



# Halbjahresbericht für das Sondervermögen

iShares SLI UCITS ETF (DE)

Für den Berichtszeitraum vom 01.05.2024 bis 31.10.2024

**HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM  
01.05.2024 BIS 31.10.2024**

**Inhaltsverzeichnis**

---

<b>Hinweis und Lizenzvermerk</b>	3
<b>Ergänzende Angaben für Anleger in der Schweiz</b>	4
<b>Bericht des Vorstands</b>	5
<b>Halbjahresbericht für iShares SLI UCITS ETF (DE)</b>	7
Vermögensübersicht	7
Vermögensaufstellung	8
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte	10
Ertrags- und Aufwandsrechnung	11
Entwicklung des Sondervermögens	11
Anhang	12
<b>Allgemeine Informationen</b>	13

## HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024

### Hinweis

---

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

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

Rechtlich bindend ist allein die deutsche Fassung.

### Lizenzvermerk

---

#### Rechtliche Informationen

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

#### Für Anleger in Deutschland

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

#### Risikohinweise

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

#### Index-Haftungsausschlüsse

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

## HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024

### Ergänzende Angaben für Anleger in der Schweiz

---

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

#### Zahlstelle in der Schweiz:

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

#### Vertreter in der Schweiz:

BlackRock Asset Management Schweiz AG  
Bahnhofstrasse 39  
8001 Zürich, Schweiz

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

### Zusätzliche Angaben für Investoren im Ausland:

---

#### iShares SLI UCITS ETF (DE)

**Gesamtkostenquote (TER):** 0,51%

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

#### Wertentwicklung des Fonds der letzten drei Kalenderjahre:

31.12.2020 - 31.12.2021	+24,77%
31.12.2021 - 31.12.2022	-19,41%
31.12.2022 - 31.12.2023	+10,24%

# HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024

## Bericht des Vorstands

---

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

die BlackRock Asset Management Deutschland AG blickt auf eine positive Marktentwicklung im Berichtszeitraum Q1-Q4 2023 zurück und erwartet auch weiterhin eine dynamische Entwicklung am Markt für Exchange Traded Products (ETP). ETPs sind eine Auswahl an Finanzinstrumenten, z.B. ETFs, die über den Tag an nationalen Börsen gehandelt werden und welche mittlerweile ein wichtiger Bestandteil der deutschen Investmentfondsbranche geworden sind. Von dieser Entwicklung hat besonders iShares profitiert. iShares erzielte in der gesamten EMEA-Region (Europe, Middle East & Africa) in 2023 Nettomittelzuflüsse von 70,8 Mrd. US-Dollar bzw. 64,1 Mrd. Euro (Vorjahr: 48,3 Mrd. US-Dollar bzw. 45,3 Mrd. EUR). Dies entsprach mit 43,9% dem höchsten Anteil an Mittelzuflüssen in ETFs in der Region EMEA.

Das ETF-Angebot von iShares umfasst derzeit 687 in Deutschland zugelassene Anteilsklassen. Dies ermöglicht Investoren hierzulande einen einfachen und diversifizierten Zugang zu einer Vielzahl von weltweiten Märkten und Anlageklassen. Rund ein Zehntel (65) dieser Anteilsklassen sind in Deutschland aufgelegt und am „(DE)“ im Fondsnamen erkennbar.

Zum 31. Oktober 2024 betrug das verwaltete Volumen der deutschen Fonds 50,1 Milliarden Euro bzw. 54,4 Milliarden US-Dollar. Das darin enthaltene Volumen der 22 Teilgesellschaftsvermögen (TGVs), wovon 21 zum öffentlichen Vertrieb zugelassenen sind, betrug zum selben Stichtag 10,6 Milliarden Euro bzw. 11,5 Milliarden US-Dollar. Der vorliegende Jahresbericht informiert Sie detailliert über die Entwicklung unserer Indexfonds.

Die deutsche Wirtschaft bleibt in einer ausgeprägten Schwächephase, mit einem erneuten leichten Rückgang des Bruttoinlandsprodukts (BIP) im dritten Quartal 2024. Die Industrie- und Bauproduktion ging spürbar zurück, was größtenteils auf anhaltend hohe Finanzierungskosten und Unsicherheiten in Bezug auf die wirtschaftlichen Rahmenbedingungen zurückzuführen ist. Diese Faktoren belasten die Investitionstätigkeit und dämpfen die Nachfrage nach Investitionsgütern. Die Nachfrage nach deutschen Exportgütern erholt sich nur schwach und weist auf fortwährende Wettbewerbsprobleme hin. Sowohl die Inlands- als auch die Auslandsnachfrage nach deutschen Industrieprodukten bleibt somit verhalten, und die geringe Kapazitätsauslastung im verarbeitenden Gewerbe wirkt sich negativ auf die Investitionsbereitschaft aus.

