltd 'A'	59.170	0,03	248	Hermes International	350.026	0,19
5.000	China Life Insurance Co Ltd 'H'	10.540	0,01	341	Imerys SA	17.878	0,01
16.000	China Merchants Bank Co Ltd 'A'	146.176	0,08	401	Kering SA	366.840	0,20
9.939	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A'	7.365	0,00	2.372	Legrand SA	249.415	0,13
58.100	China Petroleum & Chemical Corp 'A'	40.319	0,02	2.525	L'Oreal SA	1.137.078	0,61
16.200	China Railway Group Ltd 'A'	13.709	0,01	125	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE [^]	99.997	0,05
55.704	China Vanke Co Ltd 'A'	233.510	0,13	690	Pernod Ricard SA	152.290	0,08
3.500	China Yangtze Power Co Ltd 'A'	10.913	0,01	14.947	Rexel SA [^]	304.995	0,17
1.700	Contemporary Amperex Technology Co Ltd 'A'	115.864	0,06	1.318	Rubis SCA	63.696	0,03
19.320	East Money Information Co Ltd 'A'	96.459	0,05	286	Sodexo SA	27.762	0,02
1.400	Ganfeng Lithium Co Ltd 'H'	21.015	0,01	3.973	Valeo SA	130.041	0,07
15.700	Greenland Holdings Corp Ltd 'A'	14.346	0,01			3.882.551	2,10
2.000	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd 'A'	37.492	0,02	Allemagne			
143.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	93.969	0,05	514	adidas AG	188.374	0,10
31.500	Industrial Bank Co Ltd 'A'	114.293	0,06	269	Bayerische Motoren Werke AG	28.577	0,02
11.100	Jinke Properties Group Co Ltd 'A'	10.509	0,01	7.243	Beiersdorf AG	856.357	0,46
113.700	PetroChina Co Ltd 'A'	82.473	0,05	18.318	Daimler AG	1.713.087	0,93
40.000	PetroChina Co Ltd 'H'	16.338	0,01	4.626	Deutsche Post AG Reg	314.797	0,17
2.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	21.763	0,01	223	DWS Group GmbH & Co KGaA	10.701	0,01
43.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H'	30.971	0,02	1.056	Evonik Industries AG	37.915	0,02
3.200	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd 'A'	49.482	0,03	315	Fielmann AG	25.334	0,01
5.967	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd 'A'	452.493	0,24	3.650	HelloFresh SE	332.481	0,18
2.100	Spring Airlines Co Ltd 'A'	21.510	0,01	971	Rheinmetall AG	100.892	0,05
4.400	Wanhua Chemical Group Co Ltd 'A'	75.147	0,04	7.461	Schaeffler AG (Pref)	70.521	0,04
2.000	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai 'A'	94.513	0,05	5.721	Siemens AG Reg	927.198	0,50
1.440	WuXi AppTec Co Ltd 'H'	30.837	0,02	453	Talanx AG	19.117	0,01
		2.555.295	1,38	439	Volkswagen AG	157.191	0,09
				191	Volkswagen AG (Pref)	53.356	0,03
				413	Zalando SE	44.001	0,02
						4.879.899	2,64
Danemark				Hong Kong			
186	AP Moller - Maersk A/S 'A'	490.522	0,27	30.400	AIA Group Ltd	388.566	0,21
291	AP Moller - Maersk A/S 'B'	802.530	0,43	117.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd [^]	424.669	0,23
668	Coloplast A/S 'B'	105.502	0,06	6.000	Hang Lung Properties Ltd	15.137	0,01
2.631	Novo Nordisk A/S 'B'	208.112	0,11	8.000	Henderson Land Development Co Ltd	38.242	0,02
		1.606.666	0,87	4.000	Hysan Development Co Ltd	15.488	0,01
				831	I-CABLE Communications Ltd	10	0,00
Finlande				Hongrie			
835	Kone Oyj 'B'	67.562	0,03	20.000	Lenovo Group Ltd	23.966	0,01
2	Neles Oyj	30	0,00	39.000	Link REIT (REIT)	371.354	0,20
52.798	Nordea Bank Abp	569.307	0,31	94.000	MTR Corp Ltd	523.228	0,28
		636.899	0,34	5.000	New World Development Co Ltd	26.962	0,02
				6.500	Sun Hung Kai Properties Ltd	99.832	0,05
France				Irlande			
909	Amundi SA [^]	80.982	0,04	2.000	Swire Pacific Ltd 'A'	15.024	0,01
11.819	AXA SA	326.846	0,18	68.600	Swire Properties Ltd	201.971	0,11
2.856	BNP Paribas SA	195.569	0,11	2.000	Techtronic Industries Co Ltd	36.928	0,02
3.180	Casino Guichard Perrachon SA	102.494	0,06	6.000	Vitasoy International Holdings Ltd	23.463	0,01
2.047	CNP Assurances	37.110	0,02			2.204.840	1,19
1.457	Constellium SE	26.022	0,01	Hongrie			
10.994	Engie SA	163.742	0,09	14.227	MOL Hungarian Oil & Gas Plc [^]	114.081	0,06
3.774	Eutelsat Communications SA	48.084	0,03	2.241	OTP Bank Nyrt [^]	122.775	0,07
						236.856	0,13
				Irlande			
				6.878	Accenture Plc 'A'	1.940.696	1,05
				2.852	Allegion Plc	400.649	0,22
				882	Flutter Entertainment Plc (traded in Ireland)	165.765	0,09
				954	Flutter Entertainment Plc (traded in United Kingdom)	178.575	0,10
				1.652	Kingspan Group Plc	155.240	0,08
				2.917	Linde Plc	876.850	0,47

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Irlande suite				Japon suite			
3.120	Medtronic Plc	394.961	0,21	5.000	NOK Corp	61.337	0,03
807	Perrigo Co Plc	37.235	0,02	900	Nomura Research Institute Ltd	28.648	0,02
		4.149.971	2,24	2.100	Obayashi Corp	17.660	0,01
Israël				100	Obic Co Ltd	18.716	0,01
39.468	Bank Hapoalim BM	335.580	0,18	200	Omron Corp	15.724	0,01
8.344	Check Point Software Technologies Ltd	976.081	0,53	14.300	Panasonic Corp [^]	162.642	0,09
32.473	Israel Discount Bank Ltd 'A'	161.602	0,09	500	Pigeon Corp	14.069	0,01
396	Nice Ltd	86.804	0,05	18.100	Recruit Holdings Co Ltd	917.051	0,50
19.119	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	202.598	0,11	300	Relo Group Inc	6.088	0,00
38.381	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	399.162	0,21	33.000	Ricoh Co Ltd	390.679	0,21
		2.161.827	1,17	600	Sekisui House Ltd	12.466	0,01
Italie				400	Shimano Inc	90.478	0,05
13.029	Pirelli & C SpA	77.356	0,04	300	SMC Corp	179.278	0,10
20.029	Unipol Gruppo SpA	112.220	0,06	7.800	SoftBank Corp [^]	100.061	0,05
		189.576	0,10	4.300	SoftBank Group Corp [^]	323.794	0,17
Japon				7.000	Subaru Corp [^]	136.022	0,07
1.100	AEON Financial Service Co Ltd	12.772	0,01	114.400	Sumitomo Chemical Co Ltd	626.049	0,34
6.600	Aisin Corp [^]	288.946	0,16	1.500	Sumitomo Corp	20.905	0,01
19.400	Alps Alpine Co Ltd	208.262	0,11	700	Sumitomo Electric Industries Ltd	10.704	0,01
5.500	Amada Co Ltd	58.391	0,03	800	Sumitomo Heavy Industries Ltd	24.699	0,01
14.400	Asahi Kasei Corp	158.263	0,09	14.200	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	511.713	0,28
1.100	Bandai Namco Holdings Inc	78.667	0,04	40.600	Sumitomo Rubber Industries Ltd	524.349	0,28
3.200	Benesse Holdings Inc [^]	73.375	0,04	3.300	Suntory Beverage & Food Ltd	121.447	0,07
10.800	Bridgestone Corp	473.411	0,26	1.700	T&D Holdings Inc	23.103	0,01
500	Canon Marketing Japan Inc	11.656	0,01	400	Taisei Corp	13.937	0,01
1.200	Casio Computer Co Ltd	20.850	0,01	900	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	30.528	0,02
2.600	Credit Saison Co Ltd	31.990	0,02	7.500	Tokio Marine Holdings Inc	354.273	0,19
6.000	Dai Nippon Printing Co Ltd	129.095	0,07	600	Tokyo Electron Ltd	266.290	0,14
100	Daikin Industries Ltd	19.705	0,01	1.200	Tokyo Gas Co Ltd	23.712	0,01
1.500	Daiwa House Industry Co Ltd	43.862	0,02	9.400	Toray Industries Inc	60.923	0,03
1.600	DIC Corp	40.788	0,02	1.100	Toshiba Corp	46.101	0,02
300	Disco Corp	91.937	0,05	200	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	2.736	0,00
200	Ebara Corp	9.850	0,01	900	Toyota Motor Corp	74.822	0,04
1.600	FANUC Corp	383.802	0,21	43.000	Yamada Holdings Co Ltd	208.647	0,11
600	Fast Retailing Co Ltd	487.979	0,26	2.500	Yokohama Rubber Co Ltd	50.301	0,03
1.200	Haseko Corp	16.800	0,01			11.674.175	6,31
11.800	Honda Motor Co Ltd [^]	360.866	0,19	Jersey			
24.800	Inpex Corp	170.325	0,09	1.236	Amcor Plc	14.585	0,01
8.100	Japan Post Bank Co Ltd	68.781	0,04	5.416	Experian Plc	207.441	0,11
48.300	Japan Post Holdings Co Ltd [^]	401.237	0,22	11.181	Glencore Plc	50.929	0,03
2.200	Japan Tobacco Inc	43.392	0,02	3.417	Janus Henderson Group Plc	131.588	0,07
3.300	JTEKT Corp	34.342	0,02	747	WPP Plc	10.310	0,00
9.900	KDDI Corp	335.628	0,18			414.853	0,22
2.000	Keyence Corp	982.671	0,53	Luxembourg			
1.400	Koito Manufacturing Co Ltd [^]	90.788	0,05	4.761	Aroundtown SA	39.929	0,02
1.000	Lintec Corp	22.054	0,01	673	Globant SA	146.626	0,08
200	MEIJI Holdings Co Ltd	12.404	0,01	2.819	RTL Group SA	168.782	0,09
8.800	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	70.278	0,04			355.337	0,19
5.800	Mitsubishi Corp	157.855	0,09	Malaisie			
10.000	Mitsubishi Materials Corp	211.602	0,11	108.900	AirAsia Group Bhd	22.047	0,01
2.200	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	64.912	0,03	6.400	Bursa Malaysia Bhd	12.677	0,01
1.000	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	30.491	0,02	65.300	CIMB Group Holdings Bhd	67.762	0,04
400	NGK Spark Plug Co Ltd	6.290	0,00	56.900	Dialog Group Bhd	39.869	0,02
1.500	NHK Spring Co Ltd	11.985	0,01	8.200	Hartalega Holdings Bhd	17.893	0,01
600	Nidec Corp	68.570	0,04	14.900	Hong Leong Bank Bhd	66.471	0,04
26.300	Nikon Corp	269.141	0,15	116.100	IHH Healthcare Bhd	149.189	0,08
3.000	Nippon Paint Holdings Co Ltd	43.342	0,02	26.800	Inari Amertron Bhd	20.793	0,01
2.400	Nippon Telegraph & Telephone Corp	64.170	0,03	20.500	Kossan Rubber Industries	20.130	0,01
2.200	Nippon Television Holdings Inc	26.226	0,01	1.700	Kuala Lumpur Kepong Bhd	9.150	0,00
400	Nippon Yusen KK	16.472	0,01	218.500	Malayan Banking Bhd	433.345	0,23
				83.600	Maxis Bhd	94.251	0,05
				40.400	MISC Bhd	67.292	0,04
				17.300	MR DIY Group M Bhd	16.778	0,01

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Malaisie suite				Afrique du Sud suite			
2.500	Petronas Chemicals Group Bhd	4.879	0,00	15.281	FirstRand Ltd	62.269	0,03
3.700	PPB Group Bhd	16.614	0,01	909	Gold Fields Ltd	11.348	0,01
157.200	Press Metal Aluminium Holdings Bhd	198.191	0,11	1.863	Naspers Ltd 'N'	412.646	0,22
480.500	Public Bank Bhd	490.461	0,26	6.663	Sanlam Ltd	28.842	0,02
109.300	RHB Bank Bhd	140.451	0,08	16.589	Standard Bank Group Ltd	164.225	0,09
28.200	Sime Darby Bhd	15.657	0,01			761.481	0,41
16.904	Supermax Corp Bhd	16.927	0,01	Corée du Sud			
35.600	Telekom Malaysia Bhd	53.083	0,03	1	Celltrion Inc	247	0,00
4.800	Tenaga Nasional Bhd	11.580	0,01	247	Hyundai Mobis Co Ltd	62.247	0,03
10.100	Westports Holdings Bhd	10.554	0,00	914	Kakao Corp	101.185	0,06
		1.996.044	1,08	695	Korea Electric Power Corp	16.139	0,01
				151	Korea Zinc Co Ltd	61.362	0,03
Îles Marshall				1.288	KT Corp	39.647	0,02
294	Danaos Corp	18.737	0,01	401	LG Chem Ltd	295.593	0,16
		18.737	0,01	5	LG Household & Health Care Ltd	7.016	0,00
Mexique				1.074	NAVER Corp	350.412	0,19
413.955	America Movil SAB de CV 'L'	320.507	0,17	80	NCSOFT Corp	62.500	0,03
9.568	Arca Continental SAB de CV	53.765	0,03	506	POSCO	161.676	0,09
2.762	Coca-Cola Femsa SAB de CV (Unit)	13.422	0,01	8.378	Samsung Electronics Co Ltd	607.020	0,33
22.317	Grupo Bimbo SAB de CV 'A'	49.045	0,03			1.765.044	0,95
30.425	Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	209.427	0,11	Suède			
10.609	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV 'O'	10.650	0,00	3.737	Assa Abloy AB 'B'	115.599	0,06
7.006	Grupo Mexico SAB de CV 'B'	33.990	0,02	13.392	Atlas Copco AB 'A'	816.898	0,44
		690.806	0,37	2.545	Electrolux AB 'B'	72.096	0,04
Pays-Bas				1.140	Epiroc AB 'A'	25.922	0,01
4.440	ABN AMRO Bank NV - CVA	59.474	0,03	1.140	Epiroc AB 'A'	412	0,00
728	Akzo Nobel NV	93.643	0,05	1.420	Epiroc AB 'B'	28.505	0,02
218	Flow Traders	9.503	0,01	1.420	Epiroc AB 'B'	512	0,00
2.380	Heineken NV	284.646	0,15	24.147	Hennes & Mauritz AB 'B'	620.423	0,34
4.003	JDE Peet's NV	159.699	0,09	856	Intrum AB	30.020	0,02
22.582	Koninklijke Ahold Delhaize NV	653.288	0,35	2.991	Kinnevik AB 'B'	113.949	0,06
1.730	NN Group NV	87.661	0,05	2.991	Kinnevik AB 'B'	56.992	0,03
293	NXP Semiconductors NV	61.946	0,03	4.932	Loomis AB	155.836	0,08
12.634	PostNL NV	74.210	0,04	9.892	Saab AB 'B'	285.715	0,15
18.831	Randstad NV*	1.474.025	0,80	5.160	SKF AB 'B'	139.829	0,08
561	Signify NV	34.849	0,02	3.360	Swedish Match AB	31.193	0,02
4.116	Stellantis NV	82.139	0,04	55.787	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	742.082	0,40
2.032	Technip Energies NV	30.874	0,02	6.708	Trelleborg AB 'B'	172.636	0,09
		3.105.957	1,68	9.728	Volvo AB 'B**'	256.810	0,14
Nouvelle-Zélande						3.665.429	1,98
550	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	11.909	0,01	Suisse			
		11.909	0,01	4.537	Adecco Group AG Reg	314.711	0,17
Norvège				587	Chubb Ltd	99.784	0,05
2.296	Equinor ASA	49.836	0,03	1.441	Cie Financiere Richemont SA 'A' Reg	175.074	0,10
		49.836	0,03	7.630	Credit Suisse Group AG Reg*	83.481	0,05
Russie				73	Givaudan SA Reg	326.471	0,18
1.122	LUKOIL PJSC	91.801	0,05	435	Kuehne + Nagel International AG Reg*	146.812	0,08
170	MMC Norilsk Nickel PJSC	61.196	0,03	16	Schindler Holding AG Reg	4.631	0,00
		152.997	0,08	2.029	Sika AG Reg*	653.462	0,35
Singapour				725	Swatch Group AG	263.124	0,14
1.400	DBS Group Holdings Ltd	31.808	0,02	1.910	Swatch Group AG Reg	132.148	0,07
3.656	Flex Ltd	66.795	0,04			2.199.698	1,19
30.900	Singapore Telecommunications Ltd	56.341	0,03	Taiwan			
2.400	United Overseas Bank Ltd	47.337	0,02	2.000	ASE Technology Holding Co Ltd	8.078	0,00
37.400	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	42.444	0,02	34.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	68.850	0,04
		244.725	0,13	60.000	China Airlines Ltd	38.145	0,02
Afrique du Sud				73.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	60.954	0,03
3.337	AngloGold Ashanti Ltd	82.151	0,04	42.000	Delta Electronics Inc	450.353	0,24
				350.000	Eva Airways Corp	215.541	0,12
				59.000	Fubon Financial Holding Co Ltd	154.526	0,08

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Taiwan suite				États-Unis suite			
12.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	49.339	0,03	2.745	Advanced Micro Devices Inc	219.820	0,12
1.000	Largan Precision Co Ltd	109.763	0,06	1.475	AES Corp	37.480	0,02
25.000	MediaTek Inc	901.105	0,49	1.112	Affiliated Managers Group Inc	182.368	0,10
1.000	momo.com Inc	44.919	0,02	2.162	Aflac Inc	122.542	0,07
3.000	Novatek Microelectronics Corp	58.033	0,03	786	AGCO Corp	108.759	0,06
22.000	Realtek Semiconductor Corp	397.682	0,22	1.070	Agilent Technologies Inc	147.799	0,08
94.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.032.893	1,10	791	Alaska Air Group Inc	54.737	0,03
31.000	Tung Ho Steel Enterprise Corp	54.296	0,03	3.513	Albertsons Cos Inc	67.414	0,04
114.000	Uni-President Enterprises Corp	303.945	0,16	1.453	Alcoa Corp	57.641	0,03
		4.948.422	2,67	451	Alexion Pharmaceuticals Inc	79.624	0,04
Thaïlande				1.970	Align Technology Inc	1.162.595	0,63
7.500	Gulf Energy Development PCL	8.104	0,00	951	Alleghany Corp	681.458	0,37
		8.104	0,00	329	Allegiant Travel Co	72.860	0,04
Turquie				411	Alliance Data Systems Corp	49.752	0,03
124.035	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	230.640	0,12	1.166	Allison Transmission Holdings Inc	49.333	0,03
34.930	Turkiye Garanti Bankasi AS	32.846	0,02	442	Allstate Corp	60.382	0,03
41.854	Yapi ve Kredi Bankasi AS	10.640	0,01	1.006	Ally Financial Inc	55.038	0,03
		274.126	0,15	841	Alphabet Inc 'A'	1.982.111	1,07
Royaume-Uni				830	Alphabet Inc 'C'	2.001.595	1,08
1.397	AngloAmerican Plc	62.059	0,03	4.753	Altria Group Inc	233.943	0,13
2.537	AstraZeneca Plc	289.248	0,16	1.193	Amazon.com Inc	3.845.122	2,08
5.100	Aviva Plc	29.716	0,02	4.716	American Eagle Outfitters Inc	167.088	0,09
2.555	BHP Group Plc	76.862	0,04	1.854	American Express Co	296.881	0,16
110.477	BP Plc	479.266	0,26	2.368	American International Group Inc	125.125	0,07
6.338	British American Tobacco Plc*	243.653	0,13	320	Ameriprise Financial Inc	83.149	0,04
1.910	British Land Co Plc (REIT)	13.803	0,01	1.967	Amgen Inc	468.028	0,25
46.479	Centrica Plc	35.999	0,02	4.582	Antero Midstream Corp	43.987	0,02
1.533	Compass Group Plc	34.941	0,02	696	Anthem Inc	277.161	0,15
18.065	Diageo Plc	871.360	0,47	47.561	Apple Inc	5.926.576	3,20
3.456	Dunelm Group Plc	71.890	0,04	599	Aramark	22.373	0,01
11.003	GlaxoSmithKline Plc	209.578	0,11	19.748	AT&T Inc	581.184	0,31
26.781	HSBC Holdings Plc	172.780	0,09	405	Autodesk Inc	115.773	0,06
2.299	Imperial Brands Plc	52.123	0,03	1.889	Autoliv Inc	200.291	0,11
1.983	Intertek Group Plc	152.522	0,08	510	Baker Hughes Co	12.444	0,01
19.994	ITV Plc	36.378	0,02	85	Bank OZK	3.630	0,00
3.871	J Sainsbury Plc	14.569	0,01	2	Berkshire Hathaway Inc 'A'	872.000	0,47
3.714	JD Sports Fashion Plc	49.743	0,03	1.623	Berkshire Hathaway Inc 'B'	469.761	0,25
2.175	JET2 Plc	41.607	0,02	6.302	Berry Global Group Inc	429.859	0,23
16.837	John Wood Group Plc	58.428	0,03	748	Biogen Inc	200.075	0,11
8.728	Johnson Matthey Plc	376.717	0,20	1.670	BioMarin Pharmaceutical Inc	129.091	0,07
73.918	Kingfisher Plc*	377.385	0,20	322	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	193.963	0,10
243.555	Lloyds Banking Group Plc*	172.179	0,09	775	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	24.823	0,01
45.257	Marks & Spencer Group Plc	106.070	0,06	1.486	Boeing Co	367.072	0,20
8.410	Meggitt Plc	60.657	0,03	102	Booking Holdings Inc	240.878	0,13
34.652	Micro Focus International Plc	255.330	0,14	375	Booz Allen Hamilton Holding Corp	31.849	0,02
4.131	RELX Plc	107.648	0,06	5.515	BorgWarner Inc	282.864	0,15
35.155	Rentokil Initial Plc	236.022	0,13	3.638	Brighthouse Financial Inc	177.025	0,10
37.434	Rightmove Plc*	319.855	0,17	20.173	Bristol-Myers Squibb Co	1.325.770	0,72
139	Rio Tinto Plc	11.944	0,01	842	Broadcom Inc	397.702	0,21
11.357	Royal Dutch Shell Plc 'A'	216.546	0,12	3.712	Brown & Brown Inc	194.954	0,10
10.263	Royal Dutch Shell Plc 'B'	186.670	0,10	341	Bruker Corp	23.679	0,01
19.044	Royal Mail Plc	156.137	0,09	1.033	Brunswick Corp	105.604	0,06
13.417	Standard Chartered Plc	96.542	0,05	222	Builders FirstSource Inc	9.888	0,00
39.772	Wm Morrison Supermarkets Plc*	99.667	0,05	179	Burlington Stores Inc	57.883	0,03
		5.775.894	3,12	383	Capital One Financial Corp	61.579	0,03
États-Unis				8.463	Carrier Global Corp	388.706	0,21
1.571	3M Co	318.976	0,17	175	Carvana Co	46.391	0,02
176	A O Smith Corp	12.508	0,01	1.494	Caterpillar Inc	360.174	0,19
4.891	Abbott Laboratories - CDI	570.535	0,31	3.697	CBRE Group Inc 'A'	324.523	0,18
4.939	AbbVie Inc	559.095	0,30	4.163	Centene Corp	306.397	0,17
331	ABIOMED Inc	94.196	0,05	2.399	CenterPoint Energy Inc	60.695	0,03
1.340	Adobe Inc	676.137	0,37	879	CH Robinson Worldwide Inc	85.281	0,05
703	Advanced Drainage Systems Inc	79.734	0,04	7.781	Charles Schwab Corp	574.627	0,31
				388	Charter Communications Inc 'A'	269.478	0,15
				2.197	Chegg Inc	168.971	0,09
				5.331	Chevron Corp	553.304	0,30

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de	% de			Valeur de	% de
Nombre	Description	marché	l'actif	Nombre	Description	marché	l'actif
		USD	net			USD	net
États-Unis suite				États-Unis suite			
35	Chipotle Mexican Grill Inc	48.019	0,03	1.023	Henry Schein Inc	77.789	0,04
1.449	Choice Hotels International Inc	175.199	0,09	14.187	Hewlett Packard Enterprise Co	226.425	0,12
3.338	Cigna Corp	864.041	0,47	481	Hexcel Corp	28.600	0,02
191	Clean Harbors Inc	17.782	0,01	142	Hill-Rom Holdings Inc	15.802	0,01
551	Cloudflare Inc 'A'	45.215	0,02	756	Hilton Worldwide Holdings Inc	94.704	0,05
774	CMS Energy Corp	48.561	0,03	2.054	Hologic Inc	129.525	0,07
11.317	Coca-Cola Co	625.717	0,34	3.012	Home Depot Inc	960.557	0,52
6.432	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	460.274	0,25	3.324	HP Inc	97.161	0,05
5.907	Colgate-Palmolive Co	494.888	0,27	120	HubSpot Inc	60.526	0,03
12.597	Comcast Corp 'A'	722.312	0,39	365	Humana Inc	159.760	0,09
2.934	Conagra Brands Inc	111.785	0,06	2.846	Huntington Bancshares Inc	45.138	0,02
5.220	Consolidated Edison Inc	403.193	0,22	23	IDEXX Laboratories Inc	12.837	0,01
167	Cooper Cos Inc	65.706	0,04	866	Illinois Tool Works Inc	200.704	0,11
6.162	Corning Inc	268.848	0,14	7.278	Ingersoll Rand Inc	361.280	0,19
110	CoStar Group Inc	93.940	0,05	37.174	Intel Corp	2.123.379	1,15
1.233	Costco Wholesale Corp	466.407	0,25	4.000	Intuit Inc	1.756.360	0,95
374	Coupa Software Inc	89.087	0,05	196	ITT Inc	18.404	0,01
197	Credit Acceptance Corp	88.150	0,05	3.690	J M Smucker Co	491.840	0,27
400	Cummins Inc	102.912	0,06	537	Jabil Inc	30.314	0,02
272	Curtiss-Wright Corp	34.087	0,02	7.372	Jefferies Financial Group Inc	236.862	0,13
3.662	CVS Health Corp	316.543	0,17	186	John Bean Technologies Corp	26.790	0,01
323	Danaher Corp	82.733	0,04	10.673	Johnson & Johnson	1.806.405	0,98
246	Darden Restaurants Inc	35.235	0,02	269	Jones Lang LaSalle Inc	54.405	0,03
2.127	Darling Ingredients Inc	145.614	0,08	7.929	JPMorgan Chase & Co	1.302.259	0,70
2.615	Deere & Co	944.276	0,51	2.080	KB Home	97.365	0,05
432	Delta Air Lines Inc	20.598	0,01	5.077	Kellogg Co	332.493	0,18
265	DexCom Inc	97.888	0,05	2.097	KeyCorp	48.315	0,03
1.268	Dick's Sporting Goods Inc	123.668	0,07	1.611	Keysight Technologies Inc	229.374	0,12
378	Discovery Inc 'C'	11.359	0,01	50.640	Kinder Morgan Inc	928.738	0,50
473	DocuSign Inc	95.366	0,05	2.286	Kohl's Corp	126.850	0,07
2.799	Donaldson Co Inc	172.390	0,09	793	L3Harris Technologies Inc	172.922	0,09
6.900	DR Horton Inc	657.501	0,35	99	Laboratory Corp of America Holdings	27.174	0,01
541	DTE Energy Co	74.653	0,04	923	Las Vegas Sands Corp	53.303	0,03
2.037	Duke Energy Corp	204.148	0,11	243	Leggett & Platt Inc	13.372	0,01
1.476	East West Bancorp Inc	110.375	0,06	5.676	Lennar Corp 'A'	561.981	0,30
591	Emergent BioSolutions Inc	35.844	0,02	490	Lennox International Inc	171.466	0,09
561	EOG Resources Inc	45.071	0,02	212	LHC Group Inc	41.732	0,02
733	Equinix Inc (REIT)	540.016	0,29	2.562	Lincoln National Corp	178.802	0,10
9.017	Equitrans Midstream Corp	74.300	0,04	256	Lithia Motors Inc 'A'	90.109	0,05
4.329	Equity Residential (REIT)	335.281	0,18	798	LKQ Corp	40.666	0,02
495	Estee Lauder Cos Inc 'A'	151.727	0,08	253	Louisiana-Pacific Corp	17.004	0,01
338	Etsy Inc	55.679	0,03	3.154	Lowe's Cos Inc	614.494	0,33
2.146	Euronet Worldwide Inc	321.127	0,17	240	Lumentum Holdings Inc	19.529	0,01
302	Eversource Energy	24.519	0,01	1.554	Manhattan Associates Inc	211.313	0,11
2.692	Exelon Corp	121.463	0,07	49	Markel Corp	60.049	0,03
371	Expedia Group Inc	65.648	0,04	750	Marriott International Inc 'A'	107.685	0,06
4.192	Expeditors International of Washington Inc	526.892	0,28	306	Marriott Vacations Worldwide Corp	52.721	0,03
11.047	Exxon Mobil Corp	644.813	0,35	643	Marsh & McLennan Cos Inc	88.959	0,05
6.358	Facebook Inc 'A'	2.090.065	1,13	10.681	Masco Corp	644.171	0,35
1.016	FedEx Corp	319.847	0,17	171	MasTec Inc	19.892	0,01
11.435	Fidelity National Information Services Inc	1.703.586	0,92	2.460	Mastercard Inc 'A'	887.027	0,48
1.917	Fifth Third Bancorp	80.782	0,04	332	MAXIMUS Inc	30.766	0,02
2.720	First American Financial Corp	174.923	0,09	2.064	McDonald's Corp	482.749	0,26
346	Flowserve Corp	14.667	0,01	3.232	McKesson Corp	621.804	0,34
5.388	Franklin Resources Inc	184.323	0,10	6.836	MDU Resources Group Inc	230.100	0,12
2.459	Gartner Inc	570.095	0,31	2.417	Medical Properties Trust Inc (REIT)	51.168	0,03
1.667	General Mills Inc	104.788	0,06	123	MercadoLibre Inc	167.116	0,09
3.340	Genuine Parts Co	437.941	0,24	7.040	Merck & Co Inc	534.266	0,29
4.794	Gilead Sciences Inc	316.931	0,17	589	Meritage Homes Corp	63.418	0,03
811	Global Payments Inc	157.099	0,08	7.500	MetLife Inc	490.200	0,26
457	GoDaddy Inc 'A'	36.999	0,02	3.041	MGIC Investment Corp	44.764	0,02
508	Goldman Sachs Group Inc	188.986	0,10	1.615	MGM Resorts International	69.235	0,04
214	Graco Inc	16.204	0,01	15.684	Microsoft Corp	3.915.981	2,12
773	Guidewire Software Inc	75.553	0,04	927	Moderna Inc	171.504	0,09
215	Hanover Insurance Group Inc	29.990	0,02	212	Molina Healthcare Inc	53.288	0,03
2.730	Hartford Financial Services Group Inc	178.405	0,10	3.936	Morgan Stanley	357.979	0,19
549	Hasbro Inc^	52.688	0,03	1.350	National Fuel Gas Co	70.051	0,04
				1.799	National Vision Holdings Inc	89.356	0,05

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
France			
USD 59.712	Lyxor MSCI India UCITS ETF [^]	1.459.958	0,79
		1.459.958	0,79
Total des Fonds négociés en bourse		1.459.958	0,79
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		182.417.393	98,57
Portefeuille de titres à la valeur de marché		182.417.393	98,57
Autres éléments de l'actif net		2.649.923	1,43
Total de l'actif net (USD)		185.067.316	100,00

[^] Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-value nette non réalisée USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
6	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.261.680	10.811
5	USD	MSCI EAFE Index Futures June 2021	Juin 2021	583.250	3.593
4	USD	MSCI Emerging Markets Index Futures June 2021	Juin 2021	274.880	7.530
Total				2.119.810	21.934

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	592.439	USD	716.401	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	6.792
USD	27.379	EUR	22.532	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(126)
						6.666
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 750.699)						6.666

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	18,89
Finance	17,75
Technologie	17,43
Communications	13,05
Biens de consommation cyclique	12,40
Valeurs industrielles	10,91
Matériaux de base	3,39
Énergie	2,73
Services aux collectivités	1,22
Fonds négociés en bourse	0,79
Diversifiés	0,01
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,57
Autres éléments de l'actif net	1,43
	100,00

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				États-Unis suite			
				USD 1.000.000	United States Treasury Bill 13/7/2021 (Zero Coupon)	999.994	2,09
				USD 5.000.000	United States Treasury Bill 15/7/2021 (Zero Coupon)	5.000.000	10,45
						42.199.923	88,16
					Total des obligations	42.199.923	88,16
					Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	43.425.124	90,72
					Portefeuille de titres à la valeur de marché	43.425.124	90,72
					Autres éléments de l'actif net	4.440.532	9,28
					Total de l'actif net (USD)	47.865.656	100,00
ACTIONS ORDINAIRES & WARRANTS							
Îles Caïmans							
18.000	Hedosophia European Growth (Unit)	220.551	0,46				
		220.551	0,46				
Allemagne							
3.260	Vantage Towers AG	108.574	0,23				
		108.574	0,23				
Luxembourg							
2.999	468 Spac I SE (Wts 30/4/2026)	3.294	0,01				
8.996	468 Spac I SE 'A'	106.164	0,22				
1.576	SUSE SA	57.720	0,12				
		167.178	0,35				
Pays-Bas							
3.340	European FinTech IPO Co 1 BV (Wts 26/3/2026)	2.853	0,01				
10.022	European FinTech IPO Co 1 BV (Unit)	119.251	0,25				
9.928	Pegasus Acquisition Co Europe BV (Unit)	120.919	0,25				
		243.023	0,51				
Suède							
913	Hemnet Group AB	24.003	0,05				
		24.003	0,05				
Suisse							
755	PolyPeptide Group AG	63.858	0,13				
		63.858	0,13				
Royaume-Uni							
9.462	Allfunds UK Ltd	159.354	0,33				
27.827	Alphawave IP Group Plc	120.856	0,25				
27.712	Trustpilot Group Plc	117.804	0,25				
		398.014	0,83				
	Total des actions ordinaires & Warrants	1.225.201	2,56				
OBLIGATIONS							
États-Unis							
USD 7.700.000	United States Treasury Bill 1/6/2021 (Zero Coupon)	7.700.000	16,09				
USD 1.500.000	United States Treasury Bill 3/6/2021 (Zero Coupon)	1.499.997	3,13				
USD 5.000.000	United States Treasury Bill 8/6/2021 (Zero Coupon)	4.999.998	10,44				
USD 2.000.000	United States Treasury Bill 10/6/2021 (Zero Coupon)	1.999.984	4,18				
USD 1.000.000	United States Treasury Bill 15/6/2021 (Zero Coupon)	999.999	2,09				
USD 12.000.000	United States Treasury Bill 17/6/2021 (Zero Coupon)	11.999.985	25,07				
USD 6.000.000	United States Treasury Bill 22/6/2021 (Zero Coupon)	5.999.968	12,53				
USD 1.000.000	United States Treasury Bill 24/6/2021 (Zero Coupon)	999.998	2,09				

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés				Australie suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(1)	G8 Education Ltd	Bank of America Merrill Lynch	—
Australie				28.953	Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.793
27.730	Alumina Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)	8.813	Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd	Goldman Sachs	546
34.304	Alumina Ltd	Goldman Sachs	571	3.926	GrainCorp Ltd 'A'	Goldman Sachs	(577)
50.620	Alumina Ltd	Morgan Stanley	1.379	(5.374)	Home Consortium (REIT)	Goldman Sachs	(374)
1.171	Appen Ltd	Bank of America Merrill Lynch	403	(6.382)	Ingenia Communities Group (REIT)	Goldman Sachs	(593)
701	Appen Ltd	Goldman Sachs	1.232	1.081	Inghams Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	336
860	Appen Ltd	Morgan Stanley	(87)	6.740	Inghams Group Ltd	Goldman Sachs	1.930
(2.945)	ARB Corp Ltd	Goldman Sachs	(10.913)	(10.987)	Integrated Research Ltd	Goldman Sachs	(680)
440	AUB Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(201)	(4.520)	InvoCare Ltd	Goldman Sachs	(770)
280	AUB Group Ltd	Goldman Sachs	(128)	(2.879)	IPH Ltd	Goldman Sachs	(1.003)
21.151	Aurizon Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	159	4.102	Lifestyle Communities Ltd	Goldman Sachs	3.143
69.083	Aurizon Holdings Ltd	Goldman Sachs	4.807	6.840	Link Administration Holdings Ltd	Goldman Sachs	(548)
63.449	Aurizon Holdings Ltd	Morgan Stanley	2.872	(12.826)	Lynas Rare Earths Ltd	Goldman Sachs	(1.718)
6.991	Austal Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(54)	(16.711)	Lynas Rare Earths Ltd	Morgan Stanley	(374)
3.163	Austal Ltd	Goldman Sachs	(24)	31	Magellan Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(38)	Bega Cheese Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1)	1.086	Magellan Financial Group Ltd	Goldman Sachs	1.331
(30.359)	Bega Cheese Ltd	Goldman Sachs	(1.236)	306	Magellan Financial Group Ltd	Morgan Stanley	42
(9.125)	Boral Ltd	Goldman Sachs	(296)	22.203	Medibank Pvt Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.711
(6.143)	Bravura Solutions Ltd	Goldman Sachs	(1.277)	60.375	Medibank Pvt Ltd	Goldman Sachs	3.022
(3.409)	Breville Group Ltd	Goldman Sachs	(3.261)	49.297	Medibank Pvt Ltd	Morgan Stanley	1.442
(5.341)	Brickworks Ltd	Goldman Sachs	(1.728)	(95.701)	Mirvac Group (REIT)	Goldman Sachs	(1.186)
(1.038)	BWP Trust (REIT)	Goldman Sachs	(38)	(512)	Netwealth Group Ltd	Goldman Sachs	(622)
(3.775)	BWX Ltd	Goldman Sachs	(789)	1.683	Nick Scali Ltd	Bank of America Merrill Lynch	880
(4.041)	Chalice Mining Ltd	Goldman Sachs	(3.439)	(7.047)	Omni Bridgeway Ltd	Goldman Sachs	(1.145)
32.243	Challenger Ltd	Goldman Sachs	8.038	2.241	Pendal Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	330
28.780	Challenger Ltd	Morgan Stanley	6.460	5.010	Pendal Group Ltd	Goldman Sachs	737
1.810	Charter Hall Long Wale REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(42)	10.359	Platinum Asset Management Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(401)
948	Charter Hall Long Wale REIT (REIT)	Goldman Sachs	(22)	12.109	Platinum Asset Management Ltd	Goldman Sachs	(391)
1.908	Charter Hall Social Infrastructure REIT (REIT)	Goldman Sachs	236	9.425	Platinum Asset Management Ltd	Morgan Stanley	73
(9.043)	Cleanaway Waste Management Ltd	Goldman Sachs	95	(3.340)	Premier Investments Ltd	Goldman Sachs	(2.921)
538	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(32)	(10.958)	Ramelius Resources Ltd	Goldman Sachs	(714)
624	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	Goldman Sachs	97	727	Ramsay Health Care Ltd	Goldman Sachs	289
(429)	Corporate Travel Management Ltd	Goldman Sachs	(164)	960	REA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.244
305	Credit Corp Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	462	823	REA Group Ltd	Goldman Sachs	6.683
(10.335)	Crown Resorts Ltd	Goldman Sachs	2.160	188	REA Group Ltd	Morgan Stanley	999
13.896	CSR Ltd	Bank of America Merrill Lynch	686	(4.490)	Redbubble Ltd	Goldman Sachs	510
8.960	CSR Ltd	Goldman Sachs	(1.210)	(11.898)	Reece Ltd	Goldman Sachs	4.862
3.937	CSR Ltd	Morgan Stanley	(488)	39.038	Regis Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	749
(5.701)	Data#3 Ltd	Goldman Sachs	(1.324)	42.316	Regis Resources Ltd	Goldman Sachs	658
(4.479)	Deterra Royalties Ltd	Morgan Stanley	—	2.777	Rural Funds Group (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	172
4.078	Domain Holdings Australia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.478	1.727	Sandfire Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(212)
3.710	Domain Holdings Australia Ltd	Goldman Sachs	259	2.862	Sandfire Resources Ltd	Goldman Sachs	(673)
859	Eagers Automotive Ltd	Bank of America Merrill Lynch	558	(22.842)	Santos Ltd	Goldman Sachs	2.990
531	Eagers Automotive Ltd	Goldman Sachs	345	4.909	Scentre Group (REIT)	Morgan Stanley	152
8.289	Elders Ltd	Goldman Sachs	(3.913)	(2.738)	SeaLink Travel Group Ltd	Goldman Sachs	538
(21.647)	Electro Optic Systems Holdings Ltd	Goldman Sachs	(6.493)	1.787	SEEK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.305
6.487	Flight Centre Travel Group Ltd	Goldman Sachs	384	629	SEEK Ltd	Goldman Sachs	528
821	Flight Centre Travel Group Ltd	Morgan Stanley	57	1.188	SEEK Ltd	Morgan Stanley	1.563

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Australie suite				Belgique suite			
3.155	Southern Cross Media Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(183)	(243)	Biocartis Group NV	Goldman Sachs	47
10.345	Southern Cross Media Group Ltd	Goldman Sachs	(600)	1.929	bpost SA	Bank of America Merrill Lynch	195
20.371	St Barbara Ltd	Bank of America	(2.286)	1.613	bpost SA	Goldman Sachs	580
3.572	Steadfast Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	387	(19)	D'ieteren SA	Bank of America Merrill Lynch	26
2.366	Steadfast Group Ltd	Goldman Sachs	273	(172)	Elia Group SA	Bank of America Merrill Lynch	470
19.487	Super Retail Group Ltd	Goldman Sachs	10.407	(17)	Elia Group SA	Morgan Stanley	91
(146)	Sydney Airport (Unit)	Goldman Sachs	(9)	(200)	Fagron	Bank of America Merrill Lynch	85
(40.514)	Sydney Airport (Unit)	Morgan Stanley	(3.449)	47	Ion Beam Applications	Goldman Sachs	2
6.048	Tabcorp Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	65	(9)	KBC Ancora	Bank of America Merrill Lynch	7
1.315	Tabcorp Holdings Ltd	Goldman Sachs	(75)	(585)	Ontex Group NV	Goldman Sachs	150
(3.588)	Tassal Group Ltd	Goldman Sachs	(167)	(117)	Sofina SA	Morgan Stanley	(1.456)
1.693	Technology One Ltd	Bank of America Merrill Lynch	593	2.179	Umicore SA	Morgan Stanley	(3.430)
6.479	Technology One Ltd	Goldman Sachs	971				(3.466)
(3.121)	Temple & Webster Group Ltd	Goldman Sachs	(507)	Bermudes			
9.658	Treasury Wine Estates Ltd	Morgan Stanley	4.410	(591)	Liberty Latin America Ltd 'C'	Bank of America Merrill Lynch	2
(3.137)	Tyro Payments Ltd	Goldman Sachs	(364)				2
738	United Malt Grp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(21)	Canada			
5.697	United Malt Grp Ltd	Goldman Sachs	(243)	198	Absolute Software Corp	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(46.523)	Western Areas Ltd	Goldman Sachs	(3.241)	(4.661)	Advantage Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(232)
(6.118)	Westgold Resources Ltd	Goldman Sachs	(758)	(456)	Air Canada	Goldman Sachs	(546)
2.808	WiseTech Global Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.409	(770)	Altius Minerals Corp	Bank of America Merrill Lynch	(389)
2.408	WiseTech Global Ltd	Morgan Stanley	2.292	379	Boardwalk Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	248
(2.577)	Woolworths Group Ltd	Goldman Sachs	(2.342)	958	Boardwalk Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	626
2.701	Worley Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(499)	(385)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(483)
1.978	Worley Ltd	Goldman Sachs	119	(331)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Goldman Sachs	(207)
617	Worley Ltd	Morgan Stanley	(115)	(1.864)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Morgan Stanley	(237)
			37.279	75	BRP Inc	Bank of America Merrill Lynch	224
Autriche				121	BRP Inc	Goldman Sachs	361
(98)	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	Bank of America Merrill Lynch	54	169	BRP Inc	Morgan Stanley	270
(312)	CA Immobilien Anlagen AG	Bank of America Merrill Lynch	30	(3.845)	Cameco Corp	Bank of America Merrill Lynch	286
(430)	Erste Group Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	(53)	(2.634)	Cameco Corp	Goldman Sachs	(68)
(1.098)	Erste Group Bank AG	Morgan Stanley	1.206	(546)	Cameco Corp	Morgan Stanley	(515)
(206)	FACC AG	Goldman Sachs	(88)	262	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs	366
(377)	IMMOFINANZ AG	Goldman Sachs	(144)	(155)	Canadian Pacific Railway Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(65)
55	Oesterreichische Post AG	Bank of America Merrill Lynch	138	(1.715)	Canadian Pacific Railway Ltd	Goldman Sachs	(6.785)
1.105	Oesterreichische Post AG	Goldman Sachs	2.289	(6.332)	Canadian Pacific Railway Ltd	Morgan Stanley	1.415
(429)	S IMMO AG	Bank of America Merrill Lynch	—	313	Cargojet Inc	Morgan Stanley	1.241
219	Semperit AG Holding	Bank of America Merrill Lynch	(254)	(330)	Celestica Inc	Goldman Sachs	(55)
690	Semperit AG Holding	Goldman Sachs	(800)	5.057	Chorus Aviation Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.046
(406)	UNIQA Insurance Group AG	Goldman Sachs	(74)	2.304	Chorus Aviation Inc	Goldman Sachs	477
(376)	Vienna Insurance Group AG	Goldman Sachs	229	234	Cineplex Inc	Goldman Sachs	304
	Wiener Versicherung Gruppe	Goldman Sachs	229	383	Cogeco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(499)
405	voestalpine AG	Bank of America Merrill Lynch	(69)	125	Cogeco Inc	Goldman Sachs	(163)
1.270	voestalpine AG	Goldman Sachs	(198)	199	Colliers International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	450
5.134	voestalpine AG	Morgan Stanley	6.767	546	Colliers International Group Inc	Morgan Stanley	1.401
			9.033				
Belgique							
(1.380)	AGFA-Gevaert NV	Bank of America Merrill Lynch	(170)				
(94)	Befimmo SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(63)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Canada suite				Canada suite			
19	Constellation Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(108)	(1.124)	Largo Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	130
15	Constellation Software Inc	Goldman Sachs	100	(3.130)	Largo Resources Ltd	Goldman Sachs	363
49	Constellation Software Inc	Morgan Stanley	(1.025)	(3.279)	Lithium Americas Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.345)
1.618	Corus Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	308	(1.333)	Lithium Americas Corp	Morgan Stanley	(2.328)
3.611	Crescent Point Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	686	(10.872)	Lundin Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.070
19.750	Crescent Point Energy Corp	Morgan Stanley	8.664	(1.118)	Martinrea International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(352)
118	CT Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(2.594)	Martinrea International Inc	Goldman Sachs	(861)
1.632	CT Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(81)	105	Maverix Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47)
2.465	Descartes Systems Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.972	1.058	Maverix Metals Inc	Goldman Sachs	(473)
733	Descartes Systems Group Inc	Goldman Sachs	742	3.073	Morguard North American Residential Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	356
623	Descartes Systems Group Inc	Morgan Stanley	328	66	MTY Food Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	172
457	Dream Industrial Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(185)	(233)	NFI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(168)
1.175	Dream Industrial Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	5	(447)	NFI Group Inc	Goldman Sachs	(322)
462	Dream Office Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(4)	752	Novagold Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	158
1.902	Dream Office Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(16)	288	Novagold Resources Inc	Goldman Sachs	(21)
(1.963)	ECN Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(455)	498	Novagold Resources Inc	Morgan Stanley	4
4.006	Enerplus Corp	Goldman Sachs	1.658	(12.999)	OceanaGold Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.130
66	Equitable Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(86)	(7.892)	OceanaGold Corp	Goldman Sachs	686
76	Equitable Group Inc	Goldman Sachs	(31)	(1.218)	Orla Mining Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(357)
132	ERO Copper Corp	Bank of America Merrill Lynch	(68)	(1.337)	Osisko Mining Inc	Goldman Sachs	(260)
1.883	First National Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	661	3.148	Parex Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.735
1.915	First National Financial Corp	Goldman Sachs	685	1.259	Parex Resources Inc	Goldman Sachs	354
221	FirstService Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.136	1.222	Parkland Corp	Morgan Stanley	253
32	FirstService Corp	Morgan Stanley	45	335	Pason Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
1.103	Fortuna Silver Mines Inc	Goldman Sachs	391	407	Real Matters Inc	Bank of America Merrill Lynch	(102)
454	Freehold Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(47)	876	Real Matters Inc	Goldman Sachs	219
4.575	Freehold Royalties Ltd	Goldman Sachs	(1.345)	1.278	Russel Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	254
(742)	Galaxy Digital Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.075)	(3.501)	Sabina Gold & Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	310
(317)	GDI Integrated Facility Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.055	(6.476)	Sabina Gold & Silver Corp	Goldman Sachs	214
(1.274)	Gran Colombia Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	443	172	Sandstorm Gold Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11)
163	Home Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	25	9.471	Sandstorm Gold Ltd	Goldman Sachs	(627)
3.838	Innergex Renewable Energy Inc	Morgan Stanley	731	(1.006)	Saputo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.895)
2.057	Interfor Corp	Goldman Sachs	(4.716)	(603)	Saputo Inc	Morgan Stanley	(789)
1.404	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(105)	1.011	Savaria Corp	Bank of America Merrill Lynch	783
1.212	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(90)	1.749	Savaria Corp	Goldman Sachs	1.533
226	Kinaxis Inc	Bank of America Merrill Lynch	121	(3.123)	Sienna Senior Living Inc	Bank of America Merrill Lynch	(960)
9	Kinaxis Inc	Goldman Sachs	(1)	(825)	Sienna Senior Living Inc	Goldman Sachs	(362)
(4.052)	Kinross Gold Corp	Morgan Stanley	(101)	(2.605)	Sierra Wireless Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.324)
2.062	Knight Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(111)	(303)	SilverCrest Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(703)	Labrador Iron Ore Royalty Corp	Goldman Sachs	(506)	170	Sleep Country Canada Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(168)
				134	Spin Master Corp	Bank of America Merrill Lynch	(87)
				1.537	Summit Industrial Income REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(309)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
France suite				Allemagne suite			
3.048	Rubis SCA	Bank of America		36	Datagroup SE	Goldman Sachs	202
		Merrill Lynch	2.103	48	Dermapharm Holding SE	Bank of America	
811	Rubis SCA	Goldman Sachs	637			Merrill Lynch	39
1.118	Rubis SCA	Morgan Stanley	953	235	Dermapharm Holding SE	Goldman Sachs	(20)
(4.440)	Sanofi	Morgan Stanley	3.739	127	Deutsche Beteiligungs AG	Bank of America	
2.684	SCOR SE	Bank of America				Merrill Lynch	132
		Merrill Lynch	(2.981)	(409)	Deutsche EuroShop AG	Bank of America	
3.843	SCOR SE	Morgan Stanley	(2.908)			Merrill Lynch	(399)
(410)	SEB SA	Goldman Sachs	1.201	(245)	Deutsche EuroShop AG	Goldman Sachs	(239)
(199)	SEB SA	Morgan Stanley	146	3.179	Deutsche Pfandbriefbank AG		
2.089	SES SA	Bank of America				Goldman Sachs	303
		Merrill Lynch	2.405	(3.289)	Deutsche Telekom AG Reg	Bank of America	
3.416	SES SA	Goldman Sachs	3.187			Merrill Lynch	(1.660)
9.592	SES SA	Morgan Stanley	10.651	(1.098)	Deutsche Telekom AG Reg	Goldman Sachs	119
5	Societe BIC SA	Goldman Sachs	(22)	(23.223)	Deutsche Telekom AG Reg	Morgan Stanley	4.138
(121)	SOITEC	Morgan Stanley	(247)	(652)	DIC Asset AG	Goldman Sachs	(788)
178	Sopra Steria Group SACA	Goldman Sachs	673	557	Duerr AG	Bank of America	
7	Synergie SE	Bank of America				Merrill Lynch	258
		Merrill Lynch	11	767	Duerr AG	Goldman Sachs	455
773	Television Francaise 1	Goldman Sachs	67	242	Duerr AG	Morgan Stanley	55
19	Trigano SA	Bank of America		(145)	flatexDEGIRO AG	Morgan Stanley	(813)
		Merrill Lynch	218	(1.763)	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Bank of America	
12	Trigano SA	Goldman Sachs	21			Merrill Lynch	1.334
1.120	Valeo SA	Goldman Sachs	(614)	(645)	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide		
8.086	Valeo SA	Morgan Stanley	6.694			Goldman Sachs	(11)
1.198	Valneva SE	Bank of America		(1.843)	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide		
		Merrill Lynch	95			Morgan Stanley	(3.187)
243	Valneva SE	Goldman Sachs	(316)	945	Freenet AG	Bank of America	
(61)	Vicat SA	Goldman Sachs	(89)			Merrill Lynch	473
(307)	Vivendi SE	Goldman Sachs	(255)	1.125	Freenet AG	Morgan Stanley	590
(2.101)	Vivendi SE	Morgan Stanley	(974)	(1.846)	Fresenius SE & Co KGaA	Bank of America	
(327)	Worldline SA	Morgan Stanley	(511)			Merrill Lynch	1.852
			26.792	(3.513)	Fresenius SE & Co KGaA	Goldman Sachs	2.479
				(1.832)	Fresenius SE & Co KGaA	Morgan Stanley	4.717
				(1.231)	Hamborner AG (REIT)	Goldman Sachs	(1.672)
				58	Hamburger Hafen und Logistik AG	Bank of America	
						Merrill Lynch	14
(46)	Adesso SE	Bank of America		819	Hamburger Hafen und Logistik AG		
		Merrill Lynch	(640)	(297)	Home24 SE	Goldman Sachs	137
(9)	Adesso SE	Goldman Sachs	(125)			Bank of America	
(16)	Amadeus Fire AG	Bank of America		(425)	Home24 SE	Merrill Lynch	(874)
		Merrill Lynch	(82)	(1)	Hypoport SE	Goldman Sachs	(1.250)
(34)	Amadeus Fire AG	Goldman Sachs	(126)			Bank of America	
(1.496)	Auto1 Group SE	Bank of America		(42)	Hypoport SE	Merrill Lynch	(14)
		Merrill Lynch	(522)	1.259	Kloeckner & Co SE	Goldman Sachs	(605)
(374)	Auto1 Group SE	Goldman Sachs	(1.539)			Bank of America	
3	Basler AG	Bank of America		5.699	Kloeckner & Co SE	Merrill Lynch	175
		Merrill Lynch	(1)	191	Krones AG	Bank of America	1.160
44	Befesa SA	Goldman Sachs	40			Merrill Lynch	1.002
(185)	Bertrandt AG	Goldman Sachs	(90)	693	Krones AG	Goldman Sachs	2.622
497	Bilfinger SE	Bank of America		(61)	KWS Saat SE & Co KGaA	Bank of America	
		Merrill Lynch	(261)			Merrill Lynch	208
531	Bilfinger SE	Goldman Sachs	(722)	(26)	KWS Saat SE & Co KGaA	Goldman Sachs	89
(692)	Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA	Bank of America		(80)	MBB SE	Bank of America	
(1.036)	Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA	Merrill Lynch	258			Merrill Lynch	(371)
(216)	CANCOM SE	Bank of America		(94)	MBB SE	Goldman Sachs	(436)
		Merrill Lynch	(180)	(76)	Medios AG	Goldman Sachs	97
(107)	CANCOM SE	Goldman Sachs	52	3.229	MLP SE	Bank of America	
(980)	CECONOMY AG	Bank of America				Merrill Lynch	1.287
		Merrill Lynch	(230)	10.407	MLP SE	Goldman Sachs	4.172
(11.979)	Commerzbank AG	Bank of America		91	MTU Aero Engines AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.024)			Merrill Lynch	400
(2.182)	Commerzbank AG	Morgan Stanley	(27)	210	MTU Aero Engines AG	Goldman Sachs	759
(18)	Corestate Capital Holding SA		18	694	MTU Aero Engines AG	Morgan Stanley	4.327
4.163	Covestro AG	Goldman Sachs	9.247	(452)	Nagarro SE	Bank of America	
366	CropEnergies AG	Bank of America				Merrill Lynch	(2.317)
		Merrill Lynch	143	74	New Work SE	Goldman Sachs	(452)
293	CropEnergies AG	Goldman Sachs	114	(71)	Norma Group SE	Bank of America	
14	Datagroup SE	Bank of America				Merrill Lynch	(231)
		Merrill Lynch	79				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Israël suite				Italie suite			
197	Camtek Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.509	(45)	Cementir Holding NV	Goldman Sachs	(3)
408	Camtek Ltd	Goldman Sachs	3.125	(390)	Credito Emiliano SpA	Bank of America Merrill Lynch	29
(2.681)	Cellcom Israel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(908)	771	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	Bank of America Merrill Lynch	894
(75)	Delek Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10	1.191	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	Goldman Sachs	1.381
79	Delta Galil Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(156)	(773)	Danieli & C Officine Meccaniche SpA - RSP	Bank of America Merrill Lynch	(1.000)
325	Delta Galil Industries Ltd	Goldman Sachs	(640)	243	Datalogic SpA	Goldman Sachs	379
(592)	Electra Consumer Products 1970 Ltd	Goldman Sachs	(1.148)	123	El.En. SpA	Bank of America Merrill Lynch	1.171
(218)	Electreon Wireless Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.344)	66	El.En. SpA	Goldman Sachs	628
(43)	Electreon Wireless Ltd	Goldman Sachs	(261)	(2.334)	Enav SpA	Bank of America Merrill Lynch	(330)
195	FIBI Holdings Ltd	Goldman Sachs	204	(531)	Enav SpA	Goldman Sachs	(75)
(601)	Formula Systems 1985 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(740)	(2.068)	Falck Renewables SpA	Goldman Sachs	(292)
(244)	Formula Systems 1985 Ltd	Goldman Sachs	(301)	(55)	Ferrari NV	Goldman Sachs	(560)
(1.143)	Gilat Satellite Networks Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(834)	(2.021)	Fila SpA	Goldman Sachs	(987)
(997)	Gilat Satellite Networks Ltd	Goldman Sachs	(728)	122	Gruppo MutuiOnline SpA	Bank of America Merrill Lynch	73
726	IDI Insurance Co Ltd	Goldman Sachs	291	34	Gruppo MutuiOnline SpA	Goldman Sachs	33
14	Israel Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	89	(1.492)	Immobiliare Grande Distribuzione SLIQ SpA (REIT)	Goldman Sachs	(146)
41	Israel Corp Ltd	Goldman Sachs	727	(104)	MARR SpA	Bank of America Merrill Lynch	(135)
(69)	Matrix IT Ltd	Bank of America Merrill Lynch	49	710	Piaggio & C SpA	Goldman Sachs	40
(628)	Matrix IT Ltd	Goldman Sachs	443	759	Pirelli & C SpA	Bank of America Merrill Lynch	112
(359)	Maytronics Ltd	Goldman Sachs	(78)	1.875	Pirelli & C SpA	Morgan Stanley	318
(179)	Mega Or Holdings Ltd	Goldman Sachs	(182)	(1.450)	RAI Way SpA	Goldman Sachs	(93)
1.075	Menora Mivtachim Holdings Ltd	Goldman Sachs	20	(4.628)	Societa Cattolica Di Assicurazione SpA	Goldman Sachs	(10.546)
(31.244)	Mivne Real Estate KD Ltd	Goldman Sachs	(5.937)	(260)	Tamburi Investment Partners SpA	Bank of America Merrill Lynch	(69)
(2.060)	Naphtha Israel Petroleum Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	317	5.134	Tenaris SA	Bank of America Merrill Lynch	1.166
(2.221)	Naphtha Israel Petroleum Corp Ltd	Goldman Sachs	342	1.726	Tenaris SA	Morgan Stanley	302
147	Nova Measuring Instruments Ltd	Goldman Sachs	1.870	(140)	Tinexta SpA	Bank of America Merrill Lynch	(523)
(638)	Partner Communications Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(49)	(108)	Tinexta SpA	Goldman Sachs	(403)
(500)	Phoenix Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	266	(15.491)	UniCredit SpA	Morgan Stanley	(4.764)
(18)	Property & Building Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	103	(6.289)	Webuild SpA	Bank of America Merrill Lynch	(1.167)
(92)	Property & Building Corp Ltd	Goldman Sachs	527	(1.552)	Webuild SpA	Goldman Sachs	(288)
890	Summit Real Estate Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38	Japon			
1.912	Summit Real Estate Holdings Ltd	Goldman Sachs	82	400	ABC-Mart Inc	Bank of America Merrill Lynch	698
631	Tower Semiconductor Ltd	Goldman Sachs	923	100	ABC-Mart Inc	Goldman Sachs	292
(72)	YH Dimri Construction & Development Ltd	Bank of America Merrill Lynch	115	1.800	ABC-Mart Inc	Morgan Stanley	3.583
			(6.577)	400	Adastria Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	76
				(800)	Aeon Hokkaido Corp	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	108
(298)	Banca IFIS SpA	Bank of America Merrill Lynch	55	(3)	AEON Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	292
4.690	Banca Mediolanum SpA	Bank of America Merrill Lynch	1.236	(200)	Ai Holdings Corp	Goldman Sachs	(143)
8.251	Banca Mediolanum SpA	Goldman Sachs	2.756	(2.100)	Ai Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	46
16.933	Banca Mediolanum SpA	Morgan Stanley	4.050	(200)	Aichi Bank Ltd	Goldman Sachs	479
(1.098)	Banca Popolare di Sondrio SCPA	Bank of America Merrill Lynch	(300)	1.000	Aichi Steel Corp	Goldman Sachs	171
(648)	Banca Popolare di Sondrio SCPA	Goldman Sachs	(177)	(1.800)	Aiful Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.186)
(1.455)	BFF Bank SpA	Goldman Sachs	(107)	(4.000)	Aiful Corp	Bank of America Merrill Lynch	39
(175)	Carel Industries SpA	Bank of America Merrill Lynch	(320)	(100)	Akatsuki Inc	Goldman Sachs	274
						Bank of America Merrill Lynch	22

