



# **Jahresbericht für das Sondervermögen**

iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS  
ETF (DE)

Für den Berichtszeitraum vom 01.05.2021 bis 30.04.2022

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS  
ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

**Inhaltsverzeichnis**

---

<b>Hinweis und Lizenzvermerk</b>	3
<b>Ergänzende Angaben für Anleger in Österreich und der Schweiz</b>	4
<b>Bericht des Vorstands</b>	5
<b>iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE)</b>	6
Tätigkeitsbericht des Fondsmanagements	6
Jahresbericht für iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE)	8
<b>Allgemeine Informationen</b>	23

# JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

## Hinweis

---

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

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

Rechtlich bindend ist allein die deutsche Fassung.

## Lizenzvermerk

---

### Rechtliche Informationen

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

### Für Anleger in Deutschland

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

### Risikohinweise

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

### Index-Haftungsausschlüsse

Der Dow Jones Sustainability Eurozone ex Alcohol, Tobacco, Gambling, Armaments & Firearms and Adult Entertainment Index<sup>SM</sup> ist ein gemeinsames Produkt von Dow Jones Indexes, dem Marketingnamen und einer lizenzierten Marke der CME Group Index Services LLC ("CME Indexes") und der SAM Indexes GmbH ("SAM") (im Folgenden "Lizenzgeber" genannt). Diese werden im Rahmen einer Lizenz genutzt. Das Sondervermögen wird vom Lizenzgeber weder gesponsert, gefördert, verkauft oder vermarktet. Der Lizenzgeber ist mit der Gesellschaft abgesehen von der Lizenzierung des zugrunde liegenden Index und der gestatteten Verwendung der Marke in Zusammenhang mit der Namensnennung des Sondervermögens in keiner Weise verbunden.

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS  
ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022****Ergänzende Angaben für Anleger in Österreich und 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.

**Steuerlicher Vertreter in Österreich:**

Ernst & Young  
Wagramer Str. 19  
1220 Wien, Österreich

**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 Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE)

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

31.12.2018 - 31.12.2019	+27,11%
31.12.2019 - 31.12.2020	-3,88%
31.12.2020 - 31.12.2021	+24,85%

**PEA-Qualifikation**

Der PEA (Plan d'Épargne en Actions) ist ein französischer Aktiensparplan, der im steuerrechtlichen Sinn in Frankreich ansässige natürliche Personen ermutigen soll, in europäische Aktien zu investieren. Jeder für PEA in Frage kommende Fonds muss mindestens 75% seines Vermögens dauerhaft in für PEA geeignete Wertpapiere investieren, die von Unternehmen begeben werden, die (i) in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in Island, Liechtenstein oder Norwegen ansässig sind und (ii) der Körperschaftsteuer oder einer gleichwertigen Steuer unterliegen.

Per 30.04.2022 hatte der nachstehende Fonds den folgenden Prozentsatz seines Vermögens in PEA-geeigneten Wertpapieren angelegt:

Fonds	% investiert in europäische, für PEA geeignete Aktien
iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE)	98,57

# JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

## Bericht des Vorstands

---

Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,

die BlackRock Asset Management Deutschland AG blickt auf eine dynamische Entwicklung am Markt für Exchange Traded Products (ETP) im Berichtszeitraum Q1 2022 zurück. Von dieser Entwicklung hat besonders iShares profitiert. Auf europäischer Ebene erzielte iShares in dem ersten Quartal 2022 Nettomittelzuflüsse von rund 51,2 Mrd. Euro bzw. 56,9 Mrd. US-Dollar (Vorjahreszeitraum 2021: 59,4 Mrd. EUR bzw. 69,7 Mrd. US-Dollar). Unter der Marke iShares ist BlackRock weltweit Marktführer bei ETFs.

Das ETF-Angebot von iShares umfasst derzeit 620 in Deutschland zugelassene Anteilsklassen. Dies ermöglicht Investoren hierzulande einen einfachen und diversifizierten Zugang zu einer Vielzahl von weltweiten Märkten und Anlageklassen. Rund ein Zehntel (64) dieser Anteilsklassen sind in Deutschland aufgelegt und am „(DE)“ im Fondsnamen erkennbar.

Zum 30. April 2022 betrug das verwaltete Volumen der deutschen Fonds 43,0 Milliarden Euro bzw. 45,3 Milliarden US-Dollar. Das darin enthaltene Volumen der 23 zum öffentlichen Vertrieb zugelassenen Teilgesellschaftsvermögen (TGVs) betrug zum selben Stichtag 9,3 Milliarden Euro bzw. 9,8 Milliarden US-Dollar. Der vorliegende Jahresbericht informiert Sie detailliert über die Entwicklung unserer Indexfonds.