Der private Konsum konnte die Konjunktur im dritten Quartal ebenfalls kaum stützen. Trotz eines deutlichen Anstiegs der Realeinkommen, da die Löhne stärker als die Preise steigen, zeigen sich die Verbraucher weiterhin zurückhaltend und nutzen ihre zusätzlichen finanziellen Spielräume nur zögerlich. Die Konsumentenstimmung verbesserte sich zwar leicht, bleibt jedoch auf niedrigem Niveau, während die Sparneigung weiterhin hoch ist.

In der Industrieproduktion gab es im August ein leichtes Plus, das jedoch fast ausschließlich auf die Automobilbranche zurückzuführen ist, bei der Sonderfaktoren eine Rolle spielten. Die Produktion in den energieintensiven Branchen bleibt insgesamt schwach, und der Auftragseingang sank im August wieder deutlich, nachdem er zuvor durch Großaufträge einen Anstieg verzeichnet hatte. Die Inlandnachfrage schwächte sich ab, und die leichten Erholungstendenzen in der Auslandsnachfrage nach deutschen Industrieprodukten verloren an Dynamik. Die Geschäftserwartungen in der Industrie fielen im dritten Quartal deutlich zurück, und kurzfristig ist keine Besserung der Industriekonjunktur in Sicht.

Der Arbeitsmarkt reagiert bislang relativ mild auf die wirtschaftliche Schwäche, wenngleich die Arbeitslosigkeit leicht angestiegen ist. Sektoren wie das produzierende Gewerbe und der Handel verzeichnen Personalabbau, während in den Bereichen Gesundheit, Bildung und Logistik weiterhin eingestellt wird. Die Nutzung der Kurzarbeit bleibt nahezu ausschließlich auf das verarbeitende Gewerbe beschränkt, da spezielle Zugangserleichterungen derzeit nicht bestehen.

Die Preise für Energierohstoffe stiegen aufgrund geopolitischer Spannungen zwischenzeitlich leicht an, stabilisierten sich jedoch insgesamt wieder. Die Inflation sank im September auf 1,8%, getrieben von einem deutlichen Rückgang der Energiepreise. Die Preise für Lebensmittel, insbesondere Obst und Gemüse, stiegen hingegen. Diese Entwicklungen deuten darauf hin, dass die deutsche Wirtschaft mittelfristig in einer Phase anhaltender Schwäche verharren könnte.

Unsicherheiten bestehen aus Sicht der Gesellschaft vor allem in der weiteren Entwicklung der Inflation und der entsprechenden Reaktion der Notenbanken. Ferner stehen neben geopolitischen Konflikten wie in der Ukraine oder Taiwan oder im Nahen Osten auch diverse Parlaments- und Präsidentschaftswahlen außerhalb von Europa an. Mit der breiten, an den Anleger- und Marktinteressen ausgerichteten Produktpalette sieht sich die Gesellschaft für den Wettbewerb weiterhin gut gerüstet, auch wenn ein zunehmender Wettbewerbsdruck zu verspüren ist, der sich unter anderem durch den Markteintritt weiterer und teilweise großer Wettbewerber ergibt und den Margendruck in der Asset-Management-Industrie erhöht. Um die Gesellschaft trotz des zunehmenden Wettbewerbs am ETF-Markt auch in Zukunft zu behaupten, ist eine Vielzahl an kundengruppenspezifischen und individuellen Vertriebsaktivitäten geplant.

Seit dem Beginn des Angriffskrieges der Russischen Föderation gegen den souveränen Nachbarstaat Ukraine am 24. Februar 2022 wurden bereits seit 2014 bestehende wirtschaftliche Sanktionen gegen Russland signifikant ausgeweitet. Diese wurden neben der Europäischen Union auch von weiteren internationalen Organisationen sowie Nationalstaaten, wie zum Beispiel dem Vereinigten Königreich, Norwegen oder der Schweiz gegen Unternehmen, Individuen oder Funktionäre erlassen. Die Sanktionen werden durch weitere Verordnungen und Regulierungsmaßnahmen ergänzt, welche unter anderem den Handel mit russischen Wertpapieren signifikant eingeschränkt haben. Die langfristigen Folgen des Konflikts sind zum aktuellen Zeitpunkt schwer abzuschätzen. Die iShares Fonds der BlackRock Asset Management Deutschland AG (inklusive TGVs) hatten zum Berichtstichtag kein direktes Exposure in russischen oder ukrainischen Wertpapieren.