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Japon suite				Japon suite			
3.100	Alfresa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	730	2.200	Canon Inc	Morgan Stanley	(811)
8.100	Alfresa Holdings Corp	Goldman Sachs	23	100	Canon Marketing Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38)
9.100	Alfresa Holdings Corp	Morgan Stanley	2.896	1.200	Canon Marketing Japan Inc	Goldman Sachs	(460)
600	Alpen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	974	800	Canon Marketing Japan Inc	Morgan Stanley	(832)
800	Alpen Co Ltd	Goldman Sachs	1.299	600	Cawachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(393)
(500)	Alpha Systems Inc	Goldman Sachs	—	1.500	Cawachi Ltd	Goldman Sachs	(1.256)
10.600	Alps Alpine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.627	(700)	Central Glass Co Ltd	Goldman Sachs	632
3.600	Alps Alpine Co Ltd	Goldman Sachs	1.696	100	Central Security Patrols Co Ltd	Goldman Sachs	104
6.800	Alps Alpine Co Ltd	Morgan Stanley	(778)	(3.800)	Change Inc	Morgan Stanley	520
3.900	Amada Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.036	1.100	Chiyoda Co Ltd	Goldman Sachs	50
4.500	Amada Co Ltd	Goldman Sachs	2.015	2.400	Chiyoda Corp	Bank of America Merrill Lynch	(385)
6.300	Amada Co Ltd	Morgan Stanley	2.356	3.600	Chiyoda Corp	Goldman Sachs	(558)
(5.600)	ANA Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.208)	800	Chori Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	394
(300)	Anest Iwata Corp	Goldman Sachs	(49)	600	Chori Co Ltd	Goldman Sachs	296
(100)	Aomori Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	127	(100)	Chudenko Corp	Goldman Sachs	(12)
(300)	Aomori Bank Ltd	Goldman Sachs	380	1.300	Chugoku Marine Paints Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(213)
(400)	Arata Corp	Goldman Sachs	(36)	1.800	Chugoku Marine Paints Ltd	Goldman Sachs	(296)
(700)	Arcland Sakamoto Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38	(1.600)	Chukyo Bank Ltd	Goldman Sachs	2.058
(1.500)	Arcland Sakamoto Co Ltd	Goldman Sachs	82	2.500	CI Takiron Corp	Bank of America Merrill Lynch	(707)
300	Arcs Co Ltd	Goldman Sachs	(85)	2.800	CI Takiron Corp	Goldman Sachs	(792)
(100)	Argo Graphics Inc	Goldman Sachs	(1)	1.200	Citizen Watch Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(44)
500	Aruhi Corp	Goldman Sachs	(559)	11.800	Citizen Watch Co Ltd	Goldman Sachs	2.260
300	Asahi Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	356	(1.400)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(112)
2.500	Asahi Holdings Inc	Goldman Sachs	2.964	(200)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Morgan Stanley	(20)
2.200	Asahi Kasei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(826)	(100)	cocokara fine Inc	Bank of America Merrill Lynch	(675)
1.600	Asahi Kasei Corp	Goldman Sachs	(332)	(700)	cocokara fine Inc	Goldman Sachs	(699)
(700)	ASKA Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	287	(500)	Colowide Co Ltd	Goldman Sachs	(210)
600	ASKUL Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.768	(7)	Comforia Residential Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	160
(600)	Avex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72)	(6)	Comforia Residential Inc (REIT)	Goldman Sachs	137
(1.800)	Avex Inc	Goldman Sachs	(788)	200	Computer Engineering & Consulting Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(40)
(1.700)	Awa Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.341	300	CONEXIO Corp	Bank of America Merrill Lynch	44
(5.400)	Awa Bank Ltd	Goldman Sachs	7.437	3.200	CONEXIO Corp	Goldman Sachs	467
(300)	Axial Retailing Inc	Goldman Sachs	575	2.200	COOKPAD Inc	Goldman Sachs	120
(1.100)	Bank of Nagoya Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.495	300	Cosel Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	224
(300)	Bank of Nagoya Ltd	Goldman Sachs	408	1.100	Cosel Co Ltd	Goldman Sachs	823
(900)	Bank of Okinawa Ltd	Goldman Sachs	550	4.000	CyberAgent Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.029
(100)	BayCurrent Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.140)	1.800	Dai Nippon Printing Co Ltd	Goldman Sachs	1.231
(400)	BayCurrent Consulting Inc	Morgan Stanley	(3.466)	1.900	Dai Nippon Printing Co Ltd	Morgan Stanley	549
300	Bell System24 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	52	(1.200)	Daibiru Corp	Bank of America Merrill Lynch	252
2.700	Bell System24 Holdings Inc	Goldman Sachs	294	(5.800)	Daibiru Corp	Goldman Sachs	1.217
(1.000)	Belluna Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	702	300	Dai-Dan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(156)
(500)	Belluna Co Ltd	Goldman Sachs	351	(400)	Daihen Corp	Goldman Sachs	(707)
1.400	BeNext-Yumeshin Group Co	Bank of America Merrill Lynch	638	(500)	Daiho Corp	Bank of America Merrill Lynch	402
10.700	Bic Camera Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.094)	(500)	Daiho Corp	Goldman Sachs	410
3.100	Bic Camera Inc	Goldman Sachs	(1.216)	(500)	Daiichi Jitsugyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(328)
1.700	Bic Camera Inc	Morgan Stanley	(264)	900	Daiichi Jitsugyo Co Ltd	Goldman Sachs	(985)
(2.600)	Bunka Shutter Co Ltd	Goldman Sachs	(403)	1.900	Daiken Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.386)
600	Canon Electronics Inc	Goldman Sachs	(109)				
600	Canon Inc	Bank of America Merrill Lynch	(202)				
600	Canon Inc	Goldman Sachs	81				

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
	Japon suite				Japon suite		
1.200	Daiken Corp	Goldman Sachs	(876)	4.700	FAN Communications Inc	Goldman Sachs	201
(200)	Daikokutenbussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.812	500	FANUC Corp	Morgan Stanley	3.694
900	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(509)	1.400	FCC Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(270)
2.800	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(1.583)	1.400	FCC Co Ltd	Goldman Sachs	(345)
(600)	Daio Paper Corp	Bank of America Merrill Lynch	281	2.800	Feed One Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.456)
(1.300)	Daio Paper Corp	Morgan Stanley	582	3.700	Feed One Co Ltd	Goldman Sachs	(1.924)
(700)	Daiseki Co Ltd	Goldman Sachs	(1.341)	(700)	Ferrotec Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.582)
(1.700)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	Goldman Sachs	465	1.400	Financial Products Group Co Ltd	Goldman Sachs	255
100	Daito Trust Construction Co Ltd	Morgan Stanley	(365)	300	Fixstars Corp	Bank of America Merrill Lynch	14
(1)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(68)	900	Fixstars Corp	Goldman Sachs	41
(16)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(1.166)	1.400	Foster Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.609)
(22)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(1.305)	200	Foster Electric Co Ltd	Goldman Sachs	(230)
1.000	Daiwa Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(246)	1.600	France Bed Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(131)
5.000	Daiwa Industries Ltd	Goldman Sachs	(1.231)	2.300	France Bed Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(189)
(39)	Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT)	Goldman Sachs	(36)	(7)	Frontier Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1.205)
(2.500)	DeNA Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.239)	(300)	Fuji Corp	Goldman Sachs	(252)
(4.400)	DeNA Co Ltd	Morgan Stanley	(3.291)	(400)	Fuji Kyuko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(186)
4.400	DIC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.053)	(1.700)	Fuji Kyuko Co Ltd	Morgan Stanley	(620)
2.000	DIC Corp	Goldman Sachs	(1.842)	7.100	Fuji Media Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(769)
5.900	DIC Corp	Morgan Stanley	(3.605)	1.400	Fuji Media Holdings Inc	Goldman Sachs	(119)
100	Digital Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(138)	600	Fuji Pharma Co Ltd	Goldman Sachs	(105)
100	Digital Arts Inc	Goldman Sachs	(458)	200	Fuji Seal International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(400)	Digital Garage Inc	Bank of America Merrill Lynch	(699)	100	Fuji Seal International Inc	Goldman Sachs	—
(1.100)	Digital Garage Inc	Goldman Sachs	(1.706)	(300)	Fujibo Holdings Inc	Goldman Sachs	(438)
200	Disco Corp	Goldman Sachs	3.186	2.600	Fujikura Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(142)
1.000	Disco Corp	Morgan Stanley	10.818	4.100	Fujikura Ltd	Goldman Sachs	(224)
500	DKK Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(36)	(200)	Fujio Food Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	146
1.400	DKK Co Ltd	Goldman Sachs	(102)	(2.500)	Fujio Food Group Inc	Goldman Sachs	(31)
100	DKS Co Ltd	Goldman Sachs	46	(700)	Fujitec Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(524)
200	Doshisha Co Ltd	Goldman Sachs	(139)	(5.500)	Fujitec Co Ltd	Goldman Sachs	(4.469)
(200)	DTS Corp	Goldman Sachs	4	(700)	Fujitsu General Ltd	Bank of America Merrill Lynch	246
(100)	DyDo Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	201	(1.100)	Fujiya Co Ltd	Goldman Sachs	472
(200)	Eagle Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11)	100	Fukui Computer Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	228
(1.300)	Eagle Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(71)	400	Fukui Computer Holdings Inc	Goldman Sachs	912
(100)	Earth Corp	Bank of America Merrill Lynch	228	100	Funai Soken Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	4
(100)	Earth Corp	Goldman Sachs	228	200	Gecoss Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20)
10.600	EDION Corp	Goldman Sachs	(4.737)	1.500	Gecoss Corp	Goldman Sachs	(112)
(300)	Eizo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(371)	300	Geo Holdings Corp	Goldman Sachs	(149)
200	en-japan Inc	Goldman Sachs	575	(1)	Global One Real Estate Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	5
1.100	EPS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.785	1.600	Glory Ltd	Bank of America Merrill Lynch	283
1.400	EPS Holdings Inc	Goldman Sachs	6.049	5.300	Glory Ltd	Goldman Sachs	400
900	ESPEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	804	300	GMO Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	44
800	Exedy Corp	Bank of America Merrill Lynch	448	(200)	GMO GlobalSign Holdings KK	Bank of America Merrill Lynch	(310)
700	Exedy Corp	Goldman Sachs	262	(400)	GMO GlobalSign Holdings KK	Goldman Sachs	(620)
2.400	FAN Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	110	600	Goldcrest Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)
				2.400	Goldcrest Co Ltd	Goldman Sachs	212

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
	Japon suite				Japon suite		
100	Goldwin Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	(3.000)	Idec Corp	Goldman Sachs	(2.654)
(9.900)	Gree Inc	Goldman Sachs	181	700	Inaba Denki Sangyo Co Ltd	Goldman Sachs	217
(3.800)	GS Yuasa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7.556)	(300)	Inageya Co Ltd	Goldman Sachs	230
(4.900)	GS Yuasa Corp	Goldman Sachs	(9.743)	(47)	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(772)
(2.100)	GS Yuasa Corp	Morgan Stanley	(1.532)	(21)	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	19
400	G-Tekt Corp	Bank of America Merrill Lynch	(51)	(100)	Information Services International-Dentsu Ltd	Goldman Sachs	(119)
1.500	G-Tekt Corp	Goldman Sachs	(192)	3.700	Inpex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.552)
(1.600)	H2O Retailing Corp	Bank of America Merrill Lynch	(336)	17.400	Inpex Corp	Goldman Sachs	(7.821)
(3.900)	H2O Retailing Corp	Goldman Sachs	(818)	400	Insource Co Ltd	Goldman Sachs	(930)
(400)	Hakuhodo DY Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	206	300	Internet Initiative Japan Inc	Goldman Sachs	818
100	Halows Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(126)	(200)	IR Japan Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.262)
400	Halows Co Ltd	Goldman Sachs	(503)	(600)	IR Japan Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.149)
(3)	Hankyu Hanshin Inc (REIT)	Goldman Sachs	15	500	ITOCHU Corp	Goldman Sachs	34
400	Hanwa Co Ltd	Goldman Sachs	(584)	2.100	Itokuro Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.283
400	Hazama Ando Corp	Goldman Sachs	(194)	2.700	Itokuro Inc	Goldman Sachs	1.650
(26)	Heiwa Real Estate Inc (REIT)	Goldman Sachs	119	(800)	Iwatani Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.108
1.600	Heiwado Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15)	(600)	Iwatani Corp	Goldman Sachs	1.915
700	Heiwado Co Ltd	Goldman Sachs	187	(1.000)	Iwatani Corp	Morgan Stanley	(1.277)
(300)	Hiday Hidaka Corp	Bank of America Merrill Lynch	16	(2.100)	JAFCO Group Co Ltd	Goldman Sachs	(8.428)
(200)	Hiday Hidaka Corp	Goldman Sachs	11	(3.500)	Japan Airlines Co Ltd	Goldman Sachs	(7.374)
(100)	Hioki EE Corp	Bank of America Merrill Lynch	73	(5.700)	Japan Airlines Co Ltd	Morgan Stanley	(6.914)
(900)	Hirogin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	174	(3.900)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Morgan Stanley	(8.893)
(200)	Hirogin Holdings Inc	Morgan Stanley	15	(3.200)	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.664)
(200)	HIS Co Ltd	Goldman Sachs	(140)	(700)	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Goldman Sachs	(364)
200	Hochiki Corp	Bank of America Merrill Lynch	85	(2.800)	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Morgan Stanley	(306)
400	Hochiki Corp	Goldman Sachs	114	(7)	Japan Excellent Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(543)
(300)	Hokkoku Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	219	(22)	Japan Excellent Inc (REIT)	Goldman Sachs	(1.623)
(400)	Hokkoku Bank Ltd	Goldman Sachs	292	(300)	Japan Investment Adviser Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	120
(2.100)	Hokuetsu Corp	Goldman Sachs	521	(200)	Japan Lifeline Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	139
(700)	Hokuhoku Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	306	(500)	Japan Lifeline Co Ltd	Goldman Sachs	347
(2.400)	Hokuhoku Financial Group Inc	Goldman Sachs	1.051	200	Japan Material Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	193
700	Hoshizaki Corp	Bank of America Merrill Lynch	416	(100)	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	Morgan Stanley	(1.642)
300	Hoshizaki Corp	Goldman Sachs	(296)	400	Japan Pulp & Paper Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(146)
200	Hoshizaki Corp	Morgan Stanley	(18)	200	Japan Pulp & Paper Co Ltd	Goldman Sachs	(73)
3.100	Hosiden Corp	Goldman Sachs	311	(1.400)	Japan Securities Finance Co Ltd	Goldman Sachs	(638)
(600)	Hosokawa Micron Corp	Goldman Sachs	(1.532)	1.100	Japan Wool Textile Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(361)
(3)	Hulic Reit Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(49)	500	Japan Wool Textile Co Ltd	Goldman Sachs	(164)
(7)	Hulic Reit Inc (REIT)	Goldman Sachs	(115)	(100)	JCU Corp	Goldman Sachs	160
(800)	Hyakugo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	109	(2.000)	JDC Corp	Bank of America Merrill Lynch	417
(800)	Hyakugo Bank Ltd	Goldman Sachs	109	(300)	Jeol Ltd	Goldman Sachs	(985)
(1.100)	Hyakujushi Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	943	(100)	JINS Holdings Inc	Goldman Sachs	9
(1.900)	Hyakujushi Bank Ltd	Goldman Sachs	1.629	100	JM Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(16)
(500)	Ibiden Co Ltd	Morgan Stanley	(1.300)	1.400	J-Oil Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	(575)
(1.300)	Ichibanya Co Ltd	Goldman Sachs	889	2.600	J-Oil Mills Inc	Goldman Sachs	(1.067)
(10.700)	Ichigo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47)	1.400	JSP Corp	Bank of America Merrill Lynch	77
(37.300)	Ichigo Inc	Goldman Sachs	(714)	3.600	JSP Corp	Goldman Sachs	197
(34.500)	Ichigo Inc	Morgan Stanley	947				
(600)	Ichikoh Industries Ltd	Goldman Sachs	82				
(300)	Idec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(265)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
	Japon suite				Japon suite		
(300)	JTOWER Inc	Bank of America Merrill Lynch	(230)	(2.400)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(5.904)
(300)	Juroku Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	170	(600)	Kojima Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	383
(500)	Juroku Bank Ltd	Goldman Sachs	283	(3.900)	Kojima Co Ltd	Goldman Sachs	2.490
900	K&O Energy Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(328)	1.200	KOMEDA Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(263)
700	K&O Energy Group Inc	Goldman Sachs	(255)	200	Komeri Co Ltd	Goldman Sachs	(332)
(400)	Kadokawa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.351)	15.000	Konica Minolta Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.666
(100)	Kadokawa Corp	Goldman Sachs	(384)	25.600	Konica Minolta Inc	Goldman Sachs	5.794
200	Kaga Electronics Co Ltd	Goldman Sachs	278	9.600	Konica Minolta Inc	Morgan Stanley	672
2.100	Kamei Corp	Bank of America Merrill Lynch	—	900	Konoike Transport Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(99)
2.100	Kamei Corp	Goldman Sachs	—	3.800	Konoike Transport Co Ltd	Goldman Sachs	(416)
500	Kamigumi Co Ltd	Goldman Sachs	(263)	(400)	Koshidaka Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(118)
900	Kamigumi Co Ltd	Morgan Stanley	(435)	2.200	K's Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.826)
1.200	Kanamoto Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	131	800	K's Holdings Corp	Goldman Sachs	(664)
700	Kanamoto Co Ltd	Goldman Sachs	181	5.600	K's Holdings Corp	Morgan Stanley	(3.422)
(200)	Kanematsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	4	(2.400)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	Goldman Sachs	153
(600)	Kansai Super Market Ltd	Bank of America Merrill Lynch	126	1.000	Kura Sushi Inc	Goldman Sachs	(410)
(300)	Katakura Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(227)	(100)	Kureha Corp	Goldman Sachs	255
(2.700)	Katakura Industries Co Ltd	Goldman Sachs	(2.044)	(300)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	234
(100)	Katitas Co Ltd	Goldman Sachs	24	100	KYB Corp	Bank of America Merrill Lynch	164
(2.300)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	(2.916)	200	Kyoei Steel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(162)
(100)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(80)	1.700	Kyoei Steel Ltd	Goldman Sachs	(1.636)
(100)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Morgan Stanley	(32)	(300)	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(222)
(2.200)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	(2.807)	(500)	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(139)
(3.300)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Morgan Stanley	(3.913)	(1.500)	KYORIN Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	274
(1.100)	Keiyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(241)	(4.500)	KYORIN Holdings Inc	Goldman Sachs	859
(900)	Keiyo Co Ltd	Goldman Sachs	(197)	1.500	LAC Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	297
(6)	Kenedix Residential Next Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(241)	(11.500)	LAC Co Ltd	Goldman Sachs	(139)
(14)	Kenedix Residential Next Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(562)	(11.500)	Leopalace21 Corp	Bank of America Merrill Lynch	524
(1)	Kenedix Retail Corp (REIT)	Goldman Sachs	(43)	(300)	Lifenet Insurance Co	Bank of America Merrill Lynch	(142)
(600)	Key Coffee Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43)	3.300	Link And Motivation Inc	Goldman Sachs	120
(1.600)	Key Coffee Inc	Goldman Sachs	(18)	500	Lixil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(383)
(800)	KFC Holdings Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	190	100	Lixil Corp	Morgan Stanley	(162)
(100)	Kintetsu Department Store Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23	100	Mars Group Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	19
(1.900)	Kintetsu Department Store Co Ltd	Goldman Sachs	433	600	Mars Group Holdings Corp	Goldman Sachs	115
700	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	670	300	Marudai Food Co Ltd	Goldman Sachs	(90)
100	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	95	100	Marui Group Co Ltd	Goldman Sachs	79
700	Kintetsu World Express Inc	Goldman Sachs	(1.136)	1.600	Marui Group Co Ltd	Morgan Stanley	1.459
(300)	Kisoji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(53)	800	Maruichi Steel Tube Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(200)
(1.000)	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	137	(700)	Marusan Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	170
(700)	Kiyo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	404	(1.400)	Marusan Securities Co Ltd	Goldman Sachs	73
(3.300)	Kiyo Bank Ltd	Goldman Sachs	1.955	(100)	Maruwa Co Ltd	Goldman Sachs	(128)
400	Koatsu Gas Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9	(2.400)	Marvelous Inc	Bank of America Merrill Lynch	(547)
3.000	Koatsu Gas Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	62	(1.700)	Marvelous Inc	Goldman Sachs	(388)
(1.100)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.435)	(500)	Matsuda Sangyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	113
				(600)	Matsuda Sangyo Co Ltd	Goldman Sachs	527
				(1.900)	Matsuya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	154
				(1.600)	Matsuya Co Ltd	Goldman Sachs	233
				2.600	Max Co Ltd	Goldman Sachs	1.304

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
	Japon suite				Japon suite		
300	Maxvalu Tokai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(104)	(7)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	Goldman Sachs	(661)
300	Maxvalu Tokai Co Ltd	Goldman Sachs	(104)	(19)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	Morgan Stanley	(715)
9.300	Mazda Motor Corp	Morgan Stanley	3.768	(200)	Mitsui High-Tec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(142)
1.100	MCJ Co Ltd	Goldman Sachs	110	(400)	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	544
(300)	Media Do Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.628)	(600)	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	815
(400)	Media Do Co Ltd	Goldman Sachs	(2.171)	(2.700)	Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1.256
(300)	Medley Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.751)	400	Modalis Therapeutics Corp	Goldman Sachs	387
(200)	Medley Inc	Goldman Sachs	(1.167)	100	Modec Inc	Bank of America Merrill Lynch	16
(300)	Megachips Corp	Bank of America Merrill Lynch	359	200	Modec Inc	Goldman Sachs	(75)
(100)	Megachips Corp	Goldman Sachs	53	(8.100)	Monex Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.518)
(300)	Meidensha Corp	Bank of America Merrill Lynch	209	(3.800)	Monex Group Inc	Goldman Sachs	(2.118)
(200)	Meidensha Corp	Goldman Sachs	166	(10.500)	Monex Group Inc	Morgan Stanley	(4.693)
(300)	Meiko Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(753)	(700)	Money Forward Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.703)
800	Meisei Industrial Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(36)	(2.100)	Money Forward Inc	Morgan Stanley	(3.065)
400	Meisei Industrial Co Ltd	Goldman Sachs	(18)	(3.400)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.816
(300)	Meitec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(343)	(2.900)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Goldman Sachs	6.375
(200)	Meitec Corp	Goldman Sachs	(269)	(3.400)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Morgan Stanley	6.551
100	Menicon Co Ltd	Goldman Sachs	119	(200)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(130)
(400)	Mercari Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.423)	(1.200)	Musashino Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	77
(1.700)	Mercari Inc	Morgan Stanley	(2.481)	(700)	Musashino Bank Ltd	Goldman Sachs	45
(16.400)	Mie Kotsu Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	598	(300)	Nabtesco Corp	Goldman Sachs	(331)
(1.700)	Mie Kotsu Group Holdings Inc	Goldman Sachs	62	(600)	Nabtesco Corp	Morgan Stanley	(516)
400	Milbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	401	(100)	Nachi-Fujikoshi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(50)
600	Milbon Co Ltd	Goldman Sachs	195	(100)	Nachi-Fujikoshi Corp	Goldman Sachs	(50)
(200)	MINEBEA MITSUMI Inc	Goldman Sachs	(154)	100	Nakanishi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
(800)	MINEBEA MITSUMI Inc	Morgan Stanley	(832)	400	Nakanishi Inc	Goldman Sachs	(39)
300	Miroku Jyoho Service Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(85)	(400)	Nanto Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	112
2.600	Miroku Jyoho Service Co Ltd	Goldman Sachs	(735)	(400)	Nanto Bank Ltd	Goldman Sachs	24
(1)	Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(155)	2.500	NEC Capital Solutions Ltd	Goldman Sachs	1.733
200	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	128	1.000	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.160)
2.400	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	1.883	200	NEC Corp	Goldman Sachs	80
3.100	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	(592)	1.100	NEC Corp	Morgan Stanley	(1.066)
10.100	Mitsubishi Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.497	1.300	NGK Spark Plug Co Ltd	Goldman Sachs	1.115
3.400	Mitsubishi Materials Corp	Goldman Sachs	1.271	2.100	NGK Spark Plug Co Ltd	Morgan Stanley	881
10.700	Mitsubishi Materials Corp	Morgan Stanley	5.075	10.200	NHK Spring Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.535
(300)	Mitsubishi Research Institute Inc	Goldman Sachs	301	7.000	NHK Spring Co Ltd	Goldman Sachs	2.426
(17.700)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.211)	6.500	NHK Spring Co Ltd	Morgan Stanley	2.964
(43.900)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Goldman Sachs	(3.003)	(200)	Nichias Corp	Bank of America Merrill Lynch	170
(55.700)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Morgan Stanley	5.182	(900)	Nichiban Co Ltd	Goldman Sachs	(304)
400	Mitsuboshi Belting Ltd	Bank of America Merrill Lynch	44	800	Nichicon Corp	Bank of America Merrill Lynch	572
1.000	Mitsuboshi Belting Ltd	Goldman Sachs	109	400	Nichicon Corp	Goldman Sachs	262
3.000	Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(839)	300	Nichireki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	96
7.100	Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(2.137)	700	Nihon Chouzai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(983)
(3)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(112)	2.800	Nihon Chouzai Co Ltd	Goldman Sachs	(3.933)
				(900)	Nihon Nohyaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	378
				300	Nihon Parkerizing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(93)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
	Japon suite				Japon suite		
100	Nihon Unisys Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(101)	100	OBIC Business Consultants Co Ltd	Morgan Stanley	(137)
1.700	Nihon Unisys Ltd	Goldman Sachs	(1.915)	(200)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	244
900	Nihon Unisys Ltd	Morgan Stanley	(1.143)	(2.400)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd	Goldman Sachs	2.933
(200)	Nikko Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48	1.500	Oiles Corp	Bank of America Merrill Lynch	(666)
300	Nippon Densetsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	55	1.300	Oiles Corp	Goldman Sachs	(485)
(200)	Nippon Fine Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(133)	(700)	Ois ra daichi Inc	Bank of America Merrill Lynch	969
(100)	Nippon Fine Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	(67)	(9.500)	Oji Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.047
500	Nippon Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(156)	(7.900)	Oji Holdings Corp	Goldman Sachs	3.849
(300)	Nippon Koei Co Ltd	Goldman Sachs	156	(8.100)	Oji Holdings Corp	Morgan Stanley	2.660
2.280	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(6.031)	400	Okabe Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(120)
400	Nippon Paper Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(197)	1.900	Okabe Co Ltd	Goldman Sachs	(572)
1.300	Nippon Paper Industries Co Ltd	Morgan Stanley	(154)	(200)	Okumura Corp	Goldman Sachs	95
2.800	Nippon Seiki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	234	200	Omron Corp	Goldman Sachs	836
2.000	Nippon Seiki Co Ltd	Goldman Sachs	107	(200)	Optoron Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(81)
1.300	Nippon Telegraph & T elephone Corp	Bank of America Merrill Lynch	205	(400)	Optoron Co Ltd	Goldman Sachs	(99)
5.100	Nippon Television Holdings Inc	Goldman Sachs	1.161	(200)	Organo Corp	Goldman Sachs	(215)
3.900	Nippon Television Holdings Inc	Morgan Stanley	489	(4.800)	ORIX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.966)
1.700	Nippon Yusen KK	Morgan Stanley	(1.318)	(12.200)	ORIX Corp	Goldman Sachs	(5.183)
(4.800)	Nishimatsu Construction Co Ltd	Goldman Sachs Merrill Lynch	3.940	(7.200)	ORIX Corp	Morgan Stanley	(1.567)
(100)	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	48	(11)	Orix JREIT Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(224)
(3.900)	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	1.885	300	Osaka Steel Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(369)
(500)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(150)	400	Osaka Steel Co Ltd	Goldman Sachs	(493)
400	Nissan Shatai Co Ltd	Goldman Sachs	(46)	600	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	Goldman Sachs	66
(100)	Nissei ASB Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(119)	800	Pacific Metals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	283
200	Nissha Co Ltd	Goldman Sachs	(48)	2.000	Pacific Metals Co Ltd	Goldman Sachs	524
700	Nisshinbo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(164)	1.900	Pack Corp	Goldman Sachs	(503)
(200)	Nitta Corp	Goldman Sachs	173	(300)	PAL GROUP Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(77)
100	Nitto Kogyo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(71)	400	PALTAC Corp	Bank of America Merrill Lynch	346
1.300	Nitto Kohki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(415)	300	PALTAC Corp	Goldman Sachs	98
600	Nitto Kohki Co Ltd	Goldman Sachs	(192)	800	PALTAC Corp	Morgan Stanley	(1.088)
(400)	Nittoku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	201	(100)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	34
6.100	NOK Corp	Bank of America Merrill Lynch	278	(5.200)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Morgan Stanley	2.580
6.800	NOK Corp	Goldman Sachs	310	300	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	235
4.800	NOK Corp	Morgan Stanley	(2.058)	2.700	Persol Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	74
500	Nomura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	228	(700)	Pharma Foods International Co Ltd	Goldman Sachs	145
5.600	Nomura Co Ltd	Goldman Sachs	2.554	400	Pilot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(547)
(200)	Noritsu Koki Co Ltd	Goldman Sachs	91	600	Pilot Corp	Goldman Sachs	(821)
(31.600)	North Pacific Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.585	3.300	Piolax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(654)
(68.600)	North Pacific Bank Ltd	Goldman Sachs	14.144	2.300	Piolax Inc	Goldman Sachs	(577)
1.000	NS United Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(657)	500	Press Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	—
2.500	NS United Kaiun Kaisha Ltd	Goldman Sachs	(1.642)	3.500	Press Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	—
200	NSD Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(142)	700	Pressance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(217)
21.800	NTN Corp	Goldman Sachs	(795)	2.100	Pressance Corp	Goldman Sachs	(651)
				(500)	Prima Meat Packers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	630
				(1.700)	Prima Meat Packers Ltd	Goldman Sachs	2.419
				1.900	Proto Corp	Goldman Sachs	(312)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées
			USD				USD
	Japon suite				Japon suite		
(100)	Raiznext Corp	Bank of America Merrill Lynch	48	(1.500)	Senshu Ikeda Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	137
(5.500)	Raiznext Corp	Goldman Sachs	2.659	(1.700)	Senshu Ikeda Holdings Inc	Goldman Sachs	155
100	Rakus Co Ltd	Goldman Sachs	(31)	(100)	Seria Co Ltd	Goldman Sachs	43
2.900	Raysum Co Ltd	Goldman Sachs	767	(300)	Serverworks Co Ltd	Goldman Sachs	274
2.600	Resorttrust Inc	Bank of America Merrill Lynch	(849)	(300)	SFP Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(85)
700	Resorttrust Inc	Goldman Sachs	(193)	(1.600)	Shibaura Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(482)
900	Ricoh Leasing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(739)	(1.500)	Shibaura Machine Co Ltd	Goldman Sachs	(451)
1.300	Ricoh Leasing Co Ltd	Goldman Sachs	(1.067)	(400)	Shibuya Corp	Goldman Sachs	949
(300)	Riken Vitamin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	61	(200)	SHIFT Inc	Morgan Stanley	(638)
(800)	Riken Vitamin Co Ltd	Goldman Sachs	166	(100)	Shiga Bank Ltd	Goldman Sachs	119
(700)	Ringer Hut Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19)	800	Shikoku Chemicals Corp	Goldman Sachs	263
300	Riso Kagaku Corp	Goldman Sachs	651	(300)	Shima Seiki Manufacturing Ltd	Goldman Sachs	93
3.400	Rock Field Co Ltd	Goldman Sachs	434	4.800	Shimadzu Corp	Bank of America Merrill Lynch	—
(300)	Rokko Butter Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(41)	4.400	Shimadzu Corp	Goldman Sachs	—
(700)	Round One Corp	Goldman Sachs	(782)	1.700	Shimadzu Corp	Morgan Stanley	(78)
(2.000)	Royal Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(237)	(100)	Shin Nippon Air Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	109
(500)	Royal Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(58)	(1.000)	Shin Nippon Air Technologies Co Ltd	Goldman Sachs	1.085
(200)	RS Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(274)	1.000	Shin-Etsu Polymer Co Ltd	Goldman Sachs	46
500	Ryobi Ltd	Goldman Sachs	(109)	5.200	Shinmaywa Industries Ltd	Goldman Sachs	(95)
(2.100)	Ryoyo Electro Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.034)	1.500	Shinnihon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(123)
(200)	Saibu Gas Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	144	2.000	Shinnihon Corp	Goldman Sachs	(164)
(100)	Saibu Gas Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	72	(4.600)	Shizuoka Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.897
1.800	Sakai Chemical Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.248)	(700)	Shizuoka Bank Ltd	Goldman Sachs	263
1.500	Sakai Chemical Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(1.040)	(4.300)	Shizuoka Bank Ltd	Morgan Stanley	1.686
200	SAMTY Co Ltd	Goldman Sachs	(173)	(3.500)	Shizuoka Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(287)
30	Samty Residential Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	1.259	(300)	Shochiku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.218)
(800)	San ju San Financial Group Inc	Goldman Sachs	(36)	500	Shoei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2
(100)	Sanken Electric Co Ltd	Goldman Sachs	(512)	700	Shoei Co Ltd	Goldman Sachs	(323)
(200)	Sanrio Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	29	200	Showa Denko KK	Bank of America Merrill Lynch	(220)
(500)	Sansan Inc	Bank of America Merrill Lynch	186	300	Showa Denko KK	Goldman Sachs	(276)
(200)	Sansan Inc	Morgan Stanley	(91)	400	Showa Denko KK	Morgan Stanley	(274)
1.400	Sanwa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(580)	200	Siix Corp	Bank of America Merrill Lynch	212
200	Sanwa Holdings Corp	Goldman Sachs	(68)	(800)	Sinanen Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	781
400	Sanwa Holdings Corp	Morgan Stanley	(318)	(2.400)	Sinfonia Technology Co Ltd	Goldman Sachs	(525)
(400)	Sanyo Denki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.262)	5.400	Sintokogio Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.573
(900)	Sanyo Denki Co Ltd	Goldman Sachs	(5.089)	6.600	Sintokogio Ltd	Goldman Sachs	1.694
300	Sanyo Special Steel Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3	(700)	Sodick Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(389)
1.500	Sanyo Special Steel Co Ltd	Goldman Sachs	14	(2.400)	Sodick Co Ltd	Goldman Sachs	(824)
200	SB Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	89	400	Solasto Corp	Goldman Sachs	168
300	Seiko Epson Corp	Bank of America Merrill Lynch	216	2.200	Sourcenext Corp	Bank of America Merrill Lynch	—
1.100	Seiko Epson Corp	Morgan Stanley	50	2.700	Sourcenext Corp	Goldman Sachs	—
(300)	Seiren Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(159)	(100)	SRE Holdings Corp	Goldman Sachs	(579)
(3.100)	Seiren Co Ltd	Goldman Sachs	(1.640)	(200)	St Marc Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	115
(167)	Sekisui House Reit Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2.742)	(400)	St Marc Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	230
(22)	Sekisui House Reit Inc (REIT)	Goldman Sachs	(361)	300	Starzen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(197)
(63)	Sekisui House Reit Inc (REIT)	Morgan Stanley	(460)	200	Starzen Co Ltd	Goldman Sachs	(131)
				1.800	Strike Co Ltd	Goldman Sachs	2.227
				(200)	Sugi Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	115
				(200)	Sugi Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	255
				10.700	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.952

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
	Japon suite				Japon suite		
8.200	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	1.496	2.000	T-Gaia Corp	Bank of America	
65.300	Sumitomo Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	1.787			Merrill Lynch	(1.022)
7.500	Sumitomo Corp	Bank of America		2.400	T-Gaia Corp	Goldman Sachs	(1.226)
		Merrill Lynch	971	(900)	TKC Corp	Goldman Sachs	451
45.700	Sumitomo Corp	Morgan Stanley	(1.129)	300	TKP Corp	Goldman Sachs	1.021
100	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Bank of America		600	Toagosei Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(124)			Merrill Lynch	(60)
100	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Goldman Sachs	(160)	1.200	Toagosei Co Ltd	Goldman Sachs	(181)
1.800	Sumitomo Riko Co Ltd	Bank of America		(6.700)	Toho Bank Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	82	(25.800)	Toho Bank Ltd	Merrill Lynch	550
6.000	Sumitomo Riko Co Ltd	Goldman Sachs	274	300	Toho Titanium Co Ltd	Goldman Sachs	2.118
100	Sumitomo Seika Chemicals Co Ltd	Goldman Sachs	(36)	800	Tokai Corp	Goldman Sachs	50
(900)	Sumitomo Warehouse Co Ltd	Bank of America	334	1.900	Tokai Corp	Bank of America	(511)
		Merrill Lynch		800	TOKAI Holdings Corp	Goldman Sachs	(1.213)
(3.200)	Sumitomo Warehouse Co Ltd	Goldman Sachs	1.173	2.000	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Bank of America	(161)
5.400	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Bank of America	(788)	900	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Merrill Lynch	55
3.300	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Goldman Sachs	(482)	(1.900)	Tokushu Tokai Paper Co Ltd	Goldman Sachs	25
(3.500)	Suruga Bank Ltd	Bank of America	1.468	(32.700)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Goldman Sachs	6.065
		Merrill Lynch	7.007	(13.400)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Bank of America	2.414
(16.700)	Suruga Bank Ltd	Goldman Sachs	413	(60.000)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Merrill Lynch	527
(3.500)	T Hasegawa Co Ltd	Bank of America	306	(200)	Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc	Goldman Sachs	3.068
(2.800)	T Hasegawa Co Ltd	Goldman Sachs	(46)	(1.400)	Tokyu Construction Co Ltd	Bank of America	55
500	Tachibana Eletch Co Ltd	Bank of America	(1.188)	(5)	Tokyu Inc (REIT)	Merrill Lynch	(268)
(700)	Tachi-S Co Ltd	Goldman Sachs	71	(800)	TOMONY Holdings Inc	Goldman Sachs	(319)
200	Taihei Dengyo Kaisha Ltd	Bank of America	569	(7.700)	TOMONY Holdings Inc	Bank of America	58
1.600	Taihei Dengyo Kaisha Ltd	Merrill Lynch	(1.023)	(200)	Tonami Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	562
3.300	Takamatsu Construction Group Co Ltd	Goldman Sachs	(1.395)	800	Topcon Corp	Goldman Sachs	237
4.500	Takamatsu Construction Group Co Ltd	Bank of America	(234)	(600)	Torii Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	810
(900)	Takara Holdings Inc	Goldman Sachs	(235)	300	Tosei Corp	Bank of America	657
(1.500)	Takara Holdings Inc	Morgan Stanley	(27)	200	Towa Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America	(109)
(600)	Takara Holdings Inc	Goldman Sachs	(175)	(1.400)	Toyo Construction Co Ltd	Merrill Lynch	49
2.400	Takara Leben Co Ltd	Goldman Sachs	3			Bank of America	148
(100)	Takasago International Corp	Goldman Sachs	681	(2.900)	Toyo Construction Co Ltd	Merrill Lynch	312
1.600	Takasago Thermal Engineering Co Ltd	Bank of America	144	(100)	Toyo Gosei Co Ltd	Bank of America	(1.040)
600	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(13)	700	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Bank of America	888
100	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	Bank of America	1.117	400	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	606
(300)	Taki Chemical Co Ltd	Merrill Lynch	401	(900)	Toyota Motor Corp	Bank of America	(3.088)
(100)	Taki Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	2.021	(3.900)	Toyota Motor Corp	Merrill Lynch	(10.354)
(1.800)	Takuma Co Ltd	Bank of America	2.645	(2.600)	Toyota Motor Corp	Goldman Sachs	(3.739)
(2.000)	Takuma Co Ltd	Merrill Lynch	(839)	1.300	TPR Co Ltd	Bank of America	(711)
400	Tama Home Co Ltd	Goldman Sachs	(2.308)	2.600	TPR Co Ltd	Merrill Lynch	(1.423)
1.100	Tama Home Co Ltd	Bank of America	(137)	(100)	Trancom Co Ltd	Goldman Sachs	246
(500)	Tamura Corp	Merrill Lynch	(192)	200	Trusco Nakayama Corp	Bank of America	(191)
(700)	Tamura Corp	Goldman Sachs	481	300	Trusco Nakayama Corp	Merrill Lynch	(199)
1.700	Tanseisha Co Ltd	Goldman Sachs	(12)	500	Tsugami Corp	Bank of America	410
100	Teikoku Sen-I Co Ltd	Bank of America	42	500	UACJ Corp	Bank of America	(488)
(500)	Tenma Corp	Merrill Lynch	(394)	1.500	UACJ Corp	Goldman Sachs	(1.464)
(1.200)	Tenma Corp	Goldman Sachs	440				
(2.500)	TerraSky Co Ltd	Goldman Sachs					

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Norvège suite				Portugal			
(456)	Aker ASA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.202)	(251.770)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	Goldman Sachs	(1.313)
(445)	Aker ASA 'A'	Goldman Sachs	(1.173)	(73.448)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	Morgan Stanley	(350)
(1.681)	Aker ASA 'A'	Morgan Stanley	(1.007)	(27.320)	Mota-Engil SGPS SA	Goldman Sachs	(1.800)
365	Atea ASA	Bank of America Merrill Lynch	179	(24.844)	Mota-Engil SGPS SA	Goldman Sachs	12
322	Atea ASA	Goldman Sachs	89	4.820	NOS SGPS SA	Goldman Sachs	(1.600)
1.672	Austevoll Seafood ASA	Goldman Sachs	(616)	(657)	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	76
(373)	Bakkafrost P	Bank of America Merrill Lynch	(149)	(12.541)	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	Goldman Sachs	1.454
(1.132)	Bakkafrost P	Goldman Sachs	(4.339)				(3.521)
(1.974)	Bakkafrost P	Morgan Stanley	(2.365)	Singapour			
1.769	Borregaard ASA	Bank of America Merrill Lynch	2.374	(2.100)	AEM Holdings Ltd	Goldman Sachs	(178)
5.003	Borregaard ASA	Goldman Sachs	6.463	(26.900)	CapitaLand Ltd	Goldman Sachs	(1.650)
659	BW LPG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(886)	(210.900)	CapitalLand Ltd	Morgan Stanley	(6.288)
248	BW LPG Ltd	Goldman Sachs	(358)	109.600	ComfortDelGro Corp Ltd	Morgan Stanley	4.146
3.506	BW Offshore Ltd	Bank of America Merrill Lynch	244	(23.100)	Frasers Centrepoint Trust (REIT)	Goldman Sachs	(664)
4.930	BW Offshore Ltd	Goldman Sachs	606	63.900	Hutchison Port Holdings Trust 'U'	Bank of America Merrill Lynch	38
617	Crayon Group Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	128	299.200	Hutchison Port Holdings Trust 'U'	Goldman Sachs	1.166
889	Crayon Group Holding ASA	Goldman Sachs	428	229.900	Hutchison Port Holdings Trust 'U'	Morgan Stanley	—
5.740	Elkem ASA	Bank of America Merrill Lynch	275	28.600	Keppel REIT (REIT)	Morgan Stanley	—
2.096	Europris ASA	Bank of America Merrill Lynch	278	(12.800)	Parkway Life Real Estate Investment Trust (REIT)	Merrill Lynch	(2.324)
696	Europris ASA	Goldman Sachs	96	(27.500)	Singapore Airlines Ltd	Morgan Stanley	(3.704)
197	FLEX LNG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	89	(45.980)	Singapore Airlines Ltd	Morgan Stanley	—
1.855	Golden Ocean Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	724	11.500	Singapore Post Ltd	Morgan Stanley	93
6.667	Golden Ocean Group Ltd	Goldman Sachs	4.230	5.700	Singapore Press Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	396
(734)	Grieg Seafood ASA	Bank of America Merrill Lynch	(633)	80.200	Singapore Press Holdings Ltd	Morgan Stanley	(607)
(392)	Grieg Seafood ASA	Goldman Sachs	(338)	1.000	Wilmar International Ltd	Goldman Sachs	(37)
(6.755)	Hafnia Ltd	Goldman Sachs	146	10.100	Wilmar International Ltd	Morgan Stanley	(481)
(6.577)	Leroy Seafood Group ASA	Bank of America Merrill Lynch	(583)				(10.094)
(2.080)	Leroy Seafood Group ASA	Goldman Sachs	(184)	Espagne			
(7.273)	Leroy Seafood Group ASA	Morgan Stanley	1.168	(759)	Aedas Homes SA	Goldman Sachs	463
105	Norway Royal Salmon ASA	Goldman Sachs	(98)	(79)	Aena SME SA	Morgan Stanley	(53)
(1.730)	Norwegian Finans Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	3	(177)	Almirall SA	Bank of America Merrill Lynch	(50)
574	Ocean Yield ASA	Bank of America Merrill Lynch	30	89	Amadeus IT Group SA	Goldman Sachs	5
882	Ocean Yield ASA	Goldman Sachs	(34)	444	Applus Services SA	Bank of America Merrill Lynch	18
16	Pexip Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	11	982	Applus Services SA	Goldman Sachs	90
2.855	Pexip Holding ASA	Goldman Sachs	1.561	27.708	Banco de Sabadell SA	Goldman Sachs	(1.115)
(1.309)	Sbanken ASA	Bank of America Merrill Lynch	(91)	19.926	Banco de Sabadell SA	Morgan Stanley	(371)
(5.530)	Sbanken ASA	Goldman Sachs	(33)	(148)	CIE Automotive SA	Goldman Sachs	(15)
1.589	Selvaag Bolig ASA	Bank of America Merrill Lynch	249	(55)	Corp Financiera Alba SA	Goldman Sachs	—
502	Selvaag Bolig ASA	Goldman Sachs	66	(2.021)	eDreams ODIGEO SA	Bank of America Merrill Lynch	(1.159)
483	Sparebank 1 Oestlandet	Bank of America Merrill Lynch	83	(1.067)	Faes Farma SA	Goldman Sachs	112
1.484	Sparebank 1 Oestlandet	Goldman Sachs	218	1.855	Gestamp Automocion SA	Goldman Sachs	(294)
343	SpareBank 1 SMN	Goldman Sachs	3	(1.734)	Grupo Empresarial San Jose SA	Goldman Sachs	63
420	SpareBank 1 SR-Bank ASA	Goldman Sachs	(115)	339	Indra Sistemas SA	Bank of America Merrill Lynch	(50)
(2.158)	Stolt-Nielsen Ltd	Goldman Sachs	310	1.237	Indra Sistemas SA	Goldman Sachs	16
8.661	TGS NOPEC Geophysical Co ASA	Goldman Sachs	(5.466)	773	Mediaset Espana Comunicacion SA	Bank of America Merrill Lynch	151
(841)	Wallenius Wilhelmsen ASA	Bank of America Merrill Lynch	(129)	5.788	Mediaset Espana Comunicacion SA	Goldman Sachs	2.614
(2.213)	Wallenius Wilhelmsen ASA	Goldman Sachs	(251)	(328)	Melia Hotels International SA	Bank of America Merrill Lynch	3
(5.370)	XXL ASA	Goldman Sachs	746	(602)	Melia Hotels International SA	Goldman Sachs	63
			(9.224)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Espagne suite				Suède suite			
(870)	Metrovacesa SA	Bank of America		373	Loomis AB	Goldman Sachs	(216)
		Merrill Lynch	541	(204)	Mekonomen AB	Bank of America	
(3.025)	Metrovacesa SA	Goldman Sachs	1.883			Merrill Lynch	(69)
(1.118)	Prosegur Cia de Seguridad SA	Goldman Sachs	281	(1.084)	Mekonomen AB	Goldman Sachs	(366)
(1.000)	Sacyr SA	Goldman Sachs	83	66	Millicom International Cellular SA SDR	Bank of America	
(117)	Solarpack Corp Tecnologica SA	Goldman Sachs	(137)	(306)	Munters Group AB	Merrill Lynch	(26)
(402)	Talgo SA	Bank of America		(141)	NCC AB 'B'	Goldman Sachs	(11)
		Merrill Lynch	(41)			Bank of America	
(402)	Talgo SA	Goldman Sachs	(141)	(2.064)	NCC AB 'B'	Merrill Lynch	80
				(2.845)	Peab AB 'B'	Goldman Sachs	884
			2.960	(837)	Recipharm AB 'B'	Goldman Sachs	274
Suède						Bank of America	
(914)	Adapteo Oyj	Goldman Sachs	(44)			Merrill Lynch	—
296	AddTech AB 'B'	Goldman Sachs	48	(208)	Recipharm AB 'B'	Morgan Stanley	—
(759)	AF Poyry AB	Bank of America		946	Saab AB 'B'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(679)			Merrill Lynch	(625)
(2.092)	AF Poyry AB	Goldman Sachs	(2.809)	206	Saab AB 'B'	Goldman Sachs	(131)
(1.393)	Alimak Group AB	Goldman Sachs	504	990	Saab AB 'B'	Morgan Stanley	(735)
(1.780)	Ambea AB	Bank of America		2.111	Scandi Standard AB	Bank of America	
		Merrill Lynch	(912)			Merrill Lynch	(1.095)
(746)	Ambea AB	Goldman Sachs	(382)	2.289	Scandi Standard AB	Goldman Sachs	(1.187)
4.959	Arjo AB 'B'	Goldman Sachs	2.930	2.760	Scandic Hotels Group AB	Goldman Sachs	(33)
(4.907)	Attendo AB	Goldman Sachs	(166)	3.640	SKF AB 'B'	Bank of America	
(199)	Boozt AB	Goldman Sachs	(81)			Merrill Lynch	1.420
(2.084)	Bravida Holding AB	Bank of America		1.199	SKF AB 'B'	Morgan Stanley	676
		Merrill Lynch	(518)	(18)	SkiStar AB	Bank of America	
(4.620)	Bravida Holding AB	Goldman Sachs	(1.451)			Merrill Lynch	(14)
(267)	Bure Equity AB	Bank of America		(676)	SkiStar AB	Goldman Sachs	(538)
		Merrill Lynch	(250)	3.094	SSAB AB 'A'	Bank of America	
(202)	Bure Equity AB	Goldman Sachs	(199)			Merrill Lynch	(306)
514	Catena AB	Bank of America		251	SSAB AB 'A'	Goldman Sachs	(23)
		Merrill Lynch	635	40.534	SSAB AB 'A'	Morgan Stanley	(4.141)
1.618	Catena AB	Goldman Sachs	3.259	38.765	SSAB AB 'B'	Goldman Sachs	82
197	Cibus Nordic Real Estate AB	Bank of America		(4.170)	Stillfront Group AB	Morgan Stanley	(471)
		Merrill Lynch	109	(1.450)	Thule Group AB	Bank of America	
165	Clas Ohlson AB 'B'	Goldman Sachs	(6)			Merrill Lynch	(2.567)
(13.933)	Cloetta AB 'B'	Goldman Sachs	(1.042)	(1.926)	Thule Group AB	Goldman Sachs	(1.620)
(870)	Collector AB	Bank of America		(891)	Thule Group AB	Morgan Stanley	(796)
		Merrill Lynch	(141)	1.623	Tobii AB	Bank of America	
(1.390)	Creades AB 'A'	Goldman Sachs	(2.885)			Merrill Lynch	(754)
(200)	Duni AB	Bank of America		184	Tobii AB	Goldman Sachs	(85)
		Merrill Lynch	(140)	256	Troax Group AB	Bank of America	
(710)	Duni AB	Goldman Sachs	(269)			Merrill Lynch	163
280	GARO AB	Goldman Sachs	209	132	Troax Group AB	Goldman Sachs	132
(135)	Instalco AB	Goldman Sachs	(736)	394	Vitrolife AB	Goldman Sachs	1.302
928	Intrum AB	Bank of America		1.943	Wihlborgs Fastigheter AB	Goldman Sachs	485
		Merrill Lynch	(341)				(13.122)
385	Intrum AB	Goldman Sachs	(56)	Suisse			
502	Intrum AB	Morgan Stanley	(267)	65	ALSO Holding AG Reg	Goldman Sachs	974
150	Inwido AB	Goldman Sachs	(7)	(25)	APG SGA SA	Bank of America	
21	John Mattson	Bank of America				Merrill Lynch	(458)
	Fastighetsforetagen AB	Merrill Lynch	26	(1)	APG SGA SA	Goldman Sachs	(18)
232	John Mattson	Bank of America		(268)	Arbonia AG	Bank of America	
	Fastighetsforetagen AB	Goldman Sachs	285			Merrill Lynch	(119)
204	Kambi Group Plc	Goldman Sachs	238	18	Autoneum Holding AG	Bank of America	
(4.640)	Karo Pharma AB	Bank of America				Merrill Lynch	120
		Merrill Lynch	(659)	(636)	Basilea Pharmaceutica AG Reg	Goldman Sachs	(198)
(3.406)	Karo Pharma AB	Goldman Sachs	(447)	21	Bell Food Group AG Reg	Goldman Sachs	82
3.661	Kindred Group Plc SDR	Bank of America		19	Bossard Holding AG Reg	Goldman Sachs	(84)
		Merrill Lynch	3.785	(9)	Daetwyler Holding AG	Bank of America	
395	Kindred Group Plc SDR	Goldman Sachs	443			Merrill Lynch	(100)
(13.333)	Klovern AB 'B'	Goldman Sachs	(482)	(45)	Daetwyler Holding AG	Goldman Sachs	(500)
(130)	KNOW IT AB	Bank of America		(1.188)	EFG International AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	(172)			Merrill Lynch	383
(220)	KNOW IT AB	Goldman Sachs	(292)	(6.885)	EFG International AG	Goldman Sachs	2.217
408	Kungsleden AB	Goldman Sachs	52	(17)	Forbo Holding AG Reg	Goldman Sachs	(1.020)
65	Lime Technologies AB	Bank of America		(1.796)	Galenica AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	99			Merrill Lynch	(709)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Suisse suite				Royaume-Uni suite			
(14)	Galenica AG	Morgan Stanley	(9)	37	Alpha FX Group Plc	Bank of America	
201	Holcim Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	21
		Merrill Lynch	68	537	Alpha FX Group Plc	Goldman Sachs	304
144	Holcim Ltd	Goldman Sachs	(36)	(2.741)	AO World Plc	Bank of America	
(57)	Huber + Suhner AG Reg	Goldman Sachs	(114)			Merrill Lynch	(349)
(240)	Implenia AG Reg	Bank of America		622	Associated British Foods Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(270)			Merrill Lynch	388
(279)	Implenia AG Reg	Goldman Sachs	(240)	3.217	Associated British Foods Plc	Goldman Sachs	981
2	Interroll Holding AG Reg	Bank of America		15.715	Associated British Foods Plc	Morgan Stanley	(1.906)
		Merrill Lynch	1.077	(1.061)	AstraZeneca Plc	Morgan Stanley	1.564
2	Interroll Holding AG Reg	Goldman Sachs	622	(547)	AVEVA Group Plc	Morgan Stanley	(1.736)
891	Landis+Gyr Group AG	Bank of America		(24.770)	BAE Systems Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.185			Merrill Lynch	(1.669)
776	Landis+Gyr Group AG	Goldman Sachs	2.034	(7.247)	BAE Systems Plc	Goldman Sachs	(832)
2.286	Landis+Gyr Group AG	Morgan Stanley	4.399	(37.284)	BAE Systems Plc	Morgan Stanley	(2.522)
1	LEM Holding SA Reg	Goldman Sachs	53	(152)	Bank of Georgia Group Plc	Goldman Sachs	(86)
(23)	Liechtensteinische Landesbank AG	Bank of America		1.881	Beazley Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(41)			Merrill Lynch	(109)
(133)	Liechtensteinische Landesbank AG	Goldman Sachs	(236)	12.112	Beazley Plc	Goldman Sachs	427
(1.942)	Mobilezone Holding AG Reg	Goldman Sachs	(820)	10.474	Beazley Plc	Morgan Stanley	4
(57)	Mobimo Holding AG Reg	Bank of America		2.890	Bellway Plc	Goldman Sachs	2.551
		Merrill Lynch	(284)	899	Bellway Plc	Morgan Stanley	866
(78)	Mobimo Holding AG Reg	Goldman Sachs	(425)	1.430	Biffa Plc	Bank of America	
(413)	Orior AG	Goldman Sachs	688			Merrill Lynch	436
(182)	Rieter Holding AG Reg	Goldman Sachs	(2.143)	(14)	Big Yellow Group Plc (REIT)	Bank of America	
(168)	Roche Holding AG	Bank of America				Merrill Lynch	(5)
		Merrill Lynch	21	(518)	Big Yellow Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	101
(410)	Roche Holding AG	Goldman Sachs	(2.554)	17.470	Brewin Dolphin Holdings Plc	Goldman Sachs	(758)
(159)	Roche Holding AG	Morgan Stanley	(30)	(34.306)	BT Group Plc	Goldman Sachs	(3.514)
708	Sensirion Holding AG	Goldman Sachs	2.831	(135.374)	BT Group Plc	Morgan Stanley	6.043
(20)	Siegfried Holding AG Reg	Bank of America		773	Bytes Technology Group Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	170			Merrill Lynch	(1)
(112)	Siegfried Holding AG Reg	Goldman Sachs	735	3.494	Bytes Technology Group Plc	Goldman Sachs	(333)
(58)	Siegfried Holding AG Reg	Morgan Stanley	406	(2.436)	C&C Group Plc	Goldman Sachs	1.774
506	Sika AG Reg	Bank of America		(635)	C&C Group Plc	Goldman Sachs	(504)
		Merrill Lynch	7.002	2.369	Cairn Energy Plc	Goldman Sachs	(242)
173	Sika AG Reg	Goldman Sachs	2.887	(5.080)	Carnival Plc	Morgan Stanley	(8.753)
1.797	Sika AG Reg	Morgan Stanley	6.586	4.493	Centrica Plc	Bank of America	
(24)	St Galler Kantonalbank AG Reg	Bank of America				Merrill Lynch	108
		Merrill Lynch	95	9.068	Centrica Plc	Goldman Sachs	207
(26)	St Galler Kantonalbank AG Reg	Goldman Sachs	95	(1.500)	Close Brothers Group Plc	Goldman Sachs	(1.212)
(1.810)	Swiss Prime Site AG Reg	Bank of America		1.938	CMC Markets Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.020)			Merrill Lynch	439
(1.013)	Swiss Prime Site AG Reg	Goldman Sachs	(2.250)	2.837	CMC Markets Plc	Goldman Sachs	521
(3.787)	Swiss Prime Site AG Reg	Morgan Stanley	(3.365)	41	Cranswick Plc	Bank of America	
(22)	TX Group AG	Goldman Sachs	(54)	593	Crest Nicholson Holdings Plc	Bank of America	
(526)	Valiant Holding AG Reg	Bank of America				Merrill Lynch	417
		Merrill Lynch	4.010	606	Crest Nicholson Holdings Plc	Goldman Sachs	296
(896)	Valiant Holding AG Reg	Goldman Sachs	7.188	395	CVS Group Plc	Bank of America	
(86)	Vifor Pharma AG	Bank of America				Merrill Lynch	143
		Merrill Lynch	(527)	(108.165)	Deliveroo Plc	Bank of America	
37	VZ Holding AG	Bank of America				Merrill Lynch	(12.109)
		Merrill Lynch	37	(21.856)	Deliveroo Plc	Goldman Sachs	(5.110)
175	VZ Holding AG	Goldman Sachs	175	(3.154)	Deliveroo Plc	Morgan Stanley	(55)
38	V-ZUG Holding AG	Goldman Sachs	397	(70)	Diageo Plc	Goldman Sachs	2
(344)	Zehnder Group AG	Goldman Sachs	611	(2.334)	Diversified Energy Co Plc	Goldman Sachs	443
			27.524	10.385	easyJet Plc	Bank of America	
						Merrill Lynch	3.046
2.564	888 Holdings Plc	Bank of America		86	easyJet Plc	Goldman Sachs	45
		Merrill Lynch	437	(1.530)	Elementis Plc	Bank of America	
7.233	888 Holdings Plc	Goldman Sachs	1.291	(1.258)	Energiean Plc	Merrill Lynch	(10)
(872)	AB Dynamics Plc	Bank of America				Merrill Lynch	86
		Merrill Lynch	—	(4.606)	Equiniti Group Plc	Bank of America	
41	AJ Bell Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(587)
		Merrill Lynch	(7)	515	Ergomed Plc	Bank of America	
8.830	AJ Bell Plc	Goldman Sachs	(1.476)			Merrill Lynch	(385)
25	Alfa Financial Software Holdings Plc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(3)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(227)	Euromoney Institutional Investor Plc	Goldman Sachs	(153)	362	Moneysupermarket.com Group Plc	Goldman Sachs	11
(2.938)	Filtrona Plc	Bank of America Merrill Lynch	(163)	2	Moneysupermarket.com Group Plc ^{††}	Morgan Stanley	—
(6.592)	Filtrona Plc	Goldman Sachs	(200)	385	Morgan Sindall Group Plc	Goldman Sachs	191
(1)	First Derivatives Plc	Bank of America Merrill Lynch	6	7.651	National Express Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.149
(78)	First Derivatives Plc	Goldman Sachs	497	5.548	National Express Group Plc	Goldman Sachs	1.034
1.157	Forterra Plc	Bank of America Merrill Lynch	148	4.390	National Express Group Plc	Morgan Stanley	460
(340)	Future Plc	Goldman Sachs	(840)	(821)	NCC Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	17
(1.480)	Future Plc	Morgan Stanley	(2.475)	(532)	NCC Group Plc	Goldman Sachs	(31)
203	Gamesys Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(43)	3.928	Network International Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	433
(2.039)	GlaxoSmithKline Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.023	5.173	Network International Holdings Plc	Goldman Sachs	736
(4.772)	GlaxoSmithKline Plc	Goldman Sachs	2.394	3.374	Network International Holdings Plc	Morgan Stanley	585
(28.114)	GlaxoSmithKline Plc	Morgan Stanley	4.143	184	Next Plc	Morgan Stanley	188
406	Go-Ahead Group Plc	Goldman Sachs	(242)	15.474	Ninety One Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.359)
902	Greggs Plc	Morgan Stanley	40	25.176	Ninety One Plc	Goldman Sachs	(2.212)
(323.151)	Harbour Energy Plc	Goldman Sachs	(545)	(298)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	385
(210.452)	Harbour Energy Plc	Morgan Stanley	541	(86)	Pearson Plc	Goldman Sachs	30
57	HomeServe Plc	Bank of America Merrill Lynch	(83)	(1.880)	Pearson Plc	Morgan Stanley	746
736	HomeServe Plc	Goldman Sachs	(403)	18.519	Phoenix Group Holdings Plc	Morgan Stanley	—
28.753	HomeServe Plc	Morgan Stanley	(2.970)	(2.103)	Premier Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	116
1.112	Hunting Plc	Bank of America Merrill Lynch	65	(8.658)	Premier Foods Plc	Goldman Sachs	526
1.798	Indivior Plc	Bank of America Merrill Lynch	156	(841)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	604
(2.235)	Informa Plc	Bank of America Merrill Lynch	(29)	(936)	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldman Sachs	1.408
(6.381)	Informa Plc	Goldman Sachs	(25)	(383)	Redde Northgate Plc	Bank of America Merrill Lynch	27
(314)	InterContinental Hotels Group Plc	Goldman Sachs	217	(16.451)	Redde Northgate Plc	Goldman Sachs	1.166
(8.263)	Investec Plc	Goldman Sachs	(2.845)	366	Redrow Plc	Bank of America Merrill Lynch	36
(4.888)	IP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(288)	1.259	Redrow Plc	Morgan Stanley	150
(25.656)	IP Group Plc	Goldman Sachs	(2.006)	5.349	Restaurant Group Plc	Goldman Sachs	106
(16.543)	ITM Power Plc	Bank of America Merrill Lynch	(16.948)	(108)	RWS Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	12
3.241	John Wood Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(756)	(9.303)	RWS Holdings Plc	Goldman Sachs	395
5.479	John Wood Group Plc	Goldman Sachs	(1.606)	1.692	Safestore Holdings Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	707
32.071	John Wood Group Plc	Morgan Stanley	(3.681)	1.387	Safestore Holdings Plc (REIT)	Goldman Sachs	580
67	Judges Scientific Plc	Bank of America Merrill Lynch	171	(2.017)	Sage Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	455
80	Judges Scientific Plc	Goldman Sachs	204	(4.452)	Sage Group Plc	Goldman Sachs	1.089
128	Kainos Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	44	(2.917)	Serica Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	83
2.360	Kainos Group Plc	Goldman Sachs	804	(16.040)	Serica Energy Plc	Goldman Sachs	455
(2.738)	Lancashire Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.561	(485)	Shaftesbury Plc (REIT)	Goldman Sachs	(86)
(9.388)	Lancashire Holdings Ltd	Goldman Sachs	6.718	(3.201)	Spire Healthcare Group Plc	Goldman Sachs	(2.336)
1.107	Marshalls Plc	Bank of America Merrill Lynch	(16)	(798)	Sports Direct International Plc	Goldman Sachs	28
3.214	Marshalls Plc	Goldman Sachs	(144)	1.374	St Modwen Properties Plc	Bank of America Merrill Lynch	76
26	Mediclinic International Plc	Bank of America Merrill Lynch	10	2.358	Strix Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	529
5.938	Mediclinic International Plc	Goldman Sachs	2.322	6.238	Strix Group Plc	Goldman Sachs	1.645
5.851	Micro Focus International Plc	Bank of America Merrill Lynch	4.046	24.420	Taylor Wimpey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(960)
9.854	Micro Focus International Plc	Goldman Sachs	6.357	8.504	Taylor Wimpey Plc	Morgan Stanley	175
10.160	Micro Focus International Plc	Morgan Stanley	1.811	(412)	TBC Bank Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(416)
2	Moneysupermarket.com Group Plc ^{††}	Bank of America Merrill Lynch	—	(160)	TBC Bank Group Plc	Goldman Sachs	(74)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Royaume-Uni suite				États-Unis suite			
464	Team17 Group Plc	Bank of America		(557)	ALLETE Inc	Goldman Sachs	151
		Merrill Lynch	(208)	(158)	Altabancorp	Bank of America	
6.850	Team17 Group Plc	Goldman Sachs	(343)			Merrill Lynch	(404)
256	Ultra Electronics Holdings Plc	Goldman Sachs	102	(384)	Altabancorp	Goldman Sachs	(1.075)
(6.963)	United Utilities Group Plc	Morgan Stanley	592	377	Alteryx Inc 'A'	Bank of America	
7.243	Virgin Money UK Plc	Bank of America				Merrill Lynch	282
		Merrill Lynch	757	389	Alteryx Inc 'A'	Goldman Sachs	459
8.156	Virgin Money UK Plc	Goldman Sachs	869	984	Alteryx Inc 'A'	Morgan Stanley	1.411
370	Workspace Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	(16)	(3.865)	Alto Ingredients Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(5.063)
			(13.954)	(67)	Altra Industrial Motion Corp	Goldman Sachs	(8)
				156	Amalgamated Financial Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	20
	États-Unis			1.475	Amalgamated Financial Corp	Goldman Sachs	192
(1.235)	10X Genomics Inc 'A'	Morgan Stanley	(17.047)	711	Ambarella Inc	Bank of America	
137	1-800-Flowers.com Inc 'A'	Goldman Sachs	(101)			Merrill Lynch	8.752
180	1st Source Corp	Goldman Sachs	63	812	Ambarella Inc	Goldman Sachs	7.162
(306)	2U Inc	Bank of America		449	Ambarella Inc	Morgan Stanley	1.165
		Merrill Lynch	19	(94)	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'		
(889)	2U Inc	Goldman Sachs	(1.012)	(122)	Ameresco Inc 'A'	Morgan Stanley	85
(333)	8x8 Inc	Goldman Sachs	133			Bank of America	
(1.328)	A10 Networks Inc	Bank of America		(653)	Ameresco Inc 'A'	Merrill Lynch	(340)
		Merrill Lynch	(558)	1.577	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs	(1.431)
(528)	A10 Networks Inc	Goldman Sachs	(222)			Bank of America	
(181)	AAON Inc	Bank of America		673	American Eagle Outfitters Inc	Merrill Lynch	3.403
		Merrill Lynch	(32)	(363)	American National Group Inc	Morgan Stanley	1.837
(1.132)	AAON Inc	Goldman Sachs	474	(591)	American National Group Inc	Bank of America	
142	AAR Corp	Bank of America		(85)	American Public Education Inc	Goldman Sachs	(1)
		Merrill Lynch	260	95	American Software Inc 'A'	Bank of America	
834	AAR Corp	Goldman Sachs	1.243			Merrill Lynch	46
1.764	Aaron's Co Inc	Goldman Sachs	5.715	1.260	American Software Inc 'A'	Goldman Sachs	605
68	ACM Research Inc 'A'	Bank of America		(30)	American States Water Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	791			Merrill Lynch	11
89	ACM Research Inc 'A'	Goldman Sachs	1.009	(76)	American States Water Co	Goldman Sachs	3
(74)	Adtalem Global Education Inc	Bank of America		559	American Woodmark Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	117			Merrill Lynch	(4.357)
(2.934)	Adtalem Global Education Inc	Goldman Sachs	4.636	608	American Woodmark Corp	Goldman Sachs	(4.196)
(1.264)	ADTRAN Inc	Bank of America		(1.847)	Ameris Bancorp	Goldman Sachs	2.900
		Merrill Lynch	63	2.896	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(3.012)
(3.335)	ADTRAN Inc	Goldman Sachs	1.334	(8.307)	Amphenol Corp 'A'	Morgan Stanley	(1.578)
119	Advanced Drainage Systems Inc	Bank of America		(162)	Analog Devices Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(210)			Merrill Lynch	(122)
3.008	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	(893)	(724)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	291
(723)	Adverum Biotechnologies Inc	Bank of America		(441)	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	(707)
		Merrill Lynch	(31)	(434)	AnaptysBio Inc	Bank of America	
(32)	AeroVironment Inc	Bank of America				Merrill Lynch	890
		Merrill Lynch	(58)	(408)	AnaptysBio Inc	Goldman Sachs	836
(239)	AeroVironment Inc	Goldman Sachs	(527)	648	Andersons Inc	Goldman Sachs	39
(263)	Affirm Holdings Inc	Bank of America		(408)	Antero Resources Corp	Goldman Sachs	(134)
		Merrill Lynch	(2.685)	(425)	Apogee Enterprises Inc	Bank of America	
(125)	Affirm Holdings Inc	Goldman Sachs	(468)			Merrill Lynch	(68)
68	Agilysys Inc	Bank of America		(562)	Apogee Enterprises Inc	Goldman Sachs	101
		Merrill Lynch	(125)	(1.047)	Apollo Medical Holdings Inc	Bank of America	
1.993	AGNC Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	658			Merrill Lynch	(3.580)
286	AGNC Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(11)	(1.743)	Apollo Medical Holdings Inc	Goldman Sachs	(5.976)
(4.164)	Akebia Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(497)	(2.565)	Apple Hospitality Inc (REIT)	Goldman Sachs	(975)
260	Albany International Corp 'A'	Bank of America		434	Apple Inc	Goldman Sachs	(974)
		Merrill Lynch	1.194	1.675	Apple Inc	Morgan Stanley	(3.378)
448	Albany International Corp 'A'	Goldman Sachs	1.967	(1.290)	Applied Materials Inc	Bank of America	
895	Alcoa Corp	Morgan Stanley	2.837			Merrill Lynch	(666)
242	Alexander & Baldwin Inc (REIT)	Bank of America		(721)	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	(274)
		Merrill Lynch	179				
1.071	Alexander & Baldwin Inc (REIT)	Goldman Sachs	810				
(1.255)	Allegheny Technologies Inc	Goldman Sachs	(803)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(2.791)	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	(6.540)	820	Axis Capital Holdings Ltd	Bank of America	
(1.340)	AppLovin Corp 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	(43)
		Merrill Lynch	(6.735)	1.320	Axis Capital Holdings Ltd	Goldman Sachs	1.120
2.460	Aramark	Bank of America		826	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	468
		Merrill Lynch	(2.646)	(396)	Axogen Inc	Bank of America	
795	Aramark	Goldman Sachs	43			Merrill Lynch	309
248	Aramark	Morgan Stanley	(22)	(76)	AZEK Co Inc	Bank of America	
3.291	Arch Capital Group Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(17)
		Merrill Lynch	(1.630)	(345)	AZEK Co Inc	Goldman Sachs	(77)
1.300	Arch Capital Group Ltd	Goldman Sachs	305	(328)	AZEK Co Inc	Morgan Stanley	(157)
694	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	(28)	(282)	AZZ Inc	Goldman Sachs	227
(31)	Arcosa Inc	Bank of America		(166)	B Riley Financial Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(38)			Merrill Lynch	219
(783)	Arcosa Inc	Goldman Sachs	(938)	(233)	B Riley Financial Inc	Goldman Sachs	308
99	Arcus Biosciences Inc	Bank of America		10	Bandwidth Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	33			Merrill Lynch	25
(517)	Ares Management Corp 'A'	Goldman Sachs	(703)	334	Bandwidth Inc 'A'	Goldman Sachs	571
(65)	Argo Group International Holdings Ltd			227	Bandwidth Inc 'A'	Morgan Stanley	409
		Goldman Sachs	74	(155)	Bank First Corp	Bank of America	
(287)	Arrow Electronics Inc	Bank of America				Merrill Lynch	148
		Merrill Lynch	201	(15.636)	Bank of America Corp	Morgan Stanley	(582)
(177)	Arrow Electronics Inc	Goldman Sachs	414	1.220	Bank of Marin Bancorp	Bank of America	
(149)	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	495			Merrill Lynch	(2.171)
(177)	Arrow Financial Corp	Bank of America		739	Bank of Marin Bancorp	Goldman Sachs	(1.245)
		Merrill Lynch	(27)	(44)	Barrett Business Services Inc		
(189)	Arrow Financial Corp	Goldman Sachs	(28)			Goldman Sachs	(17)
(2.046)	Asana Inc 'A'	Bank of America		(325)	Baxter International Inc	Morgan Stanley	211
		Merrill Lynch	(5.050)	(139)	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs	(101)
(297)	Asana Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.877)	(431)	Becton Dickinson and Co	Bank of America	
(341)	Asana Inc 'A'	Morgan Stanley	(204)			Merrill Lynch	(104)
(62)	Asbury Automotive Group Inc	Bank of America		(1.056)	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	1.932
		Merrill Lynch	508	348	BellRing Brands Inc 'A'	Bank of America	
(706)	Assembly Biosciences Inc	Bank of America				Merrill Lynch	339
		Merrill Lynch	7	471	BellRing Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	721
(4.459)	Assembly Biosciences Inc	Goldman Sachs	45	1.493	Benchmark Electronics Inc	Bank of America	
129	AssetMark Financial Holdings Inc	Bank of America		1.011	Benchmark Electronics Inc	Merrill Lynch	922
		Merrill Lynch	187	(3.003)	BGC Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	647
864	AssetMark Financial Holdings Inc		1.253			Bank of America	
(101)	Atkore Inc	Goldman Sachs		(6.217)	BGC Partners Inc 'A'	Merrill Lynch	(1.201)
		Bank of America	(205)	50	Big Lots Inc	Goldman Sachs	(2.487)
674	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	931	(240)	BigCommerce Holdings Inc	Merrill Lynch	(228)
1.887	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc		(1.151)	(257)	Bill.com Holdings Inc	Morgan Stanley	328
		Goldman Sachs		(1.645)	Black Knight Inc	Morgan Stanley	(62)
594	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc		(368)			Bank of America	
		Morgan Stanley		(1.494)	Black Knight Inc	Merrill Lynch	(567)
(685)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc		(246)	(1.719)	Black Knight Inc	Goldman Sachs	(2.249)
		Goldman Sachs		(95)	Blackbaud Inc	Morgan Stanley	(236)
10	Atlassian Corp Plc 'A'	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	182	(180)	Blackbaud Inc	Merrill Lynch	(134)
104	Atlassian Corp Plc 'A'	Goldman Sachs	263	220	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(113)
676	Atlassian Corp Plc 'A'	Morgan Stanley	7.220	107	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America	
57	ATN International Inc	Bank of America				Merrill Lynch	104
		Merrill Lynch	(54)	6.238	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	42
46	ATN International Inc	Goldman Sachs	(43)			Goldman Sachs	
356	Atreca Inc 'A'	Goldman Sachs	(55)	777	Bloom Energy Corp 'A'	Morgan Stanley	1.310
(82)	AutoZone Inc	Morgan Stanley	2.054	68	Bloom Energy Corp 'A'	Goldman Sachs	1.368
(256)	Avalara Inc	Goldman Sachs	300	800	Bloomin' Brands Inc	Morgan Stanley	45
(204)	Avalara Inc	Morgan Stanley	(450)	(38)	Bluebird Bio Inc	Goldman Sachs	1.033
192	Avantor Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	240	(1.999)	Bluebird Bio Inc	Merrill Lynch	(46)
1.533	Avantor Inc	Morgan Stanley	690	(50)	BOK Financial Corp	Goldman Sachs	(2.084)
101	Avaya Holdings Corp	Goldman Sachs	142			Bank of America	
(126)	Avista Corp	Bank of America		(358)	BOK Financial Corp	Merrill Lynch	(89)
		Merrill Lynch	(11)	62	Boot Barn Holdings Inc	Goldman Sachs	(202)
(549)	Avista Corp	Goldman Sachs	197			Bank of America	
583	Avrobio Inc	Bank of America		(540)	Brandywine Realty Trust (REIT)	Merrill Lynch	(9)
		Merrill Lynch	(169)			Bank of America	
291	Avrobio Inc	Goldman Sachs	(84)			Merrill Lynch	—