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

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

Birgit Ludwig

# JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

## Tätigkeitsbericht des Fondsmanagements

### Anlageziele und Anlagepolitik

Das Sondervermögen iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE) ist ein börsengehandelter Indexfonds (Exchange Traded Fund, ETF), der möglichst genau die Wertentwicklung des Dow Jones Sustainability Eurozone Index ex Alcohol, Tobacco, Gambling, Armaments & Firearms and Adult Entertainment (EUR) abbildet. Der Index bildet derzeit 79 Unternehmen ab, die unter den Top 20 Prozent ihrer Branche im Bereich Wirtschaft, Umweltschutz und sozialen Kriterien liegen. Von vorne herein nicht in die Auswahl einbezogen werden Unternehmen, die mit Alkohol, Tabak, Glücksspiel, Waffen und Erwachsenenunterhaltung handeln. Der Index ist nach der Marktkapitalisierung der ausgewählten Unternehmen gewichtet. Die Auswahl der Unternehmen erfolgt nach den SAM (Sustainable Asset Management) Kriterien. Die SAM Group ist ein global anerkannter Experte auf dem Gebiet der Nachhaltigkeit und analysiert mehr als 1.000 Unternehmen jährlich. Zur Replizierung des Index investiert das Sondervermögen iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE) im Rahmen eines passiven Investmentansatzes direkt in die im Index enthaltenen Wertpapiere entsprechend ihrer Gewichtung im Index. Der Fonds war zum Stichtag 30. April 2022 in 79 Titel investiert.

### Aufnahme von Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG-Kriterien“)

Ab dem am 30. April 2021 endenden Geschäftsjahr wurden die vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale durch Nachbildung der Indexwerte des Referenzindex des Fonds erreicht. Der Referenzindex des Fonds wendet Ausschlusskriterien an, um Indexkomponenten herauszufiltern, die nicht den im Prospekt des Fonds dargelegten Umwelt- und Sozialmerkmalen entsprechen. Der Anlageverwalter ist nach wie vor davon überzeugt, dass die Indexmethodik weiterhin die im Prospekt des Fonds dargelegten Good-Governance-Kriterien erfüllt.

### Struktur des Sondervermögens im Hinblick auf die Anlageziele sowie wesentliche Veränderungen während des Berichtszeitraums

Der Duplizierungsgrad des Fonds verglichen mit dem Benchmarkindex lag zum Ende des Berichtszeitraums bei 99,97%. Mittelzuflüsse während der Berichtsperiode wurden ebenfalls entsprechend der Gewichtung der Aktien im Index angelegt. Dividenden werden im Fonds angesammelt. Das Sondervermögen iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE) ist ein ausschüttender Fonds. Die Erträge werden nach Verrechnung mit den Aufwendungen im Rahmen von Zwischenausschüttungen bzw. sechs Wochen nach Geschäftsjahresende ausgeschüttet.

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren im Wesentlichen aus Transaktionen mit Aktien, die aufgrund von Indexveränderungen, Kapitalmaßnahmen und der Rücknahme von Anteilscheinen durchgeführt wurden.

Indexveränderungen, die für den Dow Jones Sustainability Eurozone Index ex Alcohol, Tobacco, Gambling, Armaments & Firearms and Adult Entertainment (EUR) vom Indexanbieter veröffentlicht wurden, wurden im Fonds direkt nachvollzogen.

Neuaufnahme	
Acciona S.A. Acciones Port. EO 1	ES0125220311
ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16	NL0011872643
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37
bioMerieux Actions au Porteur (P.S.) o.N.	FR0013280286
Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.	DE0005140008
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14
Italgas S.P.A. Azioni nom. o.N.	IT0005211237
Iveco Group N.V. Aandelen op naam EUR 1	NL0015000LU4
Merlin Properties SOCIMI S.A. Acciones Nominativas EO 1	ES0105025003
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026
OMV AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000743059
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783
Signify N.V. Registered Shares EO -,01	NL0011821392
STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04	NL0000226223
Valéo S.E. Actions Port. EO 1	FR0013176526
voestalpine AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000937503
Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	DE0007664039
Warehouses De Pauw N.V. Actions Nom. o.N.	BE0974349814

Löschung	
Aéroports de Paris S.A. Actions au Port. EO 3	FR0010340141
ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN	LU1598757687
Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5	FR0000120172
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644
Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50	ES0130960018
Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N.	DE000EVNK013
Naturgy Energy Group S.A. Acciones Port. EO 1	ES0116870314
NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	NL0010773842
Nokian Renkaat Oyj Registered Shares EO 0,2	FI0009005318