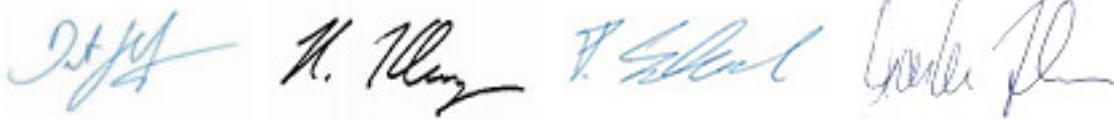
## HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024

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

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

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

Ihr Vorstand der BlackRock Asset Management Deutschland AG



Dirk Schmitz

Harald Klug

Peter Scharl

Maika Jahn

**HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024**

Vermögensübersicht zum 31.10.2024

	Kurswert in CHF	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>382.531.457,89</b>	<b>100,05</b>
<b>1. Aktien</b>	<b>379.997.411,90</b>	<b>99,39</b>
Finanzsektor	112.154.077,55	29,33
Gesundheits- und Pflegewesen	56.378.036,05	14,75
Handel und Dienstleistung	174.356.044,62	45,60
Herstellung industr. Grundstoffe und Halbfabrikate	7.812.937,60	2,04
Industrielle Produktion incl. Bauindustrie	19.816.865,00	5,18
Nahrungsherstellung und Produktion v. Konsumgütern	4.322.250,00	1,13
Technologiesektor	5.157.201,08	1,35
<b>2. Derivate</b>	<b>-20.593,00</b>	<b>-0,01</b>
Finanzterminkontrakte	-20.593,00	-0,01
<b>3. Bankguthaben</b>	<b>448.704,45</b>	<b>0,12</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>2.105.934,54</b>	<b>0,55</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-196.509,89</b>	<b>-0,05</b>
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-1.885,21	-0,00
Sonstige Verbindlichkeiten	-194.624,68	-0,05
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>382.334.948,00</b>	<b>100,00</b>