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(2.418)	Brandywine Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(342)	483	Camping World Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	1.963
488	Bright Horizons Family Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	850	788	Camping World Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	3.198
1.486	Bright Horizons Family Solutions Inc	Morgan Stanley	5.362	632	Capital City Bank Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	256
689	BrightHouse Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(448)	553	Capital City Bank Group Inc	Goldman Sachs	182
2.440	BrightHouse Financial Inc	Goldman Sachs	(1.247)	(691)	Cara Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(145)
4.058	BrightHouse Financial Inc	Morgan Stanley	933	108	Cardlytics Inc	Morgan Stanley	690
1.121	BrightView Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41)	(30)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	22
716	BrightView Holdings Inc	Goldman Sachs	(44)	(70)	CarMax Inc	Morgan Stanley	(66)
(1.007)	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.779	(942)	Carnival Corp	Goldman Sachs	(1.688)
(889)	Broadridge Financial Solutions Inc	Morgan Stanley	(27)	(3.166)	Carnival Corp	Morgan Stanley	503
(251)	Brookline Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(329)	Carpenter Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	(842)
(27)	Brown-Forman Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(11)	(455)	Carpenter Technology Corp	Goldman Sachs	(1.171)
(444)	Brown-Forman Corp 'B'	Goldman Sachs	(522)	3.121	Carrier Global Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.866
(3.256)	Brown-Forman Corp 'B'	Morgan Stanley	(2.540)	440	Carrier Global Corp	Goldman Sachs	806
112	Bruker Corp	Bank of America Merrill Lynch	28	825	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	1.279
433	Bruker Corp	Goldman Sachs	(283)	696	Cars.com Inc	Goldman Sachs	821
466	Bruker Corp	Morgan Stanley	(149)	1.140	Carter's Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.546
87	Buckle Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8)	2.396	Carter's Inc	Goldman Sachs	(206)
273	Buckle Inc	Goldman Sachs	322	683	Carter's Inc	Morgan Stanley	(418)
(243)	Bumble Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.473)	(1.317)	Casa Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(316)
(279)	Bumble Inc 'A'	Goldman Sachs	170	(632)	Casa Systems Inc	Goldman Sachs	(105)
(148)	Bumble Inc 'A'	Morgan Stanley	(359)	171	Castle Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	476
(967)	C3.ai Inc 'A'	Goldman Sachs	(8.181)	53	Castle Biosciences Inc	Goldman Sachs	217
(358)	C3.ai Inc 'A'	Morgan Stanley	(759)	(592)	Catalyst Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24)
(528)	Cabot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(313)	(192)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(4)
(2.079)	Cabot Corp	Goldman Sachs	(1.112)	(1.053)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	45
1.001	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs	(76)	1.200	CBRE Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.176)
(237)	Cadence BanCorp	Goldman Sachs	166	5.826	CDK Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.948)
(1.734)	Cadiz Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.853)	1.245	CDK Global Inc	Goldman Sachs	(697)
(2.155)	Cadiz Inc	Goldman Sachs	(4.051)	7.487	CDK Global Inc	Morgan Stanley	(5.316)
1.064	Caesarstone Ltd	Bank of America Merrill Lynch	755	(113)	Central Garden & Pet Co 'A'	Goldman Sachs	29
2.745	Caesarstone Ltd	Goldman Sachs	1.949	(1.482)	Cerner Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.002)
1	CAI International Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	(921)	Cerner Corp	Morgan Stanley	(1.151)
287	CAI International Inc	Goldman Sachs	(66)	(7.328)	ChargePoint Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.307)
135	Calavo Growers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(323)	(389)	ChargePoint Holdings Inc	Morgan Stanley	(370)
321	Calavo Growers Inc	Goldman Sachs	(1.050)	(79)	Chase Corp	Goldman Sachs	446
(100)	California Water Service Group	Bank of America Merrill Lynch	44	125	Check Point Software Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(183)
(932)	California Water Service Group	Goldman Sachs	(613)	237	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	(486)
(410)	Calix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.263)	1.305	Cheesecake Factory Inc	Goldman Sachs	1.292
(473)	Calix Inc	Goldman Sachs	(1.457)	95	Chesapeake Utilities Corp	Bank of America Merrill Lynch	(243)
(177)	Callaway Golf Co	Morgan Stanley	—	272	Cimpress Plc	Bank of America Merrill Lynch	(651)
(282)	Cal-Maine Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	719	547	Cimpress Plc	Goldman Sachs	(2.401)
(299)	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	431	634	Cinemark Holdings Inc	Goldman Sachs	374
316	Camden National Corp	Bank of America Merrill Lynch	119	(1.525)	Cisco Systems Inc - CDI	Bank of America Merrill Lynch	194
1.055	Camden National Corp	Goldman Sachs	(7)	(5.569)	Cisco Systems Inc - CDI	Morgan Stanley	2.729
1.138	Campbell Soup Co	Bank of America Merrill Lynch	286	1.334	Citizens Inc	Bank of America Merrill Lynch	(245)
720	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	(210)	2.435	Citizens Inc	Goldman Sachs	(186)
523	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	16	(1.029)	Clarivate Plc	Goldman Sachs	(217)
				(506)	Clarivate Plc	Morgan Stanley	(177)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(452)	Clean Energy Fuels Corp	Bank of America Merrill Lynch	95	(992)	Consolidated Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	(109)
(3.462)	Clean Energy Fuels Corp	Goldman Sachs	186	(660)	Construction Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(388)
2.332	Clean Harbors Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.191)	(3.330)	ContextLogic Inc 'A'	Goldman Sachs	1.783
1.627	Clean Harbors Inc	Goldman Sachs	(392)	(155)	Cornerstone Building Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
1.965	Clean Harbors Inc	Morgan Stanley	(965)	(1.397)	Cornerstone Building Brands Inc	Goldman Sachs	27
(7.455)	Clear Channel Outdoor Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(373)	(1.812)	Coursera Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.074)
(6.517)	Clear Channel Outdoor Holdings Inc	Goldman Sachs	(326)	(1.912)	Coursera Inc	Morgan Stanley	(211)
132	CMC Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	308	(723)	Covanta Holding Corp	Goldman Sachs	217
373	CMC Materials Inc	Goldman Sachs	664	1.370	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Goldman Sachs	(2.467)
952	CMC Materials Inc	Morgan Stanley	503	1.854	Crawford & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(630)
(2.537)	Co-Diagnostics Inc	Goldman Sachs	934	2.469	Crawford & Co 'A'	Goldman Sachs	(839)
770	Cogent Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	701	66	Credit Acceptance Corp	Bank of America Merrill Lynch	969
848	Cogent Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	1.189	126	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs	1.359
113	Cogent Communications Holdings Inc	Morgan Stanley	96	401	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	3.935
610	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Morgan Stanley	281	832	Crocs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.187)
358	Cohen & Steers Inc	Bank of America Merrill Lynch	295	299	Crocs Inc	Goldman Sachs	955
551	Cohen & Steers Inc	Goldman Sachs	419	143	Crocs Inc	Morgan Stanley	(94)
312	Coherus Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(169)	345	CrossFirst Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(95)
(476)	Cohu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(387)	1.203	CrossFirst Bankshares Inc	Goldman Sachs	(168)
(302)	Cohu Inc	Goldman Sachs	(248)	(158)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	264
(197)	Coinbase Global Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	764	(44)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(42)
(1.243)	Coinbase Global Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.313)	(153)	CryoLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	37
(106)	Coinbase Global Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.191)	(455)	CryoPort Inc	Goldman Sachs	(2.785)
263	Collegium Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	167	383	CSG Systems International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(325)
97	Collegium Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	107	559	CSG Systems International Inc	Goldman Sachs	(486)
(49)	Colony Capital Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(16)	739	CTS Corp	Bank of America Merrill Lynch	645
(3.627)	Colony Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	(1.161)	275	CTS Corp	Goldman Sachs	338
(169)	Columbia Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	49	1.026	Cushman & Wakefield Plc	Goldman Sachs	831
(228)	Columbia Financial Inc	Goldman Sachs	66	1.415	CVR Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.822)
(166)	Columbia Property Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	78	1.370	CVR Energy Inc	Goldman Sachs	(2.720)
(1.303)	Columbia Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	612	(823)	Dana Inc	Goldman Sachs	551
410	Columbia Sportswear Co	Bank of America Merrill Lynch	(383)	(183)	Danaher Corp	Goldman Sachs	217
66	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	(105)	(688)	Danaher Corp	Morgan Stanley	(3.043)
914	Comcast Corp 'A'	Morgan Stanley	1.536	1.109	Darling Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	60
(354)	Commercial Metals Co	Bank of America Merrill Lynch	64	294	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs	20
(671)	Commercial Metals Co	Goldman Sachs	256	179	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	27
(268)	CommScope Holding Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(509)	(1.097)	Datadog Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(321)
(3.454)	CommScope Holding Co Inc	Goldman Sachs	(6.645)	(754)	Datadog Inc 'A'	Goldman Sachs	(6.274)
176	Community Health Systems Inc	Goldman Sachs	(48)	(3.668)	Datadog Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.682)
179	Community Trust Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	60	395	Dave & Buster's Entertainment Inc	Goldman Sachs	(905)
286	Community Trust Bancorp Inc	Goldman Sachs	(120)	475	Deckers Outdoor Corp	Morgan Stanley	(1.530)
157	CommVault Systems Inc	Goldman Sachs	(87)	341	Deere & Co	Bank of America Merrill Lynch	716
(30)	CONMED Corp	Goldman Sachs	143	85	Deere & Co	Morgan Stanley	23
314	ConnectOne Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(132)	686	Delek US Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	109
501	ConnectOne Bancorp Inc	Goldman Sachs	(210)	2.141	Delek US Energy Inc	Goldman Sachs	2.698
				(451)	Deluxe Corp	Bank of America Merrill Lynch	(217)
				(187)	Deluxe Corp	Goldman Sachs	(11)
				2.346	Denny's Corp	Goldman Sachs	399

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
359	Designer Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	(62)	1.059	Envista Holdings Corp	Morgan Stanley	(409)
(74)	Diamond Hill Investment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	47	(199)	ePlus Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.109
(188)	Diamond Hill Investment Group Inc	Goldman Sachs	397	(146)	ePlus Inc	Goldman Sachs	834
431	Digi International Inc	Bank of America Merrill Lynch	5	74	EPR Properties (REIT)	Goldman Sachs	136
211	Digi International Inc	Goldman Sachs	152	(1.182)	EQT Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.581
1	Digital Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	3	(3.476)	EQT Corp	Morgan Stanley	1.808
702	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs	(2.920)	(960)	Equity Commonwealth (REIT)	Goldman Sachs	(163)
57	Diodes Inc	Goldman Sachs	32	(3.090)	Equity Commonwealth (REIT)	Morgan Stanley	989
985	Diversified Healthcare Trust (REIT)	Goldman Sachs	99	294	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.581
91	Dollar General Corp	Morgan Stanley	(87)	247	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	470
2.371	Donegal Group Inc 'A'	Goldman Sachs	332	375	Erie Indemnity Co 'A'	Morgan Stanley	1.571
(688)	Dorian LPG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(62)	(2.804)	Esperion Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.692
(1.302)	Dorian LPG Ltd	Goldman Sachs	746	1.559	Essent Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	649
(65)	Dorman Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)	1.489	Essent Group Ltd	Goldman Sachs	(625)
(117)	Dorman Products Inc	Goldman Sachs	(187)	5.202	Essent Group Ltd	Morgan Stanley	1.768
76	Dril-Quip Inc	Bank of America Merrill Lynch	113	198	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	109
108	Ducommun Inc	Goldman Sachs	221	217	Ethan Allen Interiors Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28)
(39)	DuPont de Nemours Inc	Goldman Sachs	(1)	299	Ethan Allen Interiors Inc	Goldman Sachs	151
(2.719)	DuPont de Nemours Inc	Morgan Stanley	1.584	334	Euronet Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.454
171	DXP Enterprises Inc	Goldman Sachs	51	115	Euronet Worldwide Inc	Goldman Sachs	3
(2.131)	Dynatrace Inc	Morgan Stanley	(2.238)	1.057	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	1.071
(45)	Eagle Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31)	787	Everbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.317
99	Eagle Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(188)	1.182	Everbridge Inc	Morgan Stanley	1.158
888	Easterly Government Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	533	1.620	Everi Holdings Inc	Goldman Sachs	4.423
(130)	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs	6	463	EverQuote Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	917
(730)	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	628	950	EverQuote Inc 'A'	Goldman Sachs	1.613
(1.991)	Eastman Kodak Co	Bank of America Merrill Lynch	(498)	1.055	EVERTEC Inc	Goldman Sachs	11
(5.108)	Eastman Kodak Co	Goldman Sachs	(2.359)	(322)	Evoqua Water Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(682)
(726)	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs	(639)	(128)	Evoqua Water Technologies Corp	Goldman Sachs	(146)
(84)	eHealth Inc	Goldman Sachs	(81)	(24)	EW Scripps Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(15)
871	El Pollo Loco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(801)	(154)	EW Scripps Co 'A'	Goldman Sachs	(99)
6.333	El Pollo Loco Holdings Inc	Goldman Sachs	(5.826)	(3.527)	Exelon Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.460
(681)	Element Solutions Inc	Goldman Sachs	(490)	(298)	Exelon Corp	Goldman Sachs	24
(7.522)	Element Solutions Inc	Morgan Stanley	(3.611)	26	ExlService Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	23
399	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	144	431	ExlService Holdings Inc	Goldman Sachs	1.383
2.487	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	895	133	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs	293
(471)	Employers Holdings Inc	Goldman Sachs	(373)	734	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	1.260
(55)	Encore Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	8	52	Exponent Inc	Bank of America Merrill Lynch	4
(288)	Encore Capital Group Inc	Goldman Sachs	(676)	(53)	Fabrinet	Bank of America Merrill Lynch	(198)
(310)	Encore Wire Corp	Goldman Sachs	99	(325)	Fabrinet	Goldman Sachs	(1.515)
(260)	Endo International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(39)	(165)	Facebook Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2.415)
(2.158)	Endo International Plc	Goldman Sachs	(324)	(192)	Facebook Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.286)
120	Enerpac Tool Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	50	(421)	Facebook Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.726)
3.599	EnLink Midstream LLC	Bank of America Merrill Lynch	(165)	(825)	Fastly Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3.850)
344	Ennis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(241)	(3.619)	Fastly Inc 'A'	Goldman Sachs	(6.309)
675	Ennis Inc	Goldman Sachs	(473)	307	FB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(193)
281	Enstar Group Ltd	Goldman Sachs	2.211				
537	Envista Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(282)				
306	Envista Holdings Corp	Goldman Sachs	(181)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
1.311	FB Financial Corp	Goldman Sachs	(830)	3.012	Frank's International NV	Goldman Sachs	(307)
(381)	Federal Signal Corp	Bank of America		(1.651)	Frequency Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(116)
		Merrill Lynch	(330)	(368)	frontdoor Inc	Goldman Sachs	(271)
(1.024)	Federal Signal Corp	Goldman Sachs	(786)	306	FRP Holdings Inc	Bank of America	
(2.335)	Federated Hermes Inc	Goldman Sachs	140			Merrill Lynch	(251)
1.112	FibroGen Inc	Bank of America		17	FRP Holdings Inc	Goldman Sachs	(14)
		Merrill Lynch	671	16	FTI Consulting Inc	Bank of America	
2.674	FibroGen Inc	Goldman Sachs	2.058			Merrill Lynch	(5)
(4.424)	Fifth Third Bancorp	Bank of America		1.276	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	715
		Merrill Lynch	961	63	Futu Holdings Ltd ADR	Bank of America	
(2.887)	Fifth Third Bancorp	Morgan Stanley	(779)			Merrill Lynch	821
(3.040)	FireEye Inc	Bank of America		145	Futu Holdings Ltd ADR	Goldman Sachs	2.500
		Merrill Lynch	(932)	(1.232)	FutureFuel Corp	Bank of America	
(4.068)	FireEye Inc	Morgan Stanley	(718)			Merrill Lynch	4.272
(282)	First Bancshares Inc	Bank of America		(827)	FutureFuel Corp	Goldman Sachs	1.001
		Merrill Lynch	147	(514)	Garmin Ltd	Bank of America	
(619)	First Bancshares Inc	Goldman Sachs	322			Merrill Lynch	(1.022)
2.515	First Busey Corp	Goldman Sachs	3.299	(601)	Garmin Ltd	Goldman Sachs	(2.631)
120	First Citizens BancShares Inc 'A'	Bank of America		(2.348)	Garmin Ltd	Morgan Stanley	(5.283)
		Merrill Lynch	1.034	(7.420)	General Motors Co	Bank of America	
15	First Citizens BancShares Inc 'A'	Goldman Sachs	(128)			Merrill Lynch	211
10	First Citizens BancShares Inc 'A'	Morgan Stanley	39	(1.604)	General Motors Co	Morgan Stanley	(4.347)
(487)	First Community Bankshares Inc	Bank of America		847	Genesco Inc	Goldman Sachs	(2.219)
(447)	First Community Bankshares Inc	Merrill Lynch	65	(316)	Gentherm Inc	Bank of America	
(420)	First Financial Bankshares Inc	Goldman Sachs	(14)			Merrill Lynch	(757)
(2.016)	First Foundation Inc	Goldman Sachs	(614)	(1.018)	Gentherm Inc	Goldman Sachs	(1.712)
1.078	First Merchants Corp	Bank of America		(2.904)	Genworth Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(261)
		Merrill Lynch	708	96	German American Bancorp Inc	Bank of America	
(61)	First Mid Bancshares Inc	Bank of America		51	German American Bancorp Inc	Merrill Lynch	101
		Merrill Lynch	(23)			Goldman Sachs	65
(85)	First Mid Bancshares Inc	Goldman Sachs	(11)	333	G-III Apparel Group Ltd	Bank of America	
691	First of Long Island Corp	Goldman Sachs	(760)			Merrill Lynch	268
(4.319)	Fisker Inc	Goldman Sachs	(3.222)	271	G-III Apparel Group Ltd	Goldman Sachs	15
(2.091)	Fisker Inc	Morgan Stanley	(1.582)	(338)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Bank of America	
(385)	FleetCor Technologies Inc	Bank of America		(237)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Merrill Lynch	(59)
		Merrill Lynch	(922)			Goldman Sachs	(137)
(326)	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	(463)	1.072	Glatfelter Corp	Bank of America	
(398)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(187)			Merrill Lynch	557
6.546	Flowers Foods Inc	Morgan Stanley	(327)	11	Global Indemnity Group LLC 'A'	Goldman Sachs	34
(2.750)	Fluidigm Corp	Bank of America		539	Global Medical Inc (REIT)	Goldman Sachs	54
		Merrill Lynch	(1.186)	(1.111)	GoHealth Inc 'A'	Bank of America	
(2.442)	Fluidigm Corp	Goldman Sachs	(1.123)			Merrill Lynch	(178)
2.492	Flushing Financial Corp	Goldman Sachs	(1.296)	(391)	GoodRx Holdings Inc 'A'	Bank of America	
(99)	Focus Financial Partners Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	211
(147)	Focus Financial Partners Inc 'A'	Merrill Lynch	(80)	(533)	GoodRx Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(3.311)
		Goldman Sachs	(100)	171	Goosehead Insurance Inc 'A'	Bank of America	
140	Forestar Group Inc	Bank of America		266	Goosehead Insurance Inc 'A'	Merrill Lynch	900
		Merrill Lynch	(17)			Goldman Sachs	1.950
815	FormFactor Inc	Bank of America		1.132	GoPro Inc 'A'	Goldman Sachs	1.506
		Merrill Lynch	683	(670)	Gorman-Rupp Co	Bank of America	
550	FormFactor Inc	Goldman Sachs	305			Merrill Lynch	(415)
739	Forrester Research Inc	Bank of America		(432)	Gorman-Rupp Co	Goldman Sachs	(368)
		Merrill Lynch	(1.988)	(778)	GrafTech International Ltd	Bank of America	
1.416	Forrester Research Inc	Goldman Sachs	(3.763)			Merrill Lynch	459
(448)	Fortinet Inc	Morgan Stanley	(2.451)	(1.115)	GrafTech International Ltd	Goldman Sachs	219
90	Franklin Electric Co Inc	Bank of America		(1.080)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	161			Merrill Lynch	73
488	Franklin Electric Co Inc	Goldman Sachs	632	(4.813)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Goldman Sachs	(1.086)
1.433	Franklin Street Properties Corp (REIT)	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	100	21	Great Southern Bancorp Inc	Merrill Lynch	(21)
474	Franklin Street Properties Corp (REIT)	Goldman Sachs	33			Goldman Sachs	(355)
3.161	Frank's International NV	Bank of America		(379)	Green Brick Partners Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.227)			Merrill Lynch	(404)
				(435)	Green Brick Partners Inc	Goldman Sachs	(285)
				170	Group 1 Automotive Inc	Goldman Sachs	(1.052)
				496	Groupon Inc	Goldman Sachs	1.455

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
9.389	GTT Communications Inc	Goldman Sachs	(94)	(337)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.200)
1.642	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	112	(788)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.324)
6	Guidewire Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	34	1.111	HollyFrontier Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.025)
1.438	Guidewire Software Inc	Morgan Stanley	848	1.344	HollyFrontier Corp	Goldman Sachs	(4.810)
69	H&E Equipment Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	24	1.601	HollyFrontier Corp	Morgan Stanley	(2.770)
1.036	H&R Block Inc	Goldman Sachs	32	933	Homology Medicines Inc	Goldman Sachs	215
(1.981)	Hancock Whitney Corp	Goldman Sachs	1.525	2.588	Horizon Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	450
1.019	Harley-Davidson Inc	Goldman Sachs	174	1.841	Horizon Bancorp Inc	Goldman Sachs	79
114	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	78	(1.666)	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	Morgan Stanley	(65)
235	Haverty Furniture Cos Inc	Goldman Sachs	(143)	610	Hostess Brands Inc	Goldman Sachs	37
(344)	Hawaiian Electric Industries Inc	Goldman Sachs	454	(718)	Howard Hughes Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.120)
(182)	Hawaiian Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15)	(486)	Howard Hughes Corp	Goldman Sachs	(880)
(3.582)	Hawaiian Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.308)	(62)	Howard Hughes Corp	Morgan Stanley	(81)
(1.243)	Hawkins Inc	Goldman Sachs	(1.268)	40	Hub Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	37
(220)	HCI Group Inc	Goldman Sachs	(1.003)	707	Hub Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.943)
(234)	Healthcare Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	220	122	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	401
(3.706)	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs	3.484	51	HubSpot Inc	Morgan Stanley	(180)
2.253	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(541)	5.948	Huntington Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.421
2.314	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(555)	5.444	Huntington Bancshares Inc	Goldman Sachs	(63)
2.951	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(1.490)	10.896	Huntington Bancshares Inc	Morgan Stanley	2.397
2.170	Hearland Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	(630)	(481)	Huron Consulting Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	92
6.605	Hearland Express Inc	Goldman Sachs	(1.216)	(800)	Huron Consulting Group Inc	Goldman Sachs	(10)
295	Hearland Financial USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	143	(1.513)	IAC Via InterActive Corp	Morgan Stanley	140.951
1.013	Hearland Financial USA Inc	Goldman Sachs	(90)	63	Ichor Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	405
71	Heidrick & Struggles International Inc	Goldman Sachs	73	620	Ichor Holdings Ltd	Goldman Sachs	3.987
(293)	Helios Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	263	(289)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(249)
(464)	Helios Technologies Inc	Goldman Sachs	1.154	400	Independent Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(108)
764	Helix Energy Solutions Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46)	1.067	Independent Bank Corp	Goldman Sachs	(236)
1.721	Helix Energy Solutions Group Inc	Goldman Sachs	(103)	(215)	Industrial Logistics Properties Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(19)
486	Hemisphere Media Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(238)	(3.089)	Infinera Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.297)
723	Hemisphere Media Group Inc	Goldman Sachs	(354)	(923)	Infinera Corp	Goldman Sachs	(26)
464	Herbalife Nutrition Ltd	Bank of America Merrill Lynch	835	(473)	Inmode Ltd	Morgan Stanley	(1.216)
608	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs	1.177	292	Innospec Inc	Bank of America Merrill Lynch	498
3.004	Herbalife Nutrition Ltd	Morgan Stanley	1.622	(1.307)	Innospec Inc	Goldman Sachs	579
658	Herc Holdings Inc	Goldman Sachs	6.300	(5.358)	Innoviva Inc	Bank of America Merrill Lynch	(749)
(228)	Herman Miller Inc	Goldman Sachs	(609)	(354)	Insight Enterprises Inc	Goldman Sachs	(1.292)
(462)	Hershey Co	Bank of America Merrill Lynch	643	288	Inspire Medical Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.224
(151)	Hershey Co	Goldman Sachs	46	97	Inspire Medical Systems Inc	Goldman Sachs	1.777
111	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	(118)	219	Inspire Medical Systems Inc	Morgan Stanley	2.718
175	Hess Corp	Morgan Stanley	(37)	1.512	Intel Corp	Goldman Sachs	476
1.313	Hexcel Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.729	6.006	Intel Corp	Morgan Stanley	(22)
1.425	Hexcel Corp	Goldman Sachs	10.497	240	Inter Parfums Inc	Bank of America Merrill Lynch	338
1.407	Hexcel Corp	Morgan Stanley	7.190	802	Inter Parfums Inc	Goldman Sachs	1.151
292	Hibbett Sports Inc	Goldman Sachs	1.702	268	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	102
(1.809)	Hilltop Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.035)	1.105	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(186)
(513)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.826)	2.042	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Morgan Stanley	503

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
410	Intercept Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(317)	835	Kohl's Corp	Morgan Stanley	(203)
(1.335)	InterDigital Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13.305)	51	Kontoor Brands Inc	Goldman Sachs	(23)
472	Interface Inc	Goldman Sachs	618	930	Koppers Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	306
(421)	International Bancshares Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.110	212	Koppers Holdings Inc	Goldman Sachs	6
(3.299)	International Bancshares Corp	Goldman Sachs	10.792	(6.049)	Kosmos Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	181
230	International Game Technology Plc	Goldman Sachs	(11)	(5.464)	Kosmos Energy Ltd	Goldman Sachs	164
512	International Game Technology Plc	Morgan Stanley	(51)	(3.249)	Kraft Heinz Co	Bank of America Merrill Lynch	662
(1.350)	International Money Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.580)	(11.885)	Kraft Heinz Co	Morgan Stanley	10.051
(162)	International Money Express Inc	Goldman Sachs	(220)	109	Kraton Corp	Bank of America Merrill Lynch	(179)
1.213	Invitation Homes Inc (REIT)	Morgan Stanley	267	210	Kraton Corp	Goldman Sachs	12
110	iRhythm Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	136	110	Kulicke & Soffa Industries Inc	Goldman Sachs	114
132	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs	170	(144)	Lakeland Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31)
291	iRobot Corp	Goldman Sachs	170	424	Lakeland Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(108)
116	iTeos Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(219)	1.723	Lakeland Financial Corp	Goldman Sachs	9
194	Itron Inc	Goldman Sachs	413	(1.074)	Landec Corp	Bank of America Merrill Lynch	149
608	Itron Inc	Morgan Stanley	2.132	(1.395)	Landec Corp	Goldman Sachs	535
(306)	Ituran Location and Control Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(405)	396	Lands' End Inc	Bank of America Merrill Lynch	760
61	J & J Snack Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	339	1.014	Lands' End Inc	Goldman Sachs	2.018
218	J & J Snack Foods Corp	Goldman Sachs	770	(2.643)	Laureate Education Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(79)
10	J2 Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7)	(3.708)	Laureate Education Inc 'A'	Goldman Sachs	(111)
622	J2 Global Inc	Goldman Sachs	(411)	(1.394)	La-Z-Boy Inc	Goldman Sachs	2.872
627	J2 Global Inc	Morgan Stanley	(1.925)	5	LCI Industries	Bank of America Merrill Lynch	36
(553)	JBG SMITH Properties (REIT)	Goldman Sachs	(224)	181	LCI Industries	Goldman Sachs	1.193
2.761	JELD-WEN Holding Inc	Goldman Sachs	(972)	(643)	Leidos Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(470)
(543)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(717)	(859)	Leidos Holdings Inc	Goldman Sachs	189
(1.549)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.045)	(424)	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	(170)
(8.561)	Juniper Networks Inc	Morgan Stanley	4.366	234	LeMaitre Vascular Inc	Bank of America Merrill Lynch	527
180	Kadant Inc	Goldman Sachs	(265)	119	LeMaitre Vascular Inc	Goldman Sachs	268
(109)	Kaiser Aluminum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(46)	(1.863)	Lemonade Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33.515)
(81)	Kaman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(269)	Lemonade Inc	Morgan Stanley	(3.522)
(160)	Kaman Corp	Goldman Sachs	(88)	1.731	LendingClub Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.160
1.329	KAR Auction Services Inc	Goldman Sachs	(452)	422	LendingClub Corp	Goldman Sachs	1.013
(798)	Karyopharm Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(111)	2.331	Levi Strauss & Co 'A'	Goldman Sachs	(1.308)
(4.835)	Karyopharm Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(870)	3.049	Levi Strauss & Co 'A'	Morgan Stanley	(661)
(183)	Kearny Financial Corp	Goldman Sachs	(9)	16	LHC Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	93
185	Kemper Corp	Goldman Sachs	(55)	389	LHC Group Inc	Goldman Sachs	2.879
364	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs	83	932	LHC Group Inc	Morgan Stanley	760
(2.035)	Keurig Dr Pepper Inc	Morgan Stanley	(204)	(655)	Liberty Broadband Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(592)
(169)	Kimball Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25)	(150)	Liberty Broadband Corp 'A'	Morgan Stanley	76
(108)	Kimball Electronics Inc	Goldman Sachs	(16)	7.135	Liberty Global Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2.321)
3.798	Kimco Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	2.335	3.719	Liberty Global Plc 'A'	Goldman Sachs	(2.275)
1.384	Kimco Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	846	3.330	Liberty Global Plc 'A'	Morgan Stanley	587
794	Kite Realty Group Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	517	4.413	Liberty Global Plc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	32
348	Kite Realty Group Trust (REIT)	Goldman Sachs	340	1.864	Liberty Global Plc 'C'	Goldman Sachs	234
1.251	Kohl's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.784)	5.030	Liberty Global Plc 'C'	Morgan Stanley	151
1.313	Kohl's Corp	Goldman Sachs	(3.229)	158	Liberty Latin America Ltd 'A'	Goldman Sachs	30
				840	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Bank of America Merrill Lynch	318
				1.511	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Goldman Sachs	604

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
265	Liberty Oilfield Services Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	77	(673)	Maxar Technologies Inc	Goldman Sachs	(680)
336	Liberty Oilfield Services Inc 'A'	Goldman Sachs	97	(262)	MaxLinear Inc	Bank of America Merrill Lynch	(893)
1	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	—	(102)	MaxLinear Inc	Goldman Sachs	(429)
(3.195)	Limelight Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	6	(1.372)	MBIA Inc	Goldman Sachs	(1.221)
(4.988)	Limelight Networks Inc	Goldman Sachs	(11)	(407)	McGrath RentCorp	Goldman Sachs	(550)
55	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	(301)	MDC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(124)
470	Lincoln Electric Holdings Inc	Morgan Stanley	58	(159)	MDC Holdings Inc	Goldman Sachs	(236)
(603)	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Goldman Sachs	(350)	686	Media Gen Inc CVR'	Bank of America Merrill Lynch	—
(1.034)	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1.730)	(177)	MEDNAX Inc	Goldman Sachs	(44)
(971)	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Goldman Sachs	(2.593)	8	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	(69)
(90)	Littelfuse Inc	Bank of America Merrill Lynch	(188)	151	Mercantile Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21)
(175)	Live Oak Bancshares Inc	Goldman Sachs	(243)	1.204	Mercantile Bank Corp	Goldman Sachs	(144)
(86)	LTC Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	21	191	Merchants Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	156
(858)	LTC Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	27	435	Merchants Bancorp	Goldman Sachs	197
3.026	Luther Burbank Corp	Goldman Sachs	(424)	(1.093)	Mercury General Corp	Goldman Sachs	3.268
110	Lyft Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	259	2.164	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	4.598
2.784	Lyft Inc 'A'	Morgan Stanley	10.474	(95)	Meredith Corp	Bank of America Merrill Lynch	29
355	Mack-Cali Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	121	(456)	Meredith Corp	Goldman Sachs	158
963	Mack-Cali Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	294	(565)	Meridian Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(157)
(66)	Macquarie Infrastructure Corp	Bank of America Merrill Lynch	18	(7.122)	Meridian Bancorp Inc	Goldman Sachs	(2.186)
(5.160)	Macquarie Infrastructure Corp	Goldman Sachs	1.408	(1.195)	Meridian Bioscience Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.732)
(304)	Madison Square Garden Entertainment Corp	Goldman Sachs	(1.046)	(1.272)	Meridian Bioscience Inc	Goldman Sachs	(1.921)
(145)	Madison Square Garden Sports Corp	Bank of America Merrill Lynch	583	263	Meritor Inc	Goldman Sachs	(66)
(117)	Madison Square Garden Sports Corp	Goldman Sachs	835	(48)	Methode Electronics Inc	Goldman Sachs	(53)
(1.005)	Madison Square Garden Sports Corp	Morgan Stanley	6.784	6	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	112
1.073	Magnolia Oil & Gas Corp 'A'	Goldman Sachs	86	1	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	7
58	Malibu Boats Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	69	(1.749)	MGE Energy Inc	Goldman Sachs	(857)
291	Malibu Boats Inc 'A'	Goldman Sachs	(882)	(127)	MGP Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	(292)
97	Manhattan Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	31	(467)	MGP Ingredients Inc	Goldman Sachs	(1.232)
33	Manhattan Associates Inc	Goldman Sachs	220	(1.171)	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(3.337)
600	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	597	(301)	Middlesex Water Co	Bank of America Merrill Lynch	(1.615)
267	Manitowoc Co Inc	Goldman Sachs	476	(904)	Middlesex Water Co	Goldman Sachs	(2.686)
(61)	ManTech International Corp 'A'	Goldman Sachs	(54)	188	Midland States Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	13
910	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs	240	420	Midland States Bancorp Inc	Goldman Sachs	134
1.997	Marathon Oil Corp	Morgan Stanley	280	507	MidWestOne Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39)
335	Marcus & Millichap Inc	Bank of America Merrill Lynch	771	1.883	MidWestOne Financial Group Inc	Goldman Sachs	(241)
1.967	Marcus & Millichap Inc	Goldman Sachs	4.067	(1.140)	Mitek Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(181)
(58)	Marriott International Inc 'A'	Goldman Sachs	(216)	(323)	Mitek Systems Inc	Goldman Sachs	(184)
(1.372)	Marriott International Inc 'A'	Morgan Stanley	(2.319)	140	Model N Inc	Bank of America Merrill Lynch	193
94	Masonite International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(425)	531	Model N Inc	Goldman Sachs	690
276	Masonite International Corp	Goldman Sachs	(1.248)	(216)	Moelis & Co 'A'	Goldman Sachs	(145)
458	Matador Resources Co	Goldman Sachs	9	110	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.176)
(191)	Matthews International Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	9	458	Molson Coors Beverage Co 'B'	Morgan Stanley	261
(192)	Matthews International Corp 'A'	Goldman Sachs	342	(857)	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.051)
				(4.197)	Mondelez International Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.046)
				(5.328)	Mondelez International Inc 'A'	Morgan Stanley	799
				(932)	Monmouth Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(84)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.182)	Monmouth Real Estate			1.290	NexTier Oilfield Solutions		
	Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(106)		Inc	Goldman Sachs	(697)
91	Moog Inc 'A'	Bank of America		127	Nicolet Bankshares Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	126			Merrill Lynch	236
128	Moog Inc 'A'	Goldman Sachs	137	152	Nicolet Bankshares Inc	Goldman Sachs	16
(614)	Morgan Stanley	Bank of America		(117)	NMI Holdings Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.445)			Merrill Lynch	4
(5.022)	Mosaic Co	Bank of America		1.554	Nordstrom Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	890			Merrill Lynch	(3.503)
(104)	Mosaic Co	Goldman Sachs	(43)	762	Nordstrom Inc	Goldman Sachs	(4.448)
(5.015)	Mosaic Co	Morgan Stanley	(2.207)	3.415	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	(10.292)
(7.139)	MP Materials Corp	Morgan Stanley	(11.212)	(673)	Norwegian Cruise Line	Bank of America	
(715)	Mr Cooper Group Inc	Bank of America			Holdings Ltd	Merrill Lynch	(1.443)
		Merrill Lynch	(508)	(818)	Norwegian Cruise Line		
(806)	Mr Cooper Group Inc	Goldman Sachs	(572)		Holdings Ltd	Goldman Sachs	(692)
1.499	MRC Global Inc	Goldman Sachs	(1.979)	(2.310)	Norwegian Cruise Line		
(86)	Mueller Industries Inc	Bank of America			Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.609)
		Merrill Lynch	(32)	(202)	Novanta Inc	Goldman Sachs	(519)
(2.995)	Myers Industries Inc	Goldman Sachs	(539)	809	NOW Inc	Bank of America	
(82)	MYR Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(401)
		Merrill Lynch	(360)	1.091	NOW Inc	Goldman Sachs	(798)
(235)	MYR Group Inc	Goldman Sachs	(1.086)	(488)	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	(244)
(1.337)	Nasdaq Inc	Bank of America		(3.286)	Nucor Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.851)			Merrill Lynch	(4.679)
(564)	Nasdaq Inc	Goldman Sachs	(1.974)	(642)	Nucor Corp	Goldman Sachs	(361)
(2.102)	Nasdaq Inc	Morgan Stanley	(5.339)	(529)	Nucor Corp	Morgan Stanley	434
(331)	National Research Corp	Bank of America		(338)	NXP Semiconductors NV	Bank of America	
		Merrill Lynch	436			Merrill Lynch	(3.473)
(895)	National Research Corp	Goldman Sachs	1.630	(476)	NXP Semiconductors NV	Goldman Sachs	(1.436)
1.864	National Vision Holdings Inc	Bank of America		470	Oceaneering International	Bank of America	
		Merrill Lynch	31		Inc	Merrill Lynch	133
1.236	National Vision Holdings Inc	Goldman Sachs	300	479	OceanFirst Financial Corp	Bank of America	
2.384	National Vision Holdings Inc	Morgan Stanley	3.123			Merrill Lynch	(240)
(259)	Nautilus Inc	Bank of America		(2.828)	Odonate Therapeutics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(238)			Merrill Lynch	(877)
(1.535)	Nautilus Inc	Goldman Sachs	(558)	(6.596)	Odonate Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2.045)
637	Neenah Inc	Bank of America		(8.228)	Old Republic International	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.072)		Corp	Merrill Lynch	(209)
185	Neenah Inc	Goldman Sachs	(554)	(1.554)	Old Republic International		
233	Nelnet Inc 'A'	Bank of America			Corp	Goldman Sachs	(94)
		Merrill Lynch	19	993	Ollie's Bargain Outlet		
164	Nelnet Inc 'A'	Goldman Sachs	28		Holdings Inc	Goldman Sachs	6.532
(847)	NeoPhotonics Corp	Goldman Sachs	(754)	489	Ollie's Bargain Outlet		
(79)	Netflix Inc	Bank of America			Holdings Inc	Morgan Stanley	4.513
		Merrill Lynch	—	(1.674)	One Liberty Properties		
(200)	Netflix Inc	Goldman Sachs	19		Inc (REIT)	Goldman Sachs	(887)
(681)	Netflix Inc	Morgan Stanley	(349)	(691)	OneSpan Inc	Goldman Sachs	(888)
(51)	NETGEAR Inc	Bank of America		47	Onto Innovation Inc	Goldman Sachs	633
		Merrill Lynch	(73)	(319)	Ontrak Inc	Bank of America	
(275)	NETGEAR Inc	Goldman Sachs	(264)			Merrill Lynch	427
(962)	NetScout Systems Inc	Bank of America		(5.284)	Opendoor Technologies Inc	Morgan Stanley	(2.611)
		Merrill Lynch	(1.477)	(337)	Option Care Health Inc	Goldman Sachs	69
(1.137)	NetScout Systems Inc	Goldman Sachs	(1.508)	603	Origin Bancorp Inc	Bank of America	
333	Nevro Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(211)
		Merrill Lynch	1.075	697	Origin Bancorp Inc	Goldman Sachs	(244)
1.947	Nevro Corp	Morgan Stanley	1.537	272	Orthofix Medical Inc	Goldman Sachs	(98)
995	New York Community			(4.272)	Oscar Health Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.782)
	Bancorp Inc	Goldman Sachs	(38)	478	OSI Systems Inc	Goldman Sachs	378
33.541	New York Community			84	Otis Worldwide Corp ^{††}	Bank of America	
	Bancorp Inc	Morgan Stanley	5.031			Merrill Lynch	—
(918)	Newell Brands Inc	Bank of America		594	Otis Worldwide Corp	Goldman Sachs	355
		Merrill Lynch	(583)	2.874	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	575
(1.187)	Newell Brands Inc	Goldman Sachs	(329)	304	Ovintiv Inc	Bank of America	
(703)	Newell Brands Inc	Morgan Stanley	(314)			Merrill Lynch	137
274	NextCure Inc	Bank of America		314	Ovintiv Inc	Goldman Sachs	426
		Merrill Lynch	(154)	(332)	Owens & Minor Inc	Bank of America	
223	NextCure Inc	Goldman Sachs	(36)			Merrill Lynch	(4.382)
797	NextGen Healthcare Inc	Goldman Sachs	(810)	(318)	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs	296
63	NexTier Oilfield Solutions	Bank of America		1.322	PAE Inc	Bank of America	
	Inc	Merrill Lynch	(34)			Merrill Lynch	(635)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
2.791 (62)	PAE Inc Palomar Holdings Inc	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	(1.340) (235)	(1.583) (775)	PriceSmart Inc Primoris Services Corp	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	(373) 853
320	Par Pacific Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	195	(704) (109)	Primoris Services Corp ProAssurance Corp	Goldman Sachs Goldman Sachs	180 61
129	Park Hotels & Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	(42)	(1.068) 1.306	Procter & Gamble Co ProPetro Holding Corp	Morgan Stanley Goldman Sachs	222 (115)
5.620 (80)	Park Hotels & Resorts Inc (REIT) Parsons Corp	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	562 39	(181) (120)	Provident Financial Services Inc PS Business Parks Inc (REIT)	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	(87) (134)
(113) 217	Parsons Corp Passage Bio Inc	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	49 (86)	(140)	PS Business Parks Inc (REIT)	Goldman Sachs	(157)
47	Patrick Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48)	1.425 765	PTC Therapeutics Inc Purple Innovation Inc	Goldman Sachs Goldman Sachs	1.263 (513)
(100)	Patterson Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	305	965	PVH Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.418
(927)	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs	2.791	263	PVH Corp	Goldman Sachs	791
1.144	Patterson-UTI Energy Inc	Goldman Sachs	(698)	238	PVH Corp	Morgan Stanley	(270)
349	Paylocity Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.609	(114)	QAD Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(701)
106	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	(59)	(115)	QAD Inc 'A'	Goldman Sachs	(874)
452	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	257	(564)	Qorvo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.305)
193	PC Connection Inc	Goldman Sachs	193	(1.541)	Qorvo Inc	Goldman Sachs	(14.830)
80	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	(310)	(1.558)	Qorvo Inc	Morgan Stanley	(6.193)
(1.329)	Penn National Gaming Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.651)	1.868	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	2.167
(858)	Penn National Gaming Inc	Goldman Sachs	(446)	1.169	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	1.356
(1.012)	Penn National Gaming Inc	Morgan Stanley	(363)	260	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	39
2.055	Peoples Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.870)	370	Quaker Chemical Corp	Goldman Sachs	2.831
5.187	Peoples Bancorp Inc	Goldman Sachs	(4.325)	211	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs	183
944	Perficient Inc	Goldman Sachs	472	638	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	967
543	Perrigo Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	453	1.240	Quanex Building Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	(285)
2.402	Perrigo Co Plc	Morgan Stanley	2.234	479	Quanex Building Products Corp	Goldman Sachs	(62)
(5.197)	PG&E Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.820	(23)	Quanta Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	2
(2.198)	PG&E Corp	Goldman Sachs	305	(4.296)	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	(12.330)
(12.133)	PG&E Corp	Morgan Stanley	2.151	902	QuinStreet Inc	Bank of America Merrill Lynch	235
773	PGT Innovations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(759)	(607)	Radius Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	971
76	Phreesia Inc	Bank of America Merrill Lynch	28	(850)	Radius Health Inc	Goldman Sachs	1.360
182	Phreesia Inc	Goldman Sachs	634	102	RadNet Inc	Goldman Sachs	314
(632)	Pinterest Inc 'A'	Goldman Sachs	(785)	1.059	Radware Ltd	Bank of America Merrill Lynch	906
(49)	Piper Sandler Cos	Bank of America Merrill Lynch	(65)	4.704	Radware Ltd	Goldman Sachs	4.111
88	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	83	230	Ralph Lauren Corp	Bank of America Merrill Lynch	682
201	Planet Fitness Inc 'A'	Goldman Sachs	(249)	40	Ralph Lauren Corp	Goldman Sachs	(305)
2.277	Planet Fitness Inc 'A'	Morgan Stanley	689	(2.152)	Range Resources Corp	Goldman Sachs	1.614
(3.421)	Playa Hotels & Resorts NV	Bank of America Merrill Lynch	(820)	(155)	Raven Industries Inc	Goldman Sachs	(291)
(2.902)	Playa Hotels & Resorts NV	Goldman Sachs	(796)	(123)	Rayonier Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(248)	Plexus Corp	Goldman Sachs	(175)	(997)	Rayonier Inc (REIT)	Goldman Sachs	(299)
(99)	Post Holdings Inc	Goldman Sachs	143	(70)	REGENXBIO Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(3.083)	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	185	(732)	REGENXBIO Inc	Goldman Sachs	(388)
96	PRA Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	78	368	Reinsurance Group of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(345)
965	Precigen Inc	Goldman Sachs	(106)	48	Reinsurance Group of America Inc	Goldman Sachs	104
1.317	Premier Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.541)	1.505	Reinsurance Group of America Inc	Morgan Stanley	3.401
455	Premier Financial Corp	Goldman Sachs	(532)	1.302	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	(234)
(183)	Premier Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6				
(3.568)	Premier Inc 'A'	Goldman Sachs	5.820				
(182)	PriceSmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	27				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(126)	Renewable Energy Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	57	(165)	Scholastic Corp	Bank of America Merrill Lynch	(93)
(68)	Rent-A-Center Inc	Bank of America Merrill Lynch	(88)	(147)	Scholastic Corp	Goldman Sachs	(172)
(1.112)	Rent-A-Center Inc	Goldman Sachs	(5.587)	(63)	Schrodinger Inc	Morgan Stanley	36
(314)	Repay Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	33	(4)	Seaboard Corp	Bank of America Merrill Lynch	54
(4.353)	Repay Holdings Corp	Goldman Sachs	1.161	(4)	Seaboard Corp	Goldman Sachs	226
2.850	Resources Connection Inc	Bank of America Merrill Lynch	43	266	SeaWorld Entertainment Inc	Goldman Sachs	561
9.032	Resources Connection Inc	Goldman Sachs	86	456	Select Energy Services Inc 'A'	Goldman Sachs	51
798	Retail Properties of America Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	309	(63)	Selective Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	9
(162)	REV Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3	(299)	Selective Insurance Group Inc	Goldman Sachs	208
(146)	REV Group Inc	Goldman Sachs	3	(1.985)	Sensient Technologies Corp	Goldman Sachs	(2.422)
199	REX American Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.409	664	Service Properties Trust (REIT)	Goldman Sachs	969
(3.941)	Rigel Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(158)	(767)	ServisFirst Bancshares Inc	Goldman Sachs	(949)
(6.722)	Rigel Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(264)	1.059	Shake Shack Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	10.756
1.910	RLI Corp	Goldman Sachs	(5.508)	335	Shake Shack Inc 'A'	Goldman Sachs	2.379
601	RLJ Lodging Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	215	(790)	Shift4 Payments Inc 'A'	Morgan Stanley	(485)
(766)	RMR Group Inc 'A'	Goldman Sachs	15	(2.365)	Shoals Technologies Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(14.001)
(970)	Rocket Cos Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(213)	(542)	Shoals Technologies Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.756)
(446)	Rocket Cos Inc 'A'	Goldman Sachs	13	(2.896)	Shoals Technologies Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.463)
(5.362)	Rocket Cos Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.343)	891	Shoe Carnival Inc	Goldman Sachs	1.410
(225)	Rogers Corp	Goldman Sachs	(1.145)	(58)	ShotSpotter Inc	Goldman Sachs	37
(1.310)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	(9.694)	(802)	Shyft Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(784)
(283)	Royal Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	401	(2.417)	Shyft Group Inc	Goldman Sachs	(1.815)
(190)	Royal Gold Inc	Goldman Sachs	145	1.503	SIGA Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	256
(783)	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	712	780	SIGA Technologies Inc	Goldman Sachs	133
5.615	RPC Inc	Goldman Sachs	(6.008)	116	Signature Bank	Bank of America Merrill Lynch	179
107	Rush Enterprises Inc 'B'	Goldman Sachs	(355)	157	Signature Bank	Goldman Sachs	1.349
293	Ruth's Hospitality Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(117)	462	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs	(2.287)
1.355	Ruth's Hospitality Group Inc	Goldman Sachs	(542)	(677)	Simmons First National Corp 'A'	Goldman Sachs	223
6.285	Sabra Health Care Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1.948	(963)	Simply Good Foods Co	Goldman Sachs	(2.735)
719	Sabra Health Care Inc (REIT)	Goldman Sachs	223	116	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	107
4.840	Sabra Health Care Inc (REIT)	Morgan Stanley	(194)	1.745	Sirius XM Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	663
3.554	Sabre Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.224	123.882	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	13.550
790	Sabre Corp	Goldman Sachs	131	512	SITE Centers Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	133
1.147	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.043	2.361	SITE Centers Corp (REIT)	Goldman Sachs	614
4.248	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs	7.072	206	SiteOne Landscape Supply Inc	Goldman Sachs	(760)
3.257	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	3.844	49	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	(197)
(214)	salesforce.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	158	101	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	78
(250)	salesforce.com Inc	Goldman Sachs	(2.689)	100	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs	(1)
(332)	salesforce.com Inc	Morgan Stanley	(2.931)	(126)	SJW Group	Goldman Sachs	2
329	Sanderson Farms Inc	Bank of America Merrill Lynch	(924)	1.318	Skechers USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	94
375	Sanderson Farms Inc	Morgan Stanley	(819)	299	Skechers USA Inc 'A'	Goldman Sachs	(30)
(69)	Sandy Spring Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	67	3.113	Skechers USA Inc 'A'	Morgan Stanley	2.312
(1.167)	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs	1.036	(162)	Skyworks Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(127)
(353)	Saul Centers Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(484)	(675)	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs	(1.927)
(590)	Saul Centers Inc (REIT)	Goldman Sachs	(808)	(192)	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	(215)
(1.160)	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Goldman Sachs	2.007	150	SMART Global Holdings Inc	Goldman Sachs	488
				(1.208)	Snap Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3.229)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
(1.440)	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.207)	61	Sysco Corp	Bank of America	
(119)	Snap Inc 'A'	Morgan Stanley	(146)			Merrill Lynch	(19)
(413)	Snowflake Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.697)	126	Sysco Corp	Morgan Stanley	(120)
(654)	SolarWinds Corp	Bank of America		(693)	Systemax Inc	Goldman Sachs	(28)
		Merrill Lynch	(122)	(62)	Tactile Systems Technology Inc	Bank of America	
(2.309)	SolarWinds Corp	Goldman Sachs	(724)	(54)	Tactile Systems Technology Inc	Merrill Lynch	(97)
359	Sonic Automotive Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.235)			Goldman Sachs	(40)
99	Southwest Gas Holdings Inc	Bank of America		(444)	Talos Energy Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(9)			Merrill Lynch	(462)
2.573	Southwest Gas Holdings Inc	Goldman Sachs	(5.619)	135	Tandem Diabetes Care Inc	Goldman Sachs	926
(1.394)	Southwestern Energy Co	Bank of America		503	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	181
		Merrill Lynch	275	723	Tapestry Inc	Bank of America	
(1.138)	SP Plus Corp	Goldman Sachs	312			Merrill Lynch	209
(1.084)	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs	(260)	1.362	Tapestry Inc	Goldman Sachs	(835)
289	SPS Commerce Inc	Bank of America		4.400	Tapestry Inc	Morgan Stanley	5.977
		Merrill Lynch	(301)	(359)	Taro Pharmaceutical Industries Ltd	Bank of America	
497	SPS Commerce Inc	Goldman Sachs	(267)	(1.197)	Taro Pharmaceutical Industries Ltd	Merrill Lynch	272
(1.982)	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America				Goldman Sachs	2.565
(130)	SS&C Technologies Holdings Inc	Merrill Lynch	564	(3.946)	TCF Financial Corp	Bank of America	
		Goldman Sachs	31			Merrill Lynch	(179)
(6.816)	SS&C Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	4.294	(1.592)	TCF Financial Corp	Goldman Sachs	(817)
(197)	St Joe Co	Bank of America		(8.242)	TCF Financial Corp	Morgan Stanley	(7.410)
		Merrill Lynch	(556)	(1.690)	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	(1.927)
28	Stamps.com Inc	Bank of America		(957)	TEGNA Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	147			Merrill Lynch	(32)
264	Stamps.com Inc	Morgan Stanley	436	1.185	Tejon Ranch Co	Bank of America	
(748)	Starbucks Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(127)
		Merrill Lynch	(2.169)	1.792	Tejon Ranch Co	Goldman Sachs	(122)
(99)	Starbucks Corp	Goldman Sachs	(287)	934	Tenneco Inc 'A'	Bank of America	
(4.986)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	(6.781)			Merrill Lynch	1.442
3.238	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Bank of America		3.269	Tenneco Inc 'A'	Goldman Sachs	4.675
		Merrill Lynch	1.430	199	Teradata Corp	Goldman Sachs	797
2.538	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	1.293	142	Terex Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	287
50	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	17	530	Terex Corp	Goldman Sachs	702
1.195	State Auto Financial Corp	Bank of America		361	Terminix Global Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(275)			Merrill Lynch	184
1.114	State Auto Financial Corp	Goldman Sachs	(256)	362	Terminix Global Holdings Inc	Goldman Sachs	122
128	Sterling Construction Co Inc	Bank of America		345	Terminix Global Holdings Inc	Morgan Stanley	190
		Merrill Lynch	77	47	Terreno Realty Corp (REIT)	Bank of America	
102	Steven Madden Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	4
		Merrill Lynch	113	596	Terreno Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	(313)
2.709	Steven Madden Ltd	Goldman Sachs	1.931	187	Texas Capital Bancshares Inc	Bank of America	
611	Stock Yards Bancorp Inc	Goldman Sachs	825			Merrill Lynch	(178)
(142)	Stoneridge Inc	Goldman Sachs	277	658	Texas Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs	(615)
71	StoneX Group Inc	Goldman Sachs	10			Bank of America	
291	Stride Inc	Bank of America		1.446	TFS Financial Corp	Merrill Lynch	43
		Merrill Lynch	(454)			Goldman Sachs	34
(361)	Stryker Corp	Morgan Stanley	679	1.138	TFS Financial Corp	Merrill Lynch	
216	Summit Hotel Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	34	735	Thermon Group Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.668)
(1.214)	Sunstone Hotel Investors Inc (REIT)	Goldman Sachs	61	(273)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	128
(62)	Super Micro Computer Inc	Goldman Sachs	69	(111)	Towne Bank	Bank of America	
(139)	Surmodics Inc	Goldman Sachs	16			Merrill Lynch	(7)
(635)	SVMK Inc	Bank of America		(140)	Towne Bank	Goldman Sachs	(22)
		Merrill Lynch	(800)	(1.602)	Translate Bio Inc	Goldman Sachs	(1.618)
(317)	SVMK Inc	Goldman Sachs	(209)	(1.590)	Tredegar Corp	Goldman Sachs	1.336
(1.296)	Switch Inc 'A'	Bank of America		(268)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	479			Merrill Lynch	478
(3.241)	Switch Inc 'A'	Morgan Stanley	389	(673)	TreeHouse Foods Inc	Goldman Sachs	1.333
99	Sykes Enterprises Inc	Bank of America		130	TriCo Bancshares	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6)			Merrill Lynch	98
279	Synaptics Inc	Bank of America		2.686	TriCo Bancshares	Goldman Sachs	2.812
		Merrill Lynch	480	191	TriMas Corp	Bank of America	
306	Synaptics Inc	Goldman Sachs	1.150			Merrill Lynch	(212)
34	Synaptics Inc	Morgan Stanley	6	69	TriMas Corp	Goldman Sachs	(77)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
États-Unis suite				États-Unis suite			
94	TriNet Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(197)	(61)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Goldman Sachs	1
279	TriNet Group Inc	Goldman Sachs	(817)	606	Univest Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	12
461	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs	(212)	569	Univest Financial Corp	Goldman Sachs	93
593	Triple-S Management Corp	Goldman Sachs	71	(526)	Upland Software Inc	Goldman Sachs	(763)
187	TriState Capital Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	180	(519)	Upstart Holdings Inc	Morgan Stanley	(4.386)
762	TriState Capital Holdings Inc	Goldman Sachs	151	1.483	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs	291
494	Triton International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.098	(579)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	41
436	Triton International Ltd	Goldman Sachs	441	(1.327)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	93
705	Triumph Group Inc	Goldman Sachs	1.833	296	US Ecology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(465)
230	Tronox Holdings Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	105	1.350	US Ecology Inc	Goldman Sachs	(1.810)
371	Tronox Holdings Plc 'A'	Goldman Sachs	12	821	US Physical Therapy Inc	Goldman Sachs	(148)
1.110	TrueCar Inc	Goldman Sachs	1.376	(139)	USANA Health Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(779)
162	Trustmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(152)	(81)	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	(375)
518	Trustmark Corp	Goldman Sachs	(487)	(1.181)	Utz Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29)
(358)	TTEC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.418)	(3.779)	Utz Brands Inc	Goldman Sachs	(113)
(1.530)	TTEC Holdings Inc	Goldman Sachs	(8.752)	(8.211)	UWM Holdings Corp	Goldman Sachs	(6.322)
1.569	TTM Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	281	(4.100)	UWM Holdings Corp	Morgan Stanley	(2.665)
1.010	TTM Technologies Inc	Goldman Sachs	182	(23)	Vapotherm Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61)
85	Tucows Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(85)	(450)	Vapotherm Inc	Goldman Sachs	(1.188)
(537)	Tupperware Brands Corp	Goldman Sachs	1.338	154	Varex Imaging Corp	Bank of America Merrill Lynch	171
(5.755)	TuSimple Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(9.411)	1.116	Varonis Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.129
1.387	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.958	1.602	Varonis Systems Inc	Morgan Stanley	1.410
914	UGI Corp	Goldman Sachs	1.065	(786)	Vector Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	448
4.761	UGI Corp	Morgan Stanley	5.470	(3.562)	Vector Group Ltd	Goldman Sachs	2.975
638	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Morgan Stanley	18.847	60	Vectrus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(71)	UMB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6)	115	Vectrus Inc	Goldman Sachs	36
(129)	UMB Financial Corp	Goldman Sachs	113	(315)	Veeco Instruments Inc	Goldman Sachs	(209)
5.149	Umpqua Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	984	(4.149)	Veoneer Inc	Goldman Sachs	(6.182)
3.934	Umpqua Holdings Corp	Goldman Sachs	701	1.107	Verint Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.205
2.837	Under Armour Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	735	3.228	Verint Systems Inc	Goldman Sachs	3.249
2.526	Under Armour Inc 'A'	Goldman Sachs	487	676	VF Corp	Morgan Stanley	1.174
18.337	Under Armour Inc 'A'	Morgan Stanley	18.302	(4.586)	Viatris Inc	Goldman Sachs	(588)
316	Under Armour Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	250	(461)	Viatris Inc	Morgan Stanley	55
6.345	Under Armour Inc 'C'	Goldman Sachs	(1.904)	2.730	Victory Capital Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.661
(13)	UniFirst Corp	Goldman Sachs	30	2.040	Victory Capital Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	920
(118)	Unisys Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41)	(2.456)	Vimeo Inc	Morgan Stanley	(103.152)
(3.041)	Unisys Corp	Goldman Sachs	(1.064)	(1.139)	Virgin Galactic Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.828)
(1.172)	United Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.745)	(354)	Virgin Galactic Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.457)
(2.324)	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.136)	472	Vishay Precision Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(873)
(158)	United Community Banks Inc	Goldman Sachs	(134)	1.181	Vishay Precision Group Inc	Goldman Sachs	(2.185)
110	United Fire Group Inc	Goldman Sachs	(220)	33	VMware Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(156)
(11)	United Natural Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)	289	VMware Inc 'A'	Goldman Sachs	(971)
(1.024)	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs	(2.447)	764	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.188)
16	United States Cellular Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1)	738	Vocera Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	131
108	United States Cellular Corp	Goldman Sachs	(6)	682	Vocera Communications Inc	Goldman Sachs	207
(437)	Uniti Group Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(96)	2.516	Voya Financial Inc	Goldman Sachs	(599)
(3.477)	Uniti Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	(765)	9.143	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	(2.377)
(61)	Unitil Corp	Bank of America Merrill Lynch	38	(2.706)	Voyager Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	758
(1.077)	Universal Corp	Goldman Sachs	4.282	(2.786)	Voyager Therapeutics Inc	Goldman Sachs	619

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD	
États-Unis suite				États-Unis suite				
171	W R Berkley Corp	Bank of America Merrill Lynch	(78)	76	Zillow Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	407	
336	W R Berkley Corp	Goldman Sachs	249	79	Zscaler Inc	Goldman Sachs	2.443	
3.422	W R Berkley Corp	Morgan Stanley	2.321	1.513	Zscaler Inc	Morgan Stanley	29.957	
245	Wabash National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(289)	68	Zumiez Inc	Bank of America Merrill Lynch	130	
674	Wabash National Corp	Goldman Sachs	(166)	658	Zumiez Inc	Goldman Sachs	767	
592	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	(71)	(488)	Zuora Inc 'A'	Goldman Sachs	(215)	
1.019	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	(320)	(1.909)	Zynex Inc	Goldman Sachs	(2.673)	
(28)	Walker & Dunlop Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32)				(122.091)	
(259)	Walker & Dunlop Inc	Goldman Sachs	(324)	Total (Exposition brute sous-jacente - USD 130.897.109)				(118.561)
205	Washington Federal Inc	Bank of America Merrill Lynch	(92)	* Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(a) de l'Annexe aux états financiers.				
3.072	Washington Federal Inc	Goldman Sachs	(1.382)	** Les montants inférieurs à 0,5 USD ont été arrondis à zéro.				
384	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	334					
1.364	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	1.187					
164	Waters Corp	Morgan Stanley	812					
637	Waterstone Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(57)					
662	Waterstone Financial Inc	Goldman Sachs	55					
801	Watts Water Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	72					
(3.755)	Western Digital Corp	Morgan Stanley	(4.957)					
(344)	Whirlpool Corp	Goldman Sachs	2.335					
(285)	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	(596)					
(3)	White Mountains Insurance Group Ltd	Goldman Sachs	17					
439	Willdan Group Inc	Goldman Sachs	(1.106)					
1.227	Wintrust Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(515)					
1.126	Wintrust Financial Corp	Goldman Sachs	(234)					
1.318	Wintrust Financial Corp	Morgan Stanley	2.162					
1.156	WisdomTree Investments Inc	Goldman Sachs	23					
211	Wolverine World Wide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66)					
857	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs	(33)					
(48)	World Acceptance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(360)					
(46)	World Acceptance Corp	Goldman Sachs	(678)					
231	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs	(906)					
628	WP Carey Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	322					
264	WP Carey Inc (REIT)	Goldman Sachs	(83)					
523	WP Carey Inc (REIT)	Morgan Stanley	(7)					
(188)	WW International Inc	Goldman Sachs	(405)					
(92)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	(222)					
(3.084)	Xcel Energy Inc	Morgan Stanley	2.436					
173	XPEL Inc	Goldman Sachs	151					
(277)	Xperi Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(152)					
201	XPO Logistics Inc	Goldman Sachs	716					
242	XPO Logistics Inc	Morgan Stanley	840					
56	Yelp Inc	Bank of America Merrill Lynch	67					
925	Yelp Inc	Goldman Sachs	1.738					
918	Yext Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.718					
3.708	Yext Inc	Goldman Sachs	6.846					
(887)	York Water Co	Goldman Sachs	(2.005)					
260	Zendesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	181					
208	Zendesk Inc	Goldman Sachs	332					
38	Zendesk Inc	Morgan Stanley	(10)					

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(18)	EUR	Amsterdam Index Futures June 2021	Juin 2021	3.124.836	(27.928)
32	EUR	CAC 40 Index Futures June 2021	Juin 2021	2.522.812	43.369
9	USD	E-mini Russell 2000 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.017.810	(24.660)
35	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	7.359.800	208.316
(13)	EUR	EURO STOXX 50 Index Futures June 2021	Juin 2021	643.017	(41.488)
5	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2021	Juin 2021	497.615	(195)
7	EUR	FTSE MIB Index Futures June 2021	Juin 2021	1.078.315	31.059
(12)	EUR	IBEX 35 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.341.904	(911)
(5)	EUR	Mini-DAX Futures June 2021	Juin 2021	471.807	(680)
(15)	SGD	MSCI Singapore Index Futures June 2021	Juin 2021	408.039	(1.290)
(19)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures June 2021	Juin 2021	515.618	(1.195)
(3)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures June 2021	Juin 2021	590.341	(14.210)
(8)	AUD	SPI 200 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.109.225	(16.504)
6	JPY	Topix Index Futures June 2021	Juin 2021	1.055.363	33.177
Total				21.736.502	186.860

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	1.911.000	USD	1.478.549	Deutsche Bank	21/6/2021	598
CAD	1.567.000	USD	1.298.754	JP Morgan	21/6/2021	(1.774)
EUR	1.411.346	CHF	1.545.000	Citibank	21/6/2021	6.387
EUR	1.028.683	CHF	1.127.000	UBS	21/6/2021	3.654
EUR	220.751	NOK	2.244.000	Deutsche Bank	21/6/2021	602
EUR	101.940	NOK	1.035.000	UBS	21/6/2021	427
EUR	264.469	SEK	2.682.000	JP Morgan	21/6/2021	(620)
EUR	241.185	USD	293.451	State Street Bank & Trust Company	21/6/2021	999
GBP	405.000	USD	575.592	Morgan Stanley	21/6/2021	(1.694)
JPY	41.294.000	USD	377.651	Morgan Stanley	21/6/2021	(964)
NOK	7.981.000	EUR	795.118	JP Morgan	21/6/2021	(14.343)
NZD	260.000	USD	187.568	Goldman Sachs	21/6/2021	1.405
SEK	21.451	EUR	2.118	Citibank	21/6/2021	1
SEK	7.274.549	EUR	718.859	Deutsche Bank	21/6/2021	(179)
SEK	21.733.000	EUR	2.142.240	UBS	21/6/2021	6.032
USD	727.961	AUD	944.000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2021	(2.711)
USD	252.117	AUD	323.000	Citibank	21/6/2021	2.110
USD	212.516	CAD	258.000	BNP Paribas	21/6/2021	(1.026)
USD	1.915.251	EUR	1.566.000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2021	3.404
USD	333.559	EUR	274.000	Citibank	21/6/2021	(954)
USD	246.120	GBP	175.043	Barclays Bank	21/6/2021	(1.921)
USD	2.924.927	NZD	4.061.000	Deutsche Bank	21/6/2021	(26.684)
USD	97.931	NZD	135.000	Morgan Stanley	21/6/2021	(190)
USD	6.743	SGD	9.000	HSBC	21/6/2021	(66)
						(27.507)

Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	31.200.308	USD	37.699.998	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	386.349
USD	1.008.033	EUR	827.127	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1.646)
						384.703

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées USD
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	402.708	USD	560.616	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	10.029
USD	12.063	GBP	8.525	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(18)
						10.011
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	585.260	USD	69.717	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	872
USD	1.394	SEK	11.613	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(6)
						866
Total (Exposition brute sous-jacente - USD 67.011.109)						368.073

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	88,16
Diversifiés	1,18
Biens de consommation non cyclique	0,46
Technologie	0,37
Communications	0,30
Valeurs industrielles	0,23
Finance	0,02
Portefeuille de titres à la valeur de marché	90,72
Autres éléments de l'actif net	9,28
100,00	

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				États-Unis suite			
GBP 5.000	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 2,00& 26/1/2035	16.945	0,10	USD 26.217	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,625& 15/1/2024	23.340	0,13
GBP 10.504	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 22/11/2036	18.112	0,10	USD 14.280	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,50& 15/4/2024	12.724	0,07
GBP 9.688	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 1,125& 22/11/2037	19.382	0,11	USD 9.591	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/7/2024	8.541	0,05
GBP 10.557	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,625& 22/3/2040	20.805	0,12	USD 6.709	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/10/2024	5.983	0,03
GBP 8.692	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 10/8/2041	16.336	0,09	USD 25.827	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,25& 15/1/2025	23.135	0,13
GBP 9.222	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,625& 22/11/2042	19.272	0,11	USD 16.999	United States Treasury Inflation Indexed Bond 2,375& 15/1/2025	16.369	0,09
GBP 11.266	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 22/3/2044	22.113	0,13	USD 9.637	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/4/2025	8.612	0,05
GBP 9.098	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 22/3/2046	18.510	0,10	USD 11.725	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,375& 15/7/2025	10.670	0,06
GBP 9.859	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,75& 22/11/2047	23.462	0,13	USD 14.901	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/10/2025	13.431	0,08
GBP 6.914	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 10/8/2048	14.812	0,08	USD 14.154	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,625& 15/1/2026	13.025	0,07
GBP 9.321	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,50& 22/3/2050	22.182	0,13	USD 13.876	United States Treasury Inflation Indexed Bond 2,00& 15/1/2026	13.536	0,08
GBP 2.019	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 22/3/2051	4.518	0,03	USD 13.531	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/4/2026	12.188	0,07
GBP 9.076	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,25& 22/3/2052	21.388	0,12	USD 13.699	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/7/2026	12.424	0,07
GBP 8.495	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 1,25& 22/11/2055	26.729	0,15	USD 15.019	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,375& 15/1/2027	13.762	0,08
GBP 5.155	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 22/11/2056	13.014	0,07	USD 10.374	United States Treasury Inflation Indexed Bond 2,375& 15/1/2027	10.535	0,06
GBP 6.613	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 22/3/2058	17.176	0,10	USD 12.774	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,375& 15/7/2027	11.781	0,07
GBP 9.064	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,375& 22/3/2062	27.155	0,15	USD 17.178	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,50& 15/1/2028	15.920	0,09
GBP 5.016	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 22/11/2065	15.424	0,09	USD 2.655	United States Treasury Inflation Indexed Bond 1,75& 15/1/2028	2.653	0,02
GBP 8.560	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125& 22/3/2068	28.385	0,16	USD 12.935	United States Treasury Inflation Indexed Bond 3,625& 15/4/2028	14.426	0,08
		527.001	2,98	USD 15.719	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,75& 15/7/2028	14.883	0,08
États-Unis				USD 13.634	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,875& 15/1/2029	13.012	0,07
USD 17.734	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/7/2022	15.132	0,09	USD 8.387	United States Treasury Inflation Indexed Bond 2,50& 15/1/2029	8.914	0,05
USD 11.473	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/1/2023	9.868	0,06	USD 17.720	United States Treasury Inflation Indexed Bond 3,875& 15/4/2029	20.568	0,12
USD 9.702	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,625& 15/4/2023	8.460	0,05				
USD 26.286	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,375& 15/7/2023	23.079	0,13				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
États-Unis suite				Canada suite			
USD 12.838	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,25& 15/7/2029	11.756	0,07	CAD 92.972	Canadian Government Real Return Bond 1,50% 1/12/2044	80.988	0,46
USD 12.454	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/1/2030	11.234	0,06	CAD 81.620	Canadian Government Real Return Bond 0,50% 1/12/2050	59.765	0,34
USD 13.531	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/7/2030	12.255	0,07			294.117	1,66
USD 13.632	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125& 15/1/2031	12.271	0,07	Total des obligations		294.117	1,66
USD 2.835	United States Treasury Inflation Indexed Bond 3,375& 15/4/2032	3.438	0,02	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		294.117	1,66
USD 6.249	United States Treasury Inflation Indexed Bond 2,125& 15/2/2040	7.537	0,04	Portefeuille de titres à la valeur de marché		14.166.286	80,04
USD 10.762	United States Treasury Inflation Indexed Bond 2,125& 15/2/2041	13.099	0,07	Autres éléments de l'actif net		3.532.242	19,96
USD 11.602	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,75& 15/2/2042	11.343	0,06	Total de l'actif net (EUR)		17.698.528	100,00
USD 9.560	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,625& 15/2/2043	9.128	0,05				
USD 9.431	United States Treasury Inflation Indexed Bond 1,375& 15/2/2044	10.399	0,06				
USD 9.334	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,75& 15/2/2045	9.160	0,05				
USD 8.718	United States Treasury Inflation Indexed Bond 1,00& 15/2/2046	9.055	0,05				
USD 8.447	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,875& 15/2/2047	8.615	0,05				
USD 7.195	United States Treasury Inflation Indexed Bond 1,00% 15/2/2048	7.601	0,04				
USD 5.788	United States Treasury Inflation Indexed Bond 1,00% 15/2/2049	6.157	0,03				
USD 5.768	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,25% 15/2/2050	5.138	0,03				
USD 3.560	United States Treasury Inflation Indexed Bond 0,125% 15/2/2051	3.059	0,02				
		508.216	2,87				
Total des obligations		13.872.169	78,38				
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		13.872.169	78,38				
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire							
OBLIGATIONS							
Canada							
CAD 78.603	Canadian Government Real Return Bond 3,00% 1/12/2036	78.451	0,44				
CAD 80.319	Canadian Government Real Return Bond 2,00% 1/12/2041	74.913	0,42				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés				Australie suite			
« CONTRACTS FOR DIFFERENCE »				(1.141)	Northern Star Resources Ltd	Credit Suisse	(148)
Australie				(670)	Northern Star Resources Ltd	Deutsche Bank	(204)
(129)	Afterpay Ltd	Credit Suisse	386	(1.660)	Oil Search Ltd	Citibank	42
(52)	Afterpay Ltd	Deutsche Bank	(208)	(2.460)	Oil Search Ltd	JP Morgan	499
(3.230)	AMP Ltd	Bank of America		(666)	Orica Ltd	Deutsche Bank	249
(1.557)	AMP Ltd	Merrill Lynch	(61)	(965)	Orica Ltd	JP Morgan	233
(5.941)	AMP Ltd ^{tr}	Citibank	(40)	(1.428)	Qantas Airways Ltd	Deutsche Bank	(145)
(19)	AMP Ltd ^{tr}	Credit Suisse	—	(239)	Ramsay Health Care Ltd	Bank of America	
(644)	APA Group (Unit)	JP Morgan	—		Merrill Lynch	Merrill Lynch	44
381	Aristocrat Leisure Ltd	Credit Suisse	241	(81)	Ramsay Health Care Ltd	Credit Suisse	(30)
251	Aristocrat Leisure Ltd	Citibank	85	(92)	Ramsay Health Care Ltd	JP Morgan	(34)
427	Aristocrat Leisure Ltd	Deutsche Bank	339	24	REA Group Ltd	Bank of America	
90	ASX Ltd	JP Morgan	826		Merrill Lynch	Merrill Lynch	213
1.832	Aurizon Holdings Ltd	Credit Suisse	248	141	REA Group Ltd	Credit Suisse	288
2.666	Aurizon Holdings Ltd	Citibank	81	60	REA Group Ltd	JP Morgan	122
3.501	Aurizon Holdings Ltd	Credit Suisse	(135)	85	Rio Tinto Ltd	Credit Suisse	(497)
1.649	Aurizon Holdings Ltd	Deutsche Bank	—	56	Rio Tinto Ltd	Deutsche Bank	(82)
(8.044)	AusNet Services Ltd	JP Morgan	(84)	185	Sonic Healthcare Ltd	Bank of America	
(255)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Credit Suisse	663	(1.140)	Sydney Airport (Unit)	Merrill Lynch	(36)
1.372	Brambles Ltd	Bank of America	(215)		Merrill Lynch	Bank of America	
		Merrill Lynch	122	(1.354)	Sydney Airport (Unit)	Credit Suisse	94
680	Brambles Ltd	Citibank	95	(1.122)	Sydney Airport (Unit)	Deutsche Bank	(64)
2.395	Brambles Ltd	Credit Suisse	349	3.121	Tabcorp Holdings Ltd	Bank of America	
2.675	Brambles Ltd	Deutsche Bank	323		Merrill Lynch	Merrill Lynch	59
(471)	CIMIC Group Ltd	Bank of America		1.311	Tabcorp Holdings Ltd	Citibank	91
		Merrill Lynch	(131)	6.945	Tabcorp Holdings Ltd	Deutsche Bank	132
66	Cochlear Ltd	Credit Suisse	359	2.350	Telstra Corp Ltd	Deutsche Bank	134
(79)	Commonwealth Bank of Australia	Deutsche Bank	(97)	2.042	Telstra Corp Ltd	JP Morgan	39
(552)	Crown Resorts Ltd	Deutsche Bank	27	(2.446)	TPG Telecom Ltd	Deutsche Bank	(258)
(836)	Crown Resorts Ltd	JP Morgan	64	(1.304)	TPG Telecom Ltd	JP Morgan	(241)
(25)	CSL Ltd	Deutsche Bank	(216)	(1.090)	Transurban Group (Unit)	Citibank	(21)
(1)	Deterra Royalties Ltd	Bank of America		(533)	Transurban Group (Unit)	Deutsche Bank	(23)
		Merrill Lynch	—	(2.781)	Transurban Group (Unit)	JP Morgan	811
(2.312)	Evolution Mining Ltd	Deutsche Bank	(425)	430	Wesfarmers Ltd	Bank of America	
(824)	Fortescue Metals Group Ltd	Credit Suisse	1.233		Merrill Lynch	Merrill Lynch	357
(136)	Fortescue Metals Group Ltd	JP Morgan	204	440	Wesfarmers Ltd	JP Morgan	151
(2)	Iluka Resources Ltd	Bank of America		(856)	Westpac Banking Corp	Credit Suisse	—
		Merrill Lynch	1	(679)	Westpac Banking Corp	Deutsche Bank	(469)
(484)	Insurance Australia Group Ltd	Bank of America		(216)	WiseTech Global Ltd	Deutsche Bank	(342)
(312)	Insurance Australia Group Ltd	Merrill Lynch	(58)	(162)	Woolworths Group Ltd	Citibank	(2)
		Citibank	(28)	(82)	Xero Ltd	Deutsche Bank	(562)
(1.711)	Insurance Australia Group Ltd	Credit Suisse	87				4.315
(3.628)	Insurance Australia Group Ltd	JP Morgan	184	Autriche			
866	James Hardie Industries Plc - CDI	Bank of America	647	(137)	Erste Group Bank AG	Deutsche Bank	(14)
317	James Hardie Industries Plc - CDI	Merrill Lynch	(163)	272	OMV AG	Citibank	212
173	James Hardie Industries Plc - CDI	Credit Suisse	65	506	Raiffeisen Bank International AG	Deutsche Bank	(81)
(31)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Deutsche Bank	(7)	(80)	Verbund AG	Bank of America	
(1.331)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Merrill Lynch	(127)			Merrill Lynch	(232)
(133)	Magellan Financial Group Ltd	JP Morgan	(152)	273	voestalpine AG	Citibank	284
(1.592)	Medibank Pvt Ltd	Deutsche Bank	(151)				169
(107)	Medibank Pvt Ltd	Bank of America	(2)	Belgique			
(2.509)	Medibank Pvt Ltd	Merrill Lynch	(111)	(34)	Argenx SE	Credit Suisse	(554)
(1.980)	Medibank Pvt Ltd	Citibank	(88)	(17)	Argenx SE	Deutsche Bank	(34)
(320)	National Australia Bank Ltd	Credit Suisse	(183)	(189)	Elia Group SA	Bank of America	
(579)	Newcrest Mining Ltd	JP Morgan	73			Merrill Lynch	385
(232)	Newcrest Mining Ltd	Citibank	(33)	(19)	Elia Group SA	Citibank	84
		Deutsche Bank		(17)	Elia Group SA	Credit Suisse	20
				(134)	Elia Group SA	Deutsche Bank	228
				84	Etablissements Franz Colruyt NV	JP Morgan	(8)
				250	Proximus SADP	Citibank	(119)
				969	Proximus SADP	Credit Suisse	(814)
				51	UCB SA	Deutsche Bank	(134)
				48	UCB SA	JP Morgan	27

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Belgique suite				Canada suite			
(197)	Umicore SA	Citibank	254	607	Empire Co Ltd 'A'	JP Morgan	276
(76)	Umicore SA	Credit Suisse	179	(144)	Enbridge Inc	JP Morgan	204
			(486)	(300)	First Quantum Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	142
Canada				(57)	FirstService Corp	JP Morgan	(6)
(233)	Air Canada	Citibank	(216)	(291)	Fortis Inc	Bank of America Merrill Lynch	17
(701)	Algonquin Power & Utilities Corp	Citibank	43	(279)	Fortis Inc	Citibank	22
(350)	Algonquin Power & Utilities Corp	Credit Suisse	(2)	(410)	Fortis Inc	Credit Suisse	13
(445)	Algonquin Power & Utilities Corp	JP Morgan	196	(875)	Fortis Inc	JP Morgan	(46)
640	AltaGas Ltd	Citibank	96	(96)	Franco-Nevada Corp	JP Morgan	(41)
149	Atco Ltd 'I'	JP Morgan	126	120	George Weston Ltd	Bank of America Merrill Lynch	269
513	B2Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	(83)	9	George Weston Ltd	Citibank	2
6.700	B2Gold Corp	Citibank	45	230	George Weston Ltd	JP Morgan	580
770	B2Gold Corp	Credit Suisse	42	(138)	GFL Environmental Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119)
(225)	Ballard Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(589)	(683)	GFL Environmental Inc	Citibank	(79)
(223)	Ballard Power Systems Inc	Credit Suisse	(560)	(156)	GFL Environmental Inc	Credit Suisse	(78)
180	Bank of Montreal	Credit Suisse	1.131	177	Gildan Activewear Inc	Credit Suisse	(8)
164	Bank of Montreal	JP Morgan	1.030	(498)	Great-West Lifeco Inc	Citibank	(40)
88	Bank of Nova Scotia	Bank of America Merrill Lynch	92	1.961	Hydro One Ltd	Citibank	399
103	Bank of Nova Scotia	JP Morgan	122	95	iA Financial Corp Inc	Citibank	(52)
(362)	Bausch Health Cos Inc	Citibank	(216)	102	Intact Financial Corp	Credit Suisse	(156)
(110)	BCE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75)	1.397	Kinross Gold Corp	JP Morgan	389
(338)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Credit Suisse	(1.208)	(505)	Kirkland Lake Gold Ltd	Citibank	255
(125)	Brookfield Renewable Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(287)	352	Loblaw Cos Ltd	Citibank	(129)
(114)	Brookfield Renewable Corp 'A'	Credit Suisse	(312)	88	Magna International Inc	Citibank	334
(160)	CAE Inc	Credit Suisse	(66)	430	Manulife Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(117)
(492)	Cameco Corp	Citibank	(380)	578	Manulife Financial Corp	Citibank	188
122	Canadian Apartment Properties REIT (REIT)	JP Morgan	(108)	22	Manulife Financial Corp	Credit Suisse	(11)
66	Canadian Imperial Bank of Commerce	Bank of America Merrill Lynch	425	(255)	Metro Inc	Citibank	(3)
60	Canadian Imperial Bank of Commerce	Citibank	291	(459)	Metro Inc	JP Morgan	37
253	Canadian Imperial Bank of Commerce	Credit Suisse	2.056	79	National Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	80
59	Canadian Imperial Bank of Commerce	JP Morgan	479	101	National Bank of Canada	Citibank	(3)
45	Canadian National Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	166	72	National Bank of Canada	Credit Suisse	173
63	Canadian National Railway Co	JP Morgan	(17)	103	National Bank of Canada	JP Morgan	248
(80)	Canadian Pacific Railway Ltd	Citibank	15	(357)	Northland Power Inc	Citibank	(140)
39	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(147)	(199)	Northland Power Inc	JP Morgan	(212)
94	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Citibank	5	100	Nutrien Ltd	JP Morgan	20
34	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Credit Suisse	187	87	Onex Corp	Citibank	106
37	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	JP Morgan	203	254	Open Text Corp	Citibank	172
(667)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Citibank	131	160	Open Text Corp	JP Morgan	(6)
(104)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Credit Suisse	25	(319)	Pan American Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	39
(515)	Canadian Utilities Ltd 'A'	JP Morgan	122	(155)	Pan American Silver Corp	Credit Suisse	(2)
93	CCL Industries Inc 'B'	Citibank	37	(148)	Pan American Silver Corp	JP Morgan	118
77	CGI Inc	Citibank	(96)	349	Parkland Corp	Citibank	59
20	Constellation Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	214	(198)	Pembina Pipeline Corp	Credit Suisse	(154)
6	Constellation Software Inc	Citibank	(103)	438	Power Corp of Canada	Citibank	193
(144)	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	46	341	Quebecor Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(57)
(133)	Dollarama Inc	Citibank	69	(84)	Restaurant Brands International Inc	Citibank	(117)
(253)	Dollarama Inc	Credit Suisse	76	81	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(139)
(135)	Dollarama Inc	JP Morgan	111	55	Royal Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	120
				131	Royal Bank of Canada	Citibank	182
				(244)	Saputo Inc	JP Morgan	(359)
				(9)	Shopify Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.070)
				(4)	Shopify Inc 'A'	Citibank	(3)
				(5)	Shopify Inc 'A'	JP Morgan	(660)
				(686)	SSR Mining Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
				(235)	SSR Mining Inc	Citibank	8
				(372)	SSR Mining Inc	Credit Suisse	(23)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Canada suite				Danemark suite			
(301)	SSR Mining Inc	JP Morgan	(429)	(127)	Vestas Wind Systems A/S	Deutsche Bank	31
251	Sun Life Financial Inc	Bank of America		(140)	Vestas Wind Systems A/S	JP Morgan	(25)
		Merrill Lynch	(100)				3.462
98	Sun Life Financial Inc	Credit Suisse	(44)	Finlande			
193	Sun Life Financial Inc	JP Morgan	(86)	206	Kesko Oyj 'B'	Bank of America	
(106)	TC Energy Corp	Bank of America				Merrill Lynch	305
		Merrill Lynch	13	148	Kesko Oyj 'B'	Deutsche Bank	101
(287)	TC Energy Corp	Citibank	(88)	(64)	Kone Oyj 'B'	Citibank	84
(238)	TC Energy Corp	JP Morgan	121	83	Neste Oyj	Credit Suisse	287
(319)	TELUS Corp	Citibank	(61)	358	Neste Oyj	Deutsche Bank	995
(61)	Thomson Reuters Corp	JP Morgan	(72)	256	Stora Enso Oyj 'R'	Deutsche Bank	(298)
59	Toromont Industries Ltd	Citibank	53	(284)	Wartsila Oyj Abp	Citibank	(186)
(85)	Toronto-Dominion Bank	Citibank	59	(1.007)	Wartsila Oyj Abp	Credit Suisse	(408)
(168)	Toronto-Dominion Bank	JP Morgan	(147)				880
61	West Fraser Timber Co Ltd	Bank of America		France			
		Merrill Lynch	69	(126)	Accor SA	JP Morgan	20
84	West Fraser Timber Co Ltd	Credit Suisse	(629)	(42)	Aeroports de Paris	Bank of America	
60	West Fraser Timber Co Ltd	JP Morgan	(449)			Merrill Lynch	(109)
173	Wheaton Precious Metals Corp	Bank of America		(58)	Aeroports de Paris	Citibank	(258)
		Merrill Lynch	55	(91)	Aeroports de Paris	Deutsche Bank	(237)
			2.126	(32)	Air Liquide SA	Bank of America	
Danemark						Merrill Lynch	2
(105)	Ambu A/S 'B'	Deutsche Bank	51	(64)	Air Liquide SA	Credit Suisse	241
(131)	Ambu A/S 'B'	JP Morgan	1.732	(150)	Air Liquide SA	Deutsche Bank	3
5	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Credit Suisse	239	(100)	Alstom SA	Bank of America	
5	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Deutsche Bank	830			Merrill Lynch	(205)
1	AP Moller - Maersk A/S 'B'	JP Morgan	48	(93)	Alstom SA	Citibank	(91)
98	Carlsberg A/S 'B'	JP Morgan	(33)	(537)	Alstom SA	Deutsche Bank	(1.101)
(289)	Chr Hansen Holding A/S	Credit Suisse	272	69	Amundi SA	JP Morgan	(262)
(77)	Chr Hansen Holding A/S	Deutsche Bank	46	80	Arkema SA	Deutsche Bank	8
(82)	Chr Hansen Holding A/S	JP Morgan	77	50	BNP Paribas SA	Citibank	26
46	Coloplast A/S 'B'	Bank of America		151	BNP Paribas SA	Credit Suisse	44
		Merrill Lynch	(88)	117	BNP Paribas SA	Deutsche Bank	(102)
25	Coloplast A/S 'B'	Citibank	(50)	82	BNP Paribas SA	JP Morgan	24
32	Coloplast A/S 'B'	Credit Suisse	35	471	Bollere SA	Citibank	50
57	Coloplast A/S 'B'	JP Morgan	(9)	3.528	Bollere SA	Deutsche Bank	423
(30)	DSV PANALPINA A/S	Citibank	(40)	(187)	Bouygues SA	Citibank	(18)
(44)	DSV PANALPINA A/S	JP Morgan	(254)	36	Capgemini SE	Credit Suisse	(52)
34	Genmab A/S	Citibank	178	393	Carrefour SA	Deutsche Bank	(216)
34	Genmab A/S	Deutsche Bank	530	109	Cie de Saint-Gobain	Citibank	(9)
67	GN Store Nord AS	Credit Suisse	113	251	Cie de Saint-Gobain	Deutsche Bank	90
(194)	H Lundbeck A/S	Bank of America		82	Cie de Saint-Gobain	JP Morgan	(79)
		Merrill Lynch	258	55	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	JP Morgan	4
(145)	H Lundbeck A/S	Credit Suisse	(10)	260	CNP Assurances	JP Morgan	(173)
(175)	H Lundbeck A/S	Deutsche Bank	156	948	Credit Agricole SA	Deutsche Bank	(1.005)
10	Novo Nordisk A/S 'B'	Bank of America		(276)	Danone SA	Credit Suisse	(237)
		Merrill Lynch	(15)	(112)	Danone SA	Deutsche Bank	(17)
212	Novo Nordisk A/S 'B'	Credit Suisse	406	(23)	Dassault Systemes SE	Deutsche Bank	(122)
740	Novo Nordisk A/S 'B'	Deutsche Bank	(1.139)	(118)	Eiffage SA	Citibank	26
163	Novo Nordisk A/S 'B'	JP Morgan	312	(56)	Eiffage SA	Deutsche Bank	(22)
87	Novozymes A/S 'B'	Bank of America		(449)	Electricite de France SA	Credit Suisse	30
		Merrill Lynch	(43)	405	Engie SA	Citibank	(177)
85	Novozymes A/S 'B'	Citibank	(165)	338	Engie SA	Deutsche Bank	(173)
164	Novozymes A/S 'B'	Deutsche Bank	(82)	1.337	Engie SA	JP Morgan	(596)
211	Novozymes A/S 'B'	JP Morgan	(176)	(30)	EssilorLuxottica SA	Credit Suisse	(74)
(30)	Orsted A/S	Citibank	63	(120)	EssilorLuxottica SA	Deutsche Bank	(259)
101	Pandora A/S	Deutsche Bank	915	(41)	EssilorLuxottica SA	JP Morgan	(102)
(13)	ROCKWOOL International A/S 'B'	Citibank	(107)	43	Eurazeo SE	Bank of America	
(29)	ROCKWOOL International A/S 'B'	Deutsche Bank	(682)			Merrill Lynch	62
(210)	Tryg A/S	Credit Suisse	42	272	Eurazeo SE	Citibank	517
(991)	Tryg A/S	Deutsche Bank	513	22	Eurazeo SE	Credit Suisse	54
(306)	Tryg A/S	JP Morgan	62	(122)	Eurofins Scientific SE	JP Morgan	(826)
(260)	Vestas Wind Systems A/S	Bank of America		(211)	Faurecia SE	Citibank	(74)
		Merrill Lynch	(353)	(87)	Faurecia SE	Credit Suisse	45
(609)	Vestas Wind Systems A/S	Citibank	(176)	(189)	Faurecia SE	Deutsche Bank	(2)

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
France suite				Allemagne			
(375)	Getlink SE	Bank of America		(15)	adidas AG	Credit Suisse	(208)
		Merrill Lynch	56	(38)	adidas AG	JP Morgan	(526)
(369)	Getlink SE	Citibank	105	25	Allianz SE Reg	Citibank	10
(132)	Getlink SE	Deutsche Bank	20	45	Allianz SE Reg	Deutsche Bank	(30)
(374)	Getlink SE	JP Morgan	206	28	Allianz SE Reg	JP Morgan	15
8	Hermes International	Citibank	480	76	BASF SE	Bank of America	
4	Hermes International	Deutsche Bank	364			Merrill Lynch	(172)
(24)	Iliad SA	Credit Suisse	263	160	BASF SE	Citibank	(34)
(31)	Iliad SA	Deutsche Bank	(49)	67	BASF SE	Credit Suisse	(259)
53	Ipsen SA	Credit Suisse	157	191	BASF SE	Deutsche Bank	(432)
53	Ipsen SA	JP Morgan	157	66	Bechtle AG	JP Morgan	(69)
(7)	Kering SA	Citibank	(195)	(45)	Beiersdorf AG	Bank of America	
(17)	Kering SA	Deutsche Bank	(726)			Merrill Lynch	3
(7)	Kering SA	JP Morgan	(316)	(82)	Beiersdorf AG	Deutsche Bank	5
159	La Francaise des Jeux SAEM	Bank of America		110	Brenntag SE	Citibank	18
		Merrill Lynch	466	154	Brenntag SE	Credit Suisse	95
431	La Francaise des Jeux SAEM			(1.564)	Commerzbank AG	Deutsche Bank	(224)
		Credit Suisse	1.177	(40)	Continental AG	Citibank	(117)
(13)	L'Oreal SA	JP Morgan	(216)	(75)	Continental AG	Deutsche Bank	(518)
(41)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Citibank	(738)	(64)	Continental AG	JP Morgan	(474)
(7)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	JP Morgan	(214)	(34)	Delivery Hero SE	Bank of America	
1.624	Orange SA	Bank of America		(101)	Delivery Hero SE	Merrill Lynch	(308)
		Merrill Lynch	(409)			Citibank	(298)
400	Orange SA	Citibank	(42)	(40)	Delivery Hero SE	Credit Suisse	206
1.708	Orange SA	Credit Suisse	(287)	(155)	Delivery Hero SE	Deutsche Bank	(1.403)
2.155	Orange SA	Deutsche Bank	(543)	(464)	Deutsche Bank AG	Bank of America	
790	Orange SA	JP Morgan	(133)			Merrill Lynch	(228)
(16)	Orpea SA	Bank of America		(414)	Deutsche Bank AG	JP Morgan	(256)
		Merrill Lynch	75	30	Deutsche Boerse AG	Bank of America	
(117)	Orpea SA	Citibank	228			Merrill Lynch	(146)
(69)	Orpea SA	Deutsche Bank	324	31	Deutsche Boerse AG	Deutsche Bank	(150)
(3)	Orpea SA	JP Morgan	6	(385)	Deutsche Lufthansa AG Reg	Bank of America	
83	Publicis Groupe SA	Bank of America		26	Deutsche Post AG Reg	Merrill Lynch	(16)
		Merrill Lynch	46			Bank of America	
79	Publicis Groupe SA	Credit Suisse	(54)	222	Deutsche Post AG Reg	Merrill Lynch	125
426	Publicis Groupe SA	Deutsche Bank	239	155	Deutsche Post AG Reg	Citibank	479
(20)	Remy Cointreau SA	Credit Suisse	(72)	1.701	Deutsche Post AG Reg	Credit Suisse	668
(67)	Remy Cointreau SA	Deutsche Bank	(261)	121	Deutsche Post AG Reg	Deutsche Bank	8.165
(112)	Renault SA	Bank of America		121	Deutsche Post AG Reg	JP Morgan	521
		Merrill Lynch	(41)	(320)	Deutsche Telekom AG Reg	Bank of America	
(506)	Renault SA	Deutsche Bank	(187)			Merrill Lynch	79
(47)	Sanofi	Credit Suisse	(35)	(290)	Deutsche Telekom AG Reg	Credit Suisse	(109)
(11)	Sartorius Stedim Biotech	Deutsche Bank	(21)	(807)	Deutsche Telekom AG Reg	Deutsche Bank	200
176	Schneider Electric SE	Deutsche Bank	(88)	1.187	E.ON SE	Credit Suisse	(914)
(150)	SCOR SE	Credit Suisse	149	868	E.ON SE	Deutsche Bank	(385)
34	SEB SA	Bank of America		(39)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Citibank	16
		Merrill Lynch	(82)	(70)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA		
811	SES SA	Bank of America	469	(59)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Credit Suisse	(53)
		Merrill Lynch	161			JP Morgan	(45)
234	Societe Generale SA	JP Morgan	375	(113)	Fresenius SE & Co KGaA	Bank of America	
(58)	Sodexo SA	JP Morgan	(70)			Merrill Lynch	116
37	Teleperformance	Credit Suisse		13	GEA Group AG	Bank of America	
(11)	TOTAL SE	Bank of America				Merrill Lynch	9
		Merrill Lynch	21	120	GEA Group AG	Citibank	92
(274)	TOTAL SE	JP Morgan	390	94	GEA Group AG	Deutsche Bank	64
(436)	Veolia Environnement SA	JP Morgan	(30)	425	GEA Group AG	JP Morgan	(140)
46	Vinci SA	Citibank	(29)	54	HeidelbergCement AG	Citibank	69
426	Vivendi SE	Bank of America		130	HeidelbergCement AG	Deutsche Bank	(39)
		Merrill Lynch	290	153	Henkel AG & Co KGaA (Pref)		
40	Wendel SE	Bank of America				Citibank	(239)
		Merrill Lynch	28	(434)	Infineon Technologies AG	Credit Suisse	(807)
217	Wendel SE	Citibank	108	(1.309)	Infineon Technologies AG	Deutsche Bank	(2.703)
(55)	Worldline SA	Citibank	(70)	(126)	Infineon Technologies AG	JP Morgan	(234)
(55)	Worldline SA	Credit Suisse	(86)	(23)	KION Group AG	Citibank	(31)
(259)	Worldline SA	Deutsche Bank	(811)	(11)	KION Group AG	Credit Suisse	(34)
(136)	Worldline SA	JP Morgan	(212)	(163)	KION Group AG	JP Morgan	(505)
			(4.586)	(123)	Knorr-Bremse AG	Deutsche Bank	166

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Allemagne suite				Hong Kong suite			
69	LANXESS AG	Bank of America Merrill Lynch	(95)	2.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Credit Suisse	(127)
101	LEG Immobilien SE	Bank of America Merrill Lynch	374	500	Swire Pacific Ltd 'A'	Citibank	(29)
38	Merck KGaA	Credit Suisse	241	3.500	Swire Pacific Ltd 'A'	Credit Suisse	(1.885)
(22)	MTU Aero Engines AG	Citibank	(106)	2.500	Swire Pacific Ltd 'A'	JP Morgan	(1.346)
(16)	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Deutsche Bank	82	(6.000)	Swire Properties Ltd	Citibank	95
71	Nemetschek SE	JP Morgan	283	1.000	Techtronic Industries Co Ltd	Credit Suisse	(718)
(80)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(557)	(5.000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Citibank	(343)
(17)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Credit Suisse	(85)				(3.802)
(92)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Deutsche Bank	(640)	Irlande			
(81)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	JP Morgan	(403)	103	CRH Plc	Bank of America Merrill Lynch	107
(46)	Puma SE	Credit Suisse	(250)	217	CRH Plc	Citibank	204
(6)	Rational AG	Deutsche Bank	217	103	CRH Plc	Credit Suisse	72
38	SAP SE	Citibank	(43)	115	CRH Plc	JP Morgan	81
(12)	Sartorius AG (Pref)	Credit Suisse	220	(39)	Flutter Entertainment Plc	Credit Suisse	382
(29)	Sartorius AG (Pref)	Deutsche Bank	(3)	(25)	Kerry Group Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(33)
63	Scout24 AG	Citibank	(26)	(11)	Kerry Group Plc 'A'	Citibank	(11)
63	Scout24 AG	Credit Suisse	(166)	(99)	Kerry Group Plc 'A'	JP Morgan	(198)
62	Scout24 AG	Deutsche Bank	195	(56)	Kingspan Group Plc	Citibank	44
140	Siemens AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(1.207)	118	Smurfit Kappa Group Plc	JP Morgan	(85)
68	Siemens AG Reg	Credit Suisse	(604)				563
33	Siemens AG Reg	JP Morgan	(363)	Israël			
(158)	Siemens Energy AG	Deutsche Bank	(41)	630	Bank Hapoalim BM	JP Morgan	87
(139)	Siemens Healthineers AG	Bank of America Merrill Lynch	101	1.956	Israel Discount Bank Ltd 'A'	JP Morgan	267
(362)	Siemens Healthineers AG	Citibank	14				354
(288)	Siemens Healthineers AG	Deutsche Bank	210	Italie			
(175)	Siemens Healthineers AG	JP Morgan	177	(17)	Atlantia SpA	Deutsche Bank	(11)
39	Symrise AG	Credit Suisse	82	(700)	Atlantia SpA	JP Morgan	(18)
(129)	TeamViewer AG	Citibank	(99)	296	CNH Industrial NV	JP Morgan	33
(158)	TeamViewer AG	Deutsche Bank	(229)	2.317	Enel SpA	Deutsche Bank	(167)
(102)	TeamViewer AG	JP Morgan	129	2.323	Eni SpA	Citibank	(74)
(98)	Zalando SE	Credit Suisse	(345)	146	EXOR NV	Credit Suisse	175
			(3.922)	(52)	Ferrari NV	Deutsche Bank	(227)
				(48)	Ferrari NV	JP Morgan	(401)
				(2.159)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Bank of America Merrill Lynch	635
				(584)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Citibank	(40)
				(440)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Credit Suisse	143
				(506)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	JP Morgan	164
(11.212)	Bank of East Asia Ltd	Citibank	379	3.710	Intesa Sanpaolo SpA	Citibank	226
10.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Credit Suisse	(1.531)	9.107	Intesa Sanpaolo SpA	JP Morgan	314
500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	JP Morgan	(76)	1	Mediaset SpA	Citibank	—
(6.800)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Citibank	72	1	Mediaset SpA	Credit Suisse	—
3.000	CK Asset Holdings Ltd	Credit Suisse	285	(942)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Credit Suisse	(145)
3.500	CK Asset Holdings Ltd	JP Morgan	333	(458)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	JP Morgan	(71)
2.000	CK Hutchison Holdings Ltd	Citibank	—	(185)	Moncler SpA	Deutsche Bank	(1.217)
500	CK Hutchison Holdings Ltd	JP Morgan	(264)	(75)	Moncler SpA	JP Morgan	(283)
(1.600)	ESR Cayman Ltd	Citibank	17	(25)	Nexi SpA	Bank of America Merrill Lynch	(17)
(1.000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Citibank	(53)	(275)	Nexi SpA	Citibank	(65)
(300)	Hang Seng Bank Ltd	Citibank	(9)	(350)	Nexi SpA	Deutsche Bank	(240)
2.000	Henderson Land Development Co Ltd	Citibank	285	682	Poste Italiane SpA	Deutsche Bank	188
3.000	Henderson Land Development Co Ltd	JP Morgan	348	(94)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Bank of America Merrill Lynch	(61)
(13.000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Citibank	—	(468)	Tenaris SA	Bank of America Merrill Lynch	193
(1.000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	JP Morgan	99	(2.243)	Tenaris SA	Citibank	(15)
(9.000)	MTR Corp Ltd	Citibank	855	(669)	Tenaris SA	Deutsche Bank	276
1.000	New World Development Co Ltd	JP Morgan	(53)	(921)	Tenaris SA	JP Morgan	372
(1.600)	Sands China Ltd	Citibank	(194)	710	Terna SpA	Citibank	(30)
(5.000)	SJM Holdings Ltd	Citibank	58				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Italie suite				Japon suite			
810	Terna SpA	Credit Suisse	70	(400)	Fukuoka Financial Group Inc	Citibank	84
1.883	Terna SpA	Deutsche Bank	11	(200)	Fukuoka Financial Group Inc	Credit Suisse	(45)
			(282)	(100)	Fukuoka Financial Group Inc	JP Morgan	(22)
Japon				(86)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	(508)
(100)	ABC-Mart Inc	JP Morgan	(194)	400	Hakuhodo DY Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	87
(2.200)	Acom Co Ltd	Citibank	(49)	1.400	Hakuhodo DY Holdings Inc	JP Morgan	(262)
(4.500)	Acom Co Ltd	JP Morgan	(572)	(100)	Hamamatsu Photonics KK	Citibank	105
(100)	Advantest Corp	Credit Suisse	232	(300)	Hankyu Hanshin Holdings Inc	JP Morgan	235
(200)	Aeon Co Ltd	Credit Suisse	233	(100)	Harmonic Drive Systems Inc	Credit Suisse	1.136
500	AGC Inc	JP Morgan	(1.682)	(100)	Hikari Tsushin Inc	Credit Suisse	299
(100)	Aisin Corp	Citibank	(176)	1.700	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	661
400	Ajinomoto Co Inc	JP Morgan	394	100	Hirose Electric Co Ltd	Credit Suisse	67
1.600	Amada Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	753	300	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	JP Morgan	(1.256)
400	Amada Co Ltd	Citibank	123	(800)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Credit Suisse	120
(300)	ANA Holdings Inc	Citibank	(317)	100	Hitachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	263
(400)	Asahi Group Holdings Ltd	Citibank	(33)	200	Honda Motor Co Ltd	Citibank	(9)
(200)	Asahi Intecc Co Ltd	Citibank	244	200	Honda Motor Co Ltd	Credit Suisse	(117)
600	Asahi Kasei Corp	JP Morgan	(11)	1.100	Honda Motor Co Ltd	JP Morgan	(641)
1.200	Astellas Pharma Inc	Credit Suisse	677	100	Hoya Corp	Citibank	(235)
(100)	Bandai Namco Holdings Inc	JP Morgan	187	(100)	Ibiden Co Ltd	JP Morgan	(153)
(100)	Bank of Kyoto Ltd	Credit Suisse	456	500	Iida Group Holdings Co Ltd	Citibank	(34)
100	Bridgestone Corp	Bank of America Merrill Lynch	111	600	Isuzu Motors Ltd	Citibank	108
200	Bridgestone Corp	JP Morgan	266	100	Ito En Ltd	Citibank	(30)
1.000	Brother Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.001	100	Ito En Ltd	JP Morgan	(135)
800	Brother Industries Ltd	JP Morgan	711	(100)	ITOCHU Corp	Citibank	30
400	Calbee Inc	Bank of America Merrill Lynch	(254)	(400)	ITOCHU Corp	Credit Suisse	942
400	Calbee Inc	Citibank	(221)	(300)	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(518)
300	Calbee Inc	JP Morgan	(339)	(400)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Credit Suisse	(15)
(400)	Canon Inc	Credit Suisse	184	(400)	Japan Exchange Group Inc	Credit Suisse	351
(100)	Central Japan Railway Co	JP Morgan	4	(300)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	67
100	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	90	(1.900)	Japan Post Bank Co Ltd	Credit Suisse	1.576
(100)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Bank of America Merrill Lynch	50	(700)	Japan Post Bank Co Ltd	JP Morgan	581
300	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	168	100	Japan Post Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(200)	Daifuku Co Ltd	JP Morgan	3.049	200	JSR Corp	Citibank	(37)
(600)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Citibank	2	1.300	Kajima Corp	Credit Suisse	(661)
(200)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Credit Suisse	(264)	800	Kajima Corp	JP Morgan	(407)
(100)	Dai-ichi Life Holdings Inc	JP Morgan	(132)	(200)	Kao Corp	Credit Suisse	245
(200)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Citibank	68	200	KDDI Corp	Bank of America Merrill Lynch	39
(100)	Daikin Industries Ltd	Credit Suisse	1.128	700	KDDI Corp	Credit Suisse	1.119
(300)	Daiwa House Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	81	(200)	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(75)
(400)	Daiwa House Industry Co Ltd	Citibank	(90)	(400)	Keihan Holdings Co Ltd	Citibank	(583)
(2.700)	Daiwa Securities Group Inc	Credit Suisse	(95)	(300)	Keikyu Corp	Citibank	(128)
(300)	Denso Corp	Credit Suisse	(899)	(400)	Keio Corp	Credit Suisse	1.226
(200)	East Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(160)	(200)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Credit Suisse	(82)
(100)	East Japan Railway Co	Citibank	(88)	(100)	Keyence Corp	Credit Suisse	(284)
(100)	East Japan Railway Co	JP Morgan	25	200	Kikkoman Corp	Bank of America Merrill Lynch	463
2.800	ENEOS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(199)	(200)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	135
1.900	ENEOS Holdings Inc	Credit Suisse	(781)	(300)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Citibank	(280)
4.600	ENEOS Holdings Inc	JP Morgan	(1.891)				
(100)	FANUC Corp	Citibank	(605)				
300	Fuji Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	729				
200	Fuji Electric Co Ltd	JP Morgan	(30)				
100	FUJIFILM Holdings Corp	Citibank	203				
200	Fujitsu Ltd	Citibank	(351)				
(300)	Fukuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	54				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Japon suite				Japon suite			
(200)	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(103)	(100)	Murata Manufacturing Co Ltd	Credit Suisse	314
(400)	Kirin Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(387)	(100)	Murata Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	314
(100)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	—	(200)	Nagoya Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(100)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	82	200	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(60)
(500)	Kobe Bussan Co Ltd	Citibank	217	(200)	Nexon Co Ltd	Credit Suisse	1.324
(390)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.530)	200	NGK Insulators Ltd	Citibank	(27)
(100)	Koito Manufacturing Co Ltd	Citibank	(127)	1.700	NGK Insulators Ltd	JP Morgan	(1.614)
(300)	Komatsu Ltd	Citibank	81	400	NGK Spark Plug Co Ltd	JP Morgan	48
(200)	Konami Holdings Corp	JP Morgan	(419)	100	NH Foods Ltd	Citibank	(138)
(100)	Kose Corp	JP Morgan	(785)	(100)	Nidec Corp	Citibank	(153)
(100)	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	53	(300)	Nihon M&A Center Inc	JP Morgan	339
(200)	Kubota Corp	Citibank	106	100	Nippon Express Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	97
(300)	Kubota Corp	JP Morgan	517	100	Nippon Express Co Ltd	Credit Suisse	(37)
300	Kurita Water Industries Ltd	Credit Suisse	22	(1.500)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Credit Suisse	1.895
300	Kurita Water Industries Ltd	JP Morgan	22	(400)	Nippon Sanso Holdings Corp	JP Morgan	(78)
300	Kyocera Corp	Citibank	168	(100)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Citibank	(45)
(300)	Kyowa Kirin Co Ltd	Credit Suisse	146	(500)	Nippon Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	389
(200)	Kyushu Railway Co	Credit Suisse	49	(200)	Nippon Steel Corp	Citibank	90
(100)	Lasertec Corp	Credit Suisse	(1.353)	200	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Bank of America Merrill Lynch	120
(300)	Lion Corp	Credit Suisse	276	300	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Citibank	26
100	Lixil Corp	Citibank	(133)	400	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Credit Suisse	232
700	Lixil Corp	Credit Suisse	(303)	1.600	Nippon Telegraph & Telephone Corp	JP Morgan Credit Suisse	822 224
(100)	M3 Inc	Credit Suisse	41	300	Nippon Yusen KK	JP Morgan	(232)
800	Marubeni Corp	Bank of America Merrill Lynch	271	100	Nissan Chemical Corp	Citibank	(47)
(1.100)	Marui Group Co Ltd	Citibank	(822)	(1.000)	Nissan Motor Co Ltd	Credit Suisse	1.133
(100)	Marui Group Co Ltd	Credit Suisse	9	(3.500)	Nissan Motor Co Ltd	Citibank	(54)
(100)	Marui Group Co Ltd	JP Morgan	9	400	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37)
100	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Citibank	(19)	100	Nissin Foods Holdings Co Ltd	JP Morgan	22
200	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	JP Morgan	(67)	100	Nissin Foods Holdings Co Ltd	JP Morgan	(262)
300	MEIJI Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(291)	200	Nitto Denko Corp	Bank of America Merrill Lynch	(60)
(100)	Mercari Inc	Bank of America Merrill Lynch	(291)	500	Nitto Denko Corp	Citibank	271
(200)	MISUMI Group Inc	Citibank	7	200	Nitto Denko Corp	Credit Suisse	(807)
800	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Credit Suisse	38	100	Nitto Denko Corp	JP Morgan	(128)
(700)	Mitsubishi Corp	Credit Suisse	141	1.100	Nomura Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	159
1.300	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	515	300	Nomura Real Estate Holdings Inc	Credit Suisse	(25)
400	Mitsubishi Electric Corp	Credit Suisse	(12)	200	Nomura Research Institute Ltd	Credit Suisse	298
4.300	Mitsubishi Electric Corp	JP Morgan	(129)	1.400	NSK Ltd	JP Morgan	(335)
300	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JP Morgan	(139)	400	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25)
(2.000)	Mitsubishi HC Capital Inc	Citibank	613	700	Obayashi Corp	Citibank	(120)
(1.400)	Mitsubishi HC Capital Inc	Credit Suisse	324	(100)	Obic Co Ltd	Credit Suisse	(419)
(500)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Citibank	116	(600)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	417
(200)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	34	(200)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Credit Suisse	256
300	Mitsui & Co Ltd	Citibank	(47)	(2.400)	Oji Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	986
200	Mitsui Chemicals Inc	Citibank	194	(1.100)	Oji Holdings Corp	Citibank	296
300	Mitsui Chemicals Inc	Credit Suisse	22	300	Olympus Corp	Citibank	242
200	Mitsui Chemicals Inc	JP Morgan	15				
(100)	Miura Co Ltd	JP Morgan	658				
1.670	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	162				
(400)	MonotaRO Co Ltd	Credit Suisse	24				
(200)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31)				
(100)	Murata Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(86)				
(200)	Murata Manufacturing Co Ltd	Citibank	(81)				