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

# HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024

## Vermögensaufstellung zum 31.10.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs im Berichtszeitraum	Kurswert in CHF	% des Fondsvermögens <sup>2)</sup>
<b>Wertpapiervermögen</b>								<b>379.997.411,90</b>	<b>99,39</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>379.997.411,90</b>	<b>99,39</b>
<b>Aktien</b>								<b>340.547.578,10</b>	<b>89,07</b>
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	CH0012221716		STK	367.825	112.471	148.212	CHF 47,900	17.618.817,50	4,61
Adecco Group AG Namens-Aktien SF 0,1	CH0012138605		STK	72.428	86.816	14.388	CHF 27,060	1.959.901,68	0,51
Alcon AG Namens-Aktien SF -,04	CH0432492467		STK	203.545	51.295	63.483	CHF 79,580	16.198.111,10	4,24
Cie Financière Richemont SA Namens-Aktien SF 1	CH0210483332		STK	144.420	61.337	145.037	CHF 125,350	18.103.047,00	4,73
Geberit AG Nam.-Akt. (Dispost.) SF -,10	CH0030170408		STK	14.447	3.945	3.930	CHF 540,800	7.812.937,60	2,04
Givaudan SA Namens-Aktien SF 10	CH0010645932		STK	3.438	928	924	CHF 4.097,000	14.085.486,00	3,68
Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2	CH0012214059		STK	215.674	53.483	58.152	CHF 85,080	18.349.543,92	4,80
Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -,02	CH0102484968		STK	88.864	24.570	24.642	CHF 52,660	4.679.578,24	1,22
Kühne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1	CH0025238863		STK	23.974	6.573	6.575	CHF 215,600	5.168.794,40	1,35
Logitech International S.A. Namens-Aktien SF -,25	CH0025751329		STK	72.883	21.917	19.965	CHF 70,760	5.157.201,08	1,35
Lonza Group AG Namens-Aktien SF 1	CH0013841017		STK	31.208	8.743	9.685	CHF 532,600	16.621.380,80	4,35
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	392.384	124.710	85.592	CHF 81,580	32.010.686,72	8,37
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,49	CH0012005267		STK	350.298	88.663	113.887	CHF 93,800	32.857.952,40	8,59
Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01	CH0024608827		STK	9.807	2.655	2.639	CHF 1.193,000	11.699.751,00	3,06
Sandoz Group AG Namens-Aktien SF -,05	CH1243598427		STK	186.073	51.107	51.108	CHF 39,350	7.321.972,55	1,92
Schindler Holding AG Inhaber-Part.sch. SF -,10	CH0024638196		STK	17.571	4.863	4.870	CHF 251,400	4.417.349,40	1,16
SGS S.A. Namen-Aktien SF 0,04	CH1256740924		STK	66.143	20.652	19.945	CHF 91,500	6.052.084,50	1,58
SIG Group AG Namens-Aktien SF-,01	CH0435377954		STK	148.221	40.708	42.010	CHF 18,590	2.755.428,39	0,72
Sika AG Namens-Aktien SF 0,01	CH0418792922		STK	65.135	17.857	15.701	CHF 240,500	15.664.967,50	4,10
Sonova Holding AG Namens-Aktien SF 0,05	CH0012549785		STK	21.252	5.827	5.828	CHF 315,200	6.698.630,40	1,75
Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01	CH1175448666		STK	50.966	16.108	13.985	CHF 114,000	5.810.124,00	1,52
Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25	CH0012255151		STK	12.450	3.356	3.398	CHF 176,550	2.198.047,50	0,57
Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	CH0014852781		STK	12.410	3.464	3.798	CHF 704,400	8.741.604,00	2,29
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561		STK	126.992	34.547	32.934	CHF 110,650	14.051.664,80	3,68
Swisscom AG Namens-Aktien SF 1	CH0008742519		STK	10.980	3.014	3.004	CHF 526,000	5.775.480,00	1,51
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585		STK	1.396.943	1.056.028	289.117	CHF 26,540	37.074.867,22	9,70
VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0311864901		STK	11.616	3.194	3.191	CHF 359,500	4.175.952,00	1,09
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394		STK	34.233	10.472	10.662	CHF 510,800	17.486.216,40	4,57
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>								<b>39.449.833,80</b>	<b>10,32</b>
Chocoladef. Lindt & Sprüngli Inhaber-Part.sch. SF 10	CH0010570767		STK	425	130	145	CHF 10.170,000	4.322.250,00	1,13
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048		STK	131.122	32.609	34.174	CHF 267,900	35.127.583,80	9,19
<b>Derivate</b>								<b>-20.593,00</b>	<b>-0,01</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>								<b>-20.593,00</b>	<b>-0,01</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>-20.593,00</b>	<b>-0,01</b>
Swiss Leader Index Future (FSLI) Dez. 24		EDT	Anzahl	119			CHF	-20.593,00	-0,01
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>								<b>448.704,45</b>	<b>0,12</b>
<b>Bankguthaben</b>								<b>448.704,45</b>	<b>0,12</b>
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>								<b>448.704,45</b>	<b>0,12</b>
Verwahrestelle: State Street Bank International GmbH			CHF	448.704,45		%	100,000	448.704,45	0,12



**HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in CHF	% des Fondsvermögens <sup>2)</sup>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>2.105.934,54</b>	<b>0,55</b>
Quellensteuerrückerstattungsansprüche			CHF	1.943.406,54				1.943.406,54	0,51
Initial Margin			CHF	158.000,00				158.000,00	0,04
Geleistete Variation Margin			CHF	4.528,00				4.528,00	0,00
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>								<b>-1.885,21</b>	<b>-0,00</b>
<b>EUR-Kredite</b>								<b>-1.885,21</b>	<b>-0,00</b>
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			EUR	-2.008,19		%	100,000	-1.885,21	-0,00
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>-194.624,68</b>	<b>-0,05</b>
Verwaltungsvergütung			CHF	-190.606,93				-190.606,93	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten			EUR	-4.279,84				-4.017,75	-0,00
<b>Fondsvermögen</b>							<b>CHF</b>	<b>382.334.948,00</b>	<b>100,00</b>
Anteilwert							CHF	133,22	
Umlaufende Anteile							STK	2.870.000	

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

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

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

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

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

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

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

**Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2024**

Euro (EUR) 1,06523 = 1 Schweizer Franken (CHF)