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Japon suite				Japon suite			
300	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(101)	200	Sony Group Corp	Citibank	411
400	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(1.206)	200	Sony Group Corp	Credit Suisse	7
(100)	Oracle Corp Japan	Bank of America		(100)	Square Enix Holdings Co Ltd	Citibank	67
(100)	Oriental Land Co Ltd	Merrill Lynch	209	600	Subaru Corp	JP Morgan	11
(100)	Oriental Land Co Ltd	Bank of America		(300)	SUMCO Corp	Bank of America	
700	Osaka Gas Co Ltd	Merrill Lynch	(770)	(300)	SUMCO Corp	Credit Suisse	242
		JP Morgan	(765)	(400)	SUMCO Corp	JP Morgan	323
300	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America	(558)	(600)	Sumitomo Corp	Credit Suisse	143
1.200	Osaka Gas Co Ltd	Citibank	(193)	(1.000)	Sumitomo Corp	JP Morgan	239
(200)	Otsuka Corp	JP Morgan	(807)	(400)	Sumitomo Electric Industries Ltd	JP Morgan	3
(200)	Otsuka Corp	Bank of America	(149)	(100)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Citibank	(210)
100	Otsuka Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	224	200	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Bank of America	
200	Otsuka Holdings Co Ltd	Credit Suisse	197	100	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Merrill Lynch	(10)
(700)	Pan Pacific International Holdings Corp	Credit Suisse	1.072	200	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Citibank	(59)
1.600	Panasonic Corp	Bank of America		200	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	JP Morgan	(28)
500	Panasonic Corp	Merrill Lynch	454	200	Sundrug Co Ltd	Bank of America	
1.000	Panasonic Corp	Citibank	241	300	Suntory Beverage & Food Ltd	Merrill Lynch	(151)
(400)	PeptiDream Inc	JP Morgan	(325)	400	Suntory Beverage & Food Ltd	Citibank	202
(300)	Persol Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(777)	400	Suntory Beverage & Food Ltd	Credit Suisse	777
(600)	Pigeon Corp	JP Morgan	(96)	400	Suntory Beverage & Food Ltd	JP Morgan	777
(1.300)	Rakuten Group Inc	Credit Suisse	2.758	(100)	Suzuki Motor Corp	Credit Suisse	(333)
(1.600)	Resona Holdings Inc	Citibank	233	100	Sysmex Corp	JP Morgan	—
(700)	Resona Holdings Inc	Citibank	171	400	T&D Holdings Inc	Bank of America	
(1.000)	Resona Holdings Inc	Credit Suisse	5	1.000	Taiheiyo Cement Corp	Merrill Lynch	251
(300)	Ryohin Keikaku Co Ltd	JP Morgan	7	300	Taisei Corp	Bank of America	
(500)	SBI Holdings Inc	JP Morgan	576	100	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(523)
(200)	SCKS Corp	Citibank	(224)	100	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Citibank	(303)
100	Secom Co Ltd	JP Morgan	(30)	200	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(822)
500	Sega Sammy Holdings Inc	JP Morgan	(558)	100	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	JP Morgan	(411)
900	Sega Sammy Holdings Inc	Credit Suisse	(788)	(800)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America	
(500)	Seibu Holdings Inc	JP Morgan	(1.419)	(700)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Merrill Lynch	293
(500)	Seibu Holdings Inc	Bank of America		(600)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	225
1.000	Seiko Epson Corp	Merrill Lynch	(377)	(900)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	49
1.700	Sekisui Chemical Co Ltd	Credit Suisse	(370)	100	TDK Corp	JP Morgan	74
200	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	329	3.100	Teijin Ltd	Bank of America	
500	Sekisui Chemical Co Ltd	Citibank	(711)	100	Terumo Corp	Merrill Lynch	(857)
1.600	Sekisui House Ltd	Credit Suisse	(208)	(300)	THK Co Ltd	Bank of America	
(100)	Sharp Corp	JP Morgan	(519)	(100)	THK Co Ltd	Citibank	(370)
(500)	Sharp Corp	Credit Suisse	(311)	(400)	TIS Inc	Credit Suisse	235
200	Shimadzu Corp	JP Morgan	(658)	(300)	TIS Inc	Bank of America	
100	Shimamura Co Ltd	Bank of America		(300)	Tobu Railway Co Ltd	Merrill Lynch	224
(100)	Shimano Inc	Merrill Lynch	(426)	(500)	Toho Co Ltd	Citibank	(841)
900	Shimizu Corp	JP Morgan	303	(100)	Tokio Marine Holdings Inc	Bank of America	
(100)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Credit Suisse	(256)	(200)	Tokio Marine Holdings Inc	Merrill Lynch	199
(100)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	JP Morgan		(200)	Tokyo Century Corp	JP Morgan	438
100	Shionogi & Co Ltd	Merrill Lynch	(561)	700	Tokyo Gas Co Ltd	Citibank	254
(200)	Shiseido Co Ltd	Credit Suisse	(209)	900	Tokyo Gas Co Ltd	Citibank	(306)
(100)	Shiseido Co Ltd	JP Morgan	(179)	(400)	Tokyu Corp	JP Morgan	(1.130)
(100)	Shiseido Co Ltd	Bank of America					
(200)	Shiseido Co Ltd	Merrill Lynch	(347)				
(100)	Shiseido Co Ltd	Citibank	(227)				
(200)	Shiseido Co Ltd	Credit Suisse	(13)				
(100)	Shiseido Co Ltd	JP Morgan	(7)				
700	Shizuoka Bank Ltd	Citibank	(225)				
(100)	SMC Corp	Citibank	(2.347)				
(400)	SoftBank Corp	Credit Suisse	127				
(136)	SoftBank Group Corp	Citibank	60				
300	Sohgo Security Services Co Ltd	Citibank	—				
(300)	Sompo Holdings Inc	Bank of America					
100	Sony Group Corp	Merrill Lynch	(119)				
		Bank of America					
		Merrill Lynch	340				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Japon suite				Pays-Bas suite			
(500)	Tokyu Corp	Citibank	(149)	(168)	JDE Peet's NV	JP Morgan	(44)
(1.200)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(108)	(48)	Just Eat Takeaway.com NV	Bank of America Merrill Lynch	(131)
(1.300)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Citibank	(223)	(148)	Just Eat Takeaway.com NV	Citibank	(360)
(1.200)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Credit Suisse	(63)	(16)	Just Eat Takeaway.com NV	Credit Suisse	92
400	Toppa Printing Co Ltd	Citibank	48	(283)	Just Eat Takeaway.com NV	Deutsche Bank	(764)
300	Toppa Printing Co Ltd	JP Morgan	(78)	(62)	Just Eat Takeaway.com NV	JP Morgan	301
1.100	Toray Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	215	309	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America Merrill Lynch	(82)
1.300	Toray Industries Inc	Citibank	44	211	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Citibank	(64)
900	Toray Industries Inc	Credit Suisse	17	995	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Credit Suisse	453
800	Toray Industries Inc	JP Morgan	15	373	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Deutsche Bank	(99)
(100)	Toshiba Corp	Citibank	18	3.245	Koninklijke KPN NV	Deutsche Bank	(276)
800	Tosoh Corp	Citibank	(454)	104	Koninklijke Philips NV	Citibank	(75)
300	TOTO Ltd	Bank of America Merrill Lynch	561	771	Koninklijke Philips NV	Deutsche Bank	(358)
500	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Citibank	(224)	233	Koninklijke Philips NV	JP Morgan	(114)
100	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Credit Suisse	(123)	119	NN Group NV	Credit Suisse	(209)
100	Toyoda Gosei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	83	198	NN Group NV	Deutsche Bank	(384)
800	Toyoda Gosei Co Ltd	Credit Suisse	448	709	NN Group NV	JP Morgan	(1.248)
500	Toyoda Gosei Co Ltd	JP Morgan	280	(419)	Prosus NV	Bank of America Merrill Lynch	(373)
100	Toyota Industries Corp	Credit Suisse	239	(51)	Prosus NV	Credit Suisse	(17)
(100)	Toyota Motor Corp	Citibank	(209)	(112)	Prosus NV	JP Morgan	155
(100)	Toyota Motor Corp	Credit Suisse	(455)	423	Randstad NV	Bank of America Merrill Lynch	1.015
100	Toyota Tsusho Corp	Credit Suisse	(153)	128	Randstad NV	Citibank	277
(300)	Unicharm Corp	Credit Suisse	(155)	114	Randstad NV	Credit Suisse	148
(300)	USS Co Ltd	Credit Suisse	195	491	Randstad NV	Deutsche Bank	1.178
(900)	USS Co Ltd	JP Morgan	585	211	Randstad NV	JP Morgan	274
(200)	Welcia Holdings Co Ltd	Citibank	30	17	Wolters Kluwer NV	Bank of America Merrill Lynch	11
(200)	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(208)	64	Wolters Kluwer NV	Credit Suisse	26
(100)	West Japan Railway Co	JP Morgan	(7)	85	Wolters Kluwer NV	Deutsche Bank	56
1.100	Yamada Holdings Co Ltd	JP Morgan	(27)	81	Wolters Kluwer NV	JP Morgan	32
300	Yamaha Corp	JP Morgan	628				
300	Yamaha Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	500				1.571
400	Yamaha Motor Co Ltd	Citibank	239	Nouvelle-Zélande			
200	Yamato Holdings Co Ltd	JP Morgan	(142)	(1.158)	a2 Milk Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(69)
(400)	Yamazaki Baking Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	197	(4.277)	Auckland International Airport Ltd	JP Morgan	586
(100)	Yaskawa Electric Corp	JP Morgan	(105)	174	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(382)
800	Yokogawa Electric Corp	Credit Suisse	(1.991)	770	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Citibank	(1.931)
(1.400)	Z Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(457)	(2.701)	Ryman Healthcare Ltd	JP Morgan	1.834
(1.300)	Z Holdings Corp	Credit Suisse	(383)	1.463	Spark New Zealand Ltd	Deutsche Bank	52
			(4.083)				90
Pays-Bas				Norvège			
(1.015)	ABN AMRO Bank NV - CVA	Bank of America Merrill Lynch	(341)	(91)	Adevinta ASA	Bank of America Merrill Lynch	(152)
2	Adyen NV	Credit Suisse	121	(330)	Adevinta ASA	Deutsche Bank	(552)
7	Adyen NV	Deutsche Bank	1.017	(110)	Adevinta ASA	JP Morgan	(217)
(1.470)	Aegon NV	Bank of America Merrill Lynch	212	270	Equinor ASA	Deutsche Bank	(7)
(1.463)	Aegon NV	Credit Suisse	159	(211)	Gjensidige Forsikring ASA	Credit Suisse	50
(94)	Aegon NV	Deutsche Bank	14	(478)	Mowi ASA	Bank of America Merrill Lynch	(357)
129	Akzo Nobel NV	Deutsche Bank	368	(599)	Mowi ASA	Citibank	(147)
(161)	ArcelorMittal SA	Credit Suisse	114	(204)	Mowi ASA	Credit Suisse	62
(982)	ArcelorMittal SA	Deutsche Bank	(2)	(97)	Mowi ASA	Deutsche Bank	(72)
(234)	ArcelorMittal SA	JP Morgan	166	1.579	Norsk Hydro ASA	Credit Suisse	(267)
(62)	Galapagos NV	Deutsche Bank	137	1.069	Norsk Hydro ASA	JP Morgan	(181)
(144)	Heineken NV	Bank of America Merrill Lynch	104	139	Orkla ASA	Citibank	22
(48)	Heineken NV	Citibank	38	1.631	Orkla ASA	JP Morgan	368
(31)	Heineken NV	Credit Suisse	47				
(46)	Heineken NV	Deutsche Bank	33				
(137)	JDE Peet's NV	Credit Suisse	(36)				

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Norvège suite				Espagne suite			
(119)	Schibsted ASA 'A'	Deutsche Bank	(252)	(176)	Grifols SA	Credit Suisse	146
(128)	Schibsted ASA 'B'	Deutsche Bank	(151)	(174)	Grifols SA	Deutsche Bank	80
			(1.853)	2.140	Iberdrola SA	JP Morgan	(899)
Portugal				20	Industria de Diseno Textil SA	Citibank	(10)
445	Galp Energia SGPS SA	Deutsche Bank	(87)	300	Industria de Diseno Textil SA	JP Morgan	93
(274)	Jeronimo Martins SGPS SA	Deutsche Bank	17	(408)	Naturgy Energy Group SA	JP Morgan	5
			(70)	705	Repsol SA	Citibank	(32)
Singapour				516	Repsol SA	Credit Suisse	41
(4.500)	CapitalLand Ltd	Citibank	(139)	611	Repsol SA	Deutsche Bank	(117)
(2.200)	CapitalLand Ltd	Deutsche Bank	(123)	(423)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Bank of America Merrill Lynch	(445)
(3.700)	Keppel Corp Ltd	Credit Suisse	(46)				(5.677)
(3.100)	Singapore Airlines Ltd	JP Morgan	(211)	Suède			
(6.479)	Singapore Airlines Ltd ^{tr}	JP Morgan	—	141	Alfa Laval AB	Bank of America Merrill Lynch	194
1.800	Singapore Technologies Engineering Ltd	Credit Suisse	134	168	Boliden AB	Citibank	5
2.100	Singapore Technologies Engineering Ltd	Deutsche Bank	156	168	Boliden AB	Citibank	—
5.700	Singapore Telecommunications Ltd	Credit Suisse	(106)	134	Boliden AB	Credit Suisse	(364)
2.900	Singapore Telecommunications Ltd	Deutsche Bank	72	134	Boliden AB	Credit Suisse	79
300	United Overseas Bank Ltd	Citibank	71	383	Boliden AB	Deutsche Bank	(617)
400	United Overseas Bank Ltd	Credit Suisse	(117)	383	Boliden AB	Deutsche Bank	1
500	United Overseas Bank Ltd	JP Morgan	(146)	479	Electrolux AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(222)
(3.400)	UOL Group Ltd	JP Morgan	316	352	Electrolux AB 'B'	Citibank	125
(1.300)	Venture Corp Ltd	JP Morgan	(81)	204	Electrolux AB 'B'	Credit Suisse	(34)
			(220)	188	Electrolux AB 'B'	Deutsche Bank	(87)
Corée du Sud				202	Electrolux AB 'B'	JP Morgan	(34)
(1)	AMOREPACIFIC Group (Pref)	Credit Suisse	(3)	(145)	EQT AB	Deutsche Bank	(516)
1	HDC Holdings Co Ltd	JP Morgan	—	(674)	Essity AB 'B'	Credit Suisse	127
(2)	Medytox Inc	Credit Suisse	21	(152)	Essity AB 'B'	Deutsche Bank	77
			18	(163)	Essity AB 'B'	JP Morgan	183
Espagne				(30)	Evolution AB	Deutsche Bank	(467)
(36)	Aena SME SA	Bank of America Merrill Lynch	(25)	(96)	Fastighets AB Balder	Bank of America Merrill Lynch	(216)
(106)	Aena SME SA	Citibank	(58)	(301)	H & M Hennes & Mauritz AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(62)	Aena SME SA	Deutsche Bank	(43)	(273)	H & M Hennes & Mauritz AB 'B'	Deutsche Bank	(28)
(31)	Aena SME SA	JP Morgan	8	(525)	Hexagon AB 'B'	Citibank	(221)
(71)	Amadeus IT Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(134)	(420)	Hexagon AB 'B'	Credit Suisse	(178)
(79)	Amadeus IT Group SA	Deutsche Bank	(149)	(639)	Hexagon AB 'B'	Deutsche Bank	(301)
(120)	Amadeus IT Group SA	JP Morgan	(331)	2.129	Husqvarna AB 'B'	Deutsche Bank	358
1.487	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Bank of America Merrill Lynch	213	(121)	ICA Gruppen AB	Bank of America Merrill Lynch	—
(392)	Cellnex Telecom SA	Bank of America Merrill Lynch	(1.384)	(128)	ICA Gruppen AB	Citibank	27
(301)	Cellnex Telecom SA	Citibank	(96)	(211)	ICA Gruppen AB	Credit Suisse	(154)
(511)	Cellnex Telecom SA	Deutsche Bank	(1.804)	(40)	ICA Gruppen AB	JP Morgan	(29)
(247)	Cellnex Telecom SA	JP Morgan	(610)	(172)	Investment AB Latour 'B'	Citibank	(112)
411	Endesa SA	Citibank	(317)	(182)	Investment AB Latour 'B'	Credit Suisse	(378)
1.036	Endesa SA	Deutsche Bank	(715)	(1.084)	Investment AB Latour 'B'	JP Morgan	(2.250)
276	Endesa SA	JP Morgan	17	1.212	Investor AB 'B'	Credit Suisse	958
(284)	Ferrovial SA	Bank of America Merrill Lynch	125	232	Investor AB 'B'	Deutsche Bank	177
(284)	Ferrovial SA	Bank of America Merrill Lynch	1	459	Investor AB 'B'	JP Morgan	249
(724)	Ferrovial SA	Citibank	188	136	Kinnevik AB	Citibank	(54)
(724)	Ferrovial SA	Citibank	3	136	Kinnevik AB 'B'	Citibank	543
(63)	Ferrovial SA	Credit Suisse	33	(140)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(533)
(63)	Ferrovial SA	Credit Suisse	(13)	(80)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Citibank	(247)
(6)	Ferrovial SA	Deutsche Bank	3	(30)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Deutsche Bank	(114)
(6)	Ferrovial SA	Deutsche Bank	—	(182)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	JP Morgan	(583)
(107)	Ferrovial SA	JP Morgan	56	50	Lundin Energy AB	Bank of America Merrill Lynch	11
(107)	Ferrovial SA	JP Morgan	(21)	153	Lundin Energy AB	Citibank	107
(391)	Grifols SA	Bank of America Merrill Lynch	422	485	Lundin Energy AB	Credit Suisse	321
(262)	Grifols SA	Citibank	92				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Suède suite				Suisse suite			
184	Lundin Energy AB	JP Morgan	122	304	Holcim Ltd	Citibank	55
109	Nordea Bank Abp	Deutsche Bank	27	124	Holcim Ltd	JP Morgan	(174)
2.109 (174)	Nordea Bank Abp Sandvik AB	JP Morgan Bank of America Merrill Lynch	656	142	Julius Baer Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	346
(205)	Sandvik AB	Credit Suisse	143	32	Kuehne + Nagel International AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	507
(462)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	JP Morgan	176	68	Kuehne + Nagel International AG Reg	Citibank	433
261	Skanska AB 'B'	Citibank	(103)	1	Kuehne + Nagel International AG Reg	Credit Suisse	21
241	Skanska AB 'B'	Credit Suisse	(131)	46	Logitech International SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	705
430	Skanska AB 'B'	Deutsche Bank	(183)	152	Logitech International SA Reg	Citibank	1.169
(186)	SKF AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	16	48	Logitech International SA Reg	Credit Suisse	601
(10)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	9	(10)	Lonza Group AG Reg	Citibank	(49)
(858)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Citibank	428	(39)	Lonza Group AG Reg	JP Morgan	(596)
(1.754)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Deutsche Bank	1.551	130	Nestle SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	161
(452)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	JP Morgan	253	62	Novartis AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(61)
623	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Bank of America Merrill Lynch	2	401	Novartis AG Reg	JP Morgan	(135)
516	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Citibank	(83)	68	Roche Holding AG	Citibank	68
485	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Deutsche Bank	(46)	23	Roche Holding AG	JP Morgan	244
1.451	Telia Co AB	Bank of America Merrill Lynch	(47)	(4)	Schindler Holding AG	Citibank	(14)
1.192	Telia Co AB	Citibank	(130)	(65)	Schindler Holding AG	JP Morgan	(396)
3.921	Telia Co AB	Deutsche Bank	(210)	5	SGS SA Reg	JP Morgan	287
			(1.490)	(94)	Sika AG Reg	Credit Suisse	(984)
				27	Sonova Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1.526
				43	Sonova Holding AG Reg	Credit Suisse	2.234
				3	Straumann Holding AG Reg	Citibank	94
				5	Straumann Holding AG Reg	JP Morgan	230
				29	Swiss Life Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	164
				51	Swisscom AG Reg	JP Morgan	576
				(34)	Temenos AG Reg	Citibank	(71)
				(34)	Temenos AG Reg	Credit Suisse	(274)
				1.126	UBS Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	681
				318	UBS Group AG Reg	Citibank	69
				676	UBS Group AG Reg	JP Morgan	345
				(37)	Vifor Pharma AG	Bank of America Merrill Lynch	(177)
				(128)	Vifor Pharma AG	Citibank	(565)
				(118)	Vifor Pharma AG	Credit Suisse	(912)
				(185)	Vifor Pharma AG	JP Morgan	(962)
				40	Zurich Insurance Group AG	Citibank	87
							4.470
				Taiwan			
				(2)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	—
				Royaume-Uni			
				304	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	74
				359	3i Group Plc	Citibank	(42)
				1.017	3i Group Plc	Credit Suisse	112
				790	3i Group Plc	JP Morgan	87
				(242)	Admiral Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	25
				(156)	Admiral Group Plc	Citibank	(56)
				(234)	Admiral Group Plc	Credit Suisse	106
				(114)	Admiral Group Plc	Deutsche Bank	12
				(386)	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	114
				(206)	Antofagasta Plc	Credit Suisse	811
				(239)	Antofagasta Plc	Deutsche Bank	437

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(256)	Antofagasta Plc	JP Morgan	1.008	(48)	London Stock Exchange		
97	Ashtead Group Plc	Deutsche Bank	194		Group Plc	JP Morgan	(278)
(65)	Associated British Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	(33)	1.778	M&G Plc	Deutsche Bank	165
(71)	AstraZeneca Plc	Deutsche Bank	(124)	(2.218)	Melrose Industries Plc	Credit Suisse	(160)
(98)	AstraZeneca Plc	JP Morgan	(374)	261	Mondi Plc	Deutsche Bank	(89)
1.241	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	202	260	Mondi Plc	JP Morgan	(162)
(220)	AVEVA Group Plc	Credit Suisse	(634)	(616)	National Grid Plc	JP Morgan	40
(350)	AVEVA Group Plc	Deutsche Bank	(1.260)	64	Next Plc	Credit Suisse	(120)
(198)	AVEVA Group Plc	JP Morgan	(104)	(165)	Ocado Group Plc	Bank of America	
1.633	Aviva Plc	Bank of America Merrill Lynch	85	(876)	Ocado Group Plc	Merrill Lynch	148
		Citibank	225	(172)	Ocado Group Plc	Deutsche Bank	783
3.516	Aviva Plc	Credit Suisse	(22)	(172)	Ocado Group Plc	JP Morgan	165
928	Aviva Plc	JP Morgan	(9)	(406)	Pearson Plc	Deutsche Bank	163
368	Aviva Plc	JP Morgan	(9)	138	Persimmon Plc	Bank of America	
(4.154)	Barclays Plc	Citibank	(165)	395	Persimmon Plc	Merrill Lynch	83
694	Barratt Developments Plc	Citibank	35	960	Phoenix Group Holdings Plc	Deutsche Bank	238
926	Barratt Developments Plc	Deutsche Bank	(32)	(259)	Prudential Plc	Citibank	67
535	Barratt Developments Plc	JP Morgan	(154)	(3)	Reckitt Benckiser Group Plc	Citibank	4
2.155	BP Plc	Citibank	(256)	(54)	Reckitt Benckiser Group Plc	Credit Suisse	(11)
318	Bunzl Plc	Citibank	(11)	(184)	Reckitt Benckiser Group Plc	Deutsche Bank	(13)
56	Bunzl Plc	Credit Suisse	(20)	(236)	Reed Elsevier Plc	Deutsche Bank	29
181	Burberry Group Plc	Credit Suisse	70	151	Rio Tinto Plc	JP Morgan	(1.041)
372	Coca-Cola HBC AG	Citibank	138	(6.915)	Rolls-Royce Holdings Plc	Bank of America	
139	Coca-Cola HBC AG	Credit Suisse	2	(3.287)	Rolls-Royce Holdings Plc	Merrill Lynch	(145)
(462)	Compass Group Plc	Deutsche Bank	(499)	738	Sage Group Plc	Deutsche Bank	(154)
(109)	Croda International Plc	Deutsche Bank	(409)	105	Sage Group Plc	Credit Suisse	(122)
(1.211)	Direct Line Insurance Group Plc	Deutsche Bank	(62)	105	Schroders Plc	JP Morgan	(50)
963	Evraz Plc	Credit Suisse	(678)	142	Severn Trent Plc	Deutsche Bank	(78)
38	Ferguson Plc	Bank of America Merrill Lynch	171	(251)	Smith & Nephew Plc	Bank of America	
		Citibank	(115)	(59)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Merrill Lynch	(70)
71	Ferguson Plc	Deutsche Bank	904	(9)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Deutsche Bank	(397)
250	Ferguson Plc	Deutsche Bank	87	(27)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Deutsche Bank	(61)
(413)	Fresnillo Plc	Deutsche Bank	87	512	SSE Plc	JP Morgan	(282)
(307)	GlaxoSmithKline Plc	JP Morgan	27	(278)	St James's Place Plc	JP Morgan	(282)
(2.744)	Glencore Plc	Citibank	(390)			Deutsche Bank	131
(1.586)	Glencore Plc	JP Morgan	(5)	(736)	Standard Chartered Plc	Bank of America	
(161)	Halma Plc	Bank of America Merrill Lynch	(232)	(123)	Unilever Plc	Merrill Lynch	(126)
(258)	Halma Plc	Deutsche Bank	(371)	(107)	Unilever Plc	Deutsche Bank	(82)
(361)	Halma Plc	JP Morgan	(180)	(489)	Unilever Plc	Citibank	63
(499)	Hargreaves Lansdown Plc	Deutsche Bank	196	(298)	Unilever Plc	Credit Suisse	65
(579)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Credit Suisse	(632)	438	United Utilities Group Plc	Deutsche Bank	477
(2.876)	HSBC Holdings Plc	Deutsche Bank	(397)	4.395	Vodafone Group Plc	JP Morgan	180
(625)	Informa Plc	Credit Suisse	177			JP Morgan	(22)
(118)	InterContinental Hotels Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(62)	2.740	Vodafone Group Plc	Bank of America	
(142)	InterContinental Hotels Group Plc	Credit Suisse	97	7.559	Vodafone Group Plc	Merrill Lynch	(684)
(77)	InterContinental Hotels Group Plc	Deutsche Bank	(40)	(119)	Whitbread Plc	Deutsche Bank	(426)
88	Intertek Group Plc	Citibank	(478)	(9.554)	Wm Morrison Supermarkets Plc	JP Morgan	(1.239)
219	Intertek Group Plc	Deutsche Bank	(954)	(4.836)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Credit Suisse	8
3	JD Sports Fashion Plc	Bank of America Merrill Lynch	2	(3.073)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Citibank	277
202	JD Sports Fashion Plc	JP Morgan	68	(4.073)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Credit Suisse	254
1.392	Kingfisher Plc	Citibank	(10)	1.193	WPP Plc	Deutsche Bank	246
1.328	Kingfisher Plc	Deutsche Bank	(128)	(4.073)	Wm Morrison Supermarkets Plc	JP Morgan	293
1.410	Kingfisher Plc	JP Morgan	(164)	1.132	WPP Plc	Bank of America	
1.283	Legal & General Group Plc	Credit Suisse	93	2.360	WPP Plc	Merrill Lynch	33
1.335	Legal & General Group Plc	Deutsche Bank	64			Credit Suisse	(229)
1.268	Legal & General Group Plc	JP Morgan	87			Deutsche Bank	66
(117)	London Stock Exchange Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(538)				(6.745)
(46)	London Stock Exchange Group Plc	Credit Suisse	(266)	États-Unis			
(109)	London Stock Exchange Group Plc	Deutsche Bank	(501)	(28)	10X Genomics Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(830)
				(28)	3M Co	Bank of America Merrill Lynch	47

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
89	A O Smith Corp	JP Morgan	(86)	20	Ameriprise Financial Inc	Citibank	73
(51)	Abbott Laboratories	Bank of America Merrill Lynch	4	20	Ameriprise Financial Inc	Credit Suisse	(70)
(44)	Abbott Laboratories	Credit Suisse	83	49	Ameriprise Financial Inc	JP Morgan	3
(89)	Abbott Laboratories	JP Morgan	167	109	AmerisourceBergen Corp	Citibank	(338)
(55)	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	166	43	AmerisourceBergen Corp	Credit Suisse	(300)
(88)	AbbVie Inc	JP Morgan	176	48	AmerisourceBergen Corp	JP Morgan	(335)
16	ABIOMED Inc	Bank of America Merrill Lynch	218	(77)	AMETEK Inc	JP Morgan	126
27	ABIOMED Inc	Citibank	111	79	Amgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(935)
64	Accenture Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(254)	(76)	Amphenol Corp 'A'	Credit Suisse	(265)
72	Accenture Plc 'A'	Citibank	(159)	(170)	Amphenol Corp 'A'	Citibank	(26)
95	Accenture Plc 'A'	Credit Suisse	(658)	(80)	Amphenol Corp 'A'	JP Morgan	(13)
18	Accenture Plc 'A'	JP Morgan	(125)	(173)	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.339)
49	Adobe Inc	Bank of America Merrill Lynch	877	(73)	Analog Devices Inc	Citibank	(125)
23	Adobe Inc	Citibank	127	(82)	Analog Devices Inc	Credit Suisse	(928)
41	Adobe Inc	Credit Suisse	847	(69)	Analog Devices Inc	JP Morgan	(781)
55	Adobe Inc	JP Morgan	1.136	(31)	ANSYS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(424)
488	Aflac Inc	Citibank	124	(36)	ANSYS Inc	Citibank	24
180	Aflac Inc	JP Morgan	22	(16)	ANSYS Inc	Credit Suisse	(194)
80	Agilent Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	416	(15)	Anthem Inc	Credit Suisse	45
77	Agilent Technologies Inc	Credit Suisse	219	(73)	Aon Plc 'A'	Citibank	(11)
209	Agilent Technologies Inc	JP Morgan	1.011	(17)	Aon Plc 'A'	JP Morgan	71
(8)	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	13	(114)	Apollo Global Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	4
(107)	Air Products and Chemicals Inc	Citibank	(8)	(179)	Apollo Global Management Inc	Citibank	15
(18)	Air Products and Chemicals Inc	Credit Suisse	(90)	(106)	Apollo Global Management Inc	JP Morgan	25
(37)	Air Products and Chemicals Inc	JP Morgan	(186)	54	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	(73)
(106)	Akamai Technologies Inc	JP Morgan	(259)	183	Apple Inc	Citibank	(373)
(32)	Albemarle Corp	Bank of America Merrill Lynch	(244)	21	Apple Inc	Credit Suisse	(39)
9	Align Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	226	148	Apple Inc	JP Morgan	(272)
10	Align Technology Inc	Citibank	(117)	109	Applied Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.300
(8)	Alleghany Corp	JP Morgan	45	40	Applied Materials Inc	Citibank	116
41	Allegion Plc	Bank of America Merrill Lynch	52	49	Applied Materials Inc	Credit Suisse	540
35	Allegion Plc	Citibank	50	176	Applied Materials Inc	JP Morgan	1.938
46	Allstate Corp	Credit Suisse	80	(43)	Aptiv Plc	Bank of America Merrill Lynch	(401)
118	Allstate Corp	JP Morgan	205	(251)	Aptiv Plc	Citibank	(1.843)
240	Ally Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	151	(161)	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	169
218	Ally Financial Inc	Credit Suisse	186	125	Arch Capital Group Ltd	JP Morgan	35
(37)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(185)	419	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America Merrill Lynch	(381)
14	Alphabet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	779	340	Archer-Daniels-Midland Co	Citibank	(25)
2	Alphabet Inc 'A'	Citibank	(7)	297	Archer-Daniels-Midland Co	JP Morgan	(268)
2	Alphabet Inc 'A'	Credit Suisse	107	18	Arista Networks Inc	Credit Suisse	194
6	Alphabet Inc 'A'	JP Morgan	355	181	Arrow Electronics Inc	Citibank	(492)
2	Alphabet Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	148	89	Arrow Electronics Inc	JP Morgan	220
4	Amazon.com Inc	Citibank	(72)	(78)	Arthur J Gallagher & Co	JP Morgan	119
34	AMERCO	Citibank	(86)	20	Assurant Inc	Citibank	33
8	AMERCO	Credit Suisse	(373)	150	AT&T Inc	Bank of America Merrill Lynch	(238)
(43)	American Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(124)	361	AT&T Inc	Citibank	(95)
(40)	American Water Works Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137)	184	AT&T Inc	Credit Suisse	(482)
(64)	American Water Works Co Inc	Citibank	(43)	(117)	Atmos Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(61)
(34)	American Water Works Co Inc	Credit Suisse	27	(49)	Atmos Energy Corp	Credit Suisse	174
				(174)	Atmos Energy Corp	JP Morgan	195
				102	Autodesk Inc	Citibank	(135)
				63	Autodesk Inc	Credit Suisse	314
				18	Autodesk Inc	JP Morgan	73

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
27	Automatic Data Processing Inc	Citibank	(23)	(27)	Broadcom Inc	Bank of America	
26	Automatic Data Processing Inc	JP Morgan	35	(31)	Broadcom Inc	Merrill Lynch	(717)
4	AutoZone Inc	JP Morgan	(370)	(11)	Broadcom Inc	Citibank	(334)
(152)	Avalara Inc	Bank of America		(59)	Broadcom Inc	Credit Suisse	(327)
(74)	Avalara Inc	Merrill Lynch	(1.402)	(106)	Brown & Brown Inc	JP Morgan	(1.744)
(183)	Avantor Inc	Credit Suisse	(401)			Bank of America	
73	Avery Dennison Corp	JP Morgan	(250)	(123)	Brown-Forman Corp 'B'	Merrill Lynch	(25)
152	Avery Dennison Corp	Bank of America		63	Bunge Ltd	Citibank	(79)
28	Avery Dennison Corp	Merrill Lynch	(26)			Bank of America	
17	Axalta Coating Systems Ltd	Citibank	264	69	Bunge Ltd	Merrill Lynch	(140)
631	Axalta Coating Systems Ltd	Credit Suisse	(24)	72	Bunge Ltd	Citibank	1
(392)	Baker Hughes Co	Citibank	12	86	Bunge Ltd	Credit Suisse	(219)
(607)	Baker Hughes Co	JP Morgan	(641)	(20)	Burlington Stores Inc	JP Morgan	(262)
(55)	Ball Corp	JP Morgan		(20)	Burlington Stores Inc	Bank of America	209
104	Bank of New York Mellon Corp	Bank of America	257	(7)	Cable One Inc	Credit Suisse	87
100	Bank of New York Mellon Corp	Merrill Lynch	7	(3)	Cable One Inc	Bank of America	
(179)	Baxter International Inc	Citibank	45	(3)	Cable One Inc	Merrill Lynch	(580)
(64)	Baxter International Inc	Bank of America	229	(3)	Cable One Inc	Citibank	(21)
(145)	Baxter International Inc	Merrill Lynch	309	(3)	Cable One Inc	JP Morgan	(180)
(44)	Becton Dickinson and Co	Bank of America	66	77	Cadence Design Systems Inc	Bank of America	325
(69)	Becton Dickinson and Co	JP Morgan	137	89	Cadence Design Systems Inc	Citibank	48
31	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Merrill Lynch	6	37	Cadence Design Systems Inc	Credit Suisse	86
77	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Citibank	(18)	376	Cadence Design Systems Inc	JP Morgan	878
21	Berkshire Hathaway Inc 'B'	JP Morgan	(50)	(103)	Campbell Soup Co	Credit Suisse	125
60	Best Buy Co Inc	Bank of America		76	Capital One Financial Corp	JP Morgan	212
117	Best Buy Co Inc	Merrill Lynch	(190)	308	Cardinal Health Inc	Bank of America	
96	Best Buy Co Inc	Citibank	(916)			Merrill Lynch	(96)
37	Biogen Inc	JP Morgan	(751)	119	Cardinal Health Inc	Citibank	(55)
19	Biogen Inc	Bank of America		66	Cardinal Health Inc	Credit Suisse	(122)
(100)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Merrill Lynch	(127)	250	Cardinal Health Inc	JP Morgan	(463)
(16)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Citibank	3	(32)	CarMax Inc	Bank of America	
(129)	BioMarin Pharmaceutical Inc	JP Morgan	3			Merrill Lynch	243
(80)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America	(96)	(70)	CarMax Inc	Citibank	(75)
(29)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Merrill Lynch	(60)	(29)	CarMax Inc	JP Morgan	302
(189)	Black Knight Inc	JP Morgan	(300)	(444)	Carnival Corp	Citibank	(604)
(206)	Black Knight Inc	Bank of America	(291)	(262)	Carnival Corp	Credit Suisse	(706)
(246)	Black Knight Inc	Merrill Lynch	(37)	(208)	Carnival Corp	JP Morgan	(561)
(18)	Black Knight Inc	Citibank	329	(18)	Carvana Co	Bank of America	
(67)	Blackstone Group Inc	Credit Suisse	24			Merrill Lynch	(568)
(106)	Blackstone Group Inc	JP Morgan	(80)	(19)	Carvana Co	Credit Suisse	(357)
(4)	Booking Holdings Inc	Citibank	(353)	(45)	Carvana Co	JP Morgan	(845)
60	Booz Allen Hamilton Holding Corp	JP Morgan	(43)	(28)	Catalent Inc	Bank of America	
71	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America	(40)			Merrill Lynch	(64)
(495)	BorgWarner Inc	Merrill Lynch	91	(182)	Catalent Inc	Citibank	(339)
(367)	Boston Scientific Corp	JP Morgan	146	(44)	Catalent Inc	Credit Suisse	(1)
(15)	Boston Scientific Corp	Bank of America	(250)	(139)	Catalent Inc	JP Morgan	(3)
(85)	Boston Scientific Corp	Merrill Lynch	3	(34)	Caterpillar Inc	Bank of America	
(82)	Bristol-Myers Squibb Co	Citibank	49			Merrill Lynch	(4)
(118)	Bristol-Myers Squibb Co	JP Morgan	(17)	64	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(99)			Merrill Lynch	58
		Credit Suisse		144	CBRE Group Inc 'A'	Credit Suisse	140
				28	CDW Corp	JP Morgan	(138)
				(80)	Centene Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(199)
				(743)	CenterPoint Energy Inc	Citibank	(132)
				(462)	CenterPoint Energy Inc	JP Morgan	(222)
				(165)	Ceridian HCM Holding Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(219)
				(113)	Ceridian HCM Holding Inc	Citibank	(44)
				(55)	Ceridian HCM Holding Inc	Credit Suisse	(249)
				(209)	Ceridian HCM Holding Inc	JP Morgan	(947)
				349	Cerner Corp	Citibank	357
				142	Cerner Corp	Credit Suisse	105
				285	Cerner Corp	JP Morgan	190
				58	CH Robinson Worldwide Inc	Citibank	(33)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
(86)	Charles Schwab Corp	Credit Suisse	(194)	106	Corteva Inc	Credit Suisse	(129)
(16)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(101)	(8)	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(236)
(8)	Charter Communications Inc 'A'	Citibank	56	(12)	CoStar Group Inc	Citibank	(95)
(15)	Charter Communications Inc 'A'	JP Morgan	2	(20)	CoStar Group Inc	Credit Suisse	(234)
129	Check Point Software Technologies Ltd	Citibank	(217)	(8)	CoStar Group Inc	JP Morgan	(266)
43	Check Point Software Technologies Ltd	JP Morgan	(101)	13	Costco Wholesale Corp	Bank of America Merrill Lynch	(63)
(130)	Cheniere Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(85)	(20)	Coupa Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(204)
(66)	Cheniere Energy Inc	Citibank	(42)	(21)	Coupa Software Inc	Citibank	16
(34)	Cheniere Energy Inc	JP Morgan	(90)	(22)	Coupa Software Inc	Credit Suisse	(259)
(256)	Chevron Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.192	(89)	Coupa Software Inc	JP Morgan	(197)
(181)	Chevron Corp	Citibank	151	(29)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Credit Suisse	(821)
(96)	Chevron Corp	JP Morgan	455	(17)	Crown Holdings Inc	Citibank	104
(116)	Chewy Inc 'A'	Citibank	(182)	(101)	Crown Holdings Inc	JP Morgan	775
(62)	Chewy Inc 'A'	Credit Suisse	(294)	115	CSX Corp	Citibank	73
(50)	Chewy Inc 'A'	JP Morgan	(237)	8	CSX Corp	Credit Suisse	(20)
4	Chipotle Mexican Grill Inc	Credit Suisse	(65)	9	Cummins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67)
(182)	Church & Dwight Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	266	80	Cummins Inc	JP Morgan	(882)
(222)	Church & Dwight Co Inc	Citibank	267	66	CVS Health Corp	Citibank	(177)
(118)	Church & Dwight Co Inc	Credit Suisse	213	67	CVS Health Corp	Credit Suisse	32
(57)	Church & Dwight Co Inc	JP Morgan	75	134	CVS Health Corp	JP Morgan	65
26	Cigna Corp	Bank of America Merrill Lynch	(125)	(48)	CyberArk Software Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(402)
20	Cigna Corp	Citibank	(44)	(77)	CyberArk Software Ltd	Citibank	(16)
20	Cigna Corp	JP Morgan	(132)	(37)	CyberArk Software Ltd	JP Morgan	(206)
(51)	Cincinnati Financial Corp	Credit Suisse	(42)	(91)	Danaher Corp	Bank of America Merrill Lynch	(332)
37	Cintas Corp	Bank of America Merrill Lynch	45	(28)	Danaher Corp	Citibank	(93)
1	Cintas Corp	JP Morgan	(6)	(99)	Danaher Corp	Credit Suisse	234
(176)	Cisco Systems Inc - CDI	JP Morgan	38	(184)	Danaher Corp	JP Morgan	436
272	Citigroup Inc	Credit Suisse	798	89	Darden Restaurants Inc	Citibank	136
319	Citizens Financial Group Inc	Citibank	152	35	Darden Restaurants Inc	Credit Suisse	73
42	Citrix Systems Inc	JP Morgan	(149)	(154)	Datadog Inc 'A'	Citibank	(163)
(30)	Clorox Co	Bank of America Merrill Lynch	8	(35)	Datadog Inc 'A'	Credit Suisse	(407)
(69)	Clorox Co	Credit Suisse	637	(55)	Datadog Inc 'A'	JP Morgan	(640)
(74)	Cloudflare Inc 'A'	JP Morgan	(800)	44	DaVita Inc	Citibank	(64)
(45)	CME Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(86)	45	DaVita Inc	JP Morgan	(292)
(35)	CME Group Inc	Citibank	(42)	29	Deere & Co	Bank of America Merrill Lynch	(533)
(24)	CME Group Inc	JP Morgan	(32)	108	Dell Technologies Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	22
144	Coca-Cola Co	Credit Suisse	45	75	DENTSPLY SIRONA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(125)
59	Cognex Corp	Citibank	99	224	Devon Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(116)
261	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	198	268	Devon Energy Corp	Citibank	134
104	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Credit Suisse	(209)	44	Discover Financial Services	JP Morgan	106
(219)	ConocoPhillips	Citibank	18	(182)	DISH Network Corp 'A'	JP Morgan	438
(170)	ConocoPhillips	Credit Suisse	19	(24)	DocuSign Inc	Citibank	(119)
(71)	Consolidated Edison Inc	Credit Suisse	152	(29)	DocuSign Inc	JP Morgan	(276)
(116)	Consolidated Edison Inc	JP Morgan	6	46	Dollar Tree Inc	JP Morgan	(699)
22	Constellation Brands Inc 'A'	Credit Suisse	10	14	Domino's Pizza Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69)
(20)	Cooper Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(86)	23	Domino's Pizza Inc	Citibank	113
(8)	Cooper Cos Inc	Citibank	7	186	Dover Corp	Bank of America Merrill Lynch	26
(19)	Cooper Cos Inc	JP Morgan	130	58	Dover Corp	Citibank	48
119	Copart Inc	Credit Suisse	224	53	DR Horton Inc	Citibank	182
102	Copart Inc	JP Morgan	264	(87)	DraftKings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(459)
113	Corning Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52)	265	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	271
128	Corteva Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76)	135	Dropbox Inc 'A'	Citibank	22
243	Corteva Inc	Citibank	70	79	Dropbox Inc 'A'	Credit Suisse	124
				203	Dropbox Inc 'A'	JP Morgan	73

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
132	DuPont de Nemours Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77)	364	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	1.682
68	DuPont de Nemours Inc	Credit Suisse	162	(193)	Exxon Mobil Corp	JP Morgan	666
(92)	Dynatrace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(384)	(38)	F5 Networks Inc	JP Morgan	(297)
(53)	Eaton Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7)	124	Facebook Inc 'A'	Citibank	417
398	eBay Inc	Bank of America Merrill Lynch	(264)	12	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11)
5	eBay Inc	Citibank	—	54	Fair Isaac Corp	Credit Suisse	582
179	eBay Inc	JP Morgan	(82)	11	Fair Isaac Corp	JP Morgan	159
37	Ecolab Inc	Credit Suisse	(300)	107	Fastenal Co	Bank of America Merrill Lynch	(55)
(52)	Edison International	Bank of America Merrill Lynch	81	37	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	168
(183)	Edison International	Citibank	375	41	FedEx Corp	Citibank	100
(110)	Edison International	JP Morgan	(3)	18	FedEx Corp	Credit Suisse	82
210	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.041	(120)	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3)
153	Edwards Lifesciences Corp	Citibank	56	(102)	Fidelity National Information Services Inc	Citibank	172
93	Edwards Lifesciences Corp	Credit Suisse	419	(50)	Fidelity National Information Services Inc	JP Morgan	20
58	Edwards Lifesciences Corp	JP Morgan	261	40	First Republic Bank	Credit Suisse	92
(110)	Elanco Animal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(87)	(134)	Fiserv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(261)
(540)	Elanco Animal Health Inc	Citibank	(89)	(50)	Fiserv Inc	Citibank	27
(257)	Elanco Animal Health Inc	JP Morgan	(788)	(196)	Fiserv Inc	Credit Suisse	143
186	Electronic Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	823	(71)	Fiserv Inc	JP Morgan	55
50	Electronic Arts Inc	Citibank	34	147	FMC Corp	Citibank	(6)
197	Electronic Arts Inc	Credit Suisse	509	31	Fortinet Inc	Credit Suisse	362
235	Electronic Arts Inc	JP Morgan	365	85	Fortinet Inc	JP Morgan	992
(39)	Eli Lilly & Co	Bank of America Merrill Lynch	(135)	58	Fortune Brands Home & Security Inc	JP Morgan	(418)
(25)	Eli Lilly & Co	Credit Suisse	(18)	36	Garmin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	57
145	Emerson Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	20	57	Gartner Inc	Citibank	(41)
170	Emerson Electric Co	Credit Suisse	43	27	Gartner Inc	JP Morgan	15
(113)	Enphase Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.281)	(816)	General Electric Co	Credit Suisse	(475)
14	EPAM Systems Inc	JP Morgan	202	(902)	General Electric Co	JP Morgan	(167)
(22)	Equifax Inc	JP Morgan	74	(113)	General Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)
196	Equitable Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(337)	(82)	General Mills Inc	Citibank	13
(56)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(60)	(175)	General Mills Inc	Credit Suisse	139
(77)	Erie Indemnity Co 'A'	Citibank	(209)	(143)	General Mills Inc	JP Morgan	114
(445)	Essential Utilities Inc	Bank of America Merrill Lynch	(583)	102	Genuine Parts Co	Citibank	(23)
(242)	Essential Utilities Inc	Citibank	(59)	149	Genuine Parts Co	Credit Suisse	(303)
(261)	Essential Utilities Inc	Credit Suisse	(222)	88	Genuine Parts Co	JP Morgan	(179)
(341)	Essential Utilities Inc	JP Morgan	(291)	92	Gilead Sciences Inc	Credit Suisse	(103)
(17)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Citibank	(31)	269	Gilead Sciences Inc	JP Morgan	(302)
(23)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	JP Morgan	(153)	(63)	Global Payments Inc	Bank of America Merrill Lynch	160
(58)	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	136	(58)	Global Payments Inc	Citibank	73
(62)	Eversource Energy	JP Morgan	8	(3)	Global Payments Inc	JP Morgan	4
(42)	Exact Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	(546)	129	GoDaddy Inc 'A'	Citibank	101
(41)	Exact Sciences Corp	Credit Suisse	(393)	(48)	Guidewire Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(224)
(101)	Exact Sciences Corp	JP Morgan	(967)	(962)	Halliburton Co	Citibank	60
221	Exelon Corp	Citibank	(165)	(36)	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	3
156	Exelon Corp	JP Morgan	77	(51)	Hasbro Inc	Citibank	(77)
(75)	Expedia Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(461)	(27)	Hasbro Inc	JP Morgan	76
46	Expeditors International of Washington Inc	Bank of America Merrill Lynch	190	81	HCA Healthcare Inc	Citibank	575
59	Expeditors International of Washington Inc	Citibank	80	9	HCA Healthcare Inc	JP Morgan	21
178	Expeditors International of Washington Inc	Credit Suisse	701	75	Hershey Co	Bank of America Merrill Lynch	34
				10	Hershey Co	Citibank	(9)
				(70)	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	149
				(72)	Hess Corp	Citibank	22

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
(135)	Hess Corp	JP Morgan	(139)	50	Intuit Inc	Bank of America	
380	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	(181)	14	Intuit Inc	Merrill Lynch	806
313	Hewlett Packard Enterprise Co	JP Morgan	(115)	(6)	Intuitive Surgical Inc	Citibank	5
(47)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Citibank	(65)	(7)	Intuitive Surgical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(124)
(41)	Hilton Worldwide Holdings Inc	JP Morgan	(132)	193	Invesco Ltd	Credit Suisse	(42)
66	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	23	(100)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Citibank	242
149	Hologic Inc	JP Morgan	(248)	(48)	IPG Photonics Corp	JP Morgan	(83)
43	Home Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	55	44	J M Smucker Co	JP Morgan	(540)
37	Home Depot Inc	Credit Suisse	(244)	(32)	Jack Henry & Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	(59)
118	Home Depot Inc	JP Morgan	(2.147)	106	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	61
(61)	Horizon Therapeutics Plc	Credit Suisse	(271)	46	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	116
(421)	Hormel Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	(686)	77	JB Hunt Transport Services Inc	Citibank	(31)
(207)	Hormel Foods Corp	Citibank	122	40	JB Hunt Transport Services Inc	Citibank	15
(45)	Hormel Foods Corp	JP Morgan	(36)	(130)	Johnson & Johnson	Citibank	138
(221)	Howmet Aerospace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(321)	(110)	Johnson & Johnson	JP Morgan	54
176	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(549)	127	Johnson Controls International Plc	Bank of America Merrill Lynch	66
685	HP Inc	Citibank	(1.729)	97	Johnson Controls International Plc	Citibank	143
419	HP Inc	Credit Suisse	(2.067)	292	Johnson Controls International Plc	Credit Suisse	344
(10)	HubSpot Inc	Citibank	21	(472)	Keurig Dr Pepper Inc	Bank of America Merrill Lynch	(383)
(430)	Huntington Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	25	(557)	Keurig Dr Pepper Inc	Citibank	(46)
(246)	Huntington Bancshares Inc	Citibank	(44)	(187)	Keurig Dr Pepper Inc	Credit Suisse	(89)
(196)	Huntington Bancshares Inc	JP Morgan	(16)	(179)	Keurig Dr Pepper Inc	JP Morgan	(85)
(95)	IAC Via InterActive Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.076	785	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	(309)
(40)	IAC Via InterActive Corp	Citibank	2.747	109	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	254
(34)	IDEX Corp	Credit Suisse	117	(48)	Kimberly-Clark Corp	Citibank	59
9	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	254	(57)	Kimberly-Clark Corp	Credit Suisse	293
32	IDEXX Laboratories Inc	Citibank	220	(170)	Kimberly-Clark Corp	JP Morgan	873
10	IDEXX Laboratories Inc	Credit Suisse	269	98	KKR & Co Inc	Citibank	30
26	IDEXX Laboratories Inc	JP Morgan	459	16	KLA Corp	JP Morgan	223
122	Illinois Tool Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	(579)	244	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(232)
49	Illinois Tool Works Inc	Citibank	(12)	253	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	JP Morgan	(489)
43	Illinois Tool Works Inc	Credit Suisse	(257)	176	Kroger Co	Citibank	55
(12)	illumina Inc	JP Morgan	(248)	(26)	L3Harris Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)
175	Incyte Corp	Citibank	125	(25)	L3Harris Technologies Inc	Citibank	(36)
(56)	Ingersoll Rand Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40)	(23)	L3Harris Technologies Inc	Credit Suisse	(27)
(374)	Ingersoll Rand Inc	Citibank	(15)	(105)	L3Harris Technologies Inc	JP Morgan	(89)
(210)	Ingersoll Rand Inc	Credit Suisse	39	32	Laboratory Corp of America Holdings	JP Morgan	(68)
(27)	Ingersoll Rand Inc	JP Morgan	11	16	Lam Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	758
(19)	Insulet Corp	Credit Suisse	(668)	9	Lam Research Corp	Credit Suisse	468
235	Intel Corp	Bank of America Merrill Lynch	345	28	Lam Research Corp	JP Morgan	1.455
82	Intel Corp	Credit Suisse	77	(162)	Lamb Weston Holdings Inc	Citibank	(273)
(38)	International Business Machines Corp	JP Morgan	76	(12)	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(36)	International Flavors & Fragrances Inc	Citibank	6	(581)	Las Vegas Sands Corp	Citibank	(5)
(156)	International Flavors & Fragrances Inc	Credit Suisse	133	(195)	Las Vegas Sands Corp	JP Morgan	(97)
(94)	International Flavors & Fragrances Inc	JP Morgan	80	(27)	Lear Corp	Citibank	(140)
460	International Paper Co	Bank of America Merrill Lynch	(377)	(33)	Lear Corp	JP Morgan	(74)
94	International Paper Co	Credit Suisse	79	52	Lennar Corp 'A'	Credit Suisse	(381)
479	Interpublic Group of Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	440	40	Lennox International Inc	Credit Suisse	(117)
167	Interpublic Group of Cos Inc	JP Morgan	123	(153)	Liberty Broadband Corp	Bank of America Merrill Lynch	(391)
				(137)	Liberty Broadband Corp	Citibank	76

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
(33)	Liberty Broadband Corp	Credit Suisse	(14)	281	MetLife Inc	JP Morgan	(256)
(130)	Liberty Broadband Corp	JP Morgan	(101)	4	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	57
(309)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Citibank	86	6	Mettler-Toledo International Inc	Citibank	102
(17)	Linde Plc	Citibank	9	16	Mettler-Toledo International Inc	Credit Suisse	674
(27)	Linde Plc	Credit Suisse	9	14	Mettler-Toledo International Inc	JP Morgan	552
(89)	Linde Plc	JP Morgan	30	(1)	MFA Financial Inc (REIT) [†]	Bank of America Merrill Lynch	—
(68)	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(311)	(89)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(979)
(75)	Live Nation Entertainment Inc	Credit Suisse	(433)	(33)	Microchip Technology Inc	Citibank	(77)
131	LKQ Corp	Citibank	76	(85)	Microchip Technology Inc	Credit Suisse	(1.097)
100	LKQ Corp	Credit Suisse	60	(86)	Microchip Technology Inc	JP Morgan	(981)
163	LKQ Corp	JP Morgan	134	(64)	Micron Technology Inc	Credit Suisse	(173)
133	Loews Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8)	34	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	125
196	Lowe's Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	112	121	Microsoft Corp	Citibank	(109)
27	Lowe's Cos Inc	Citibank	92	129	Microsoft Corp	JP Morgan	264
33	Lowe's Cos Inc	JP Morgan	(446)	30	Mohawk Industries Inc	Citibank	59
(89)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Citibank	(74)	33	Mohawk Industries Inc	JP Morgan	(427)
(1)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Credit Suisse	1	43	Molina Healthcare Inc	Citibank	(93)
(36)	LyondellBasell Industries NV 'A'	JP Morgan	24	23	Molina Healthcare Inc	Credit Suisse	(328)
(94)	Marathon Petroleum Corp	Credit Suisse	(153)	10	Molson Coors Beverage Co 'B'	Citibank	5
(11)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(150)	108	Mondelez International Inc 'A'	Citibank	(13)
(11)	MarketAxess Holdings Inc	Citibank	(91)	(40)	MongoDB Inc	Bank of America Merrill Lynch	(910)
(106)	Marriott International Inc 'A'	JP Morgan	(254)	(13)	MongoDB Inc	JP Morgan	(400)
(41)	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130)	48	Monolithic Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.212
(149)	Marsh & McLennan Cos Inc	JP Morgan	(68)	68	Monster Beverage Corp	Citibank	58
(104)	Marvell Technology Inc	Credit Suisse	(339)	56	Monster Beverage Corp	Credit Suisse	123
(220)	Marvell Technology Inc	JP Morgan	(717)	137	Monster Beverage Corp	JP Morgan	300
76	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(218)	72	Morgan Stanley	Citibank	74
283	Masco Corp	Citibank	(79)	180	Morgan Stanley	Credit Suisse	661
168	Masco Corp	Credit Suisse	(539)	312	Mosaic Co	JP Morgan	161
236	Masco Corp	JP Morgan	(1.315)	29	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	111
21	Masimo Corp	JP Morgan	(22)	(11)	MSCI Inc	Credit Suisse	79
(34)	Match Group Inc	Credit Suisse	(44)	(11)	MSCI Inc	JP Morgan	79
237	Maxim Integrated Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.055	(35)	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	(106)
52	Maxim Integrated Products Inc	Citibank	56	71	NetApp Inc	Citibank	(94)
255	Maxim Integrated Products Inc	Credit Suisse	1.956	243	NetApp Inc	JP Morgan	(297)
(53)	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	3	(10)	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	1
38	McDonald's Corp	JP Morgan	(100)	(11)	Netflix Inc	Citibank	1
86	McKesson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(491)	(30)	Netflix Inc	JP Morgan	(396)
35	McKesson Corp	Citibank	(208)	(54)	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(139)
82	McKesson Corp	JP Morgan	(654)	189	News Corp 'A'	Citibank	23
(176)	Medtronic Plc	Bank of America Merrill Lynch	2	(69)	NextEra Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75)
(183)	Medtronic Plc	Citibank	134	(226)	NextEra Energy Inc	Citibank	50
(82)	Medtronic Plc	Credit Suisse	(36)	(71)	NextEra Energy Inc	Credit Suisse	92
(218)	Medtronic Plc	JP Morgan	55	(277)	NextEra Energy Inc	JP Morgan	359
(494)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	45	56	NIKE Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	2
(253)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	JP Morgan	272	38	NIKE Inc 'B'	Citibank	75
(4)	MercadoLibre Inc	Citibank	28	70	Nordson Corp	Citibank	1.102
(5)	MercadoLibre Inc	Credit Suisse	106	28	Norfolk Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	(111)
(83)	Merck & Co Inc	JP Morgan	32	95	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	44
296	MetLife Inc	Citibank	(2)	(41)	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	127
244	MetLife Inc	Credit Suisse	(222)				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
(21)	Nucor Corp	Citibank	14	81	Pinterest Inc 'A'	JP Morgan	461
(13)	Nucor Corp	Credit Suisse	(13)	(44)	Pioneer Natural Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(204)	Nucor Corp	JP Morgan	(207)	(32)	Pioneer Natural Resources Co	Credit Suisse	179
(9)	NVIDIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(613)	(34)	Pioneer Natural Resources Co	JP Morgan	429
(10)	NVIDIA Corp	Citibank	(207)	(171)	Plug Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	(807)
1	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	13	(127)	Plug Power Inc	Citibank	(364)
1	NVR Inc	Citibank	192	(163)	Plug Power Inc	Credit Suisse	(1.420)
2	NVR Inc	Credit Suisse	(538)	(192)	Plug Power Inc	JP Morgan	(1.672)
1	NVR Inc	JP Morgan	(269)	16	Pool Corp	Citibank	76
52	NXP Semiconductors NV	Bank of America Merrill Lynch	862	47	Pool Corp	Credit Suisse	(324)
24	NXP Semiconductors NV	Citibank	138	17	Pool Corp	JP Morgan	(117)
(177)	Occidental Petroleum Corp	Credit Suisse	97	(44)	PPG Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	9
(60)	Okta Inc	Bank of America Merrill Lynch	123	(36)	PPG Industries Inc	JP Morgan	(13)
(23)	Okta Inc	Citibank	379	104	Principal Financial Group Inc	JP Morgan	(121)
(44)	Okta Inc	JP Morgan	300	(41)	Procter & Gamble Co	Citibank	104
138	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America Merrill Lynch	(541)	(37)	Procter & Gamble Co	JP Morgan	86
19	Old Dominion Freight Line Inc	Citibank	12	(135)	Progressive Corp	Bank of America Merrill Lynch	827
20	Old Dominion Freight Line Inc	Credit Suisse	(77)	(88)	Progressive Corp	JP Morgan	480
23	Old Dominion Freight Line Inc	JP Morgan	54	180	Prudential Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(146)
130	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(93)	26	PTC Inc	Bank of America Merrill Lynch	138
88	Omnicom Group Inc	Citibank	(69)	(85)	Public Service Enterprise Group Inc	Citibank	2
188	Omnicom Group Inc	Credit Suisse	(394)	(79)	Public Service Enterprise Group Inc	JP Morgan	75
69	Omnicom Group Inc	JP Morgan	(145)	92	PulteGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(210)	ON Semiconductor Corp	Citibank	(120)	96	PulteGroup Inc	Citibank	139
(117)	ON Semiconductor Corp	JP Morgan	(290)	104	PulteGroup Inc	JP Morgan	(389)
(64)	Oracle Corp	Bank of America Merrill Lynch	18	29	Qorvo Inc	Citibank	97
(144)	Oracle Corp	Citibank	76	22	QUALCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	85
(95)	Oracle Corp	Credit Suisse	110	180	QUALCOMM Inc	Citibank	235
(80)	Oracle Corp	JP Morgan	92	111	QUALCOMM Inc	Credit Suisse	509
11	O'Reilly Automotive Inc	Citibank	11	189	QUALCOMM Inc	JP Morgan	867
9	O'Reilly Automotive Inc	Credit Suisse	(94)	43	Quest Diagnostics Inc	JP Morgan	(346)
23	O'Reilly Automotive Inc	JP Morgan	(341)	43	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47)
128	Owens Corning	Bank of America Merrill Lynch	38	42	Raymond James Financial Inc	Citibank	(67)
154	Owens Corning	Credit Suisse	(198)	254	Regions Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	2
58	PACCAR Inc	JP Morgan	(198)	381	Regions Financial Corp	Citibank	169
(33)	Packaging Corp of America	Credit Suisse	30	240	Regions Financial Corp	Credit Suisse	149
(17)	Palo Alto Networks Inc	Citibank	18	(37)	Reinsurance Group of America Inc	Credit Suisse	60
(17)	Palo Alto Networks Inc	JP Morgan	(305)	(8)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9
22	Parker-Hannifin Corp	Citibank	41	(50)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Citibank	2
(22)	Paycom Software Inc	Citibank	123	(60)	RenaissanceRe Holdings Ltd	JP Morgan	415
(57)	PayPal Holdings Inc	Credit Suisse	(766)	(161)	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	112
(23)	PayPal Holdings Inc	JP Morgan	(309)	(155)	Republic Services Inc	Citibank	27
(52)	Peloton Interactive Inc 'A'	Citibank	(390)	(102)	Republic Services Inc	JP Morgan	240
(53)	Peloton Interactive Inc 'A'	Credit Suisse	(991)	(23)	ResMed Inc	Credit Suisse	(238)
250	Pentair Plc	Citibank	186	(47)	RingCentral Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.038)
51	PepsiCo Inc	Bank of America Merrill Lynch	74	(15)	RingCentral Inc 'A'	Citibank	(194)
223	PepsiCo Inc	Citibank	16	(19)	RingCentral Inc 'A'	JP Morgan	(32)
35	PepsiCo Inc	Credit Suisse	35				
48	PepsiCo Inc	JP Morgan	48				
(86)	PerkinElmer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130)				
(38)	PerkinElmer Inc	Credit Suisse	(158)				
(76)	PerkinElmer Inc	JP Morgan	(316)				
(154)	Pfizer Inc	Bank of America Merrill Lynch	—				
(150)	Pfizer Inc	JP Morgan	139				
(116)	Phillips 66	JP Morgan	130				

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
160	Robert Half International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(123)	(22)	Square Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(353)
66	Robert Half International Inc	Citibank	42	(21)	Square Inc 'A'	Citibank	(199)
96	Robert Half International Inc	Credit Suisse	(158)	(15)	Square Inc 'A'	Credit Suisse	(75)
35	Rockwell Automation Inc	Citibank	38	(68)	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	13
28	Rockwell Automation Inc	Credit Suisse	(163)	23	Stanley Black & Decker Inc	Citibank	98
(323)	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	532	177	Starbucks Corp	Bank of America Merrill Lynch	421
(64)	Roper Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(890)	84	Starbucks Corp	Citibank	94
(16)	Roper Technologies Inc	Citibank	(73)	46	Starbucks Corp	Credit Suisse	46
(15)	Roper Technologies Inc	Credit Suisse	(69)	277	Starbucks Corp	JP Morgan	(95)
(78)	Roper Technologies Inc	JP Morgan	(330)	123	State Street Corp	Citibank	57
96	Ross Stores Inc	Citibank	229	(208)	Steel Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	360
(64)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(458)	(112)	Steel Dynamics Inc	JP Morgan	142
(58)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Citibank	(201)	(30)	STERIS Plc	JP Morgan	412
(62)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Credit Suisse	(475)	(197)	Sunrun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(380)
(121)	Royalty Pharma Plc 'A'	JP Morgan	136	(103)	Sunrun Inc	Citibank	11
(13)	S&P Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48)	(232)	Sunrun Inc	JP Morgan	(745)
(17)	S&P Global Inc	JP Morgan	152	116	Synchrony Financial	JP Morgan	132
(132)	salesforce.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.492)	52	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	781
(27)	salesforce.com Inc	Citibank	(246)	107	Synopsys Inc	Citibank	424
(47)	salesforce.com Inc	Credit Suisse	(932)	20	Synopsys Inc	Credit Suisse	360
(87)	salesforce.com Inc	JP Morgan	(1.446)	160	Synopsys Inc	JP Morgan	2.878
(223)	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	273	27	T Rowe Price Group Inc	Citibank	77
(70)	Sarepta Therapeutics Inc	Credit Suisse	(322)	52	Take-Two Interactive Software Inc	Credit Suisse	705
(43)	Sarepta Therapeutics Inc	JP Morgan	(198)	38	Take-Two Interactive Software Inc	JP Morgan	515
(922)	Schlumberger NV	JP Morgan	79	27	Target Corp	Bank of America Merrill Lynch	374
(67)	Seagen Inc	Citibank	(92)	52	Target Corp	Citibank	64
(36)	Seagen Inc	Credit Suisse	(573)	24	Target Corp	Credit Suisse	253
(40)	Seagen Inc	JP Morgan	(637)	27	Target Corp	JP Morgan	285
109	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	29	(52)	TE Connectivity Ltd	Citibank	(49)
398	Sealed Air Corp	JP Morgan	13	(38)	TE Connectivity Ltd	Credit Suisse	26
(82)	SEI Investments Co	Citibank	(37)	(109)	TE Connectivity Ltd	JP Morgan	73
(97)	Sempra Energy	Citibank	15	(70)	Teladoc Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(534)
2	ServiceNow Inc	Citibank	(4)	(26)	Teladoc Health Inc	Credit Suisse	(203)
9	ServiceNow Inc	Credit Suisse	52	(90)	Teladoc Health Inc	JP Morgan	(703)
31	ServiceNow Inc	JP Morgan	180	(12)	Teledyne Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(81)
20	Sherwin-Williams Co	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(24)	Teledyne Technologies Inc	Citibank	(173)
131	Sherwin-Williams Co	Credit Suisse	(412)	(32)	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(235)
60	Sherwin-Williams Co	JP Morgan	(191)	(17)	Teleflex Inc	Credit Suisse	76
2.509	Sirius XM Holdings Inc	Citibank	226	132	Teradyne Inc	Citibank	504
68	Skyworks Solutions Inc	JP Morgan	226	(15)	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	(595)
(179)	Slack Technologies Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(422)	(6)	Tesla Inc	Citibank	(92)
(95)	Snap Inc 'A'	Credit Suisse	(777)	(9)	Tesla Inc	Credit Suisse	(380)
(16)	Snowflake Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(333)	(583)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	172
(24)	Snowflake Inc 'A'	JP Morgan	(869)	27	Texas Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	199
(38)	SolarEdge Technologies Inc	Credit Suisse	(709)	26	Texas Instruments Inc	Citibank	24
(42)	SolarEdge Technologies Inc	JP Morgan	(1.537)	68	Texas Instruments Inc	JP Morgan	433
(97)	Southwest Airlines Co	Bank of America Merrill Lynch	51	(11)	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America Merrill Lynch	(149)
(78)	Southwest Airlines Co	Citibank	(50)	(11)	Thermo Fisher Scientific Inc	Credit Suisse	(54)
(82)	Southwest Airlines Co	JP Morgan	(7)	(41)	Thermo Fisher Scientific Inc	JP Morgan	(203)
(41)	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	8	129	TJX Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(472)
(51)	Splunk Inc	Citibank	(63)	91	TJX Cos Inc	Citibank	29
(47)	Splunk Inc	JP Morgan	(287)	72	TJX Cos Inc	Credit Suisse	(322)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite				États-Unis suite			
(298)	T-Mobile US Inc	Bank of America Merrill Lynch	(305)	257	Verizon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(305)
(145)	T-Mobile US Inc	Credit Suisse	(607)	90	Verizon Communications Inc	Citibank	(36)
(193)	T-Mobile US Inc	JP Morgan	(892)	261	Verizon Communications Inc	Credit Suisse	(648)
54	Tractor Supply Co	Citibank	(4)	23	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(145)
30	Tractor Supply Co	JP Morgan	(344)	75	Vertex Pharmaceuticals Inc	Citibank	(159)
(7)	Trade Desk Inc 'A'	Citibank	(187)	26	Vertex Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	(91)
(10)	Trade Desk Inc 'A'	Credit Suisse	(392)	90	Vertex Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	(315)
(75)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(81)	VF Corp	Citibank	(60)
68	Trane Technologies Plc	Credit Suisse	57	(719)	Viatis Inc	Bank of America Merrill Lynch	536
(73)	TransUnion	Bank of America Merrill Lynch	62	(765)	Viatis Inc	Credit Suisse	(125)
(66)	TransUnion	Credit Suisse	(26)	(613)	Viatis Inc	JP Morgan	(100)
(52)	TransUnion	JP Morgan	(20)	(154)	Vimeo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5.300)
(72)	Travelers Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	32	(64)	Vimeo Inc	Citibank	(2.203)
62	Trimble Inc	Bank of America Merrill Lynch	79	(378)	Visa Inc 'A'	Citibank	537
64	Trimble Inc	JP Morgan	2	(11)	Visa Inc 'A'	JP Morgan	(12)
86	Truist Financial Corp	Citibank	40	33	VMware Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(151)
(65)	Twilio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2.067)	76	Voya Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	12
(15)	Twilio Inc 'A'	Citibank	(146)	(73)	W R Berkley Corp	Credit Suisse	173
(28)	Twilio Inc 'A'	Credit Suisse	(948)	(92)	Walgreens Boots Alliance Inc	JP Morgan	185
(70)	Twitter Inc	Bank of America Merrill Lynch	(310)	(99)	Walt Disney Co	Bank of America Merrill Lynch	(695)
(75)	Twitter Inc	Citibank	(58)	(36)	Walt Disney Co	Citibank	(128)
(97)	Twitter Inc	JP Morgan	(441)	(27)	Walt Disney Co	Credit Suisse	125
(1)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(16)	Waste Connections Inc	Bank of America Merrill Lynch	7
(1)	Tyler Technologies Inc	Citibank	1	(71)	Waste Connections Inc	Citibank	(34)
(13)	Tyler Technologies Inc	Credit Suisse	(117)	(44)	Waste Connections Inc	Credit Suisse	79
(29)	Tyler Technologies Inc	JP Morgan	(260)	(48)	Waste Connections Inc	JP Morgan	86
65	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(59)	(176)	Waste Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	120
104	Tyson Foods Inc 'A'	Citibank	(90)	(49)	Waste Management Inc	Citibank	17
65	Tyson Foods Inc 'A'	Credit Suisse	36	(143)	Waste Management Inc	Credit Suisse	302
(199)	Uber Technologies Inc	Citibank	(130)	(99)	Waste Management Inc	JP Morgan	209
492	UGI Corp	Credit Suisse	(65)	16	Waters Corp	Citibank	27
139	UGI Corp	JP Morgan	(18)	18	Waters Corp	Credit Suisse	68
15	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Citibank	363	34	Waters Corp	JP Morgan	129
25	Union Pacific Corp	JP Morgan	(76)	(173)	Wells Fargo & Co	Bank of America Merrill Lynch	167
29	United Parcel Service Inc 'B'	Citibank	28	(167)	Wells Fargo & Co	Citibank	(66)
25	United Rentals Inc	Citibank	165	62	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.057
(21)	UnitedHealth Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(57)	32	West Pharmaceutical Services Inc	Credit Suisse	201
(13)	UnitedHealth Group Inc	JP Morgan	96	47	West Pharmaceutical Services Inc	JP Morgan	531
45	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(36)	(26)	Western Digital Corp	Bank of America Merrill Lynch	25
77	Universal Health Services Inc 'B'	Citibank	40	(49)	Western Digital Corp	Citibank	(53)
36	Universal Health Services Inc 'B'	JP Morgan	76	(79)	Western Digital Corp	Credit Suisse	(428)
18	Vail Resorts Inc	Credit Suisse	131	231	Western Union Co	Citibank	(44)
17	Vail Resorts Inc	JP Morgan	124	194	Western Union Co	JP Morgan	(211)
(130)	Valero Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	130	(150)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	JP Morgan	(234)
(64)	Valero Energy Corp	Credit Suisse	(160)	110	Westrock Co	Citibank	5
(62)	Valero Energy Corp	JP Morgan	(39)	31	Whirlpool Corp	Bank of America Merrill Lynch	(214)
20	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	712	81	Whirlpool Corp	Citibank	139
17	Veeva Systems Inc 'A'	Credit Suisse	588	21	Whirlpool Corp	Credit Suisse	(253)
19	Veeva Systems Inc 'A'	JP Morgan	657	(21)	Willis Towers Watson Plc	Citibank	27
25	VeriSign Inc	Citibank	(94)	(24)	Willis Towers Watson Plc	JP Morgan	148
(30)	Verisk Analytics Inc	Bank of America Merrill Lynch	3				
(106)	Verisk Analytics Inc	Citibank	116				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
États-Unis suite			
(20)	Wix.com Ltd	Credit Suisse	356
(23)	Wix.com Ltd	JP Morgan	(669)
48	Workday Inc 'A'	Credit Suisse	(234)
50	WW Grainger Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(201)
12	WW Grainger Inc	JP Morgan	(119)
(85)	Wynn Resorts Ltd	JP Morgan	(428)
83	Xilinx Inc	Citibank	220
78	Xilinx Inc	JP Morgan	329
64	Yum! Brands Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	69
227	Yum! Brands Inc	Citibank	(102)
44	Yum! Brands Inc	Credit Suisse	(70)
11	Zebra Technologies Corp 'A'	Citibank	(41)
11	Zebra Technologies Corp 'A'	JP Morgan	117
(147)	Zendesk Inc	JP Morgan	(570)
42	Zimmer Biomet Holdings Inc	JP Morgan	(125)
(77)	Zoetis Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(404)
(33)	Zoetis Inc	Citibank	(8)
(29)	Zoetis Inc	Credit Suisse	(131)
(13)	Zoom Video	Bank of America	
	Communications Inc 'A'	Merrill Lynch	(241)
(31)	Zoom Video		
	Communications Inc 'A'	Credit Suisse	(598)
(16)	Zoom Video		
	Communications Inc 'A'	JP Morgan	(564)
(26)	Zscaler Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(659)
(27)	Zscaler Inc	Citibank	(438)
(37)	Zscaler Inc	JP Morgan	(862)
			(50.542)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 18.343.112)			(65.740)
<small> † Les montants inférieurs à 0,5 USD ont été arrondis à zéro. </small>			

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
Instruments financiers dérivés						
SWAPS						
TRS	BRL 2	Fund receives Ibovespa Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	2.344	2.344
TRS	BRL 6	Fund receives Ibovespa Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	4.756	4.756
TRS	BRL 4	Fund receives Ibovespa Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	1.383	1.383
TRS	BRL 1	Fund receives Ibovespa Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	51	51
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	4.539	4.539
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	2.464	2.464
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	1.590	1.590
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	(354)	(354)
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	(14)	(14)
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	(119)	(119)
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	674	674
TRS	KRW 250.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	1.340	1.340
TRS	KRW 500.000	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	1.031	1.031
TRS	TWD 2.400	Fund receives TAIEX Futures Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	91.235	91.235
TRS	TWD 800	Fund receives TAIEX Futures Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	22.628	22.628
TRS	THB 6.200	Fund receives SET50 Futures Index and pays Fixed 0,000%	Credit Suisse	29/6/2021	(717)	(717)
TRS	THB 1.600	Fund receives SET50 Futures Index and pays Fixed 0,000%	Credit Suisse	29/6/2021	(293)	(293)
TRS	USD 238.641	Fund receives Fixed 1,000% and pays MSCI Hong Kong Net Total Return US	Goldman Sachs	16/2/2022	7.282	7.282
TRS	PLN 60	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	3.009	3.009
TRS	PLN 220	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	16.543	16.543
TRS	PLN 120	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	7.996	7.996
TRS	PLN 140	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	8.361	8.361
TRS	PLN 180	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	9.946	9.946
TRS	PLN 60	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	2.646	2.646
TRS	PLN 60	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	2.459	2.459
TRS	PLN 80	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	18/6/2021	2.314	2.314
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 3.413.424)					193.094	193.094

TRS: Swaps sur rendement total (*Total Return Swaps*)

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
91	AUD	Australian 10 Year Bond Futures June 2021	Juin 2021	8.076.493	78.703
21	EUR	CAC 40 Index Futures June 2021	Juin 2021	1.356.600	36.630
(19)	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures September 2021	Septembre 2021	1.857.569	(4.253)
3	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	Juin 2021	516.912	15.922
44	EUR	Euro Bund Futures June 2021	Juin 2021	7.471.640	(60.900)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(11)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2021	June 2021	897.044	(13.620)
64	USD	FTSE China A50 Futures June 2021	June 2021	952.238	13.610
12	EUR	FTSE MIB Index Futures June 2021	June 2021	1.514.700	50.985
(15)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index Futures June 2021	June 2021	553.338	(3.989)
(3)	EUR	IBEX 35 Index Futures June 2021	June 2021	274.890	(1.690)
21	USD	MSCI Hong Kong Index Futures June 2021	June 2021	1.391.396	(2.147)
11	SGD	MSCI Singapore Index Futures June 2021	June 2021	245.189	1.553
(21)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures June 2021	June 2021	466.972	(3.096)
(4)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures June 2021	June 2021	644.969	(22.253)
(23)	USD	SGX NIFTY 50 Futures June 2021	June 2021	587.250	(10.862)
(6)	AUD	SPI 200 Index Futures June 2021	June 2021	681.677	(33.849)
15	CHF	Swiss Market Index Futures June 2021	June 2021	1.553.767	88.899
6	JPY	Topix Index Futures June 2021	June 2021	864.768	4.832
(1)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	September 2021	147.749	(279)
(12)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	September 2021	1.296.091	(652)
Total				31.351.252	133.544

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
AUD	5.000	EUR	3.203	UBS	2/6/2021	(32)
AUD	17.000	EUR	10.856	Bank of America	16/6/2021	(77)
AUD	104.000	EUR	66.631	Merrill Lynch	16/6/2021	(690)
AUD	104.000	EUR	66.590	Citibank	21/7/2021	(683)
AUD	17.000	EUR	10.849	Standard	21/7/2021	(76)
BRL	1.466.000	USD	270.975	Chartered Bank	16/6/2021	8.021
BRL	1.914.000	USD	334.616	BNP Paribas	16/6/2021	26.173
BRL	1.399.000	USD	254.841	Citibank	16/6/2021	10.726
BRL	240.000	USD	44.888	Morgan Stanley	21/7/2021	756
BRL	1.230.000	USD	225.958	Citibank	21/7/2021	7.227
BRL	1.238.000	USD	215.570	Goldman Sachs	21/7/2021	16.981
BRL	1.405.000	USD	255.206	HSBC	21/7/2021	10.630
BRL	2.012.000	USD	380.829	Standard	21/7/2021	1.697
CAD	16.000	EUR	10.796	Chartered Bank	18/8/2021	56
CAD	1.280.423	EUR	849.266	Bank of America	16/6/2021	18.899
CAD	251.000	EUR	169.600	Merrill Lynch	16/6/2021	586
CAD	1.411.000	EUR	944.393	Chartered Bank	21/7/2021	11.627
CAD	1.406.000	EUR	954.986	Morgan Stanley	18/8/2021	(2.894)
CHF	156.000	EUR	141.148	Westpac	16/6/2021	824
CLP	138.359.000	USD	187.580	Morgan Stanley	16/6/2021	3.462
CLP	189.298.000	USD	268.234	Bank of America	16/6/2021	(4.760)
CLP	52.167.000	USD	72.497	Merrill Lynch	16/6/2021	(146)
CLP	24.504.000	USD	33.581	Deutsche Bank	16/6/2021	318
CLP	189.404.000	USD	268.388	Goldman Sachs	21/7/2021	(4.821)
CLP	16.439.000	USD	22.446	Citibank	21/7/2021	276

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
CLP	16.450.000	USD	22.457	Goldman Sachs	18/8/2021	275
EUR	130.878	AUD	204.000	Bank of America	2/6/2021	1.506
EUR	118.734	AUD	185.000	Merrill Lynch	2/6/2021	1.411
EUR	118.665	AUD	185.000	Barclays Bank	2/6/2021	1.342
EUR	118.643	AUD	185.000	Deutsche Bank	2/6/2021	1.320
EUR	120.064	AUD	187.217	Goldman Sachs	2/6/2021	1.336
EUR	183.568	AUD	286.000	Morgan Stanley	2/6/2021	1.336
EUR	66.898	AUD	104.000	Deutsche Bank	16/6/2021	2.231
EUR	1.477.747	AUD	2.291.154	Goldman Sachs	16/6/2021	957
EUR	54.478	AUD	85.000	HSBC	16/6/2021	25.051
EUR	55.098	AUD	85.000	Standard	16/6/2021	584
EUR	66.860	AUD	104.000	Chartered Bank	16/6/2021	1.204
EUR	54.446	AUD	85.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	953
EUR	147.799	AUD	231.000	Goldman Sachs	21/7/2021	579
EUR	66.825	AUD	104.000	Westpac	21/7/2021	1.408
EUR	14.202	AUD	22.000	Goldman Sachs	18/8/2021	946
EUR	101.090	CAD	150.000	Westpac	18/8/2021	267
EUR	101.072	CAD	150.000	Bank of America	2/6/2021	(644)
EUR	101.113	CAD	150.000	Merrill Lynch	2/6/2021	(662)
EUR	101.767	CAD	151.000	Barclays Bank	2/6/2021	(621)
EUR	116.664	CAD	173.115	Deutsche Bank	2/6/2021	(646)
EUR	11.460	CAD	17.000	Goldman Sachs	2/6/2021	(748)
EUR	325.133	CAD	482.000	Morgan Stanley	2/6/2021	(67)
EUR	134.329	CAD	198.000	Citibank	16/6/2021	(1.677)
EUR	11.452	CAD	17.000	Standard	16/6/2021	78
				Chartered Bank	16/6/2021	(66)
				State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	
				Citibank	21/7/2021	

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	255.696	CAD	379.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(1.095)
EUR	119.492	CAD	176.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	243
EUR	155.604	CAD	229.000	Goldman Sachs	18/8/2021	533
EUR	119.425	CAD	176.000	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	244
EUR	158.962	CHF	176.185	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.380)
EUR	50.067	CHF	55.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	13
EUR	119.270	CHF	132.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(859)
EUR	146.615	CNH	1.150.000	HSBC	16/6/2021	(1.156)
EUR	144.904	CNH	1.140.000	HSBC	21/7/2021	(1.158)
EUR	145.826	CNH	1.150.000	Toronto Dominion Bank	18/8/2021	(1.194)
EUR	97.766	GBP	85.000	Bank of America Merrill Lynch	2/6/2021	(927)
EUR	97.822	GBP	85.000	Barclays Bank	2/6/2021	(871)
EUR	102.204	GBP	89.000	Deutsche Bank	2/6/2021	(1.134)
EUR	97.665	GBP	85.000	Goldman Sachs	2/6/2021	(1.028)
EUR	115.175	GBP	100.219	Morgan Stanley	2/6/2021	(1.188)
EUR	64.389	GBP	55.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	545
EUR	35.909	GBP	31.000	Citibank	16/6/2021	(76)
EUR	84.972	GBP	73.000	Deutsche Bank	16/6/2021	234
EUR	56.123	GBP	48.298	JP Morgan	16/6/2021	58
EUR	37.044	GBP	32.000	Citibank	21/7/2021	(78)
EUR	84.918	GBP	73.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	234
EUR	37.028	GBP	32.000	Morgan Stanley	18/8/2021	(75)
EUR	84.870	GBP	73.000	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	230
EUR	13.997	HKD	129.468	Morgan Stanley	16/6/2021	331
EUR	46.561	HUF	17.181.000	Barclays Bank	16/6/2021	(2.841)
EUR	70.797	HUF	25.535.000	HSBC	16/6/2021	(2.626)
EUR	169.761	HUF	61.277.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(6.434)
EUR	70.774	HUF	25.561.000	HSBC	21/7/2021	(2.625)
EUR	73.267	HUF	26.632.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(3.208)
EUR	96.447	HUF	34.708.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	(3.218)
EUR	96.450	HUF	34.744.000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(3.201)
EUR	53.761	JPY	7.072.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	916
EUR	53.745	JPY	7.073.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	915
EUR	26.059	MXN	635.000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(34)
EUR	89.144	MXN	2.186.000	Citibank	16/6/2021	(680)
EUR	41.120	MXN	1.027.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.080)
EUR	48.841	MXN	1.191.000	JP Morgan	16/6/2021	(97)
EUR	88.784	MXN	2.152.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	356
EUR	26.057	MXN	638.000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(39)
EUR	89.130	MXN	2.196.000	Citibank	21/7/2021	(694)
EUR	48.820	MXN	1.196.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(101)
EUR	88.819	MXN	2.163.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	344
EUR	258.888	MXN	6.346.000	Goldman Sachs	18/8/2021	256

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	37.453	MXN	919.000	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	(1)
EUR	278.798	NOK	2.833.000	Goldman Sachs	16/6/2021	702
EUR	190.076	NOK	1.905.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	3.076
EUR	331.154	NOK	3.359.000	HSBC	21/7/2021	1.629
EUR	79.672	NOK	798.000	JP Morgan	21/7/2021	1.387
EUR	297.442	NOK	2.985.000	HSBC	18/8/2021	4.756
EUR	380.128	NZD	634.000	Goldman Sachs	16/6/2021	2.641
EUR	27.684	NZD	47.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(300)
EUR	48.282	NZD	81.000	Toronto Dominion Bank	16/6/2021	54
EUR	54.730	NZD	92.000	Westpac	16/6/2021	(47)
EUR	236.249	NZD	400.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(1.729)
EUR	48.236	NZD	81.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	46
EUR	27.659	NZD	47.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	(303)
EUR	288.365	NZD	482.000	Morgan Stanley	18/8/2021	1.783
EUR	82.878	PLN	378.000	HSBC	16/6/2021	(1.394)
EUR	150.847	PLN	699.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(4.990)
EUR	18.964	PLN	87.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(432)
EUR	290.988	PLN	1.321.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(3.518)
EUR	20.227	PLN	92.000	UBS	16/6/2021	(284)
EUR	82.832	PLN	378.000	HSBC	21/7/2021	(1.397)
EUR	258.335	PLN	1.167.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	(1.706)
EUR	195.419	PLN	887.000	UBS	21/7/2021	(2.230)
EUR	116.442	PLN	532.000	Goldman Sachs	18/8/2021	(2.048)
EUR	142.364	PLN	640.000	UBS	18/8/2021	(180)
EUR	99.111	SEK	1.013.000	Deutsche Bank	16/6/2021	(977)
EUR	232.720	SEK	2.370.200	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.465)
EUR	9.241	SEK	94.000	HSBC	16/6/2021	(47)
EUR	50.433	SEK	510.000	JP Morgan	16/6/2021	43
EUR	169.975	SEK	1.726.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(560)
EUR	30.940	SEK	315.000	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(183)
EUR	131.988	SEK	1.343.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(653)
EUR	9.237	SEK	94.000	HSBC	21/7/2021	(47)
EUR	50.413	SEK	510.000	JP Morgan	21/7/2021	43
EUR	146.665	SEK	1.490.000	Morgan Stanley	21/7/2021	(495)
EUR	99.166	SEK	1.014.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(981)
EUR	50.397	SEK	510.000	JP Morgan	18/8/2021	43
EUR	146.617	SEK	1.490.000	Morgan Stanley	18/8/2021	(496)
EUR	148.584	SEK	1.505.000	UBS	18/8/2021	(10)
EUR	99.353	SGD	157.000	BNP Paribas	16/6/2021	2.054
EUR	8.755	SGD	14.000	Goldman Sachs	16/6/2021	79
EUR	125.582	SGD	202.000	HSBC	16/6/2021	394
EUR	79.561	SGD	128.000	JP Morgan	16/6/2021	234
EUR	8.748	SGD	14.000	Goldman Sachs	21/7/2021	78
EUR	225.551	SGD	362.000	HSBC	21/7/2021	1.378
EUR	332.181	THB	12.198.000	HSBC	16/6/2021	12.292
EUR	80.820	THB	3.042.000	Citibank	21/7/2021	1.106
EUR	99.274	USD	120.000	Bank of America Merrill Lynch	2/6/2021	945
EUR	99.290	USD	120.000	Barclays Bank	2/6/2021	962
EUR	7.477	USD	9.000	Citibank	2/6/2021	102

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
EUR	99.257	USD	120.000	Deutsche Bank	2/6/2021	929
EUR	99.281	USD	120.000	Goldman Sachs	2/6/2021	953
EUR	105.438	USD	127.418	Morgan Stanley	2/6/2021	1.032
EUR	4.746.546	USD	5.660.064	Barclays Bank	16/6/2021	109.916
EUR	46.513	USD	57.000	Citibank	16/6/2021	(181)
EUR	136.037	USD	161.000	Deutsche Bank	16/6/2021	4.148
EUR	281.331	USD	330.000	JP Morgan	16/6/2021	11.001
EUR	234.849	USD	282.000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	3.839
EUR	281.146	USD	339.000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	3.629
EUR	599.616	USD	715.240	Westpac	21/7/2021	14.099
EUR	46.455	USD	57.000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(182)
EUR	12.702	ZAR	227.000	HSBC	17/6/2021	(794)
EUR	40.025	ZAR	725.000	Morgan Stanley	17/6/2021	(3.081)
EUR	190.979	ZAR	3.371.000	HSBC	21/7/2021	(8.417)
GBP	19.000	EUR	21.900	Citibank	16/6/2021	155
GBP	116.000	EUR	133.936	Deutsche Bank	16/6/2021	717
GBP	59.000	EUR	68.206	Standard Chartered Bank	16/6/2021	281
GBP	153.000	EUR	176.232	UBS	16/6/2021	1.370
GBP	12.000	EUR	13.821	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	100
GBP	19.000	EUR	21.886	Citibank	21/7/2021	155
GBP	127.000	EUR	145.825	JP Morgan	21/7/2021	1.503
GBP	116.000	EUR	133.859	Standard Chartered Bank	21/7/2021	708
GBP	274.000	EUR	317.921	Westpac	18/8/2021	(231)
HUF	97.686.000	EUR	272.863	Standard Chartered Bank	16/6/2021	8.025
HUF	15.508.000	EUR	43.073	UBS	16/6/2021	1.519
HUF	15.526.000	EUR	43.064	BNP Paribas	21/7/2021	1.519
HUF	32.640.000	EUR	90.990	Citibank	21/7/2021	2.737
HUF	36.196.000	EUR	104.086	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(149)
HUF	11.497.000	EUR	32.031	Toronto Dominion Bank	21/7/2021	983
HUF	7.276.000	EUR	20.273	Morgan Stanley	18/8/2021	595
HUF	36.239.000	EUR	104.087	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(148)
INR	124.964.000	USD	1.680.858	Barclays Bank	16/6/2021	30.891
INR	5.325.000	USD	72.127	BNP Paribas	16/6/2021	905
INR	28.847.000	USD	385.253	Morgan Stanley	16/6/2021	9.393
INR	131.280.000	USD	1.733.833	BNP Paribas	22/7/2021	50.165
INR	15.106.000	USD	199.694	UBS	22/7/2021	5.619
INR	124.339.000	USD	1.667.232	Citibank	18/8/2021	21.241
INR	5.383.000	USD	72.175	UBS	18/8/2021	923
JPY	2.897.000	EUR	22.475	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(828)
JPY	10.867.000	EUR	82.705	Citibank	16/6/2021	(1.503)
JPY	89.186.334	EUR	689.176	HSBC	16/6/2021	(22.745)
JPY	13.683.000	EUR	104.845	Morgan Stanley	16/6/2021	(2.601)
JPY	22.405.000	EUR	172.499	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(5.081)
JPY	7.983.000	EUR	61.268	UBS	16/6/2021	(1.616)
JPY	124.404.000	EUR	952.721	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(23.508)
JPY	10.868.000	EUR	82.679	Citibank	21/7/2021	(1.502)
JPY	13.685.000	EUR	104.817	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(2.599)
JPY	134.108.000	EUR	1.012.262	Westpac	18/8/2021	(10.893)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
KRW	128.509.000	USD	114.489	Barclays Bank	16/6/2021	1.200
KRW	39.682.000	USD	35.326	Citibank	16/6/2021	392
KRW	31.450.000	USD	27.965	HSBC	16/6/2021	338
KRW	87.902.000	USD	77.986	Barclays Bank	21/7/2021	1.091
KRW	31.464.000	USD	27.982	BNP Paribas	21/7/2021	336
KRW	39.688.000	USD	35.336	Citibank	21/7/2021	391
KRW	40.659.000	USD	36.562	UBS	21/7/2021	104
KRW	71.194.000	USD	63.356	Citibank	18/8/2021	729
MXN	19.851.000	EUR	768.989	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	46.699
MXN	500.000	EUR	20.535	Standard Chartered Bank	16/6/2021	10
MXN	102.000	EUR	4.200	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(28)
NOK	553.000	EUR	54.444	Deutsche Bank	16/6/2021	(160)
NOK	60.000	EUR	5.942	Goldman Sachs	16/6/2021	(52)
NOK	822.000	EUR	82.106	HSBC	16/6/2021	(1.416)
NOK	341.000	EUR	33.906	Morgan Stanley	16/6/2021	(432)
NOK	1.371.000	EUR	134.892	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	(312)
NOK	822.000	EUR	82.048	HSBC	21/7/2021	(1.408)
NOK	1.013.000	EUR	99.449	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(71)
NOK	700.000	EUR	69.337	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	(665)
NOK	341.000	EUR	33.866	Deutsche Bank	18/8/2021	(430)
NOK	1.013.000	EUR	99.399	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(72)
NZD	613.000	EUR	361.587	Standard Chartered Bank	16/6/2021	3.396
NZD	23.000	EUR	13.848	Westpac	16/6/2021	(154)
NZD	266.000	EUR	157.083	Standard Chartered Bank	21/7/2021	1.172
NZD	266.000	EUR	156.981	Standard Chartered Bank	18/8/2021	1.174
PLN	1.881.000	EUR	408.133	Morgan Stanley	16/6/2021	11.222
PLN	799.000	EUR	175.052	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	3.079
PLN	396.000	EUR	86.903	Standard Chartered Bank	21/7/2021	1.337
PLN	403.000	EUR	88.061	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	1.739
RUB	20.360.000	USD	269.442	Goldman Sachs	16/6/2021	6.291
RUB	34.581.000	USD	461.945	HSBC	16/6/2021	7.161
RUB	14.322.000	USD	189.457	JP Morgan	16/6/2021	4.491
RUB	45.844.000	USD	584.189	BNP Paribas	21/7/2021	30.104
RUB	10.936.000	USD	146.241	Goldman Sachs	21/7/2021	1.546
RUB	14.399.000	USD	189.535	JP Morgan	21/7/2021	4.503
RUB	46.941.000	USD	624.408	UBS	18/8/2021	7.247
SEK	1.614.000	EUR	157.496	Morgan Stanley	16/6/2021	1.974
SEK	716.000	EUR	70.667	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	77
SEK	716.000	EUR	70.638	JP Morgan	21/7/2021	78
SGD	334.782	EUR	208.591	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.112)
SGD	513.000	EUR	319.852	HSBC	16/6/2021	(1.923)
SGD	485.000	EUR	300.896	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(320)
SGD	130.000	EUR	80.097	State Street Bank & Trust Company	16/6/2021	469
SGD	643.000	EUR	399.623	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	(1.434)
SGD	485.000	EUR	300.621	Westpac	21/7/2021	(277)

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
SGD	485.000	EUR	300.426	HSBC	18/8/2021	(263)
SGD	130.000	EUR	79.983	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	473
SGD	158.000	EUR	97.867	Toronto Dominion Bank	18/8/2021	(82)
THB	8.190.000	EUR	221.141	Barclays Bank	16/6/2021	(6.360)
THB	3.099.000	EUR	84.033	Goldman Sachs	16/6/2021	(2.763)
THB	8.134.000	EUR	214.014	HSBC	16/6/2021	(702)
THB	4.052.000	EUR	107.015	JP Morgan	16/6/2021	(752)
THB	784.000	EUR	20.661	Barclays Bank	21/7/2021	(117)
THB	8.145.000	EUR	213.946	HSBC	21/7/2021	(510)
THB	2.306.000	EUR	60.614	JP Morgan	21/7/2021	(186)
THB	1.751.000	EUR	46.369	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(485)
THB	10.304.000	EUR	270.199	HSBC	18/8/2021	(360)
THB	785.000	EUR	20.668	JP Morgan	18/8/2021	(110)
TWD	707.000	USD	25.350	BNP Paribas	16/6/2021	285
TWD	364.000	USD	13.056	Morgan Stanley	16/6/2021	143
TWD	705.000	USD	25.387	Barclays Bank	21/7/2021	301
TWD	363.000	USD	13.076	Morgan Stanley	21/7/2021	151
TWD	703.000	USD	25.403	Barclays Bank	18/8/2021	311
TWD	362.000	USD	13.085	Morgan Stanley	18/8/2021	157
USD	626.774	BRL	3.593.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(50.258)
USD	13.612	BRL	77.000	JP Morgan	16/6/2021	(930)
USD	362.808	BRL	2.070.000	Citibank	21/7/2021	(26.458)
USD	32.917	BRL	174.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(243)
USD	33.029	BRL	175.000	Goldman Sachs	18/8/2021	(225)
USD	252.360	CLP	180.341.000	Citibank	16/6/2021	1.928
USD	84.016	CLP	58.755.000	HSBC	16/6/2021	2.100
USD	267.235	CLP	189.566.000	Goldman Sachs	21/7/2021	3.694
USD	84.054	CLP	58.791.000	HSBC	21/7/2021	2.107
USD	276.933	CLP	193.269.000	Goldman Sachs	18/8/2021	7.483
USD	59.000	EUR	49.373	Barclays Bank	16/6/2021	(1.042)
USD	214.000	EUR	177.942	Citibank	16/6/2021	(2.636)
USD	195.000	EUR	163.375	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(3.634)
USD	140.521	EUR	117.802	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(2.767)
USD	214.000	EUR	177.807	Citibank	21/7/2021	(2.620)
USD	195.000	EUR	163.249	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(3.617)
USD	20.000	EUR	16.452	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(88)
USD	563.932	EUR	463.072	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	(1.666)
USD	12.373	INR	911.000	Citibank	16/6/2021	(128)
USD	227.861	INR	16.993.000	JP Morgan	16/6/2021	(4.780)
USD	24.302	INR	1.777.000	UBS	16/6/2021	(112)
USD	227.850	INR	17.102.000	Standard Chartered Bank	22/7/2021	(4.913)
USD	24.329	INR	1.790.000	UBS	22/7/2021	(121)
USD	24.335	INR	1.798.000	UBS	18/8/2021	(122)
USD	216.185	KRW	243.149.000	Barclays Bank	16/6/2021	(2.629)
USD	332.891	KRW	377.283.000	BNP Paribas	16/6/2021	(6.171)
USD	774.656	KRW	881.133.000	Morgan Stanley	16/6/2021	(16.707)
USD	148.814	KRW	166.779.000	Barclays Bank	21/7/2021	(1.376)
USD	1.529.967	KRW	1.715.476.000	Deutsche Bank	21/7/2021	(14.742)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées EUR
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
USD	1.575.474	KRW	1.753.230.000	UBS	18/8/2021	(5.456)
USD	79.296	RUB	5.984.000	Goldman Sachs	16/6/2021	(1.764)
USD	13.582	RUB	1.060.000	HSBC	16/6/2021	(693)
USD	297.168	RUB	22.572.000	UBS	16/6/2021	(8.243)
USD	91.789	RUB	6.796.000	BNP Paribas	21/7/2021	(216)
USD	205.511	RUB	15.895.000	Goldman Sachs	21/7/2021	(8.014)
USD	92.907	RUB	7.081.000	UBS	21/7/2021	(2.461)
USD	91.835	RUB	6.827.000	BNP Paribas	18/8/2021	(218)
USD	258.849	TWD	7.341.957	Barclays Bank	16/6/2021	(6.562)
USD	19.728	TWD	548.000	BNP Paribas	16/6/2021	(156)
USD	1.377.914	TWD	38.617.043	HSBC	16/6/2021	(21.057)
USD	19.695	TWD	545.000	Barclays Bank	21/7/2021	(176)
USD	510.901	TWD	14.412.000	State Street Bank & Trust Company	21/7/2021	(12.771)
USD	174.127	TWD	4.919.000	UBS	21/7/2021	(4.563)
USD	737.636	TWD	20.195.000	Deutsche Bank	18/8/2021	(2.487)
ZAR	1.347.961	EUR	78.011	BNP Paribas	17/6/2021	2.134
ZAR	2.479.000	EUR	133.230	Goldman Sachs	17/6/2021	14.162
ZAR	361.000	EUR	20.433	UBS	17/6/2021	1.031
ZAR	1.933.000	EUR	109.532	Goldman Sachs	21/7/2021	4.805
ZAR	946.000	EUR	54.079	HSBC	21/7/2021	1.878
ZAR	1.328.000	EUR	77.229	Morgan Stanley	21/7/2021	1.322
ZAR	650.000	EUR	36.978	UBS	21/7/2021	1.468
ZAR	148.000	EUR	8.550	Goldman Sachs	18/8/2021	168
ZAR	2.668.000	EUR	154.488	Morgan Stanley	18/8/2021	2.662
ZAR	442.000	EUR	25.634	State Street Bank & Trust Company	18/8/2021	400
						260.832

Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	65	GBP	56	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
GBP	4.320	EUR	4.976	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	39
						39

Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	116	USD	141	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1
USD	6.045	EUR	5.002	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(51)
						(50)
Total (Exposition brute sous-jacente - EUR 75.447.900)						260.821

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Gouvernement	80,04
Portefeuille de titres à la valeur de marché	80,04
Autres éléments de l'actif net	19,96
<hr/>	
	100,00

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

		Valeur de marché GBP	% de l'actif net			Valeur de marché GBP	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Royaume-Uni suite			
				GBP 3.000.000	Citibank NA 0,065% 2/9/2021	3.000.000	2,11
				GBP 2.000.000	Goldman Sachs International RegS 9/8/2021 (Zero Coupon)	1.999.704	1,41
				GBP 2.000.000	Handelsbanken Plc 0,075% 4/8/2021	2.000.000	1,41
				GBP 3.000.000	National Bank of Canada 0,03% 8/10/2021	3.000.000	2,11
				GBP 5.000.000	Nationwide Building Society 0,05% 1/6/2021	5.000.000	3,52
				GBP 1.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0,10% 24/9/2021	1.000.000	0,71
				GBP 2.000.000	Standard Chartered Bank 12/8/2021 (Zero Coupon)	1.999.586	1,41
				GBP 3.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0,10% 20/9/2021	3.000.000	2,11
				GBP 4.000.000	Toronto-Dominion Bank 12/7/2021 (Zero Coupon)	3.999.730	2,82
						30.999.020	21,84
						66.994.986	47,19
ACTIONS ORDINAIRES				BILLET DE TRÉSORERIE			
Bermudes				Belgique			
51.586	Hiscox Ltd	404.537	0,29	GBP 5.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 14/6/2021 (Zero Coupon)	4.999.911	3,52
58.129	Lancashire Holdings Ltd	366.213	0,26			4.999.911	3,52
		770.750	0,55				
Royaume-Uni				Finlande			
41.341	J D Wetherspoon Plc	544.461	0,38	GBP 1.000.000	Nordea Bank Abp RegS 16/8/2021 (Zero Coupon)	999.833	0,71
68.625	JET2 Plc	926.438	0,65	GBP 4.000.000	Nordea Bank Abp RegS 14/10/2021 (Zero Coupon)	3.998.595	2,82
188.041	Moonpig Group Plc	878.904	0,62	GBP 2.000.000	OP Corporate Bank Plc RegS 2/6/2021 (Zero Coupon)	1.999.997	1,41
15.131	SSP Group Plc	44.500	0,03	GBP 3.000.000	OP Corporate Bank Plc RegS 12/7/2021 (Zero Coupon)	2.999.831	2,11
178.157	Taylor Wimpey Plc	305.361	0,22	GBP 1.000.000	OP Corporate Bank Plc RegS 5/1/2022 (Zero Coupon)	999.702	0,70
		2.699.664	1,90			10.997.958	7,75
		3.470.414	2,45				
Total des actions ordinaires				Total des Certificats de dépôts			
CERTIFICAT DE DÉPÔTS				France			
Belgique				GBP 7.000.000 Agence Centrale Des Organismes De RegS 8/6/2021 (Zero Coupon)			
GBP 1.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 6/7/2021 (Zero Coupon)	999.930	0,70	GBP 4.000.000	BRED Banque Populaire RegS 11/8/2021 (Zero Coupon)	6.999.893	4,93
		999.930	0,70	GBP 4.000.000	Dexia Credit Local RegS 5/7/2021 (Zero Coupon)	3.998.992	2,82
Japon				GBP 1.000.000	Dexia Credit Local RegS 26/8/2021 (Zero Coupon)	999.811	0,70
GBP 4.000.000	Mitsubishi Ufj Trust And Banking Corp 1/7/2021 (Zero Coupon)	3.999.747	2,82	GBP 4.000.000	LMA SA RegS 3/6/2021 (Zero Coupon)	3.999.991	2,82
GBP 3.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,08% 8/6/2021	3.000.000	2,11	GBP 1.000.000	LMA SA RegS 14/6/2021 (Zero Coupon)	999.975	0,70
GBP 2.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,09% 21/7/2021	2.000.000	1,41	GBP 1.000.000	Managed And Enhanced Tap Magenta Funding 1/6/2021 (Zero Coupon)	1.000.000	0,71
GBP 2.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 11/6/2021 (Zero Coupon)	1.999.950	1,41	GBP 1.000.000	Managed And Enhanced Tap Magenta Funding 2/6/2021 (Zero Coupon)	999.999	0,70
GBP 4.000.000	The Norinchukin Bank 13/8/2021 (Zero Coupon)	3.999.443	2,81			22.998.419	16,20
GBP 2.000.000	The Norinchukin Bank 24/8/2021 (Zero Coupon)	1.999.658	1,41				
		16.998.798	11,97				
Luxembourg				Irlande			
GBP 1.000.000	UBS AG 0,01% 17/6/2021	1.000.000	0,71	GBP 6.000.000	Matchpoint Finance Plc RegS 6/8/2021 (Zero Coupon)	5.998.807	4,22
		1.000.000	0,71			5.998.807	4,22
Pays-Bas							
GBP 1.000.000	ABN Amro Bank NV 4/8/2021 (Zero Coupon)	999.884	0,70				
GBP 4.000.000	ABN Amro Bank NV 6/8/2021 (Zero Coupon)	3.999.517	2,82				
GBP 4.000.000	Cooperatieve Rabobank UA RegS 9/8/2021 (Zero Coupon)	3.999.448	2,82				
		8.998.849	6,34				
Singapour							
GBP 3.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp 19/11/2021 (Zero Coupon)	2.998.577	2,11				
		2.998.577	2,11				
Suisse							
GBP 5.000.000	Zuercher Kantonalbank 22/6/2021 (Zero Coupon)	4.999.812	3,52				
		4.999.812	3,52				
Royaume-Uni							
GBP 4.000.000	Bank of America NA 0,03% 19/7/2021	4.000.000	2,82				
GBP 2.000.000	Bank of America NA 0,04% 3/8/2021	2.000.000	1,41				

L'Annexe des pages 590 à 610 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre	Description	Valeur de marché GBP	% de l'actif net
Luxembourg			
GBP 1.000.000	Albion Capital Corp SA RegS 28/7/2021 (Zero Coupon)	999.860	0,71
GBP 3.000.000	Sunderland Receivables SA 8/7/2021 (Zero Coupon)	2.999.726	2,11
		3.999.586	2,82
Pays-Bas			
GBP 2.000.000	Toyota Motor Finance Netherlands BV RegS 29/6/2021 (Zero Coupon)	1.999.935	1,41
		1.999.935	1,41
Suède			
GBP 3.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 29/10/2021 (Zero Coupon)	2.998.891	2,11
GBP 1.000.000	Swedbank AB RegS 10/11/2021 (Zero Coupon)	999.556	0,71
		3.998.447	2,82
États-Unis			
GBP 1.000.000	Mont Blanc Capital Corp RegS 16/8/2021 (Zero Coupon)	999.834	0,70
GBP 1.000.000	Sheffield Receivables Co LLC 1/6/2021 (Zero Coupon)	1.000.000	0,71
GBP 1.000.000	Sheffield Receivables Co LLC 1/9/2021 (Zero Coupon)	999.798	0,70
		2.999.632	2,11
	Total des billets de trésorerie	57.992.695	40,85
	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	128.458.095	90,49
Organismes de placement collectif			
Irlande			
13.336.448	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund (Dist) ⁻	13.336.448	9,39
		13.336.448	9,39
	Total des organismes de placement collectif	13.336.448	9,39
	Portefeuille de titres à la valeur de marché	141.794.543	99,88
	Autres éléments de l'actif net	169.390	0,12
	Total de l'actif net (GBP)	141.963.933	100,00
	⁻ Investissement dans un fonds de partie liée.		

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2021

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'échéance	Exposition brute sous-jacente GBP	Moins-value nette non réalisée GBP
Instruments financiers dérivés					
CONTRATS À TERME					
(480)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2021	Juin 2021	33.712.800	(1.353.294)
Total				33.712.800	(1.353.294)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) nettes non réalisées GBP
Instruments financiers dérivés						
OPÉRATIONS DE CHANGE À TERME EN COURS						
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	5.058	GBP	4.003	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(37)
GBP	20	CHF	26	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	—
						(37)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	25.423.254	GBP	22.014.631	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(113.491)
GBP	112.991	EUR	131.371	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(180)
						(113.671)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
GBP	3.889.484	JPY	598.308.693	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	38.045
JPY	17.164.872.487	GBP	113.019.282	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(2.525.392)
						(2.487.347)
Catégorie d'Actions couverte en USD						
GBP	218.523	USD	306.257	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	2.395
USD	18.628.327	GBP	13.389.171	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(243.008)
						(240.613)
Total (Exposition brute sous-jacente - GBP 149.725.917)						(2.841.668)

Répartition sectorielle au 31 mai 2021

	% de l'actif net
Finance	81,54
Organismes de placement collectif	9,39
Gouvernement	4,93
Biens de consommation cyclique	2,66
Titres hypothécaires	0,71
Communications	0,62
Biens de consommation non cyclique	0,03
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,88
Autres éléments de l'actif net	0,12
<hr/>	
	100,00

Annexe aux États Financiers

1. Organisation

BlackRock Strategic Funds (la « Société ») est une société anonyme établie selon la législation du Grand-Duché de Luxembourg comme société d'investissement à capital variable. La Société a été agréée par la Commission de surveillance du secteur financier (la « CSSF ») en tant qu'OPCVM conformément aux dispositions de la Partie I de la Loi de 2010 et est réglementée par cette loi.

La Société a nommé BlackRock (Luxembourg) S.A. comme Société de Gestion.

Au 31 mai 2021, la Société offrait les actions de 33 Compartiments (dénommés individuellement « Compartiment » et collectivement « Compartiments »). La Société est un fonds à Compartiments multiples, à responsabilité séparée entre ses Compartiments. Le passif de chaque Compartiment est distinct de celui des autres Compartiments, et la Société dans son ensemble n'est pas responsable, vis-à-vis de tierces parties, des passifs de chaque Compartiment. Chaque Compartiment sera constitué d'un portefeuille d'investissements séparé, tenu et investi conformément aux objectifs d'investissement applicables à ce Compartiment. Chaque Compartiment est un pool distinct d'actifs et est représenté par des actions distinctes, elles-mêmes divisées en catégories d'actions, comme indiqué à l'Annexe I.

Ces catégories d'actions ont des droits équivalents dans la Société, mais présentent des caractéristiques et des frais de vente différents, qui sont détaillés dans le Prospectus de la Société.

Catégories d'Actions lancées

Les Catégories d'Actions lancées au cours de l'exercice figurent à l'Annexe I.

Événements importants au cours de l'exercice

- ▶ Le Compartiment BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund libellé en EUR a été supprimé le 2 juin 2020.
- ▶ Le Compartiment BlackRock Asia Extension Fund libellé en USD a été supprimé le 17 juin 2020.
- ▶ Un nouveau Prospectus a été publié le 5 août 2020.
- ▶ Le 7 septembre 2020, le Compartiment BlackRock UK Emerging Companies Absolute Return Fund a changé de nom pour BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund.
- ▶ Robert Hayes a démissionné de sa fonction d'Administrateur du Conseil d'administration et Ursula Marchioni a été nommée Administratrice du Conseil d'administration, avec effet le 12 octobre 2020.
- ▶ À compter du 20 octobre 2020, le taux de la commission de gestion a été réduit de 1,50 à 1,10 % pour les Catégories D et I du Compartiment BlackRock Style Advantage Fund, et de 0,60 à 0,50 % pour la Catégorie Z.

- ▶ Avec effet le 29 octobre 2020, Paul Freeman a démissionné de ses fonctions de Président du Conseil d'administration et Denise Voss a été nommée présidente du Conseil d'administration.
- ▶ Le Compartiment BlackRock Macro Opportunities Fund libellé en USD a été supprimé le 4 novembre 2020.
- ▶ Un nouveau Prospectus a été publié le 30 novembre 2020.
- ▶ Le Compartiment BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund, libellé en EUR, a été lancé le 19 février 2021.
- ▶ Le Compartiment BlackRock Global Long/Short Equity Fund a changé de nom pour BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund.
- ▶ Un nouveau Prospectus a été publié le 08 mars 2021.
- ▶ Un nouveau Prospectus a été publié le 10 mars 2021.
- ▶ À compter du 17 mars 2021, Michael Gruener a démissionné de son poste d'Administrateur du Conseil.
- ▶ À compter du 3 mai 2021, Keith Saldanha a été nommé Administrateur au Conseil d'administration.
- ▶ Un nouveau Prospectus a été publié le 20 mai 2021.

2. Récapitulatif des principales règles comptables

Les états financiers ont été préparés conformément aux principes comptables généralement reconnus au Luxembourg et aux exigences juridiques et réglementaires relatives à la préparation des états financiers telles que prescrites par les autorités luxembourgeoises pour les OPCVM du Luxembourg, et avec les méthodes comptables suivantes :

(a) Évaluation des investissements, autres actifs et autres passifs

Les investissements, autres actifs et autres passifs de la Société sont évalués comme suit :

- ▶ les titres négociables cotés en bourse ou négociés sur un autre marché réglementé sont évalués sur la base du dernier cours disponible en vigueur à la date d'évaluation. Pour les titres négociés sur des marchés clôturant après la valorisation, les derniers cours connus à ce moment ou à un autre moment seront utilisés. Si ces titres ou autres actifs sont cotés ou négociés sur plusieurs bourses ou marchés réglementés, le Conseil d'administration peut, à sa discrétion, choisir à cet effet l'une de ces bourses ou l'un de ces marchés réglementés. Des écarts dans la valeur des titres peuvent être constatés, par exemple lorsque les marchés sous-jacents sont fermés au public au moment du calcul de la VL de certains Compartiments ou lorsque les gouvernements décident d'imposer des charges fiscales ou des frais de négociation sur les investissements étrangers. Par conséquent, le Conseil a mis en œuvre des techniques de juste valeur afin d'estimer la juste valeur de ces investissements. De tels titres et instruments dérivés seront évalués à leur valeur de réalisation probable

Annexe aux États Financiers suite

telle que déterminée par des personnes compétentes (les Administrateurs). En raison de l'incertitude inhérente au processus de juste valeur, ces valeurs estimées peuvent différer significativement des valeurs qui auraient été utilisées si un marché facile existait pour ces titres et des valeurs qui pourraient en fin de compte être recouvrées ;

- ▶ pour les titres non cotés ou les titres non négociés sur une bourse ou sur un autre marché réglementé (y compris les titres de fonds d'investissement fermés) ainsi que pour les titres cotés ou non cotés sur d'autres marchés pour lesquels aucun cours n'est disponible, ou les titres pour lesquels les cours ne sont pas, selon le Conseil, représentatifs de la juste valeur de marché, la valeur sera déterminée avec prudence et de bonne foi par le Conseil d'administration de la Société, sur la base des prix de cession ou d'acquisition attendus ;
- ▶ Dans le cas où un titre ou un actif déterminé ne peut pas être valorisé selon les méthodes visées ci-dessus, ou si le Conseil estime qu'une autre méthode de valorisation reflète plus fidèlement la juste valeur de ce titre ou de cet actif par rapport au but recherché, la méthode de valorisation de ce titre ou de tout autre actif sera, à sa discrétion, arrêtée. Des écarts dans la valeur des titres peuvent être constatés, par exemple lorsque les marchés sous-jacents sont fermés au public aux fins du calcul de la VL de certains Compartiments. Dans de telles circonstances, le Conseil pourra fixer certains seuils dont le dépassement entraînera un ajustement de la valeur de ces titres à leur juste valeur en appliquant une indexation spécifique. En outre, lorsque les gouvernements décident d'imposer des charges fiscales ou des frais de transaction sur les investissements étrangers, le Conseil peut ajuster la VL afin de refléter ces charges ;
- ▶ Au 31 mai 2021, la juste valeur ajustée appliquée à certains titres et/ou instruments dérivés est présentée dans le tableau ci-dessous :

Compartiment	Devise	Juste valeur	% de l'actif net
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	(1.884.137)	(0,27)
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	USD	1.813.155	5,23
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	121.991	0,35
BlackRock European Absolute Return Fund	EUR	10	0,00
BlackRock European Opportunities Extension Fund	EUR	0	0,00
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	USD	1.300.780	1,84
BlackRock Global Event Driven Fund	USD	4.728.655	0,08
BlackRock Style Advantage Screened Fund	USD	0	0,00
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund	USD	0	0,00
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	GBP	(11.262)	(0,01)

- ▶ Pour certains Compartiments qui ont mis fin à leurs activités et détenaient des titres non liquides à la date de clôture, la valeur de marché des titres non liquides a été provisionnée

par rapport à la valeur liquidative de chaque Compartiment respectif. Cela ramène effectivement la valeur des titres à zéro et une perte est comptabilisée dans le Compte de résultat et l'Évolution de l'actif net sous « Plus/(Moins)-value nette réalisée sur investissements » au cours de l'exercice au cours duquel la résiliation a eu lieu. Au 31 mai 2021, les Compartiments BlackRock Latin American Opportunities Fund (clôturé le 8 mars 2019) et BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund (clôturé le 13 mai 2019) détenaient des positions non liquides ouvertes, qui représentaient ensemble moins de 1,00% de la valeur liquidative des Compartiments au dernier point de valorisation avant la date de dissolution de chaque Compartiment. Si les titres illiquides sont subséquemment cédés ou si de la valeur en est tirée, les gains seront distribués aux actionnaires des Compartiments respectifs, proportionnellement à la détention de chaque actionnaire dans le Compartiment à la date de liquidation ;

- ▶ les investissements dans des organismes de placement collectif de type ouvert sont évalués sur la base de la dernière VL disponible des unités ou actions de cet organisme de placement collectif ;
- ▶ certains Compartiments peuvent choisir d'émettre des Catégories d'actions ayant différents Points de valorisation, appelés « Snap » ou « Close ». Le point de valorisation « Snap » prend en compte une valeur à une autre heure que celle de fermeture du marché, et le point de valorisation « Close » prend en compte la valeur selon les cours de fermeture du marché. Par conséquent, il est attendu que les valeurs nettes d'inventaire et la performance par Action de ces Catégories d'actions diffèrent les unes des autres, les Points de valorisation utilisés n'étant pas les mêmes. Au cours de l'exercice clos le 31 mai 2021, la Catégorie X de capitalisation couverte en AUD de BlackRock Style Advantage Fund a adopté un double point de valorisation. Ceci a entraîné une variation entre la VL de ce Compartiment telle que calculée en fonction des heures de valorisation Snap et Close. La VL de ce Compartiment présentée au Bilan est calculée selon le point de valorisation Snap. Au 31 mai 2021, le pourcentage de variation entre la VL Snap et la VL Close du Fonds était de 1,30%. Au 31 mai 2021, la VL et la VL par action de la Catégorie X de capitalisation couverte en AUD selon le point de valorisation Snap étaient de 28.272.345 AUD et de 81,21 AUD. Au 31 mai 2021, la VL et la VL par action de la Catégorie X de capitalisation couverte en AUD selon le point de valorisation Close étaient de 31.262.857 AUD et de 89,80 AUD ;
- ▶ prêts de titres : les titres sont livrés à un courtier tiers, conformément aux instructions de l'agent de prêt, et continuent à être évalués comme faisant partie intégrante des portefeuilles des Compartiments ;
- ▶ les actifs liquides comme les dépôts à terme et les instruments du marché monétaire sont évalués en fonction du coût amorti qui se rapproche de leur juste valeur ;
- ▶ les liquidités en banque et les actifs sont évalués à leur montant nominal ;

Annexe aux États Financiers suite

- ▶ les actifs comprenant notamment des créances recouvrables sur des intérêts et des dividendes, des créances recouvrables pour investissements vendus ainsi que des créances recouvrables pour des actions de Compartiments souscrites, sont évalués à leur valeur nominale, à moins qu'il ne s'avère improbable que cette valeur nominale puisse être recouvrée ;
- ▶ le passif comprenant, en particulier, les intérêts et les dividendes à payer, les revenus à distribuer, les sommes à payer pour les investissements achetés et les sommes à payer pour les actions de Compartiments à racheter sont évaluées à leur valeur nominale.
- ▶ Les états financiers ont été préparés sur la base de la continuité d'exploitation, sauf pour pour BlackRock Total Advantage Fund, qui a été liquidé le 24 août 2021. L'application de la base de la non-continuité d'exploitation n'a pas mené à d'importants ajustements de la VL publiée pour le Portefeuille.

(b) Gains et pertes nets réalisés sur les ventes de placements

Les gains et pertes nets réalisés sur les ventes de placements ont été déterminés selon la méthode du coût moyen.

(c) Produits/charges liés aux investissements, Comptes de trésorerie et instruments financiers dérivés

La Société constate les revenus des placements de la manière suivante :

- ▶ les produits/charges d'intérêts sont comptabilisés quotidiennement et comprennent l'amortissement des surcotes/décotes sur une base linéaire des escomptes ;
- ▶ les intérêts bancaires, les dépôts à terme et les intérêts créditeurs sur les dépôts du marché monétaire sont comptabilisés selon la méthode d'engagement ;
- ▶ les produits de dividendes sont constatés à la date ex-dividende et après déduction de la retenue à la source ;
- ▶ les revenus sur prêt de titres sont comptabilisés selon la comptabilité d'exercice ;
- ▶ les frais de rendements négatifs sur actifs financiers en relation avec un taux d'intérêt négatif sur les actifs détenus sont cumulés quotidiennement et comptabilisés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net tout au long du cycle de vie de l'instrument sous-jacent ;
- ▶ lorsqu'une obligation a été identifiée comme étant défaillante, l'accumulation des intérêts sur le titre défaillant est interrompue. Sur confirmation du défaut par les parties concernées, le montant recevable est sorti du bilan ;
- ▶ le taux d'intérêt indiqué sous la description, dans le Portefeuille de titres, est le taux d'intérêt applicable à la fin de la période et n'est donné qu'à titre indicatif, puisque ces obligations portent un intérêt à taux variable.

(d) Instruments financiers dérivés

Au cours de l'exercice, les Fonds ont conclu un certain nombre d'opérations de change à terme et de contrats à terme (futures) sur instruments financiers. Les opérations de change à terme et les contrats à terme ferme (« futures ») sur instruments financiers en cours sont évalués à la juste valeur de marché de clôture à la date de valorisation. Les excédents ou les déficits issus de ces procédures ou de contrats non réglés sont portés au poste plus-values/ (moins-values) non réalisées et sont inclus dans les Autres éléments de l'actif ou Autres éléments du passif (selon le cas) dans le Bilan. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les gains ou pertes nets réalisés lors du règlement ou de la clôture d'opérations de change à terme et de contrats à terme sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Les Compartiments peuvent vendre des options ou des swaptions d'achat et de vente couvertes et acheter des options ou des swaptions d'achat et de vente. Lorsque les Compartiments vendent et/ou achètent une option ou une swaption, un montant égal à la prime reçue ou payée par les Compartiments apparaît en tant que passif ou actif. Le passif correspondant à une option ou une swaption vendue et l'actif correspondant à une option ou une swaption achetée sont ensuite évalués aux prix du marché afin de refléter la valeur en cours de l'option ou de la swaption. Lorsqu'un titre est vendu ou acheté à travers l'exercice d'une option ou d'une swaption, la prime reçue (ou payée) est déduite de (ou ajoutée à) la base du titre vendu ou acheté. Lorsqu'une option ou une swaption expire (ou que les Compartiments effectuent une opération de clôture), les Compartiments réalisent un profit ou une perte sur l'option ou la swaption dans la mesure des primes reçues ou payées (ou un profit ou une perte dans la mesure où le coût des opérations de clôture est supérieur à la prime payée ou reçue). Pour les options de type contrat à terme, le Compartiment ne paie pas la prime à l'avance. Le Compartiment affiche une marge comme dans les contrats à terme ferme (« futures »), et la prime de l'option est évaluée quotidiennement au prix du marché. Les options/swaptions achetées à la valeur de marché et les options/swaptions vendues à la valeur de marché sont incluses dans le Bilan. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les gains ou pertes nets réalisés lors d'opérations d'expiration ou de clôture d'options et de swaptions sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Au cours de l'exercice, les Compartiments ont conclu des Contrats sur différence (« CFD »). Les CFD permettent aux investisseurs de prendre des positions longues synthétiques ou des positions courtes synthétiques avec une marge variable. Avec les CFD, à la différence des actions, l'acheteur est potentiellement redevable d'un montant beaucoup plus élevé que le montant payé sur marge.

Les positions en CFD sont prises sous réserve d'une charge financière quotidienne, appliquée à un taux préalablement convenu supérieur ou inférieur à l'indice de référence applicable. Les intérêts créditeurs et débiteurs correspondants

Annexe aux États Financiers suite

sont comptabilisés quotidiennement en tant qu'intérêts sur CFD dans une position nette, dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les intérêts créditeurs à recevoir et débiteurs à payer sont comptabilisés en une position nette, dans le Bilan, en tant qu'intérêts et dividendes à recevoir ou intérêts et dividendes à payer.

Les positions en CFD peuvent recevoir ou payer des dividendes dans les cas où une position est détenue le jour où un dividende a été déclaré. Les produits ou les charges pour dividendes sont comptabilisés à la date ex-dividende et après déduction des retenues à la source, en tant que dividendes de CFD, après déduction des retenues à la source, dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les produits pour dividendes à recevoir et les charges pour dividendes à payer sont comptabilisés, dans le Bilan, en une position nette en tant qu'intérêts et dividendes à recevoir ou intérêts et dividendes à payer.

La juste valeur de marché des CFD est déterminée par le prix négocié à la bourse où les titres ou autres actifs sous-jacents sont négociés ou admis à la négociation. Pour les titres sous-jacents négociés sur des marchés clôturant après l'évaluation, les derniers cours connus à ce moment ou à un autre moment peuvent être utilisés.

Les plus-values nettes non réalisées et les moins-values nettes non réalisées sur CFD sont incluses dans le Bilan à l'actif ou au passif (selon le cas).

La fluctuation de la valeur de marché, le cas échéant, est enregistrée en tant que variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les gains ou les pertes réalisés à l'échéance ou à l'extinction des CFD sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Les gains et pertes nets réalisés sur les ventes de CFD ont été déterminés sur la base des coûts selon le principe du « premier entré, premier sorti ».

Au 31 mai 2021, les Compartiments avaient des opérations de CFD non réglées, comprises dans les Sommes à recevoir pour placements vendus et les Placements achetés à payer, dans le Bilan. Les CFD sont indiqués séparément, dans le Portefeuille de titres.

Le Compartiment peut conclure des opérations de Swaps (« swaps »), dans lesquelles le Compartiment et une contrepartie conviennent de faire des versements périodiques nets sur la base d'un montant notionnel spécifié. Les opérations de swaps sont négociées de façon privée sur le marché de gré à gré (OTC) et peuvent être conclues en tant que contrat bilatéral (« swaps OTC ») ou faire l'objet d'une compensation centrale (« swaps faisant l'objet d'une compensation centrale »). Ces paiements périodiques perçus ou versés sont enregistrés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net en tant que, respectivement, gains et pertes réalisés. Les swaps sont valorisés sur la base des prix reçus quotidiennement

par le service d'établissement des prix du Compartiment, les chambres de compensation centrale ou les courtiers, lesquels prix sont obtenus à l'aide de courbes et modèles quotidiens de swaps qui tiennent compte de plusieurs facteurs (données des marchés) comme les flux de trésorerie actualisés, les échanges et les valeurs des instruments de référence sous-jacents.

Dans un swap faisant l'objet d'une compensation centrale, dès l'exécution du contrat de swap, celui-ci fait l'objet d'une novation en faveur d'une contrepartie de compensation et le Compartiment fait face à la contrepartie de compensation par l'intermédiaire d'un courtier. Au moment de conclure un swap faisant l'objet d'une compensation centrale, le Compartiment est tenu de déposer une marge initiale auprès du courtier sous la forme de numéraire ou de certains titres éligibles, pour un montant variant en fonction de la taille et du profil de risque du swap en question. Tout paiement initial effectué ou reçu lors de la conclusion d'un contrat de swap est considéré comme faisant partie du gain ou de la perte net(te) réalisé(e) du swap. La variation quotidienne de la valorisation des swaps faisant l'objet d'une compensation centrale est enregistrée comme un élément à recevoir ou à payer pour la marge de variation dans la position « Avoir en banque » ou « Découverts en banque » du Bilan jusqu'à ce que le swap faisant l'objet d'une compensation centrale soit résilié, un gain ou une perte net(te) réalisé(e) étant alors enregistré(e). La variation nette des plus-values ou moins-values nettes non réalisées et les gains et pertes nets réalisés sur les ventes d'opérations de swap sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les intérêts créditeurs à recevoir et débiteurs à payer sur des swaps sont constatés sur une base quotidienne et comptabilisés en une position nette, dans le Bilan, en tant qu'intérêts et dividendes à recevoir ou intérêts et dividendes à payer. Au 31 mai 2021, les Fonds avaient des opérations de swap non réglées qui sont incluses dans les postes « Sommes à recevoir pour investissements vendus » et « Sommes à verser pour investissements achetés » dans le Bilan. Les swaps sont indiqués séparément, dans le Portefeuille de titres.

Les gains et pertes nets réalisés sur les ventes de swaps ont été déterminés sur la base des coûts selon le principe du « premier entré, premier sorti ».

Les Compartiments peuvent acheter des « titres à déterminer » (To Be Announced Securities Contract ou TBAs). Il s'agit d'une pratique de négociation courante sur le marché des titres adossés à des créances hypothécaires, selon laquelle, en vertu d'un contrat acheté, l'acheteur a droit à un titre provenant d'un bloc de créances hypothécaires, à un prix fixe et à une date ultérieure. Au moment de l'achat, le titre exact n'est pas connu, mais ses principales caractéristiques sont précisées. Bien que le prix ait été fixé au moment de l'achat, la valeur principale n'a pas été finalisée. Un TBA n'étant pas réglé au moment de l'achat, un effet de levier peut être créé au sein d'un Compartiment. Acheter des titres TBA comporte un risque si la valeur du titre à acheter baisse avant la date de règlement. Risque supplémentaire : les parties contractantes ne seront peut-être pas à même d'honorer les engagements pris lors d'une telle transaction. Les TBA sont indiqués séparément, à la fin du portefeuille de titres.