**Marktschlüssel**

**a) Terminbörsen**

EDT Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

**HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024**

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

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Wertpapiere</b>					
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
Roche Holding AG Inhaber-Aktien SF 1	CH0012032113	STK	1.352	6.846	
<b>Derivate</b>					
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
<b>Gekaufte Kontrakte:</b>					<b>4.424</b>
Basiswert(e): Swiss Leader Index (Price) (CHF) (SLI)					

**HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024**

**Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)  
für den Zeitraum vom 01.05.2024 bis 31.10.2024**

<b>I. Erträge</b>		
1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	CHF	2.227.281,74
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	CHF	1.884,92
3. Abzug ausländischer Quellensteuer	CHF	-618.607,30
<b>Summe der Erträge</b>	<b>CHF</b>	<b>1.610.559,36</b>
<b>II. Aufwendungen</b>		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	CHF	-117,85
2. Verwaltungsvergütung	CHF	-983.238,45
3. Sonstige Aufwendungen	CHF	-24.294,46
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>CHF</b>	<b>-1.007.650,76</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>CHF</b>	<b>602.908,60</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>		
1. Realisierte Gewinne	CHF	15.732.830,15
2. Realisierte Verluste	CHF	-1.649.269,54
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>CHF</b>	<b>14.083.560,61</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>CHF</b>	<b>14.686.469,21</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	CHF	-6.940,15
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	CHF	3.888.432,10
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>CHF</b>	<b>3.881.491,95</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>CHF</b>	<b>18.567.961,16</b>

**Entwicklung des Sondervermögens**

			<b>2024</b>
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>CHF</b>		<b>358.813.519,90</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr	CHF		-4.960.937,04
2. Mittelzufluss/Mittelabfluss (netto)	CHF		9.509.632,50
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	CHF	91.664.620,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	CHF	-82.154.987,50	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	CHF		404.771,48
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	CHF		18.567.961,16
davon nicht realisierte Gewinne	CHF	-6.940,15	
davon nicht realisierte Verluste	CHF	3.888.432,10	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>CHF</b>		<b>382.334.948,00</b>

**HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024****Anhang****Sonstige Angaben****Anzahl umlaufende Anteile und Wert eines Anteils am Berichtsstichtag gem. § 16 Abs. 1 Nr. 1 KARBV**

Anteilwert	CHF	133,22
Umlaufende Anteile	STK	2.870.000

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

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

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

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Berichtszeitraumes sowie zum Berichtsstichtag grundsätzlich auf Basis handelbarer Börsenkurse.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

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

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

**Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2024**

Euro	(EUR)	1,06523 = 1 Schweizer Franken (CHF)
------	-------	-------------------------------------

**Marktschlüssel****a) Terminbörsen**

EDT	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
-----	--------------------------------------

**Angaben für Indexfonds gem. § 16 Abs. 2 KARBV**

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums gem. § 16 Abs. 2 Nr. 1 KARBV	0,38 Prozentpunkte
--	--------------------

**Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben gem. § 7 Nr. 9 d) KARBV****Erläuterung zur Berechnung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste**

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

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

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

München, den 31. Oktober 2024

BlackRock Asset Management Deutschland AG (KVG)



Peter Scharl

Harald Klug

## HALBJAHRESBERICHT FÜR ISHARES SLI UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2024 BIS 31.10.2024

### Allgemeine Informationen

---

#### Verwaltungsgesellschaft

BlackRock Asset Management Deutschland AG  
Lenbachplatz 1  
80333 München

Grundkapital per 31.12.2023: 5 Mio. EUR

Haftendes Eigenkapital per 31.12.2023: 67,07 Mio. EUR

#### Gesellschafter

BlackRock Investment Management (UK) Limited

#### Vorstand

Dirk Schmitz  
Vorstandsvorsitzender  
München

Harald Klug  
Vorstand  
München

Peter Scharl  
Vorstand  
München

Maika Jahn\*  
Vorstand  
München

#### Aufsichtsrat

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

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

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

#### Verwahrstelle

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

#### Wirtschaftsprüfer

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

(\* ) seit 15.10.2024

## Want to know more?

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

© 2024 BlackRock, Inc. Sämtliche Rechte vorbehalten. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS und iSHARES sind eingetragene Handelsmarken von BlackRock, Inc. oder ihren Niederlassungen in den USA und anderen Ländern. Alle anderen Marken sind Eigentum der jeweiligen Rechteinhaber.

**iShares**  
by BlackRock

Go paperless...   
It's Easy, Economical and Green!  
Go to [www.blackrock.com/edelivery](https://www.blackrock.com/edelivery)