Annexe aux États Financiers suite

Les Compartiments peuvent se défaire d'un engagement avant le règlement, s'ils le jugent opportun. Les produits des ventes de titres TBA ne peuvent être perçus avant la date de règlement stipulée au contrat. Pendant la durée de l'engagement de vente de titres TBA, des titres livrables équivalents, ou un engagement compensatoire d'achat de titres TBA (livrables à la date de l'engagement de vente ou avant), couvrent la transaction.

Si l'engagement de vente de titres TBA se conclut par l'acquisition d'un engagement d'achat compensatoire, le Compartiment réalise un bénéfice ou un déficit sur l'engagement, indépendamment de tout bénéfice ou déficit non réalisé sur le titre sous-jacent. Si le Compartiment livre des titres en vertu de l'engagement, il réalise un bénéfice ou un déficit sur la vente des titres en fonction du prix unitaire fixé à la date à laquelle l'engagement a été conclu.

Au 31 mai 2021, les Fonds avaient des opérations TBA non réglées, comprises dans les postes « Sommes à recevoir pour investissements vendus » et « Sommes à payer pour investissements achetés » du Bilan.

Les valeurs de marché des TBAs sont présentées dans le Bilan. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les gains et pertes nets réalisés sur les ventes de TBA sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Les gains et pertes nets réalisés sur les ventes de TBA ont été déterminés sur la base des coûts selon le principe du « premier entré, premier sorti ».

(e) Change

Le cours des titres de placement libellés en une devise autre que la devise de référence du Compartiment concerné a été converti au taux de change en vigueur au moment de l'achat. Les investissements et autres actifs et passifs libellés dans une devise autre que la devise de référence du Compartiment concerné ont été convertis au taux de change en vigueur à Luxembourg aux heures d'évaluation respectives du Compartiment, le 31 mai 2021. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les gains et pertes nets réalisés lors de la cession ou du règlement d'autres actifs ou passifs dans des devises autres que la devise de référence du Compartiment concerné sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Les revenus et les frais en devises autres que la devise de référence du Compartiment concerné ont été convertis aux taux de change en vigueur à la date d'opération.

Les taux de change suivants ont été utilisés pour convertir les investissements et autres actifs et passifs libellés, pour tous les Fonds, dans des devises autres que la devise de référence du Fonds concerné, aux points de valorisation respectifs des Fonds, le 31 mai 2021 :

Devise	Tous les Compartiments (à l'exception du BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund)		BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund et BlackRock UK Equity Absolute Return Fund
	EUR	USD	EUR	GBP
AED	0,2231	0,2723	0,2227	0,1921
ARS	0,0049	0,0060	0,0049	0,0042
AUD	0,6342	0,7740	0,6331	0,5462
BRL	0,1571	0,1917	0,1558	0,1353
CAD	0,6782	0,8277	0,6770	0,5841
CHF	0,9100	1,1106	0,9094	0,7837
CLP	0,0011	0,0014	0,0011	0,0010
CNH	0,1286	0,1570	0,1283	0,1108
CNY	0,1286	0,1570	0,1283	0,1108
COP	0,0002	0,0003	0,0002	0,0002
CZK	0,0393	0,0479	0,0393	0,0338
DKK	0,1345	0,1641	0,1345	0,1158
DOP	0,0145	0,0177	0,0145	0,0125
EGP	0,0523	0,0638	0,0522	0,0450
EUR	1,0000	1,2204	1,0000	0,8613
GBP	1,1611	1,4170	1,1626	1,0000
GHS	0,1412	0,1723	0,1409	0,1216
HKD	0,1056	0,1288	0,1054	0,0909
HUF	0,0029	0,0035	0,0029	0,0025
IDR	0,0001	0,0001	0,0001	0,0000
ILS	0,2523	0,3080	0,2518	0,2173
INR	0,0113	0,0138	0,0113	0,0097
JPY	0,0075	0,0091	0,0075	0,0064
KRW	0,0007	0,0009	0,0007	0,0006
KZT	0,0019	0,0023	0,0019	0,0016
LKR	0,0041	0,0051	0,0041	0,0036
MXN	0,0412	0,0502	0,0411	0,0355
MYR	0,1987	0,2425	0,1983	0,1711
NGN	0,0018	0,0022	0,0018	0,0015
NOK	0,0982	0,1198	0,0983	0,0846
NZD	0,5956	0,7268	0,5954	0,5129
PEN	0,2159	0,2635	0,2142	0,1860
PHP	0,0172	0,0210	0,0171	0,0148
PLN	0,2230	0,2721	0,2233	0,1920
QAR	0,2216	0,2705	0,2212	0,1909
RON	0,2033	0,2481	0,2034	0,1751
RUB	0,0112	0,0136	0,0111	0,0096
SEK	0,0988	0,1206	0,0986	0,0851
SGD	0,6199	0,7566	0,6192	0,5339
THB	0,0262	0,0320	0,0262	0,0226
TRY	0,0964	0,1177	0,0965	0,0831
TWD	0,0297	0,0362	0,0296	0,0256
UAH	0,0298	0,0364	0,0298	0,0257
USD	0,8194	1,0000	0,8179	0,7057
UYU	0,0187	0,0228	0,0187	0,0161
ZAR	0,0596	0,0727	0,0596	0,0513
ZMW	0,0364	0,0444	0,0363	0,0313

(f) États financiers combinés

Les comptes de chaque Compartiment sont exprimés dans la devise de référence des Compartiments. Les chiffres combinés de la Société sont exprimés en USD et comprennent le total des états financiers des différents Compartiments, convertis

Annexe aux États Financiers suite

si nécessaire. Pour la conversion du Bilan, le taux de change en vigueur aux points de valorisation respectifs des Compartiments au Luxembourg au 31 mai 2021 pour tous les Compartiments exprimés en EUR, à l'exclusion du Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, est :

	EUR
USD	0,8194

Pour le Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, le taux de change en vigueur à l'heure de valorisation du Compartiment au Luxembourg au 31 mai 2021 est :

	EUR
USD	0,8179

Pour les Compartiments BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund et BlackRock UK Equity Absolute Return Fund, le taux de change en vigueur au point de valorisation des Compartiments au Luxembourg au 31 mai 2021 est :

	GBP
USD	0,7057

Pour le compte de résultat et l'évolution de l'actif net, le taux de change suivant est le taux moyen calculé sur l'année pour tous les Compartiments exprimés en EUR, à l'exclusion du Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund :

	EUR
USD	0,8429

Pour le Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, le taux de change suivant est le taux moyen calculé sur l'année :

	EUR
USD	0,8430

Pour les Compartiments BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund et BlackRock UK Equity Absolute Return Fund, le taux de change suivant est le taux moyen calculé sur l'exercice :

	GBP
USD	0,7494

Les chiffres combinés dans la section Compte de résultat et évolution de l'actif net et dans le Bilan ont été calculés à l'aide des taux de change moyens tout au long de l'année. L'ajustement des taux de change obtenu, de 1.486.007.339 USD, représente la variation des taux de change entre le 1^{er} juin 2020 et le 31 mai 2021. Il s'agit d'un montant notionnel, qui n'a aucun impact sur l'actif net de chacun des Compartiments.

(g) Péréquation des revenus

La Société opère des arrangements d'égalisation des revenus en vue d'assurer que le montant de revenus nets constatés au sein d'un Fonds et attribuables à chaque action n'est pas influencé par l'émission, la conversion ou le rachat des actions du Fonds pendant un même exercice comptable.

L'égalisation des revenus est comprise dans le poste Mouvements du capital social dans la section Compte de résultat et évolution de l'actif net.

(h) Dilution

Le Conseil peut ajuster la VL par Action, pour un Compartiment, afin de réduire l'effet de « dilution » sur ce Compartiment. Il y a dilution lorsque le coût réel d'achat ou de vente des actifs sous-jacents d'un Compartiment diffère de la valeur comptable de ces actifs dans le Compartiment, en raison de facteurs tels que des frais de négociation et de courtage, des impôts et droits, un mouvement du marché et tout écart entre les prix d'achat et de vente des actifs sous-jacents. La dilution peut avoir un effet défavorable sur la valeur d'un Compartiment et, par conséquent, avoir un impact sur les Actionnaires. En ajustant la VL par Action, cet effet peut être réduit ou évité, et les Actionnaires peuvent être protégés de cet impact de la dilution. Le Conseil peut ajuster la VL d'un Compartiment si, un Jour de négociation donnée, le volume total des transactions effectuées sur des Actions de toutes les Catégories de ce Compartiment entraîne une augmentation ou une diminution nette des Actions dépassant un ou plusieurs seuils arrêtés par le Conseil pour le Compartiment en question. Le montant pour lequel la VL d'un Compartiment peut être ajustée un Jour de négociation donné est lié au coût attendu des opérations de marché pour ce Compartiment. Dans de telles circonstances, la VL du Compartiment concerné peut être ajustée d'un montant n'excédant pas 1,50 %, ou 3 % dans le cas des Compartiments obligataires, de la VL. Dans des circonstances exceptionnelles, les Administrateurs peuvent, dans l'intérêt des Actionnaires, décider d'augmenter temporairement le facteur de swing maximal indiqué ci-dessus et en informer les investisseurs. L'ajustement sera opéré à la hausse, si le mouvement net entraîne une augmentation du nombre de toutes les Actions du Compartiment, et à la baisse, s'il entraîne une diminution de ce nombre.

Étant donné que certains marchés boursiers et juridictions peuvent avoir des structures de tarification différentes côté achat et côté vente, notamment en ce qui concerne les droits et taxes, l'ajustement qui en résulte peut être différent pour les entrées nettes et les sorties nettes. Par ailleurs, les Administrateurs peuvent également décider d'inclure des charges fiscales extraordinaires dans le montant de l'ajustement. Ces charges fiscales extraordinaires varient d'un marché à l'autre et il est actuellement prévu qu'elles ne dépassent pas 2,5 % de la VL. Si un Compartiment investit essentiellement dans certains types d'actifs, comme des obligations d'État ou des titres sur un marché monétaire, les Administrateurs peuvent décider qu'un tel ajustement n'est pas approprié. Conformément au Prospectus, cet ajustement de dilution a été appliqué à BlackRock Global Real Asset Securities Fund au 31 mai 2021.

Annexe aux États Financiers suite

Au cours de la période financière allant du 1^{er} juin 2020 au 31 mai 2021, des ajustements de dilution ont été appliqués à tous les Compartiments.

La VL par action publiée/négociée est indiquée dans le Récapitulatif des valeurs liquidatives sur trois ans et peut comprendre un ajustement pour dilution. Cet ajustement n'est pas constaté dans le Bilan ni dans la section intitulée Compte de résultat et évolution de l'actif net.

(i) Frais de transaction

Les coûts de transaction sont des coûts incrémentiels directement attribuables à l'acquisition, à l'émission ou à la cession de titres et d'instruments dérivés. Un coût incrémentiel est un coût qui ne serait pas appliqué si l'entité n'avait pas acquis, émis ou cédé le titre. Lorsqu'un titre est initialement constaté, il est évalué à sa valeur de marché, plus les coûts de transaction directement attribuables à l'acquisition ou à l'émission du titre.

Les coûts de transaction, à l'exclusion des commissions par opération du Dépositaire pour l'achat ou la vente de titres, sont compris dans les gains / (pertes) nets réalisés ou dans la variation nette des plus-values / (moins-values) non réalisées, dans la section intitulée Compte de résultat et évolution de l'actif net de chaque Compartiment. Les commissions par opération du Dépositaire sont comprises dans les commissions du Dépositaire dans la section intitulée Compte de résultat et évolution de l'actif net. Pour de plus amples informations, voir la Note.

(j) Devises étrangères sur autres opérations

Les devises étrangères sur les autres transactions se rapportent aux appréciations ou dépréciations réalisées et non réalisées sur les soldes de trésorerie et les contrats au comptant et sont présentées dans le Compte de résultat et l'Évolution de l'actif net.

3. Société de Gestion

BlackRock (Luxembourg) S.A. (la « Société de Gestion ») a été nommée par la Société pour exercer en tant que Société de Gestion. La Société de Gestion est autorisée à agir en qualité de gestionnaire de portefeuilles, conformément au Chapitre 15 de la Loi de 2010.

La Société a signé un contrat de société de gestion avec la Société de Gestion. En vertu de ce contrat, la Société de Gestion se voit confier la gestion quotidienne de la Société ainsi que la responsabilité de l'exécution directe, ou par voie de délégation, des opérations liées à la gestion de portefeuilles de la Société, à son administration et à la commercialisation des Compartiments.

En accord avec la Société, la Société de Gestion a décidé de déléguer plusieurs de ses fonctions, comme qu'indiqué ultérieurement dans le Prospectus.

La Société de Gestion est une filiale à 100 % de BlackRock Group. Elle est réglementée par la CSSF.

4. Commissions de gestion et de distribution

Durant l'exercice, la Société a versé des commissions de gestion à la Société de Gestion.

La Société verse des commissions de gestion à un taux annuel indiqué à l'Annexe F du Prospectus. Le niveau des commissions de gestion varie de 0,37 % à 1,80 % de la VL, sauf pour les Actions de Catégorie X, qui ne donnent lieu à aucune commission de gestion mais à une commission versée aux Gestionnaires financiers par délégation ou à leurs affiliées, en vertu d'un contrat. Le niveau des commissions de gestion varie en fonction du Compartiment et de la Catégorie d'Actions auxquels appartiennent les titres achetés par l'investisseur. Ces commissions courent de jour en jour, ont pour assiette la VL du Compartiment concerné et sont payées mensuellement. Certains coûts et certaines commissions, notamment celles des Gestionnaires financiers par délégation, sont payés à l'aide de la commission de gestion.

Lorsqu'un Fonds investit une part importante de son actif net dans d'autres organismes de placement collectif (« OPC »), le Gestionnaire financier par délégation veillera à ce que la totalité de la commission de gestion (à l'exclusion de toute commission de performance, s'il y a lieu) facturée à ce Fonds (y compris les commissions de gestion des autres OPCVM et OPC dans lesquels il investit) ne soit pas supérieure à 3,75 % de la VL du Fonds.

Au cours de l'exercice, les Fonds suivants ont fait l'objet d'une diminution de la commission de gestion pour les investissements dans les fonds cibles gérés par BlackRock comptabilisée dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net sous le poste « Remise sur la commission de gestion » :

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund, BlackRock European Select Strategies Fund, BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund, BlackRock Fixed Income Strategies Fund, BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative, BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth et BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate.

Au cours de l'exercice, les Compartiments ci-dessous ont fait l'objet d'un remboursement de commissions de la part de la Société de Gestion, comptabilisé dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net sous le poste « Remboursement des dépenses » :

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund, BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund, BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund, BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund, BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund, BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, BlackRock Global Equity Absolute Return Fund, BlackRock Style Advantage Screened Fund, BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund, BlackRock Total Advantage Fund et BlackRock UK Equity Absolute Return Fund.

Annexe aux États Financiers suite

Au cours de l'exercice, la Société a versé des commissions de distribution à BlackRock Investment Management (UK) Limited, qui a agi en tant que Distributeur Principal.

La Société verse des commissions annuelles entre 1,25 % et 1,00 % de la VL pour les Actions de Catégorie C et 0,50 % de la VL pour les Actions de Catégorie E. Ces commissions courent de jour en jour, ont pour assiette la VL du Compartiment concerné (reflétant, le cas échéant, tout ajustement de la VL du Compartiment concerné) et sont payées mensuellement.

Les commissions de gestion et de distribution par Catégorie d'action et par Compartiment sont détaillées dans le Prospectus de la Société et le DICI pertinent. Les commissions de gestion et de distribution payables au 31 mai 2021 sont comprises dans le Bilan sous le poste « Dépenses cumulées et autres éléments du passif ».

5. Commission de service annuelle

La Société verse une Commission de service annuelle à la Société de Gestion.

Le niveau de la Commission de service annuelle peut varier, à la discrétion du Conseil et comme convenu avec la Société de Gestion. Il sera applicable à divers taux dans les différents Compartiments et les différentes Catégories d'Actions émis par la Société. Cependant, le Conseil et la Société de Gestion ont décidé d'un commun accord que la Commission de service annuelle actuellement versée ne devra pas dépasser 0,30 % par an. Elle est calculée quotidiennement, sur la base de la VL de la Catégorie d'Actions concernée, et versée tous les mois.

Le Conseil et la Société de Gestion fixent le niveau de la Commission de service annuelle à un taux visant à assurer que le total des frais sur encours de chaque Compartiment reste compétitif en comparaison avec un vaste marché de produits d'investissement similaires offerts aux investisseurs dans les Compartiments, en tenant compte d'un certain nombre de critères comme le secteur marchand du Compartiment et la performance de ce dernier par rapport à ses homologues.

La Commission de service annuelle est utilisée par la Société de Gestion pour couvrir tous les coûts et dépenses de fonctionnement et d'administration, fixes et variables, supportés par la Société, à l'exception des commissions de dépositaire, des commissions de distribution, des commissions de prêts de titres et de tous coûts découlant d'emprunts (y compris, afin d'éviter toute ambiguïté, toute commission d'engagement qui pourrait être due au prêteur), ainsi que de tous les coûts de services professionnels associés aux demandes de remboursement de la retenue à la source (plus toutes taxes ou tous intérêts y afférents) et de toute taxe concernant les investissements ou la Société. Toutes commissions d'engagement découlant d'emprunts ou tous frais de services professionnels liés aux demandes de remboursement de la retenue à la source seront alloués aux Compartiments concernés sur une base juste et équitable.

Ces coûts et dépenses de fonctionnement et d'administration comprennent toutes dépenses et autres coûts recouvrables

d'une tierce partie supportés par ou pour le compte de la Société, le cas échéant, y compris mais de façon non limitative les commissions d'agent comptable du compartiment, les commissions d'agent de transfert (notamment les frais de négociation du sous-agent de transfert et de la plateforme associée), tous les coûts professionnels tels que les commissions de consultants, de conseillers juridiques et de conseillers fiscaux et les frais d'audits, les commissions des Administrateurs, les frais de voyage, les débours raisonnables, les frais d'impression, de publication et de traduction et tous les autres coûts liés aux rapports aux actionnaires, les droits de dépôt et les droits de permis, les frais des banques correspondantes et autres frais bancaires, le support technique et l'entretien des logiciels, les coûts et dépenses opérationnels attribués aux équipes de Services aux Investisseurs et autres services d'administration globaux fournis par différentes sociétés du BlackRock Group.

La Société de Gestion assume le risque financier de veiller à ce que le total des frais sur encours des Compartiments reste compétitif. Par conséquent, la Société de Gestion est en droit de conserver tout montant de la Commission de service annuelle qui lui est versée et qui dépasserait les dépenses réelles supportées par la Société durant un exercice donné, considérant que tous coûts et dépenses supportés par la Société au cours d'un exercice donné qui dépasseraient le montant de la Commission de service annuelle versé à la Société de Gestion seront à la charge de la Société de Gestion ou d'une autre société du BlackRock Group.

La Commission de service annuelle payable au 31 mai 2021 est comprise dans le Bilan sous le poste « Dépenses cumulées et autres éléments du passif ».

Les Administrateurs de la Société qui ne sont pas des employés du BlackRock Group ont reçu une rémunération annuelle brute de 30.000 EUR en contrepartie des tâches accomplies durant l'exercice clos le 31 mai 2021. La présidente reçoit une rémunération annuelle brute de 33.500 EUR. Les Administrateurs qui sont également des employés de BlackRock Group n'ont droit à aucune rémunération en tant qu'Administrateur.

Vous trouverez ci-dessous les commissions versées à Deloitte Audit S.à r.l. pour l'exercice clos le 31 mai 2021.

	31 mai 2021 EUR
Services d'audit et services liés à l'audit (hors TVA)	440.500
Services non liés à l'audit	–

6. Commissions du Dépositaire

Le Dépositaire reçoit une commission pour chaque Compartiment. Ces commissions rémunèrent le Dépositaire pour ses services de dépôt et les coûts par opération de chaque Compartiment.

Les frais de garde varient en fonction de la valeur des actifs sous gestion et du pays dans lequel les actifs sont détenus. Les frais de transaction varient en fonction du type de transaction et du pays dans lequel la transaction a lieu.

Annexe aux États Financiers suite

Les volumes d'opérations et la répartition de l'actif pour chaque Compartiment varient en fonction de la stratégie d'investissement du Compartiment concerné. Les commissions du Dépositaire regroupées de chaque Compartiment dépendent de la ventilation de ses actifs et de ses opérations au fil du temps.

Les commissions du Dépositaire payables au 31 mai 2021 sont comprises dans le Bilan sous le poste « Dépenses cumulées et autres éléments du passif ».

7. Commission de performance

Une commission de performance peut être payable pour chaque Catégorie d'Actions de chaque Compartiment, à l'exception des actions de Catégorie X, en sus des commissions et des dépenses mentionnées dans le présent Prospectus. La commission de performance est cumulée chaque Jour de valorisation et est égale à 8, 20 ou 30 % (selon la règle applicable au Compartiment correspondant, comme détaillé en Annexe E du Prospectus) du montant du rendement de la VL par action excédant le rendement de l'indice de référence approprié, comme décrit plus en détails en Annexe E du Prospectus. Deux méthodes de calcul, la méthode de Type A et la méthode de Type B, sont utilisées – la méthode applicable à chaque Compartiment est indiquée à l'Annexe E du Prospectus. Vous pourrez obtenir de plus amples informations auprès de l'équipe locale de Services aux Investisseurs et du siège de la Société.

La cristallisation de la commission de performance a lieu le dernier jour de chaque Période de Performance ou lorsqu'un actionnaire fait racheter ou convertir tout ou partie de ses actions avant la fin de la Période de Performance.

Les commissions de performance payables au 31 mai 2021 sont incluses dans le Compte de résultat et l'Évolution de l'actif net sous le poste « Commissions de performance ».

8. Fiscalité

L'impôt luxembourgeois sur les souscriptions, l'impôt belge, l'impôt sur les plus-values réalisées et non réalisées sont présentés dans le Compte de résultat et l'Évolution de l'actif net sous le poste « Impôt ». Pour l'exercice clos le 31 mai 2021, 15.854.109 USD ont été facturés au titre des Impôts.

Luxembourg

La Société est une société d'investissement régie par le droit luxembourgeois. En conséquence, la Société n'est assujettie à aucun impôt sur le revenu ou sur les plus-values. Cependant, elle est assujettie à une taxe d'abonnement calculée au taux annuel de 0,05 % de la VL de chaque Compartiment à la fin de chaque trimestre, et, dans le cas de toutes les actions de Catégorie I, de Catégorie IA, de Catégorie J, de Catégorie T et de Catégorie X, de 0,01 % de la VL de chaque Compartiment à la fin de chaque trimestre. Pour l'exercice clos le 31 mai 2021, 7.586.755 USD ont été imputés au titre de la taxe luxembourgeoise.

Belgique

La Société est enregistrée auprès de l'autorité des services et marchés financiers en Belgique en application de l'article 154

de la loi amendée du 3 août 2012 relative aux opérations financières et aux marchés financiers. Les fonds enregistrés à des fins de distribution publique en Belgique sont soumis à une taxe annuelle de 0,0925 % de la VL des parts distribuées en Belgique via des intermédiaires belges au 31 décembre de l'année précédente. Pour l'exercice clos le 31 mai 2021, 449.073 USD ont été facturés au titre de l'impôt belge.

Royaume-Uni

Fonds déclarants

Le régime des Fonds déclarants au Royaume-Uni s'applique à la Société. Suivant ce régime, les personnes investissant dans des Fonds Déclarants au Royaume-Uni sont imposables sur la part de revenu du Fonds Déclarant au Royaume-Uni attribuable à leurs avoirs dans ce fonds, que le revenu soit distribué ou non, mais toute plus-value sur une cession de leurs avoirs est assujettie à un impôt sur les plus-values. Une liste des Compartiments qui possèdent actuellement le statut de Fonds Déclarant au Royaume-Uni est disponible à l'adresse <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>.

Autres taxes sur les transactions

D'autres pays peuvent imposer des taxes, taxes sur les transactions financières (« TTF ») ou autres taxes sur les transactions portant sur certains actifs détenus par les Compartiments (par exemple, les droits de timbre au Royaume-Uni et la TTF en France).

Retenue à la source

Les dividendes, intérêts et plus-values (le cas échéant) réalisés par la Société au titre de ses investissements peuvent être soumis à des retenues à la source dans les pays d'origine, qui généralement ne peuvent être récupérées, puisque la Société elle-même est exonérée d'impôt sur les revenus. Cependant, un récent précédent en Union européenne pourrait réduire le montant de cette retenue non récupérable. Les investisseurs sont invités à s'informer et, si nécessaire, à consulter leur conseiller sur les conséquences fiscales possibles de la souscription, de l'achat, de la détention, du rachat, de la conversion ou de la vente des Actions dans le pays dont ils sont ressortissants, ou dans lequel ils sont soit domiciliés soit résidents. Les investisseurs doivent prendre note du fait que l'assiette, les taux d'imposition ainsi que les exonérations fiscales existantes, peuvent changer. Les éventuels frais de retenue à la source sont indiqués de façon plus détaillée dans le Prospectus.

La retenue à la source est incluse dans le Compte de résultat et l'Évolution de l'actif net sous le poste « Dividendes, nets de précompte mobilier ».

Les dividendes reçus par la Société pour les CFD peuvent faire l'objet d'une retenue à la source. La retenue à la source pour les CFD sur les instruments de capitaux propres américains est notamment réglementée conformément à l'Article 871(m) de l'Internal Revenue Code (« IRC »). Cette retenue à la source est incluse dans le Compte de résultat et l'Évolution de l'actif net sous le poste « Contrats de dividendes différentiels, nets de précompte mobilier ».

Annexe aux États Financiers suite

9. Gestionnaires Financiers par délégation et Sous-gestionnaires Financiers par délégation

La Société de Gestion, BlackRock (Luxembourg) S.A., a délégué les services de gestion et de conseil en investissement aux Gestionnaires Financiers par délégation : BlackRock Financial Management, Inc. (BFM Inc.), BlackRock Institutional Trust Company N.A. (BTC), BlackRock Investment Management LLC (BIMLLC), BlackRock Investment Management (UK) Limited (BIM UK) et BlackRock (Singapore) Limited (BLKSin), comme indiqué dans le Prospectus.

Les Gestionnaires Financiers par délégation dispensent des services de conseil et de gestion dans les domaines de la sélection et de la ventilation stratégique des titres et des secteurs. BIM UK a sous-délégué certaines de ses fonctions à BlackRock Japan Co., Ltd. (BLKJap), BlackRock Investment Management (Australia) Limited (BLKAus) et BlackRock Asset Management North Asia Limited (BAMNA). Nonobstant la nomination de Gestionnaires financiers par délégation, la Société de Gestion reconnaît son entière responsabilité devant la Société s'agissant de toutes les transactions d'investissement.

Compartiment	Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation	Sous-Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	BTC	-
BlackRock Asia Extension Fund ⁽¹⁾	BTC	-
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	BIM UK	BAMNA
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	BIM UK, BIMLLC	BAMNA
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	BIM UK	-
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ⁽²⁾	BIM UK	-
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	BIM UK	BAMNA
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	BIM UK	BAMNA
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	BIM UK	-
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	BIM UK	-
BlackRock ESG Euro Bond Fund	BIM UK	-
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	BIM UK	-
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund ⁽³⁾	BIM UK	-
BlackRock European Absolute Return Fund	BIM UK	-
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾	BIM UK	-
BlackRock European Opportunities Extension Fund	BIM UK	-
BlackRock European Select Strategies Fund	BIM UK	-
BlackRock European Unconstrained Equity Fund	BIM UK	-
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	BIM UK	-
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	BIM UK, BLKSin	-
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	BTC, BIM UK, BFM Inc., BLKSin	BAMNA, BLKJap
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	BIM UK	-
BlackRock Global Event Driven Fund	BIMLLC	-
BlackRock Global Real Asset Securities Fund	BIMLLC, BIM UK, BFM Inc., BLKSin	-

Compartiment	Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation	Sous-Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	BFM Inc., BIMLLC, BLKSin	-
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	BIM UK, BIMLLC	BAMNA
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	BIM UK, BIMLLC	BAMNA
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	BIM UK, BIMLLC	BAMNA
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	BIM UK, BIMLLC	BAMNA
BlackRock Style Advantage Fund	BIMLLC	-
BlackRock Style Advantage Screened Fund	BIM UK, BIMLLC	-
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund	BIMLLC	-
BlackRock Systematic Global Equity Fund	BIMLLC	-
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund ⁽²⁾	BFM Inc.	-
BlackRock Total Advantage Fund	BIMLLC, BIM UK, BFM Inc.	-
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	BIM UK	-

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

10. Transactions avec des parties liées

La société holding faitière de la Société de Gestion, du Distributeur Principal et des Gestionnaires Financiers par délégation est BlackRock, Inc., société de l'État du Delaware, aux États-Unis.

Au cours de l'exercice, aucune transaction importante n'a été effectuée en dehors du cadre ordinaire de l'activité ou à des conditions autres que les conditions d'usage. Aucune des transactions de la Société n'a été effectuée par l'entremise des Sociétés BlackRock.

La Société a nommé BlackRock Advisors (UK) Limited (l'«Agent de prêt de titres»), une partie liée à la Société, comme agent de prêt de titres. L'Agent de prêt de titres assume tous les coûts opérationnels directement liés aux opérations de prêt de titres. Le revenu total généré par les opérations de prêt de titres est divisé entre le Compartiment concerné et l'Agent de prêt de titres. Les Compartiments qui effectuent des opérations de prêt de titres reçoivent au moins 62,5 %, tandis que l'Agent de prêt de titres reçoit jusqu'à 37,5 % de ces revenus.

Certains Compartiments utilisent des techniques d'investissements croisés, c'est-à-dire que les Compartiments investissent dans d'autres Compartiments du fonds à compartiments multiples de la Société. Le Bilan combiné ainsi que le Compte de résultat et l'Évolution de l'actif net n'ont pas été ajustés pour éliminer l'impact des investissements croisés. Les commissions sur les souscriptions et les rachats, ainsi que les commissions de gestion, n'ont pas été appliquées aux actifs du compartiment investis dans d'autres Compartiments.

Annexe aux États Financiers suite

Le tableau ci-dessous présente la valeur de ces investissements croisés dans le portefeuille de titres du Compartiment concerné, au 31 mai 2021 :

Compartiment	Compartiment d'investissements croisés	Devise	Valeur de marché	% de l'actif net
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Systematic ESG World Equity Fund X2 (GBP)	EUR	50.450.912	4,10

11. Dividendes

Pour les Catégories d'Actions de capitalisation, la politique actuelle des Administrateurs est de conserver et de réinvestir tout le revenu net.

Pour les Catégories d'Actions de Distribution, la politique est de distribuer la quasi-totalité du revenu des investissements (le cas échéant) pour l'exercice après déduction des dépenses (ou du revenu brut dans le cas des Actions de Distribution (G)). Les Administrateurs peuvent également déterminer si et dans quelle mesure les dividendes peuvent comprendre les distributions de plus-values non réalisées nettes et réalisées nettes. Si des Catégories d'Actions de Distribution versent des dividendes comprenant des plus-values nettes réalisées ou des plus-values nettes non réalisées, ou dans le cas de Compartiments qui distribuent le revenu brut, les dividendes peuvent comprendre le capital initialement souscrit. Les Actionnaires sont priés de noter que lorsque les dividendes sont distribués de cette façon, ils peuvent être imposables en tant que revenu, selon la législation fiscale locale, et qu'à cet égard il conviendrait aux Actionnaires de prendre conseil auprès de leur conseiller fiscal professionnel.

Lorsqu'un Fonds bénéficie du statut de Fonds Déclarant au Royaume-Uni et que ses revenus déclarés dépassent les distributions effectuées, l'excédent sera considéré comme un revenu réputé distribué et sera imposé en tant que revenu, conformément au statut fiscal de l'investisseur.

La Société peut opérer des arrangements d'égalisation des revenus en vue d'assurer que le montant de revenus nets constatés au sein d'un Fonds (ou de revenus bruts dans le cas des Actions de Distribution (G)) et attribuables à chaque Action n'est pas influencé par l'émission, la conversion ou le rachat desdites Actions pendant un même exercice comptable.

12. Prêts de titres

Le tableau ci-dessous fournit la valeur des titres sur prêt et des garanties connexes reçues au 31 mai 2021 :

Compartiment	Devise	Valeur des titres en prêt	Valeur des garanties reçues
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	USD	3.898.531	4.265.964

Compartiment	Devise	Valeur des titres en prêt	Valeur des garanties reçues
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	EUR	26.644.683	29.846.066
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ⁽¹⁾	GBP	4.031.903	4.360.805
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	USD	867.042	964.102
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	USD	46.661.210	52.894.783
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	USD	65.789.101	72.964.785
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	USD	3.836.626	4.214.196
BlackRock ESG Euro Bond Fund	EUR	60.097.187	63.213.045
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	EUR	5.966.736	6.250.984
BlackRock European Absolute Return Fund	EUR	29.563.508	32.416.458
BlackRock European Opportunities Extension Fund	EUR	48.724.811	54.410.035
BlackRock European Select Strategies Fund	EUR	26.129.271	29.042.095
BlackRock European Unconstrained Equity Fund	EUR	3.053.718	3.428.716
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	EUR	22.038.288	24.508.308
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	EUR	228.948.121	245.017.491
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	EUR	3.910.576	4.334.767
BlackRock Global Event Driven Fund	USD	45.023.912	48.632.237
BlackRock Global Real Asset Securities Fund	USD	20.095.831	23.808.226
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	EUR	6.936.371	7.861.530
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	EUR	13.626.744	15.474.309
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	EUR	12.618.938	14.195.959
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	EUR	12.038.195	13.341.271
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund	USD	17.720.893	20.112.435
BlackRock Systematic Global Equity Fund	USD	6.542.238	7.262.706

⁽¹⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

Le revenu perçu durant l'exercice par les Compartiments et issu des opérations de prêt de titres est indiqué dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net des Compartiments, sous le poste « Prêts de titres ». Les titres sur prêt sont signalés comme tels dans le Portefeuille de titres.

13. Frais de transaction

Pour atteindre son objectif d'investissement, un Fonds engagera des coûts de transaction en lien avec l'activité de négociation dans son Portefeuille de titres. Dans le tableau ci-dessous, sont identifiables séparément les coûts de transaction engagés par chaque Compartiment pour l'exercice

Annexe aux États Financiers suite

clos le 31 mai 2021. Ceci comprend les commissions des courtiers et les frais de règlement.

Compartiment	Devise	Coûts de transaction
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	22.463
BlackRock Asia Extension Fund ⁽¹⁾	USD	-
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	USD	192.115
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	-
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	EUR	262.313
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ⁽²⁾	GBP	46.306
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	USD	34.150
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	USD	2.408.142
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	USD	879
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	USD	-
BlackRock ESG Euro Bond Fund	EUR	-
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	EUR	-
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund ⁽³⁾	EUR	-
BlackRock European Absolute Return Fund	EUR	296.259
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund ⁽¹⁾	EUR	-
BlackRock European Opportunities Extension Fund	EUR	552.396
BlackRock European Select Strategies Fund	EUR	311.023
BlackRock European Unconstrained Equity Fund	EUR	41.928
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	EUR	1.368
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	EUR	5
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	EUR	84
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	USD	55.599
BlackRock Global Event Driven Fund	USD	281.071
BlackRock Global Real Asset Securities Fund	USD	531.575
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	USD	-
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	EUR	12.056
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	EUR	13.194
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	EUR	64.407
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	EUR	99.724
BlackRock Style Advantage Fund	USD	-
BlackRock Style Advantage Screened Fund	USD	-
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund	USD	322.266
BlackRock Systematic Global Equity Fund	USD	307.974
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund ⁽²⁾	USD	-
BlackRock Total Advantage Fund	EUR	-
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	GBP	268

⁽¹⁾ Compartiment dissous, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations..

Tous les coûts de transaction ne sont pas identifiables séparément. Pour les CFD, les swaps, les opérations de change à terme, les contrats futures, les options, les swaptions et les TBA, les coûts de transaction sont compris dans le prix d'achat et de vente de l'investissement. Bien qu'ils ne soient pas identifiables séparément, ces coûts de transaction sont pris en compte dans la performance de chaque Compartiment. Les coûts d'impact sur le marché ne sont pas identifiables séparément et par conséquent ne figurent pas dans le tableau ci-dessus.

14. Facilité de crédit

Une facilité de crédit de 2 milliards d'USD arrangée par JPMorgan Chase Bank N.A. (« JPMorgan ») va permettre à la Société de disposer d'une tranche engagée de 1,23 milliard d'USD. La portion de la facilité de crédit de 1,23 milliard d'USD sera répartie entre les Compartiments, sur la base de l'avis de répartition daté du 23 avril 2021.

Cette facilité de crédit sera utilisée par les Compartiments à des fins de financement temporaire, y compris, sans s'y restreindre, le financement des rachats demandés par les investisseurs. Les intérêts et les commissions d'engagement en lien avec les montants prélevés sur cette facilité de crédit sont couverts par les actifs des Compartiments concernés. Un nouveau Compartiment ne fera pas automatiquement l'objet d'une ligne de crédit et devra par conséquent être ajouté au moyen d'un processus d'adhésion. Ce processus comprend, entre autres, tout contrôle préalable nécessaire effectué par les prêteurs, dans le but d'autoriser l'ajout de nouveaux Fonds. Durant cet exercice clos, ces Fonds ne feront l'objet d'aucune ligne de crédit, ni ne pourront faire de prélèvements sur une quelconque ligne de crédit. De plus, rien ne garantit que l'ajout de nouveaux Fonds sera approuvé par les prêteurs, ni que le crédit sera disponible pour un Fonds puisque la ligne de crédit est fonction de la disponibilité (sur une base d'allocation équitable) pour les Fonds et autres fonds BlackRock parties à la convention de crédit. À ce titre, certains Compartiments peuvent ne pas faire l'objet de la ligne de crédit et ne supporteront aucuns frais associés à cette dernière.

Une commission d'engagement de prêt est facturée en relation avec cette facilité de crédit, et est comprise dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif sous le poste « Commissions d'engagement de prêt ». La commission d'engagement de prêt facturée est de 0,10 % de l'encours.

Aucune partie de la facilité de crédit n'a été utilisée au cours de l'exercice clos le 31 mai 2021.

15. Montants dus par/au Courtier

Le poste du par/aux courtiers du Bilan correspond à une garantie en numéraire et une marge payée aux/reçue par les courtiers de compensation du Compartiment et différentes contreparties.

16. Total des frais sur encours

Le total des frais sur encours (« TFE ») correspond au total de tous les frais (en excluant les intérêts bancaires et les frais de rendements négatifs sur actifs financiers et les remboursements de frais) divisé par l'actif net moyen des Catégories d'actions, exprimé en pourcentage. Toutes les données sont annualisées.

Les Commissions de gestion peuvent être utilisées en partie pour payer la rémunération relative aux activités de distribution de la Société. Un remboursement peut être versé aux investisseurs institutionnels qui, d'un point de vue commercial, détiennent des actions de la Société pour des tierces parties.

Annexe aux États Financiers suite

Le TFE pour l'exercice allant du 1^{er} juin 2020 au 31 mai 2021 est le suivant :

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de capitalisation en AUD	2,142 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation en EUR	2,129 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	2,099 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,130 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	2,130 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	2,147 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	1,637 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,607 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,634 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,632 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,603 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1,326 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	1,360 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	1,364 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,331 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,361 %	-
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	2,819 %	0,989 %
	Action de Catégorie A de capitalisation en EUR	3,141 %	1,274 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	3,108 %	1,265 %
	Action de Catégorie D de capitalisation	3,327 %	1,959 %
	Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	2,982 %	1,637 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	2,537 %	1,201 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	3,499 %	2,128 %
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	3,182 %	0,818 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	3,377 %	0,987 %
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,079 %	-
	Action de Catégorie Z de capitalisation	2,484 %	1,367 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	1,425 %	0,355 %
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	2,367 %	1,255 %	
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	4,905 %	3,002 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	4,583 %	2,696 %
	Action de Catégorie D de capitalisation	1,643 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	4,306 %	2,911 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	5,372 %	2,991 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,140 %	-
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	3,572 %	2,667 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,391 %	2,467 %
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3,848 %	2,944 %	
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,552 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,546 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation	1,575 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,860 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	2,052 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,631 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	0,615 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	0,630 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	0,608 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,621 %	-
Action de Catégorie X de capitalisation	0,082 %	-	

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à
			la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ⁽¹⁾	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	3,544 %	1,673 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH ⁽²⁾	3,053 %	1,125 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	3,353 %	1,492 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	3,311 %	1,401 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,675 %	1,795 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	2,970 %	1,595 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	3,131 %	1,764 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,230 %	1,866 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	3,237 %	1,865 %
	Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,732 %	1,666 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	3,147 %	2,071 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,168 %	2,098 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3,069 %	1,998 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	2,860 %	1,783 %
	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,133 %	2,069 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,061 %	-
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	2,661 %	1,548 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,812 %	1,703 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	2,651 %	1,545 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	2,716 %	1,598 %
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,965 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation	1,738 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,722 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,177 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,244 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,405 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,237 %	-
	Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	0,961 %	-
	Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,960 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	0,875 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	(0,481) %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,951 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	(0,096) %	-
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,867 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,864 %	-
	Action de Catégorie D de distribution	1,325 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,346 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,350 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,359 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR	1,378 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	1,382 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	2,363 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	1,126 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	1,079 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,076 %	-
	Action de Catégorie Z de capitalisation en GBP	0,770 %	-
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,765 %	-	

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à
			la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,756 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation	1,765 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,758 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,753 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	1,745 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,743 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,017 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR	0,992 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,015 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	1,013 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,006 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,017 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	1,011 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,011 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	2,261 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,248 %	-
	Action de Catégorie I de distribution en EUR	0,828 %	-
	Action de Catégorie I de distribution couverte en EUR	0,824 %	-
	Action de Catégorie I de distribution (G) couverte en EUR	0,830 %	-
	Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,838 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,833 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,831 %	-
	Action de Catégorie X de distribution en EUR	0,067 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,083 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	0,082 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CAD	0,082 %	-
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,008 %	-
	Action de Catégorie AI de distribution couverte en EUR	0,844 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	0,837 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,633 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,576 %	-
	Action de Catégorie E de distribution en EUR	1,378 %	-
	Action de Catégorie E de distribution couverte en EUR	1,407 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	1,345 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,387 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,421 %	-
Action de Catégorie X de capitalisation	0,028 %	-	
BlackRock ESG Euro Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution	0,980 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation	0,966 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation	0,953 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,628 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,482 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,483 %	-
	Action de Catégorie X de distribution (G) ⁽²⁾	0,111 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,083 %	-
Action de Catégorie Z de capitalisation	0,328 %	-	
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	0,958 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation	0,897 %	-
	Action de Catégorie D de distribution ⁽²⁾	0,615 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,554 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,456 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,421 %	-
Action de Catégorie X de capitalisation	0,018 %	-	
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund ⁽³⁾	Action de Catégorie A de capitalisation	0,945 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation	0,839 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,485 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,283 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,457 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,059 %	-
Action de Catégorie Z de capitalisation	0,229 %	-	

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à
			la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock European Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de distribution	2,011 %	0,152 %
	Action de Catégorie A de capitalisation	2,268 %	0,421 %
	Action de Catégorie D de distribution	1,403 %	0,040 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,389 %	0,017 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,662 %	0,310 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,388 %	0,000 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD de fonds déclarant au Royaume-Uni ⁽²⁾	1,410 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	2,437 %	0,081 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,130 %	0,066 %
	Action de Catégorie S de capitalisation	1,086 %	0,011 %
	Action de Catégorie X de capitalisation ⁽²⁾	0,091 %	-
BlackRock European Opportunities Extension Fund	Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	3,451 %	1,600 %
	Action de Catégorie A de capitalisation	3,007 %	1,173 %
	Action de Catégorie D de distribution (G)	3,006 %	1,651 %
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	2,855 %	1,510 %
	Action de Catégorie D de capitalisation	2,771 %	1,428 %
	Action de Catégorie E de capitalisation	3,863 %	1,515 %
	Action de Catégorie I de capitalisation	2,388 %	1,335 %
		Action de Catégorie X de capitalisation	0,056 %
BlackRock European Select Strategies Fund	Action de Catégorie A de distribution	1,519 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation	1,520 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CZK	1,516 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation	1,521 %	-
	Action de Catégorie D de distribution couverte en USD	0,929 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,925 %	-
	Action de Catégorie E de distribution	2,010 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	2,013 %	-
	Action de Catégorie I de distribution	0,715 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,734 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,084 %	-
BlackRock European Unconstrained Equity Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,805 %	0,427 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,017 %	0,127 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,985 %	0,104 %
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,920 %	0,045 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,956 %	0,371 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,576 %	0,002 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,574 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,088 %	-
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	Action de Catégorie A de distribution	1,262 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation	1,262 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation	1,296 %	-
	Action de Catégorie D de distribution	0,867 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,917 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,766 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,684 %	-
		Action de Catégorie X de capitalisation	0,083 %

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à
			la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	Action de Catégorie A de distribution	1,255 %	-
	Action de Catégorie A de distribution couverte en CHF	1,261 %	-
	Action de Catégorie A de distribution couverte en USD	1,272 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,260 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	1,259 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,270 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,257 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,258 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation	1,289 %	-
	Action de Catégorie D de distribution	0,857 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,849 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,888 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,860 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,859 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,858 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,858 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,752 %	-
	Action de Catégorie I de distribution	0,668 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,669 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,669 %	-
Action de Catégorie X de distribution	0,071 %	-	
Action de Catégorie X de capitalisation	0,070 %	-	
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,321 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,329 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,361 %	-
	Action de Catégorie D de distribution couverte en GBP ⁽²⁾	0,834 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,843 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,310 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,844 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,656 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	0,653 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	0,653 %	-
Action de Catégorie X de capitalisation	0,162 %	-	
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	4,738 %	2,917 %
	Action de Catégorie D de capitalisation	1,999 %	0,575 %
	Action de Catégorie D de capitalisation EUR de fonds	4,556 %	3,208 %
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	5,064 %	2,701 %
	Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	3,441 %	2,374 %
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,068 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD ⁽²⁾	0,105 %	-
	Action de Catégorie Z de capitalisation	3,407 %	2,506 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	2,499 %	1,547 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	3,392 %	2,515 %
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3,467 %	2,558 %	

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à
			la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Global Event Driven Fund	Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	3,626 %	1,688 %
	Action de Catégorie A de capitalisation	3,736 %	1,854 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	3,774 %	1,919 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	3,640 %	1,800 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	3,713 %	1,716 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3,756 %	1,900 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	3,584 %	1,746 %
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP ⁽²⁾	2,645 %	1,228 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	3,363 %	2,005 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,344 %	1,977 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3,368 %	2,015 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3,400 %	2,048 %
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	4,173 %	1,811 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	4,185 %	1,831 %
	Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,120 %	2,054 %
	Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3,152 %	2,043 %
	Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3,157 %	2,094 %
	Action de Catégorie I de capitalisation en BRL	2,906 %	1,822 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	3,161 %	2,089 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,055 %	1,977 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	3,107 %	2,045 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3,111 %	2,046 %
	Action de Catégorie IA de capitalisation	3,532 %	2,964 %
	Action de Catégorie IA de capitalisation couverte en EUR	3,640 %	3,061 %
	Action de Catégorie S de capitalisation	3,152 %	2,011 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	2,878 %	1,765 %
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,072 %	-
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	2,380 %	1,524 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,494 %	1,636 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	2,337 %	1,495 %
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2,538 %	1,685 %	
BlackRock Global Real Asset Securities Fund	Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,551 %	-
	Action de Catégorie A de distribution couverte en HKD de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,585 %	-
	Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,555 %	-
	Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	1,524 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation	1,540 %	-
	Action de Catégorie D de distribution	0,933 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,950 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	2,116 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,092 %	-
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,633 %	-
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ⁽⁴⁾	Action de Catégorie A de distribution	1,120 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation	1,129 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,136 %	-
	Action de Catégorie D de distribution	0,488 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,484 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,491 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,494 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,627 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation ⁽²⁾	0,501 %	-
	Action de Catégorie IndexInvest Balance de distribution	1,120 %	-
Action de Catégorie Vermoegensstrategie Moderat de distribution - Ausgewogen	0,481 %	-	

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive ⁽⁴⁾	Action de Catégorie A de distribution	1,111 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,114 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,118 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,115 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,484 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,483 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,492 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,492 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,489 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,475 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,491 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,637 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation ⁽²⁾	0,514 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,424 %	-
	Action de Catégorie IndexInvest Substanz de distribution	1,114 %	-
	Action de Catégorie Vermoegensstrategie Defensiv de distribution	0,498 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,015 %	-
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth ⁽⁴⁾	Action de Catégorie A de distribution	1,122 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,123 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,127 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,127 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,496 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,500 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,494 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,495 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,492 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,495 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,504 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,644 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation ⁽²⁾	0,498 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,422 %	-
	Action de Catégorie IndexInvest Chance de distribution	1,119 %	-
	Action de Catégorie Vermoegensstrategie Wachstum de distribution	0,497 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,028 %	-
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate ⁽⁴⁾	Action de Catégorie A de distribution	1,117 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,119 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,119 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,126 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,490 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,506 %	-
	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,493 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,496 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,494 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,489 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,493 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,613 %	-
	Action de Catégorie I de distribution	0,420 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation ⁽²⁾	0,501 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,422 %	-
	Action de Catégorie IndexInvest Wachstum de distribution	1,115 %	-
	Action de Catégorie IndexInvest Wachstum de distribution couverte en CHF	1,121 %	-
	Action de Catégorie Vermoegensstrategie Ausgewogene de distribution	0,490 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,031 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	0,056 %	-
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD	0,062 %	-	

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à
			la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Style Advantage Fund	Action de Catégorie A de distribution	1,615 %	-
	Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	1,651 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation	1,660 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,671 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,640 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,029 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	1,017 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,008 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,042 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,029 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	2,159 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,139 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en CHF	0,517 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en EUR	0,634 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	0,772 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	0,816 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,833 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,796 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,825 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en JPY	0,829 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,091 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	0,116 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,165 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	0,067 %	-
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,130 %	-	
Action de Catégorie Z de capitalisation	0,947 %	-	
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	0,781 %	-	
BlackRock Style Advantage Screened Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,462 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,859 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,859 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	0,858 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	1,944 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,655 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	0,648 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,654 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	0,655 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,070 %	-
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	0,070 %	-	
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,033 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	0,646 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	1,548 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,470 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation en JPY	0,493 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	0,497 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP	0,089 %	-
BlackRock Systematic Global Equity Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,209 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	0,727 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	1,639 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,619 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,479 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation en EUR	0,452 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,097 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation en EUR	0,098 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation en GBP	0,090 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation en JPY	0,087 %	-

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE	Commission liée à
			la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund ⁽¹⁾	Action de Catégorie A de capitalisation	2,271 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	2,222 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	2,253 %	-
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	2,268 %	-
	Action de Catégorie C de capitalisation	3,271 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	1,655 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,658 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,663 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,754 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1,378 %	-
	Action de Catégorie J de distribution	1,684 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,190 %	-
BlackRock Total Advantage Fund	Action de Catégorie A de capitalisation	1,403 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation	0,847 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,841 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,850 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation	1,397 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation	0,665 %	-
	Action de Catégorie X de capitalisation	0,109 %	-
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR	1,847 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,839 %	-
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,844 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,098 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation en EUR	1,104 %	-
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,488 %	0,386 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	1,121 %	0,026 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,161 %	0,066 %
	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR	2,371 %	-
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,344 %	-
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1,072 %	0,240 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	0,854 %	0,034 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,956 %	0,120 %
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,072 %	-	

⁽¹⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Nouvelle Catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

⁽³⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le Fonds investit dans des fonds cibles sous-jacents qui ne publient pas de TFE conformément aux directives de la SFAMA.

Les TFE ont été calculés conformément aux lignes directrices de la Swiss Funds & Asset Management Association (« SFAMA ») sur le calcul et la divulgation des TFE d'organismes d'investissement collectif. Les lignes directrices de la SFAMA ont été modifiées pour la dernière fois le 20 avril 2015.

Certains Compartiments, comme indiqué ci-dessus, investissent une partie importante de leur actif net dans des Compartiments cibles sous-jacents qui ne publient pas de TFE conformément aux directives de la SFAMA. Par conséquent, le TFE au prorata des Compartiments cibles sous-jacents n'a pas été inclus dans le TFE des Compartiments décrits ci-dessus. Cette clause de renonciation est conforme aux directives de la SFAMA.

Annexe aux États Financiers suite

17. Événements ultérieurs

Le Compartiment BlackRock Total Advantage Fund libellé en EUR a été liquidé le 24 août 2021.

Il n'y a pas eu d'événements postérieurs à la clôture de l'exercice et à la date d'approbation des états financiers qui, de l'avis du Conseil, auraient pu avoir une incidence significative sur les états financiers de l'exercice clos le 31 mai 2021.

18. Date d'approbation

Les états financiers ont été approuvés par le Conseil le 23 septembre 2021.

Aux Actionnaires de
BlackRock Strategic Funds
49 avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

RAPPORT DU COMMISSAIRE AUX COMPTES

Opinion

Nous avons contrôlé les états financiers de BlackRock Strategic Funds (la « Société ») et de chacun de ses compartiments, à savoir le bilan, le portefeuille d'investissements au 31 mai 2021, le compte de résultat et l'évolution de l'actif net pour l'exercice clos à cette date, ainsi que l'annexe aux états financiers, y compris un résumé des principales règles comptables.

Nous estimons que les états financiers ci-joints donnent une image fidèle de la situation financière de la Société et de chacun de ses compartiments au 31 mai 2021 ainsi que des résultats de leurs opérations et des changements apportés à leur actif net pour l'exercice clos à cette date en conformité avec les prescriptions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg en matière de préparation et de présentation des états financiers.

Fondement de l'opinion

Nous avons mené notre audit conformément à la loi du 23 juillet 2016 relative à la profession de l'audit (loi du 23 juillet 2016) et aux Normes de révision internationales (International Standards on Auditing ou ISA) telles qu'elles ont été adoptées pour le Luxembourg par la « Commission de Surveillance du Secteur Financier » (CSSF). Nos responsabilités en vertu de la Loi du 23 juillet 2016 et des ISA, telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, sont décrites de façon plus détaillée dans la section de notre rapport intitulée « Responsabilités du Commissaire aux comptes s'agissant de l'audit des états financiers ». Nous sommes également indépendants de la Société conformément au Code d'éthique international, qui comprend les Normes internationales d'indépendance, publié à l'intention des comptables professionnels par le Conseil des normes internationales de déontologie comptable (Code IESBA) tel qu'adopté pour le Luxembourg par la CSSF, ainsi qu'aux exigences éthiques concernant notre audit des états financiers, et nous nous sommes acquittés de nos responsabilités éthiques en vertu de ces normes de déontologie. Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus constituent une base raisonnable pour exprimer notre opinion.

Informations complémentaires

Le Conseil d'administration de la Société est responsable des informations complémentaires. Les informations complémentaires comprennent les informations figurant dans le rapport annuel mais ne comprennent pas les états financiers ni le rapport de notre Commissaire aux comptes sur ces derniers.

Notre opinion sur les états financiers ne couvre pas les informations complémentaires et nous n'exprimons aucune forme de conclusion assortie d'une assurance sur lesdites informations complémentaires.

En ce qui concerne notre audit des états financiers, il est de notre responsabilité de lire les informations complémentaires et, ce faisant, de considérer si ces informations complémentaires présentent une incompatibilité de fond avec les états financiers ou si les informations dont nous avons pris connaissance lors de l'audit semblent de toute autre façon comporter des inexactitudes importantes. Si, sur la base de notre travail, nous concluons que ces informations complémentaires comportent des inexactitudes importantes, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

Responsabilité du Conseil d'administration de la Société concernant les états financiers

Le Conseil d'administration de la Société est responsable de la préparation et de la présentation fidèle des états financiers, en conformité avec les prescriptions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg en matière de préparation et de présentation des états financiers, et de tout contrôle interne que le Conseil d'administration de la Société jugera nécessaire à la préparation d'états financiers exempts d'anomalies importantes dues à une fraude ou à une erreur.

Dans le cadre de la préparation des états financiers, le Conseil d'administration de la Société est chargé d'évaluer la capacité de la Société à poursuivre ses activités, d'indiquer, selon le cas, les questions liées à la poursuite des activités, et d'utiliser le principe comptable de continuité des activités, à moins que le Conseil d'administration de la Société ait l'intention de liquider la Société ou de cesser ses opérations, ou qu'il n'ait aucune autre solution réaliste.

Responsabilités du Commissaire aux comptes s'agissant de l'audit des états financiers

Nos objectifs en matière d'audit sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies importantes, dues à une fraude ou à une erreur, et de publier un rapport du Commissaire aux comptes comprenant notre opinion. L'assurance raisonnable est un niveau d'assurance élevé, mais n'est pas une garantie selon laquelle un audit mené conformément aux dispositions de la loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF détectera toujours toute anomalie importante existante. Les anomalies peuvent découler d'une fraude ou d'une erreur, et sont réputées importantes si, individuellement ou collectivement, elles sont raisonnablement susceptibles d'influencer les décisions économiques des utilisateurs prises sur la base de ces états financiers.

Dans le cadre d'un audit conformément à la loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous exerçons un jugement professionnel et adoptons une attitude de scepticisme professionnel tout au long de l'audit. En outre, nous :

- identifions et évaluons les risques d'anomalie importante dans les états financiers, due à une fraude ou à une erreur, nous établissons et réalisons des procédures d'audit adaptées à ces risques, et nous obtenons les éléments probants qui constituent une base raisonnable pour exprimer notre opinion. Le risque de ne pas détecter une anomalie importante due à une fraude est plus élevé que lorsque celle-ci est due à une erreur, puisqu'une fraude peut comporter une collusion, une contrefaçon, des omissions intentionnelles, de fausses déclarations ou la dérogation à un contrôle interne.
- veillons à bien comprendre le contrôle interne concernant l'audit, afin d'établir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne de la Société.
- évaluons le caractère approprié des politiques comptables utilisées ainsi que le caractère raisonnable des estimations comptables et informations connexes émanant du Conseil d'administration de la Société.

- formulons des conclusions sur le caractère approprié de l'utilisation par le Conseil d'administration de la Société du principe comptable de continuité des activités et, sur la base des éléments probants obtenus, sur la présence ou non d'une incertitude importante quant aux événements ou conditions pouvant jeter un doute significatif sur la capacité de la Société à poursuivre ses activités. Si nous concluons à l'existence d'incertitudes importantes, nous sommes tenus, dans notre rapport du Commissaire aux comptes, d'attirer l'attention sur les informations connexes figurant dans les états financiers ou, si ces informations sont inappropriées, de modifier notre opinion. Nos conclusions sont fondées sur les éléments probants obtenus au jour de notre rapport du Commissaire aux comptes. Toutefois, des événements ou conditions à venir peuvent conduire la Société à cesser ses activités.
- évaluons la présentation générale, la structure et le contenu des états financiers, y compris les informations y figurant, et vérifions si les états financiers représentent les transactions et événements sous-jacents de manière à réaliser une présentation fidèle.

Nous communiquons avec les personnes chargées de la gouvernance en ce qui concerne, entre autres choses, l'étendue et le calendrier de l'audit ainsi que les principales conclusions de ce dernier, y compris les lacunes importantes du contrôle interne que nous identifions au cours de l'audit.

Pour Deloitte Audit, *Cabinet de révision agréé*

Justin Griffiths, *Réviseur d'entreprises agréé*
Partenaire

Le 23 septembre 2021

Annexe I – Catégories d'Actions (non révisée)

Catégories d'actions émises

Au 31 mai 2021, la Société offrait les catégories d'actions suivantes.

Catégorie A

Action de Catégorie A de distribution couverte en CHF
Action de Catégorie A de distribution en EUR
Action de Catégorie A de distribution couverte en EUR
Action de Catégorie A de distribution en USD
Action de Catégorie A de distribution couverte en USD
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
Action de Catégorie A de distribution couverte en HKD de fonds déclarant au Royaume-Uni
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni SGD hedged
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en USD
Action de Catégorie A de capitalisation en AUD
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CZK
Action de Catégorie A de capitalisation en EUR
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD
Action de Catégorie A de capitalisation en USD
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en USD

Catégorie AI⁽¹⁾

Action de Catégorie AI de distribution couverte en EUR
Action de Catégorie AI de capitalisation EUR
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR

Catégorie C⁽¹⁾

Action de Catégorie C de capitalisation en USD

Catégorie D⁽¹⁾

Action de Catégorie D de distribution (G) en EUR
Action de Catégorie D de distribution en EUR
Action de Catégorie D de distribution couverte en GBP
Action de Catégorie D de distribution en USD
Action de Catégorie D de distribution couverte en USD
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP

Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en USD
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD
Catégorie D non-distributing fund share EUR
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF
Action de Catégorie D de capitalisation en EUR
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP
Action de Catégorie D de capitalisation en USD
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en USD
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD

Catégorie E⁽¹⁾

Action de Catégorie E de distribution en EUR
Action de Catégorie E de distribution couverte en EUR
Action de Catégorie E de capitalisation en EUR
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR
Action de Catégorie E de capitalisation en USD

Catégorie I^{(1),(2)}

Action de Catégorie I de distribution (G) couverte en EUR
Action de Catégorie I de distribution en EUR
Action de Catégorie I de distribution couverte en EUR
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en USD
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en CHF
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en EUR
Action de Catégorie I de capitalisation en BRL
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF
Action de Catégorie I de capitalisation en EUR
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP
Action de Catégorie I de capitalisation en JPY
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK
Action de Catégorie I de capitalisation en USD
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP

Annexe I – Catégories d'Actions (non révisée) suite

Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
 Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en JPY
 Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en USD
 Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD
 Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD

Catégorie IA^{(1),(2)}

Action de Catégorie IA de capitalisation couverte en EUR
 IA Class non-distributing share USD

Catégorie IndexInvest Balance⁽¹⁾

Action de Catégorie IndexInvest Balance de distribution en EUR
 Action de Catégorie IndexInvest Chance de distribution en EUR
 Action de Catégorie IndexInvest Substanz de distribution en EUR
 Action de Catégorie IndexInvest Wachstum de distribution couverte en CHF
 Action de Catégorie IndexInvest Wachstum de distribution en EUR

Catégorie J⁽²⁾

Action de Catégorie J de distribution en USD

Catégorie S⁽¹⁾

Action de Catégorie S de capitalisation EUR
 Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR
 Action de Catégorie S de capitalisation USD
 Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP

Catégorie Vermoegensstrategie⁽¹⁾

Action de Catégorie Vermoegensstrategie Ausgewogen de distribution en EUR
 Action de Catégorie Vermoegensstrategie Defensiv de distribution en EUR
 Action de Catégorie Vermoegensstrategie Moderat de distribution - Ausgewogen EUR
 Action de Catégorie Vermoegensstrategie Wachstum de distribution en EUR

Catégorie X⁽²⁾

Catégorie X distributing (G) share EUR
 Action de Catégorie X de distribution en EUR
 Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD
 Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CAD
 Action de Catégorie X de capitalisation en EUR
 Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR
 Action de Catégorie X de capitalisation en GBP
 Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP
 Action de Catégorie X de capitalisation en JPY
 Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD
 Action de Catégorie X de capitalisation en USD
 Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD
 Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en EUR
 Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP
 Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
 Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en USD

Catégorie Z⁽¹⁾

Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en BRL
 Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF
 Action de Catégorie Z de capitalisation en EUR
 Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR
 Action de Catégorie Z de capitalisation en GBP
 Action de Catégorie Z de capitalisation en USD
 Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
 Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en GBP
 Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
 Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en USD
 Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD

⁽¹⁾ Disponible à la discrétion de la Société de Gestion.

⁽²⁾ Disponible pour les investisseurs institutionnels.

Catégories d'Actions lancées

Les dates communiquées sont les dates de lancement et de réactivation, mais les catégories peuvent avoir été amorcées à une date ultérieure.

Date d'effet	Compartiment	Type
26 août 2020	BlackRock European Absolute Return Fund	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD de fonds déclarant au Royaume-Uni
2 septembre 2020	BlackRock Global Event Driven Fund	Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
23 septembre 2020	BlackRock European Absolute Return Fund	Action de Catégorie X de capitalisation
28 octobre 2020	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de Catégorie I de capitalisation
28 octobre 2020	BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	Action de Catégorie I de capitalisation
28 octobre 2020	BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	Action de Catégorie I de capitalisation
28 octobre 2020	BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	Action de Catégorie I de capitalisation
25 novembre 2020	BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH
19 février 2021	BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation
19 février 2021	BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie AI de capitalisation
19 février 2021	BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie D de capitalisation
19 février 2021	BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie E de capitalisation
19 février 2021	BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie I de capitalisation
19 février 2021	BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie X de capitalisation
19 février 2021	BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation
24 février 2021	BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	Action de Catégorie D de distribution
3 mars 2021	BlackRock ESG Euro Bond Fund	Action de Catégorie X de distribution (G)
24 mars 2021	BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD
28 avril 2021	BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	Action de Catégorie D de distribution couverte en GBP

Annexe I – Catégories d'Actions (non révisée) suite

Catégories d'Actions fermées

Date d'effet	Compartiment	Type
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de capitalisation
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie E de capitalisation
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie I de capitalisation
2 juin 2020	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie X de capitalisation
17 juin 2020	BlackRock Asia Extension Fund	Action de Catégorie A de capitalisation
17 juin 2020	BlackRock Asia Extension Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
17 juin 2020	BlackRock Asia Extension Fund	Action de Catégorie E de capitalisation
17 juin 2020	BlackRock Asia Extension Fund	Action de Catégorie X de capitalisation
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie A de capitalisation
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie D de capitalisation en EUR
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie E de capitalisation en EUR
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie I de capitalisation en EUR
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie X de capitalisation
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en BRL
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
4 novembre 2020	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP

Annexe II – Exposition globale au risque de marché (non révisée)

Exposition globale

Conformément à la politique actuelle de BlackRock, l'exposition globale est mesurée selon l'« approche par les engagements » ou l'approche de la valeur à risque (« VaR »), et couvre l'ensemble des composantes du portefeuille.

L'approche par les engagements est une méthode qui regroupe les valeurs de marché sous-jacentes ou les valeurs notionnelles des instruments financiers dérivés afin de déterminer le degré d'exposition globale d'un Fonds aux instruments financiers dérivés.

Conformément à la Loi de 2010, l'exposition globale d'un Fonds selon la méthode par les engagements ne doit pas excéder 100 % de la valeur liquidative de ce Fonds.

Voici la liste des Compartiments qui utilisent l'approche par les engagements :

- BlackRock European Unconstrained Equity Fund
- BlackRock Global Real Asset Securities Fund
- BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative
- BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive
- BlackRock Managed Index Portfolios – Growth
- BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate
- BlackRock Systematic ESG World Equity Fund
- BlackRock Systematic Global Equity Fund

La VaR est une mesure de risque statistique qui estime la perte potentielle due aux mouvements défavorables du marché, dans un environnement de marché normal.

Les calculs de la VaR pour les Compartiments de BlackRock Strategic Funds, à l'exception du Compartiment BlackRock Global Event Driven Fund, sont fondés sur un modèle de simulation historique ajustée. Le BlackRock Global Event Driven Fund utilise un modèle VaR qui est un modèle de simulation de Monte Carlo. Les deux modèles utilisent un indice de confiance de 99 %, une période de détention d'un jour et une période d'observation historique d'au moins un an (250 jours). Un chiffre de VaR est défini dans la perspective d'une probabilité spécifique et d'un horizon temporel spécifique. Une VaR à 99 % à un jour signifie que l'on prévoit que pendant 99 % du temps sur une période d'un jour, le Fonds ne perdra pas plus que ce chiffre en pourcentage. Par conséquent, les VaR élevées indiquent un risque élevé.

Le modèle de VaR utilisé par le service BlackRock chargé de l'analyse des risques et de l'analyse quantitative (« RQA ») est un modèle de simulation historique ajusté.

Pour les Compartiments qui utilisent l'approche VaR relative, le RQA détermine un portefeuille de référence comme base pour le calcul de la VaR relative. Le portefeuille de référence est habituellement l'indice de référence établi lui aussi comme point de référence pour les données de performance du Fonds concerné. Il s'agit d'un indice (ou d'indices composites) construit(s), par un ou plusieurs fournisseurs d'indice reconnus, à partir de titres dans lesquels les Fonds peuvent investir. Ce processus prend dûment en compte de la disponibilité d'indices dont les règles de construction sont elles-mêmes conformes aux règles de diversification.

Lorsqu'un Fonds est contrôlé à l'aide de la VaR, les Gestionnaires Financiers par délégation observeront la limite réglementaire et toute limite de risque interne éventuellement appropriée pour le portefeuille.

Le tableau ci-dessous présente l'utilisation la plus élevée, l'utilisation la plus faible et l'utilisation moyenne de la limite de VaR, exprimées en pourcentage de la limite réglementaire de la VaR absolue ou relative. En ce qui concerne la VaR relative, la VaR du portefeuille du Fonds concerné n'excédera pas le double de la VaR du portefeuille de référence. L'utilisation correspond au niveau de risque pris dans ce contexte.

Compartiment	Approche de risque de marché	Référentiel risques	Utilisation la plus élevée de la limite de VaR (%)	Utilisation la plus faible de la limite de VaR (%)	Utilisation moyenne de la limite de VaR (%)
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	VaR absolue	n/a	27,95 %	14,76 %	20,68 %
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	VaR absolue	n/a	39,13 %	22,14 %	30,17 %
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	VaR absolue	n/a	33,54 %	22,14 %	27,07 %
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	VaR absolue	n/a	49,42 %	19,23 %	31,38 %
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ⁽¹⁾	VaR absolue	n/a	73,57 %	46,96 %	54,83 %
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	VaR absolue	n/a	79,16 %	40,70 %	57,46 %
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	VaR relative	MSCI Emerging Markets Index	78,79 %	51,01 %	63,79 %

Annexe II – Exposition globale au risque de marché (non révisée)

suite

Compartiment	Approche de risque de marché	Référentiel risques	Utilisation la plus élevée de la limite de VaR (%)	Utilisation la plus faible de la limite de VaR (%)	Utilisation moyenne de la limite de VaR (%)
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	VaR absolue	n/a	96,15 %	19,45 %	44,92 %
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	VaR absolue	n/a	57,69 %	8,50 %	23,96 %
BlackRock ESG Euro Bond Fund	VaR relative	Bloomberg Barclays MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Index	53,12 %	46,73 %	50,01 %
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	VaR relative	Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate Sustainable SRI Index	58,85 %	46,54 %	51,55 %
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾	VaR absolue	n/a	2,59 %	1,34 %	1,75 %
BlackRock European Absolute Return Fund	VaR absolue	n/a	42,93 %	20,57 %	31,01 %
BlackRock European Opportunities Extension Fund	VaR relative	S&P Europe BMI Index 75 % Barclays Pan European Aggregate Index (Hedged EUR) / 25 % MSCI Europe Index (Hedged	66,80 %	46,97 %	55,43 %
BlackRock European Select Strategies Fund	VaR relative	EUR)	64,77 %	44,81 %	53,19 %
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	VaR absolue	n/a	27,95 %	3,80 %	9,72 %
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	VaR absolue	n/a	17,66 %	4,02 %	8,07 %
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	VaR absolue	n/a	20,80 %	4,02 %	9,00 %
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	VaR absolue	n/a	59,48 %	25,71 %	33,46 %
BlackRock Global Event Driven Fund	VaR absolue	n/a	56,92 %	18,32 %	30,97 %
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽³⁾	VaR absolue	n/a	16,77 %	0,00 %	5,86 %
BlackRock Style Advantage Fund	VaR absolue	n/a	42,49 %	13,86 %	23,66 %
BlackRock Style Advantage Screened Fund	VaR absolue	n/a	36,90 %	18,34 %	23,81 %
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund ⁽¹⁾	VaR absolue	n/a	59,23 %	16,55 %	28,02 %
BlackRock Total Advantage Fund	VaR absolue	n/a	31,53 %	21,69 %	26,54 %
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	VaR absolue	n/a	33,76 %	15,21 %	22,61 %

⁽¹⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Fund terminated, see Note 1 for further details.

Effet de levier

Le recours à des instruments dérivés peut exposer les Fonds à un risque plus grand. En particulier, les contrats sur instruments dérivés peuvent être très volatils et le montant de la marge initiale est généralement faible par rapport à l'importance du contrat, de manière à donner une marge de manœuvre aux transactions en termes d'exposition au marché. Une légère évolution du marché peut avoir plus d'impact sur les instruments dérivés que sur les obligations ou les actions standard. Les positions spéculatives en instruments dérivés peuvent donc accroître la volatilité des Fonds.

Aux fins de la présente publication, l'effet de levier est l'exposition aux investissements obtenue à travers l'utilisation d'instruments financiers dérivés. Il est calculé en utilisant la somme des valeurs notionnelles de tous les instruments financiers dérivés détenus par le Fonds concerné, sans compensation, et est exprimé en pourcentage de la VL.

Le tableau ci-dessous indique le niveau d'effet de levier utilisé au cours de l'exercice.

Compartiment	Effet de levier moyen utilisé au cours de l'exercice
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	599,14 %
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	87,61 %
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	519,80 %
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	114,83 %
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund ⁽¹⁾	151,43 %
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	95,42 %
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	76,08 %
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	648,15 %
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	143,32 %
BlackRock ESG Euro Bond Fund	35,34 %
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	49,34 %
BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund ⁽²⁾	46,42 %
BlackRock European Absolute Return Fund	68,11 %
BlackRock European Opportunities Extension Fund	95,45 %
BlackRock European Select Strategies Fund	99,88 %
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	112,62 %
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	259,81 %
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	668,68 %
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	167,90 %

Annexe II – Exposition globale au risque de marché (non révisée)

suite

Compartment	Effet de levier moyen utilisé au cours de l'exercice
BlackRock Global Event Driven Fund	94,60 %
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽³⁾	1.062,99 %
BlackRock Style Advantage Fund	1.134,05 %
BlackRock Style Advantage Screened Fund	779,51 %
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund ⁽¹⁾	455,39 %
BlackRock Total Advantage Fund	746,28 %
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	113,74 %

⁽¹⁾ Compartiment renommé, pour de plus amples informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Lancement d'un Fonds, voir la Note 1 pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Fund terminated, see Note 1 for further details.

Informations supplémentaires (non révisées)

Techniques de gestion efficace de portefeuille

La Société est autorisée, pour le compte de chaque Compartiment et sous réserve des conditions et des limites établies par la CSSF et le Prospectus, à utiliser des techniques et instruments liés aux titres négociables, y compris des investissements dans des instruments financiers dérivés (les « IFD ») de gré à gré, sous réserve que ces techniques et instruments soient utilisés en vue d'une gestion efficace de portefeuille, pour offrir une protection contre le risque de change ou à des fins d'investissement direct, s'il y a lieu.

Prêt de titres et swaps sur rendement total (TRS pour Total Return Swaps) (y compris les CFD)

Toutes les opérations de prêt de titres conclues par les Compartiments sont soumises à un accord juridique écrit entre les Compartiments et l'Agent de prêts de titres, BlackRock Advisors (UK) Limited, une partie liée à la Société, et séparément entre l'Agent de prêts de titres et la contrepartie emprunteuse approuvée. La garantie reçue en échange des titres prêtés est transférée en vertu d'un accord de transfert et est versée et détenue dans un compte auprès d'un gestionnaire de garantie tripartite au nom du Dépositaire pour le compte des Compartiments. La garantie reçue est séparée des actifs appartenant au Dépositaire des Compartiments ou à l'Agent de prêt de titres.

Tous les TRS (y compris les CFD) sont conclus par les Compartiments en vertu d'un contrat-cadre International Swaps and Derivatives Associations, Inc. (« Contrat-cadre ISDA ») ou d'un contrat similaire. Un Contrat-cadre ISDA est un contrat bilatéral entre les Compartiments et une contrepartie, qui régit les IFD de gré à gré (y compris les TRS et les CFD) conclus par les parties. Les expositions des parties en vertu du Contrat-cadre ISDA sont compensées et garanties ensemble, si bien que toutes informations fournies sur la garantie dans ce rapport concernent tous les IFD de gré à gré conclus par les Compartiments en vertu du Contrat-cadre ISDA, et non uniquement les TRS et les CFD. Toute garantie autre qu'en numéraire reçue/fournie par les Compartiments en vertu du Contrat-cadre ISDA est transférée de façon bilatérale en vertu d'un accord de transfert de propriété.

Le tableau suivant indique la valeur des titres en prêt exprimée en tant que proportion du total des actifs prêtables et de la VL des Compartiments, et la valeur des TRS (y compris les CFD) en tant que proportion de la VL des Compartiments, au 31 mai 2021, et des revenus/rendements perçus pour l'exercice clos le 31 mai 2021. Le total des actifs prêtables représente la valeur globale des actifs faisant partie du programme de prêt de titres des Compartiments. La valeur des TRS (y compris les CFD) est calculée en fonction de la valeur d'exposition sous-jacente sur une base absolue brute.

Compartiment	Devise	Titres en prêt		TRS (y compris les CFDs)	
		% des actifs prêtables	% de la VNI	% de la VNI 31 mai 2021	Rendements nets générés
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	n/a	n/a	707,82 %	(40.213.038)
BlackRock Asia Extension Fund	USD	n/a	n/a	n/a	24.467
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	USD	23,82 %	11,24 %	75,11 %	(6.791.197)
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	n/a	n/a	451,77 %	6.491.854
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	EUR	6,72 %	2,17 %	17,84 %	36.421.330
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund	GBP	8,65 %	0,49 %	143,82 %	159.914.593
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	USD	0,21 %	6,87 %	77,22 %	(3.934.104)
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	USD	11,65 %	5,15 %	71,72 %	(34.328.157)
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	USD	5,66 %	4,29 %	n/a	n/a
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	USD	6,18 %	4,94 %	n/a	n/a
BlackRock ESG Euro Bond Fund	EUR	10,30 %	9,35 %	n/a	n/a
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund	EUR	2,52 %	2,20 %	n/a	n/a
BlackRock European Absolute Return Fund	EUR	8,31 %	1,93 %	68,34 %	(185.337.439)
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	EUR	n/a	n/a	n/a	4.161
BlackRock European Opportunities Extension Fund	EUR	7,97 %	7,38 %	50,54 %	13.001.543
BlackRock European Select Strategies Fund	EUR	7,30 %	5,38 %	0,15 %	(4.458.603)
BlackRock European Unconstrained Equity Fund	EUR	6,95 %	6,53 %	n/a	n/a
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund	EUR	6,97 %	5,72 %	0,19 %	(286.666)
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	EUR	6,45 %	4,03 %	0,35 %	(434.915)
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	EUR	4,18 %	2,45 %	n/a	36.833
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund	USD	n/a	n/a	61,87 %	(1.729.596)
BlackRock Global Event Driven Fund	USD	4,61 %	0,75 %	101,37 %	119.823.367
BlackRock Global Real Asset Securities Fund	USD	7,27 %	6,38 %	0,05 %	4.690
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	EUR	8,74 %	6,82 %	n/a	n/a
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	EUR	12,67 %	8,56 %	n/a	n/a
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	EUR	4,26 %	3,41 %	n/a	n/a
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	EUR	2,26 %	1,73 %	n/a	n/a
BlackRock Style Advantage Fund	USD	n/a	n/a	228,94 %	(53.492.796)
BlackRock Style Advantage Screened Fund	USD	n/a	n/a	223,14 %	(448.724)

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Compartiment	Devise	Titres en prêt		TRS (y compris les CFDs)	
		% des actifs prétables	% de la VNI	% de la VNI 31 mai 2021	Rendements nets générés
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund	USD	5,36 %	4,95 %	n/a	n/a
BlackRock Systematic Global Equity Fund	USD	4,02 %	3,54 %	n/a	n/a
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund	USD	n/a	n/a	273,47 %	428.220
BlackRock Total Advantage Fund	EUR	n/a	n/a	122,93 %	812.409
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	GBP	n/a	n/a	105,44 %	5.150.182

Le revenu total généré par les opérations de prêt de titres est divisé entre le Compartiment concerné et l'Agent de prêt de titres. Le Fonds reçoit au moins 62,5%, tandis que l'Agent de prêt de titres reçoit jusqu'à 37,5% de ce revenu, tous les coûts opérationnels étant prélevés sur la part de l'Agent de prêt de titres. Les revenus perçus au cours de l'exercice clos par les Fonds à partir d'opérations de prêt de titres sont indiqués dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net des Fonds sous le poste « Prêts de titres ». Le rendement total tiré des swaps sur rendement total (dont les CFD) est présenté sur la base du rendement total, qui comprend les intérêts connexes, les revenus ou frais de dividendes et les gains/pertes net(tes) dus aux mouvements de la juste valeur de marché. Tous les rendements et les coûts des TRS (y compris les CFD) sont comptabilisés au profit des Compartiments et ne sont soumis à aucun accord de partage des rendements et des coûts avec la Société de Gestion du Compartiment ou toute autre tierce partie.

Le tableau suivant indique la valeur des titres en prêt (identifiés individuellement dans le portefeuille de titres des Compartiments concernés) et la garantie associée ainsi que la valeur d'exposition sous-jacente sur une base absolue brute pour les TRS (y compris les CFD), analysées par contrepartie, au 31 mai 2021.

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)
		Montant prêté	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2020
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	715.633.209
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	626.513.814
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	964.729.042
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	1.010.277.237
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	n/a	n/a	1.546.509.786
Total		n/a	n/a	4.863.663.088
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	7.887.639
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	894.866	952.955	n/a
Deutsche Bank AG	Allemagne	1.639.000	1.816.253	n/a
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	565.586	620.243	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	8.557.881
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	n/a	n/a	9.600.727
The Bank of Nova Scotia	Canada	154.425	170.043	n/a
UBS AG	Suisse	644.654	706.470	n/a
Total		3.898.531	4.265.964	26.046.247
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)				
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	52.992.986
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	6.545.256
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	23.335.425
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	76.172.421
Total		n/a	n/a	159.046.088
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	27.616.047
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	17.664.962	19.814.500	17.126.560
BNP Paribas SA	France	n/a	n/a	25.354.080
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	36.886.720
Goldman Sachs International	États-Unis	1.129.253	1.370.453	40.411.291
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.196.701	1.312.349	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	n/a	n/a	72.023.616
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.728.936	1.941.250	n/a
The Bank of Nova Scotia	Canada	1.990.223	2.191.508	n/a
UBS AG	Suisse	2.934.608	3.216.006	n/a
Total		26.644.683	29.846.066	219.418.314

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)
		Montant prêté	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2020
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (en GBP)				
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	2.582.989	2.750.656	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	451.186.538
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	406.144.267
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	323.441.194
Merrill Lynch International	États-Unis	1.395.457	1.551.566	n/a
UBS AG	Suisse	53.457	58.583	n/a
Total		4.031.903	4.360.805	1.180.771.999
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	851.888
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	1.862.428
Credit Suisse Securities Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	665.868
Deutsche Bank AG	Allemagne	642.415	711.891	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	1.210.693
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	4.654.480
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	224.627	252.211	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	n/a	n/a	501.379
Total		867.042	964.102	9.746.736
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	129.115.497
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	234.416	262.941	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	3.879.315	4.131.129	n/a
Credit Suisse Securities Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	185.213.235
Goldman Sachs International	États-Unis	2.398.427	2.910.712	66.901.989
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	13.405.472	14.700.955	228.529.072
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	16.860.341	18.930.816	n/a
Societe Generale SA	France	387.847	1.552.330	n/a
UBS AG	Suisse	9.495.392	10.405.900	39.590.044
Total		46.661.210	52.894.783	649.349.837
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	777.171	808.177	n/a
BNP Paribas SA	France	852.935	889.235	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	17.684.604	18.236.098	n/a
Credit Suisse International	Suisse	2.915.577	3.526.291	n/a
Deutsche Bank AG	Allemagne	5.336.498	5.585.649	n/a
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	5.439.981	6.040.128	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	12.271	15.336	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	25.881.913	30.418.609	n/a
Nomura International Plc	Royaume-Uni	2.931.980	3.114.791	n/a
Zürcher Kantonalbank	Suisse	3.956.171	4.330.471	n/a
Total		65.789.101	72.964.785	n/a
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (en USD)				
BNP Paribas SA	France	1.068.774	1.114.260	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	211.918	220.821	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.186.364	1.444.079	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	1.369.570	1.435.036	n/a
Total		3.836.626	4.214.196	n/a

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)
		Montant prêté	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2020
BlackRock ESG Euro Bond Fund (en EUR)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	3.460.321	3.598.371	n/a
BNP Paribas SA	France	7.274.296	7.511.207	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	1.004.428	1.046.626	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	9.076.745	9.765.910	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	23.472.317	24.216.492	n/a
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	5.917.340	6.152.407	n/a
Societe Generale SA	France	8.868.635	9.772.735	n/a
UBS AG	Suisse	1.023.105	1.149.297	n/a
Total		60.097.187	63.213.045	n/a
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (en EUR)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	1.473.141	1.531.911	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	1.578.291	1.644.597	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	2.053.199	2.171.163	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	862.105	903.313	n/a
Total		5.966.736	6.250.984	n/a
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	379.633.891
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	21.143.863
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	322.876.822
Deutsche Bank AG	Allemagne	n/a	n/a	23.491.377
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	574.376	644.910	297.346.275
Natixis S.A.	France	28.989.132	31.771.548	n/a
Total		29.563.508	32.416.458	1.044.492.228
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	132.153.151
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	5.242.366
BNP Paribas Arbitrage SNC	France	11.714.705	13.501.880	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	95.936.752
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	12.892.632	14.475.853	100.221.823
Natixis S.A.	France	24.117.474	26.432.302	n/a
Total		48.724.811	54.410.035	333.554.092
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	740.523
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	890.602	926.132	n/a
BNP Paribas Arbitrage SNC	France	11.047.559	12.732.957	n/a
BNP Paribas SA	France	740.564	772.082	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	397.473	423.274	n/a
Deutsche Bank AG	Allemagne	173.750	181.861	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	632.245	658.807	n/a
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	193.831	215.214	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	7.203.727	8.004.690	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	3.106.495	3.216.915	n/a
UBS AG	Suisse	1.743.025	1.910.163	n/a
Total		26.129.271	29.042.095	740.523
BlackRock European Unconstrained Equity Fund (en EUR)				
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	3.053.718	3.428.716	n/a
Total		3.053.718	3.428.716	n/a

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)
		Montant prêté	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2020
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (en EUR)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	739.211
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	4.366.847	4.786.495	n/a
BNP Paribas SA	France	894.313	932.374	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	3.112.347	3.209.405	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	2.344.889	2.443.398	n/a
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.234.159	1.370.311	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	6.668.320	8.107.357	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	516.560	541.251	n/a
Societe Generale SA	France	2.900.853	3.117.717	n/a
Total		22.038.288	24.508.308	739.211
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	28.436.073	30.815.239	5.450.718
BNP Paribas SA	France	29.129.248	30.348.933	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	9.497.087	9.793.255	n/a
Credit Suisse Securities Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	7.541.769
Deutsche Bank AG	Allemagne	6.759.700	7.075.293	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	16.159.773	16.838.654	n/a
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.827.230	2.028.808	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	56.957.150	62.008.087	6.952.933
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	15.078.398	15.799.146	n/a
Nomura International Plc	Royaume-Uni	1.575.863	1.674.117	n/a
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	10.806.845	11.236.152	n/a
Societe Generale SA	France	13.380.900	14.796.614	n/a
UBS AG	Suisse	226.013	254.273	n/a
Zürcher Kantonalbank	Suisse	39.113.841	42.348.920	n/a
Total		228.948.121	245.017.491	19.945.420
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	3.468.199	3.873.391	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	53.311	54.973	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	217.649	226.792	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	171.417	179.611	n/a
Total		3.910.576	4.334.767	n/a
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (en USD)				
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	15.927.746
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	12.501.610
UBS AG	Suisse	n/a	n/a	15.220.074
Total		n/a	n/a	43.649.430
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	2.393.564	2.684.822	671.826.460
BNP Paribas SA	France	3.695.683	3.852.970	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	2.137.680	2.204.343	740.044.927
Credit Suisse AG	Irlande	19.342.512	20.488.112	488.158.397
Goldman Sachs International	États-Unis	1.370.226	1.662.896	1.665.500.047
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	1.742.581.071
Merrill Lynch International	États-Unis	683.253	759.689	n/a
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	1.065.658	1.196.979	559.661.714
The Bank of Nova Scotia	Canada	13.811.949	15.208.851	n/a
UBS AG	Suisse	523.387	573.575	235.053.896
Total		45.023.912	48.632.237	6.102.826.512

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)
		Montant prêté	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2020
BlackRock Global Real Asset Securities Fund (en USD)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	3.028.131	4.131.021	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	1.098.358	1.169.655	n/a
Deutsche Bank AG	Allemagne	n/a	n/a	147.921
Goldman Sachs International	États-Unis	7.801.314	9.467.614	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	3.288.184	3.692.167	n/a
UBS AG	Suisse	4.879.844	5.347.769	n/a
Total		20.095.831	23.808.226	147.921
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	4.350.078	4.879.413	n/a
BNP Paribas Arbitrage SNC	France	2.565.577	2.956.976	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	20.716	25.141	n/a
Total		6.936.371	7.861.530	n/a
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	30.968	n/a
BNP Paribas Arbitrage SNC	France	8.662.414	9.983.938	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	133.043	161.460	n/a
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	4.522.907	4.959.993	n/a
UBS AG	Suisse	308.380	337.950	n/a
Total		13.626.744	15.474.309	n/a
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	12.167.380	13.647.952	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	451.558	548.007	n/a
Total		12.618.938	14.195.959	n/a
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)				
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	3.540.275	3.971.069	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	140.307	204.923	n/a
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	8.357.613	9.165.279	n/a
Total		12.038.195	13.341.271	n/a
BlackRock Style Advantage Fund (en USD)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	91.974.885
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	105.354.868
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	18.710.266
Credit Suisse Securities Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	18.549.302
Deutsche Bank AG	Allemagne	n/a	n/a	58.980.540
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	63.475.308
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	26.974.804
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	19.250.872
Total		n/a	n/a	403.270.845
BlackRock Style Advantage Screened Fund (en USD)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	2.796.509
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	20.438.103
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	81.022
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	20.439.434
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	16.609.713
Total		n/a	n/a	60.364.781
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (en USD)				
BNP Paribas Arbitrage SNC	France	n/a	200.324	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	2.183.652	2.325.397	n/a
Credit Suisse AG	Irlande	1.446.416	1.532.082	n/a
Deutsche Bank AG	Allemagne	12.354.842	13.690.987	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	663.942	805.755	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.072.041	1.203.688	n/a
Macquarie Bank Ltd	Australie	n/a	354.202	n/a
Total		17.720.893	20.112.435	n/a

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)
		Montant prêté	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2020
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)				
BNP Paribas Arbitrage SNC	France	133.120	153.428	n/a
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	1.880.511	2.002.579	n/a
Goldman Sachs International	États-Unis	413.218	501.479	n/a
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	48.356	53.030	n/a
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	2.641.992	2.966.430	n/a
Macquarie Bank Ltd	Australie	78.779	110.406	n/a
UBS AG	Suisse	1.346.262	1.475.354	n/a
Total		6.542.238	7.262.706	n/a
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund (en USD)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	31.856.736
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	48.829.760
Morgan Stanley Group Inc	États-Unis	n/a	n/a	50.210.613
Total		n/a	n/a	130.897.109
BlackRock Total Advantage Fund (en EUR)				
Bank of America NA	États-Unis	n/a	n/a	6.450.729
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	4.595.640
Credit Suisse Securities Ltd	Royaume-Uni	n/a	n/a	3.561.260
Deutsche Bank AG	Allemagne	n/a	n/a	1.825.510
Goldman Sachs International	États-Unis	n/a	n/a	203.575
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	458.878
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	4.660.944
Total		n/a	n/a	21.756.536
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (en GBP)				
Deutsche Bank AG	Allemagne	n/a	n/a	2.092.722
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	44.585.142
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	n/a	n/a	103.014.031
Total		n/a	n/a	149.691.895

Tous les titres en prêt ont une échéance ouverte, puisqu'ils peuvent être rappelés ou résiliés sur une base quotidienne.

Le tableau suivant fournit une analyse de l'échéance des TRS (y compris les CFD), au 31 mai 2021:

	Échéance						Transactions ouvertes	Total
	1 jour	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	4.863.663.088	4.863.663.088
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	26.046.247	26.046.247
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	1.349.081	5.196.175	-	152.500.832	159.046.088
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	219.418.314	-	-	219.418.314
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (en GBP)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	1.180.771.999	1.180.771.999
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	9.746.736	9.746.736
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	649.349.837	649.349.837
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	1.044.492.228	1.044.492.228
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	333.554.092	333.554.092

Informations supplémentaires (non révisées) suite

	Échéance						Transactions ouvertes	Total
	1 jour	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	740.523	740.523
BlackRock Titres à revenu fixe Credit Strategies Fund (en EUR)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	739.211	739.211
BlackRock Titres à revenu fixe Strategies Fund (en EUR)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	1.815.507	9.981.374	8.148.539	-	19.945.420
BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	43.649.430	43.649.430
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	6.102.826.512	6.102.826.512
BlackRock Global Real Asset Securities Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	147.921	147.921
BlackRock Style Advantage Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	28.858.432	-	-	-	374.412.413	403.270.845
BlackRock Style Advantage Screened Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	2.877.531	-	-	-	57.487.250	60.364.781
BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund (en USD)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	130.897.109	130.897.109
BlackRock Total Advantage Fund (en EUR)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	3.209.849	-	203.575	-	18.343.112	21.756.536
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (en GBP)								
TRS (y compris les CFDs)	-	-	-	-	-	-	149.691.895	149.691.895

L'analyse de l'échéance ci-dessus est fondée sur la date d'échéance contractuelle de l'opération concernée. Les transactions ouvertes sont les transactions comportant un droit de retour ou résiliables sur une base journalière et incluent des CFD.

Garantie

Les Compartiments engagent des activités qui peuvent exiger de fournir une garantie à la contrepartie (« garantie fournie ») ou de détenir une garantie reçue (« garantie reçue ») d'une contrepartie.

Le tableau suivant présente une analyse par devise des garanties en numéraire et des garanties sous-jacentes autres qu'en numéraire reçues/fournies par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété, en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD de gré à gré (y compris les TRS et les CFD), au 31 mai 2021.

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire déposée	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire déposée
	BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)			
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	1.245.000	1.290.000	-	-
Total	1.245.000	1.290.000	-	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire déposée	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire déposée
	BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)			
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	17	-
CAD	-	-	153.476	-
CHF	-	-	156.375	-
EUR	-	-	862.396	-
GBP	-	-	730.307	-
JPY	-	-	419.824	-
USD	-	-	1.885.590	-
SEK	-	-	57.979	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	473.000	440.000	-	-
Total	473.000	440.000	4.265.964	-
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	660.000	-	-	-
Total	660.000	-	-	-
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	217	-
CAD	-	-	2.585.519	-
CHF	-	-	703.104	-
EUR	-	-	4.523.630	-
GBP	-	-	10.449.384	-
JPY	-	-	7.173.413	-
USD	-	-	4.288.124	-
SEK	-	-	122.675	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	8.090.000	2.400.000	-	-
Total	8.090.000	2.400.000	29.846.066	-

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire déposée	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire déposée
--------	-----------------------------	-------------------------------	--------------------------------------	--

BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (en GBP)

Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	6.689	-
CHF	-	-	97.629	-
EUR	-	-	2.059.169	-
GBP	-	-	807.574	-
JPY	-	-	67.714	-
USD	-	-	1.184.731	-
SEK	-	-	137.299	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
GBP	18.580.000	-	-	-
Total	18.580.000	-	4.360.805	-

BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)

Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	28.379	-
CHF	-	-	82.027	-
EUR	-	-	93.795	-
GBP	-	-	95.255	-
JPY	-	-	173.702	-
USD	-	-	490.944	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	-	369.700	-	-
Total	-	369.700	964.102	-

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)

Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	1.222.807	-
CHF	-	-	4.536.122	-
DKK	-	-	9.562	-
EUR	-	-	7.064.213	-
GBP	-	-	9.323.357	-
JPY	-	-	14.607.443	-
MXN	-	-	70	-
USD	-	-	14.756.794	-
SEK	-	-	1.374.415	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	11.080.000	12.270.000	-	-
Total	11.080.000	12.270.000	52.894.783	-

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	215.425	-
CAD	-	-	524.672	-
CHF	-	-	1.429.688	-
DKK	-	-	390	-
EUR	-	-	39.977.138	-
GBP	2.182.305	-	10.713.969	-
JPY	-	-	555.093	-
USD	-	-	17.366.105	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	6.010.000	64.802.000	-	-
Total	8.192.305	64.802.000	70.782.480	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire déposée	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire déposée
--------	-----------------------------	-------------------------------	--------------------------------------	--

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (en USD)

Opérations de prêts de titres				
CHF	-	-	45.048	-
EUR	-	-	2.276.204	-
GBP	-	-	756.065	-
JPY	-	-	763.884	-
USD	-	-	372.995	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	-	451.000	-	-
Total	-	451.000	4.214.196	-

BlackRock ESG Euro Bond Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	9	-
CHF	-	-	771.150	-
DKK	-	-	874.240	-
EUR	-	-	35.881.379	-
GBP	-	-	11.715.760	-
JPY	-	-	3.721.567	-
NOK	-	-	21.830	-
USD	-	-	10.227.110	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	-	1.566.000	-	-
Total	-	1.566.000	63.213.045	-

BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	2.752.956	-
GBP	-	-	2.179.200	-
USD	-	-	1.318.828	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	-	385.000	-	-
Total	-	385.000	6.250.984	-

BlackRock ESG Euro Short Duration Bond Fund (en EUR)

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	-	320.000	-	-
Total	-	320.000	-	-

BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	4.369.364	-
CHF	-	-	121.670	-
EUR	-	-	3.003.010	-
GBP	-	-	6.669.853	-
JPY	-	-	16.415.180	-
USD	-	-	1.347.219	-
SEK	-	-	490.162	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	580.000	10.425.500	-	-
Total	580.000	10.425.500	32.416.458	-

BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	5.222.323	-
CHF	-	-	2.731.031	-
EUR	-	-	4.713.053	-
GBP	-	-	7.540.847	-
JPY	-	-	29.554.729	-
USD	-	-	4.240.262	-
SEK	-	-	407.790	-
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	2.527.000	2.440.000	-	-
Total	2.527.000	2.440.000	54.410.035	-

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire déposée	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire déposée
--------	-----------------------------	-------------------------------	--------------------------------------	--

BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.504.521	-
CAD	-	-	234.963	-
CHF	-	-	1.440.688	-
EUR	-	-	6.484.923	-
GBP	-	-	4.191.682	-
JPY	-	-	12.214.192	-
USD	-	-	2.971.126	-

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	-	919.000	-	39.112.775
Total	-	919.000	29.042.095	39.112.775

BlackRock European Unconstrained Equity Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
CHF	-	-	646.865	-
EUR	-	-	211.426	-
GBP	-	-	330.061	-
JPY	-	-	1.556.277	-
USD	-	-	684.087	-
Total	-	-	3.428.716	-

BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	48.873	-
CAD	-	-	850.113	-
CHF	-	-	141.807	-
DKK	-	-	106.065	-
EUR	-	-	9.228.597	-
GBP	-	-	9.448.723	-
JPY	-	-	1.293.824	-
USD	-	-	3.390.306	-

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	-	2.959.000	-	-
Total	-	2.959.000	24.508.308	-

BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	72.358	-
CAD	-	-	2.113.557	-
CHF	-	-	1.568.376	-
DKK	-	-	210	-
EUR	-	-	101.146.729	-
GBP	312.227	-	55.944.563	-
JPY	-	-	28.579.291	-
NOK	-	-	39.867	-
USD	-	-	55.240.313	-

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	2.020.000	33.878.400	-	2.198.719.701
Total	2.332.227	33.878.400	244.705.264	2.198.719.701

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	408.721	-
EUR	-	-	1.059.207	-
GBP	-	-	1.616.067	-
JPY	-	-	1.022.335	-
USD	-	-	228.437	-

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	-	3.085.000	4.788.968	-
Total	-	3.085.000	9.123.735	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire déposée	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire déposée
--------	-----------------------------	-------------------------------	--------------------------------------	--

BlackRock Global Equity Absolute Return Fund (en USD)

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	270.000	-	-	-
Total	270.000	-	-	-

BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.506	-
CAD	-	-	432.257	-
CHF	-	-	367.236	-
EUR	-	-	11.260.333	-
GBP	-	-	5.693.635	-
JPY	-	-	2.918.957	-
USD	-	-	27.891.087	-
SEK	-	-	67.226	-

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	12.302.000	11.921.000	-	-
Total	12.302.000	11.921.000	48.632.237	-

BlackRock Global Real Asset Securities Fund (en USD)

Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	1.072.047	-
CHF	-	-	1.192.288	-
EUR	-	-	5.428.533	-
GBP	-	-	6.862.196	-
JPY	-	-	3.249.474	-
USD	-	-	6.003.688	-

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	-	1.041.000	-	-
Total	-	1.041.000	23.808.226	-

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	347.613	-
CAD	-	-	544.989	-
EUR	-	-	1.189.405	-
GBP	-	-	2.187.718	-
JPY	-	-	3.459.308	-
USD	-	-	132.497	-
Total	-	-	7.861.530	-

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.173.680	-
CAD	-	-	42.049	-
CHF	-	-	31.327	-
EUR	-	-	1.536.796	-
GBP	-	-	703.342	-
JPY	-	-	8.778.953	-
USD	-	-	2.744.515	-
SEK	-	-	463.647	-
Total	-	-	15.474.309	-

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	1.524.359	-
EUR	-	-	2.669.718	-
GBP	-	-	5.807.356	-
JPY	-	-	3.812.882	-
USD	-	-	381.644	-
Total	-	-	14.195.959	-

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire déposée	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire déposée
--------	-----------------------------	-------------------------------	--------------------------------------	--

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)

Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	443.534	-
EUR	-	-	1.624.014	-
GBP	-	-	1.697.957	-
JPY	-	-	4.188.699	-
USD	-	-	4.530.321	-
SEK	-	-	856.746	-
Total	-	-	13.341.271	-

BlackRock Style Advantage Fund (en USD)

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	4.510.000	3.482.000	-	-
Total	4.510.000	3.482.000	-	-

BlackRock Style Advantage Screened Fund (en USD)

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	550.000	181.000	-	-
Total	550.000	181.000	-	-

BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (en USD)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	23.550	-
CAD	-	-	548.100	-
CHF	-	-	889.537	-
EUR	-	-	3.591.293	-
GBP	-	-	2.286.841	-
JPY	-	-	2.185.254	-
USD	-	-	10.587.860	-
Total	-	-	20.112.435	-

BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)

Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	18.036	-
CAD	-	-	168.467	-
CHF	-	-	696.409	-
EUR	-	-	1.668.986	-
GBP	-	-	1.531.356	-
JPY	-	-	1.661.803	-
USD	-	-	1.512.692	-
SEK	-	-	4.957	-
Total	-	-	7.262.706	-

BlackRock Systematic Global Long/Short Equity Fund (en USD)

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	300.000	198.300	-	-
Total	300.000	198.300	-	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire déposée	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire déposée
--------	-----------------------------	-------------------------------	--------------------------------------	--

BlackRock Total Advantage Fund (en EUR)

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	-	8.000	-	-
Total	-	8.000	-	-

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (en GBP)

Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
GBP	530.000	910.000	-	-
Total	530.000	910.000	-	-

Au 31 mai 2021, une partie des garanties en numéraire reçues par les Compartiments avaient été réinvestie dans des fonds du marché monétaire gérés par les affiliées de la Société de Gestion, comme indiqué dans le portefeuille de titres des Compartiments. Les Compartiments sont le propriétaire légal d'une garantie entrante et peuvent vendre les actifs et conserver les liquidités en cas de défaut de paiement. Toutes les liquidités reçues ou fournies en garantie ont une échéance ouverte puisqu'elles ne sont pas soumises à une date d'échéance contractuelle.

Les garanties autres qu'en numéraire, reçues au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD de gré à gré, ne peuvent être vendues, réinvesties ni mises en gage.

Les rendements perçus par les Compartiments et issus du réinvestissement d'une garantie en numéraire dans des fonds du marché monétaire durant l'exercice clos le 31 mai 2021 sont résumés ci-dessous. Ces rendements représentent le rendement total cumulé du fonds du marché monétaire concerné sur l'exercice de un an clos le 31 mai 2021. Ces rendements ne tiennent pas compte de tout intérêt payable à la contrepartie en vertu des contrats de garantie correspondants.

Fonds du marché monétaire	Rendements totaux
Institutional Cash Series plc	
- Institutional Euro Liquidity Fund	(0,76) %
- Institutional GBP Liquidity Fund	(0,01) %
- Institutional US Dollar Liquidity Fund	0,01 %

Le tableau suivant présente une analyse du type, de la qualité et de l'échéance des garanties autres qu'en numéraire, reçues par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres, au 31 mai 2021.

Type et qualité de la garantie	Échéance						Ouvert	Total
	1 jour	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	5.938	991.280	-	997.218
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	3.268.746	3.268.746
Total	-	-	-	-	5.938	991.280	3.268.746	4.265.964

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance						Ouvert	Total
	1 jour	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	59.170	-	549.986	6.625.103	-	7.234.259
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	22.611.807	22.611.807
Total	-	-	59.170	-	549.986	6.625.103	22.611.807	29.846.066
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (en GBP)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	-	2.356.664	-	2.356.664
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	2.004.141	2.004.141
Total	-	-	-	-	-	2.356.664	2.004.141	4.360.805
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	626	32.657	-	33.283
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	930.819	930.819
Total	-	-	-	-	626	32.657	930.819	964.102
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	125.672	-	1.049.274	6.691.358	-	7.866.304
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	45.028.479	45.028.479
Total	-	-	125.672	-	1.049.274	6.691.358	45.028.479	52.894.783
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	672.379	1.239.569	59.236.954	-	61.148.902
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	9.633.578	9.633.578
Total	-	-	-	672.379	1.239.569	59.236.954	9.633.578	70.782.480
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	6.278	-	228.731	2.747.558	-	2.982.567
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	1.231.629	1.231.629
Total	-	-	6.278	-	228.731	2.747.558	1.231.629	4.214.196
BlackRock ESG Euro Bond Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	29.758	74	1.415.140	46.623.561	-	48.068.533
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	15.144.512	15.144.512
Total	-	-	29.758	74	1.415.140	46.623.561	15.144.512	63.213.045
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	46.760	-	31.800	6.172.424	-	6.250.984
Actions								
Total	-	-	46.760	-	31.800	6.172.424	-	6.250.984
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	-	1.218.549	-	1.218.549
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	31.197.909	31.197.909
Total	-	-	-	-	-	1.218.549	31.197.909	32.416.458

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance						Ouvert	Total
	1 jour	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	-	1.013.771	-	1.013.771
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	53.396.264	53.396.264
Total	-	-	-	-	-	1.013.771	53.396.264	54.410.035
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	18.731	7	202.783	7.498.933	-	7.720.454
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	21.321.641	21.321.641
Total	-	-	18.731	7	202.783	7.498.933	21.321.641	29.042.095
BlackRock European Unconstrained Equity Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	3.428.716	3.428.716
Total	-	-	-	-	-	-	3.428.716	3.428.716
BlackRock Titres à revenu fixe Credit Strategies Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	69.471	98.480	601.959	18.727.781	-	19.497.691
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	5.010.617	5.010.617
Total	-	-	69.471	98.480	601.959	18.727.781	5.010.617	24.508.308
BlackRock Titres à revenu fixe Strategies Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	478.762	361.135	7.749.282	134.640.795	-	143.229.974
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	101.475.290	101.475.290
Total	-	-	478.762	361.135	7.749.282	134.640.795	101.475.290	244.705.264
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	6.448	1.687	4.385	1.653.627	-	1.666.147
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	2.668.620	2.668.620
Total	-	-	6.448	1.687	4.385	1.653.627	2.668.620	4.334.767
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	3.964.498	282.447	3.385.856	16.855.128	-	24.487.929
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	24.144.308	24.144.308
Total	-	-	3.964.498	282.447	3.385.856	16.855.128	24.144.308	48.632.237
BlackRock Global Real Asset Securities Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	408.770	-	3.412.955	8.453.473	-	12.275.198
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	11.533.028	11.533.028
Total	-	-	408.770	-	3.412.955	8.453.473	11.533.028	23.808.226
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	1.085	-	9.063	1.336.049	-	1.346.197
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	6.515.333	6.515.333
Total	-	-	1.085	-	9.063	1.336.049	6.515.333	7.861.530

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance						Ouvert	Total
	1 jour	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	6.971	-	58.205	148.666	-	213.842
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	15.260.467	15.260.467
Total	-	-	6.971	-	58.205	148.666	15.260.467	15.474.309
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	23.661	-	197.550	4.021.443	-	4.242.654
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	9.953.305	9.953.305
Total	-	-	23.661	-	197.550	4.021.443	9.953.305	14.195.959
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	8.848	-	73.872	1.197.174	-	1.279.894
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	12.061.377	12.061.377
Total	-	-	8.848	-	73.872	1.197.174	12.061.377	13.341.271
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	325.881	-	423.788	3.744.174	-	4.493.843
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	15.618.592	15.618.592
Total	-	-	325.881	-	423.788	3.744.174	15.618.592	20.112.435
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)								
Garantie reçue – Prêts de titres								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	21.652	-	180.777	2.201.468	-	2.403.897
Actions								
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	-	4.858.809	4.858.809
Total	-	-	21.652	-	180.777	2.201.468	4.858.809	7.262.706

Le tableau suivant présente une analyse du type, de la qualité et de l'échéance des garanties autres qu'en numéraire, reçues/fournies par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des IFD de gré à gré, au 31 mai 2021.

Type et qualité de la garantie	Échéance						Opérations ouvertes	Total
	1 jour	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	-	39.112.775	-	39.112.775
Total	-	-	-	-	-	39.112.775	-	39.112.775
BlackRock Titres à revenu fixe Strategies Fund (en EUR)								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	74.716.080	2.124.003.621	-	2.198.719.701
Total	-	-	-	-	74.716.080	2.124.003.621	-	2.198.719.701
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)								
Titres à revenu fixe								
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	-	4.788.968	-	4.788.968
Total	-	-	-	-	-	4.788.968	-	4.788.968

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Les titres de qualité 'investment grade' sont ceux émis par une entité possédant une notation minimale de crédit de qualité 'investment grade' attribuée par au moins une agence de notation mondialement reconnue : Standard & Poor's, Moody's ou Fitch.

Un indice d'actions reconnu contient au moins 20 actions parmi lesquelles aucune action individuelle ne représente plus de 20 % du total de l'indice et aucune combinaison de cinq actions ne représente plus de 60 % du total de l'indice.

L'analyse de l'échéance pour les titres à revenu fixe reçus ou fournis en garantie est fondée sur la date d'échéance contractuelle concernée, tandis que pour les actions, les ETF et les fonds du marché monétaire reçus ou fournis en garantie sont présentés en tant qu'opérations ouvertes puisqu'elles ne sont soumises à aucune date d'échéance contractuelle.

Le tableau suivant présente une analyse des montants de garantie autre qu'en numéraire reçus par le Compartiment en relation avec des opérations de prêt de titres et détenus par le Dépositaire des Compartiments (ou via ses délégués) ou par l'entremise d'un système de règlement des titres, au 31 mai 2021.

Dépositaire	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Prêts de titres
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		4.265.964
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		29.846.066
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (en GBP)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		4.360.805
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		964.102
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		52.894.783
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		40.804.542
EUROCLEAR		29.977.938
Total		70.782.480
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		2.887.487
EUROCLEAR		1.326.709
Total		4.214.196
BlackRock ESG Euro Bond Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		40.410.502
EUROCLEAR		22.802.543
Total		63.213.045
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		2.547.910
EUROCLEAR		3.703.074
Total		6.250.984
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		32.416.458
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		54.410.035
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		25.808.261
EUROCLEAR		3.233.834
Total		29.042.095
BlackRock European Unconstrained Equity Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		3.428.716
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		8.906.589
EUROCLEAR		15.601.719
Total		24.508.308
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)		153.644.030
EUROCLEAR		91.061.234
Total		244.705.264

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Dépositaire	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Prêts de titres
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	4.065.780	
EUROCLEAR	268.987	
Total	4.334.767	
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	42.574.926	
EUROCLEAR	6.057.311	
Total	48.632.237	
BlackRock Global Real Asset Securities Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	23.808.226	
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	7.861.530	
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	15.474.309	
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	14.195.959	
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	13.341.271	
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	20.112.435	
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)		
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch (ou ses délégués)	7.262.706	

Le tableau suivant présente les dix plus grands émetteurs, en valeur, de garanties autres qu'en numéraire reçues par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD de gré à gré, au 31 mai 2021.

Émetteurs	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)		
Vodafone Group Plc	222.794	0,64 %
Royaume-Uni	183.236	0,53 %
Trésor des États-Unis	181.305	0,52 %
République française	172.707	0,50 %
République d'Autriche	171.188	0,49 %
Novartis AG	156.375	0,45 %
PepsiCo Inc	156.097	0,45 %
Walt Disney Co	144.334	0,42 %
République fédérale d'Allemagne	128.788	0,37 %
Kohnan Shoji Co Ltd	110.332	0,32 %
Autres émetteurs	2.638.808	7,61 %
Total	4.265.964	12,30 %
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)		
Royaume-Uni	3.775.240	0,31 %
Rentokil Initial Plc	1.825.512	0,15 %
Royaume des Pays-Bas	1.802.515	0,15 %
Imperial Brands Plc	1.683.052	0,14 %
George Weston Ltd	1.544.899	0,13 %
Asahi Holdings Inc	1.455.078	0,12 %
Just Eat Takeaway.com NV	1.074.679	0,09 %
Intertek Group Plc	964.716	0,08 %
Manulife Financial Corp	668.209	0,05 %
Gouvernement du Canada	367.227	0,03 %
Autres émetteurs	14.684.939	1,19 %
Total	29.846.066	2,44 %

Émetteurs	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Emerging Companies Absolute Return Fund (en GBP)		
République française	498.510	0,06 %
Royaume-Uni	494.830	0,06 %
République d'Autriche	494.125	0,06 %
Trésor des États-Unis	490.770	0,06 %
République fédérale d'Allemagne	371.740	0,05 %
Schlumberger NV	259.245	0,03 %
ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	142.466	0,02 %
Wuestenrot & Wuerttembergische AG	141.661	0,02 %
Ashmore Group Plc	141.205	0,02 %
HomeServe Plc	141.203	0,02 %
Autres émetteurs	1.185.050	0,14 %
Total	4.360.805	0,54 %
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)		
Vodafone Group Plc	70.976	0,56 %
PepsiCo Inc	61.183	0,48 %
Walt Disney Co	56.573	0,45 %
Kohnan Shoji Co Ltd	43.245	0,34 %
Pegasystems Inc	42.904	0,34 %
Novartis AG	34.445	0,27 %
QUALCOMM Inc	31.568	0,25 %
Royaume des Pays-Bas	30.934	0,25 %
Crédit Agricole SA	30.602	0,24 %
Spin Master Corp	28.379	0,22 %
Autres émetteurs	533.293	4,23 %
Total	964.102	7,63 %

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Émetteurs	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)		
Royaume-Uni	1.484.870	0,16 %
Amazon.com Inc	1.380.718	0,15 %
Evolution AB	1.374.398	0,15 %
Apple Inc	1.353.536	0,15 %
NVIDIA Corp	1.335.963	0,15 %
Vivendi SE	1.332.512	0,15 %
West Japan Railway Co	1.327.626	0,15 %
Ricoh Co Ltd	1.323.813	0,15 %
BHP Group Plc	1.288.876	0,14 %
HSBC Holdings Plc	1.288.706	0,14 %
Autres émetteurs	39.403.765	4,35 %
Total	52.894.783	5,84 %
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)		
Trésor des États-Unis	10.541.761	0,69 %
République fédérale d'Allemagne	9.777.008	0,64 %
Royaume-Uni	9.765.074	0,64 %
République française	9.706.983	0,63 %
Royaume de Belgique	8.329.757	0,54 %
Royaume des Pays-Bas	6.070.319	0,40 %
République d'Autriche	1.441.395	0,09 %
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	1.132.977	0,07 %
European Investment Bank	1.098.506	0,07 %
Gouvernement du Canada	1.060.827	0,07 %
Autres émetteurs	11.857.873	0,77 %
Total	70.782.480	4,61 %
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund (en USD)		
République française	512.895	0,66 %
Royaume-Uni	475.285	0,61 %
Royaume de Belgique	473.017	0,61 %
République fédérale d'Allemagne	401.678	0,52 %
Royaume des Pays-Bas	335.398	0,43 %
Trésor des États-Unis	307.085	0,40 %
République d'Autriche	214.956	0,28 %
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	119.028	0,15 %
Sony Corp	116.164	0,15 %
Weir Group Plc	113.829	0,15 %
Autres émetteurs	1.144.861	1,48 %
Total	4.214.196	5,44 %
BlackRock ESG Euro Bond Fund (en EUR)		
Royaume-Uni	10.196.120	1,59 %
République fédérale d'Allemagne	8.621.566	1,34 %
République française	8.011.574	1,25 %
Royaume des Pays-Bas	6.399.443	1,00 %
Royaume de Belgique	5.405.442	0,84 %
Trésor des États-Unis	2.537.743	0,39 %
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	1.794.362	0,28 %
République de Finlande	1.782.131	0,28 %
République d'Autriche	1.642.807	0,26 %
European Investment Bank	1.472.368	0,23 %
Autres émetteurs	15.349.489	2,39 %
Total	63.213.045	9,85 %

Émetteurs	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock ESG Euro Corporate Bond Fund (en EUR)		
Royaume-Uni	2.179.200	0,80 %
République fédérale d'Allemagne	1.077.385	0,40 %
Trésor des États-Unis	823.845	0,30 %
République française	707.289	0,26 %
Royaume de Belgique	455.548	0,17 %
Royaume des Pays-Bas	232.248	0,09 %
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	217.171	0,08 %
Asian Development Bank	210.932	0,08 %
République de Finlande	188.402	0,07 %
République d'Autriche	92.083	0,03 %
Autres émetteurs	66.881	0,02 %
Total	6.250.984	2,30 %
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)		
International Consolidated Airlines Group SA	2.909.147	0,19 %
Taylor Wimpey Plc	2.909.018	0,19 %
Murata Manufacturing Co Ltd	2.891.862	0,19 %
Ampol Ltd	2.851.438	0,19 %
Hoya Corp	2.456.461	0,16 %
Mabuchi Motor Co Ltd	2.079.793	0,14 %
ConvaTec Group Plc	2.002.794	0,13 %
Keyence Corp	1.756.490	0,11 %
SHO-BOND Holdings Co Ltd	1.595.702	0,10 %
Daiwabo Holdings Co Ltd	1.285.221	0,08 %
Autres émetteurs	9.678.532	0,63 %
Total	32.416.458	2,11 %
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)		
International Consolidated Airlines Group SA	2.420.262	0,37 %
Taylor Wimpey Plc	2.420.154	0,37 %
Murata Manufacturing Co Ltd	2.405.881	0,36 %
Ampol Ltd	2.372.250	0,36 %
Hoya Corp	2.043.650	0,31 %
Mabuchi Motor Co Ltd	1.730.281	0,26 %
ConvaTec Group Plc	1.666.222	0,25 %
Keyence Corp	1.461.310	0,22 %
SHO-BOND Holdings Co Ltd	1.327.542	0,20 %
Toyota Industries Corp	1.261.077	0,19 %
Autres émetteurs	35.301.406	5,35 %
Total	54.410.035	8,24 %
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)		
Royaume-Uni	1.889.193	0,39 %
République fédérale d'Allemagne	1.192.363	0,25 %
Toyota Industries Corp	1.189.260	0,24 %
Kao Corp	1.101.780	0,23 %
République française	1.098.442	0,23 %
Shin-Etsu Chemical Co Ltd	1.019.208	0,21 %
East Japan Railway Co	939.153	0,19 %
Mitsubishi Heavy Industries Ltd	923.837	0,19 %
Royaume de Belgique	919.783	0,19 %
Royaume des Pays-Bas	747.567	0,15 %
Autres émetteurs	18.021.509	3,71 %
Total	29.042.095	5,98 %

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Émetteurs	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock European Unconstrained Equity Fund (en EUR)		
HSBC Holdings Plc	233.408	0,50 %
BHP Group Plc	232.916	0,50 %
Duke Energy Corp	226.118	0,48 %
Amazon.com Inc	225.051	0,48 %
NET One Systems Co Ltd	224.025	0,48 %
Furukawa Electric Co Ltd	223.420	0,48 %
Amada Co Ltd	217.976	0,47 %
Bucher Industries AG	189.330	0,40 %
Anheuser-Busch InBev SA	184.499	0,39 %
Maeda Road Construction Co Ltd	142.698	0,30 %
Autres émetteurs	1.329.275	2,84 %
Total	3.428.716	7,32 %
BlackRock Fixed Income Credit Strategies Fund (en EUR)		
Royaume-Uni	8.505.495	2,21 %
République fédérale d'Allemagne	3.096.455	0,80 %
République française	1.899.432	0,49 %
Trésor des États-Unis	1.679.167	0,44 %
Royaume des Pays-Bas	1.051.816	0,27 %
Royaume de Belgique	934.627	0,24 %
République d'Autriche	723.222	0,19 %
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	397.853	0,10 %
Gouvernement du Canada	366.894	0,10 %
Asian Development Bank	318.242	0,08 %
Autres émetteurs	5.535.105	1,44 %
Total	24.508.308	6,36 %
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)		
Royaume-Uni	34.353.719	0,61 %
Trésor des États-Unis	18.386.251	0,32 %
République française	18.209.858	0,32 %
République fédérale d'Allemagne	17.440.510	0,31 %
Royaume des Pays-Bas	13.298.549	0,23 %
Royaume de Belgique	12.238.963	0,22 %
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	8.004.970	0,14 %
République d'Autriche	7.697.757	0,14 %
République de Finlande	4.827.924	0,09 %
KDDI Corp	4.441.545	0,08 %
Autres émetteurs	105.805.218	1,86 %
Total	244.705.264	4,32 %
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)		
Royaume-Uni	725.942	0,46 %
Royaume des Pays-Bas	376.364	0,24 %
Rentokil Initial Plc	337.139	0,21 %
Imperial Brands Plc	310.829	0,19 %
George Weston Ltd	285.315	0,18 %
Asahi Holdings Inc	268.726	0,17 %
Just Eat Takeaway.com NV	198.474	0,12 %
Intertek Group Plc	178.165	0,11 %
Trésor des États-Unis	124.985	0,08 %
Manulife Financial Corp	123.406	0,08 %
Autres émetteurs	1.405.422	0,88 %
Total	4.334.767	2,72 %

Émetteurs	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)		
Trésor des États-Unis	8.940.012	0,15 %
République française	5.580.016	0,09 %
Royaume-Uni	4.249.307	0,07 %
RH	1.555.201	0,03 %
CoreLogic Inc	1.524.617	0,03 %
Starbucks Corp	1.523.437	0,03 %
Apple Inc	1.523.429	0,03 %
Amazon.com Inc	1.522.632	0,03 %
Royaume des Pays-Bas	1.345.957	0,02 %
Peloton Interactive Inc	1.305.780	0,02 %
Autres émetteurs	19.561.849	0,32 %
Total	48.632.237	0,82 %
BlackRock Global Real Asset Securities Fund (en USD)		
Royaume-Uni	2.732.785	0,87 %
République française	1.925.671	0,61 %
Trésor des États-Unis	1.916.192	0,61 %
République fédérale d'Allemagne	1.865.440	0,59 %
Province de l'Ontario au Canada	1.705.924	0,54 %
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	746.656	0,24 %
Gouvernement du Canada	610.647	0,19 %
GVC Holdings Plc	503.259	0,16 %
Novartis AG	495.718	0,16 %
Quilter Plc	479.241	0,15 %
Autres émetteurs	10.826.693	3,43 %
Total	23.808.226	7,55 %
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)		
Royaume-Uni	858.469	0,84 %
Rentokil Initial Plc	449.541	0,44 %
Royaume des Pays-Bas	443.878	0,44 %
Imperial Brands Plc	414.459	0,41 %
George Weston Ltd	380.439	0,37 %
Asahi Holdings Inc	358.320	0,35 %
Toyota Industries Corp	276.182	0,27 %
Just Eat Takeaway.com NV	264.645	0,26 %
Kao Corp	255.867	0,25 %
Intertek Group Plc	237.566	0,23 %
Autres émetteurs	3.922.164	3,86 %
Total	7.861.530	7,72 %
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)		
Toyota Industries Corp	932.501	0,59 %
Kao Corp	863.908	0,54 %
Shin-Etsu Chemical Co Ltd	799.163	0,50 %
Tokio Marine Holdings Inc	738.588	0,46 %
East Japan Railway Co	736.392	0,46 %
Mitsubishi Heavy Industries Ltd	724.383	0,46 %
Aurizon Holdings Ltd	529.827	0,33 %
SAP SE	515.318	0,32 %
CSL Ltd	477.136	0,30 %
Evolution AB	463.647	0,29 %
Autres émetteurs	8.693.446	5,46 %
Total	15.474.309	9,71 %

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Émetteurs	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)		
Royaume-Uni	2.487.561	0,67 %
Rentokil Initial Plc	1.257.387	0,34 %
Royaume des Pays-Bas	1.241.548	0,34 %
Imperial Brands Plc	1.159.263	0,31 %
George Weston Ltd	1.064.105	0,29 %
Asahi Holdings Inc	1.002.237	0,27 %
Just Eat Takeaway.com NV	740.224	0,20 %
Intertek Group Plc	664.483	0,18 %
Manulife Financial Corp	460.254	0,12 %
Informa Plc	238.663	0,06 %
Autres émetteurs	3.880.234	1,05 %
Total	14.195.959	3,83 %
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)		
Evolution AB	856.746	0,12 %
Apple Inc	833.946	0,12 %
NVIDIA Corp	832.903	0,12 %
Vivendi SE	830.752	0,12 %
West Japan Railway Co	827.706	0,12 %
Ricoh Co Ltd	825.328	0,12 %
Z Holdings Corp	753.714	0,11 %
Royaume-Uni	732.015	0,11 %
Slack Technologies Inc	700.681	0,10 %
Monolithic Power Systems Inc	675.672	0,10 %
Autres émetteurs	5.471.808	0,79 %
Total	13.341.271	1,93 %
BlackRock Systematic ESG World Equity Fund (en USD)		
Vodafone Group Plc	1.365.001	0,38 %
PepsiCo Inc	1.176.663	0,33 %
Trésor des États-Unis	1.168.876	0,33 %
Walt Disney Co	1.087.996	0,30 %
République française	858.381	0,24 %
Kohnan Shoji Co Ltd	831.684	0,23 %
Pegasystems Inc	825.129	0,23 %
Royaume-Uni	770.850	0,22 %
Novartis AG	662.449	0,18 %
QUALCOMM Inc	607.115	0,17 %
Autres émetteurs	10.758.291	3,00 %
Total	20.112.435	5,61 %

Émetteurs	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)		
Royaume-Uni	474.451	0,26 %
République française	453.704	0,25 %
Trésor des États-Unis	447.742	0,24 %
République fédérale d'Allemagne	361.075	0,20 %
République d'Autriche	359.741	0,19 %
HSBC Holdings Plc	201.938	0,11 %
BHP Group Plc	201.513	0,11 %
Duke Energy Corp	195.631	0,11 %
Amazon.com Inc	194.708	0,11 %
NET One Systems Co Ltd	193.820	0,10 %
Autres émetteurs	4.178.383	2,26 %
Total	7.262.706	3,94 %

Émetteur de garanties autres qu'en numéraire (transactions sur instruments dérivés de gré à gré)	Valeur	% de la VNI du Compartiment

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)		
French Republic	4.788.968	3,00 %

À la fin de l'exercice, aucune garantie en titres reçue d'un émetteur unique, en relation avec une gestion efficace du portefeuille et des IFD de gré à gré, ne dépassait 20 % de la VL de chaque Compartiment concerné.

À la fin de l'exercice, aucun des Fonds n'avait été pleinement garanti en titres émis ou garantis par un État membre de l'UE.

Vous voulez en savoir davantage ?

blackrockinternational.com | +44 (0)20 7743 3000

© 2021 BlackRock, Inc. Tous droits réservés. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS, iSHARES, BUILD ON BLACKROCK et SO WHAT DO I DO WITH MY MONEY sont des marques de BlackRock, Inc. ou de ses filiales aux États-Unis et ailleurs. Toutes les autres marques de commerce appartiennent à leurs détenteurs respectifs.

BlackRock[®]

Go paperless... 
It's Easy, Economical and Green!
Go to www.icsdelivery.com