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

<b>Löschung</b>	
SBM Offshore N.V. Aandelen op naam EO -,25	NL0000360618
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972
Siemens Energy AG Namens-Aktien o.N.	DE000ENER6Y0
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271
Wereldhave N.V. Aandelen aan toonder EO 1	NL0000289213

**Wesentliche Risiken und Ereignisse im Berichtszeitraum**

Auswirkungen der Corona Pandemie (COVID-19)

In Bezug auf die unverändert einschlägige COVID-19 Pandemie waren für die Verwaltung des Sondervermögens bis auf intensiviertere Überwachungsaktivitäten keine weiteren, außerordentlichen Maßnahmen zum Management der relevanten Risiken im Verlauf des Geschäftsjahres erforderlich.

Marktpreisrisiko

Um das Anlageziel, eine möglichst genaue Abbildung der Wertentwicklung des Dow Jones Sustainability Eurozone Index ex Alcohol, Tobacco, Gambling, Armaments & Firearms and Adult Entertainment (EUR) im Berichtszeitraum zu realisieren, wurde ein ausschließlich passiver Investmentansatz verfolgt. Daher wurden im Rahmen der Fondsmanagementaktivitäten, die dieses Sondervermögen betrafen, keine Risiken aktiv gesteuert bzw. eingegangen. Das Sondervermögen unterlag im Berichtszeitraum dem allgemeinen sowie dem spezifischen, aus Einzeltiteln resultierenden Marktpreisrisiko. Im gesamten Berichtszeitraum wurde die durch die Indexanbieter vorgegebene Einzeltitelselektion innerhalb des Anlageuniversums umgesetzt. Damit unterlag das Sondervermögen einem hohen absoluten Marktpreisrisiko.

Währungsrisiko

Das Sondervermögen investierte im Berichtszeitraum gemäß den Indexvorgaben in europäische Aktien der Eurolandzone. Es lag somit für Euro-Anleger kein Währungsrisiko vor.

Liquiditätsrisiko

Die Veräußerbarkeit der im Sondervermögen gehaltenen Vermögenswerte war jederzeit gegeben, somit war das Liquiditätsrisiko als gering zu bewerten.

Operationelles Risiko

Das Management von operationellen Risiken für das Sondervermögen erfolgt im Rahmen des Risikomanagementsystems der BlackRock Asset Management Deutschland AG.

Die operationellen Risiken der für das Sondervermögen relevanten Prozesse sind Gegenstand einer regelmäßigen Identifikation, Analyse und Überwachung. Dies wird unter anderem durch den Einsatz von Instrumenten wie dem Self-Assessment, Risikoindikatoren und einer Schadensfalldatenbank erreicht.

Geschäftsbereiche bzw. -prozesse, die für dieses Sondervermögen maßgeblich sind und welche durch die BlackRock Asset Management Deutschland AG ausgelagert wurden, unterliegen einem Outsourcing-Controlling Prozess.

Im Berichtszeitraum entstand dem Sondervermögen kein Schaden aus operationellen Risiken.

Als Reaktion auf die zunehmende Ausbreitung von COVID-19 hat die Gesellschaft ab Mitte März 2020 weiterreichende Notfallmaßnahmen in Kraft gesetzt. Diese werden unter Beachtung der politischen, wirtschaftlichen und gesellschaftlichen Gegenmaßnahmen fortlaufend angepasst.

Russland-Ukraine-Konflikt

Aufgrund der geopolitischen Spannungen infolge des russischen Einmarsches in die Ukraine und der Auswirkungen der nachfolgenden Sanktionen, Vorschriften und anderen Maßnahmen, die den normalen Handel mit russischen Wertpapieren beeinträchtigten, fielen die Werte bestimmter Finanzmärkte stark ab. Die Gesellschaft überwacht weiterhin die Anlageperformance im Einklang mit den Anlagezielen; die Geschäftstätigkeit des Fonds sowie die Veröffentlichung der Nettoinventarwerte werden weiterhin fortgeführt.

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS  
ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

Vermögensübersicht zum 30.04.2022

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>135.855.553,69</b>	<b>100,03</b>
<b>1. Aktien</b>	<b>134.850.187,87</b>	<b>99,29</b>
Belgien	421.057,44	0,31
Deutschland	35.614.052,60	26,22
Finnland	3.549.284,11	2,61
Frankreich	30.257.636,20	22,28
Irland	2.399.994,80	1,77
Italien	9.491.632,49	6,99
Niederlande	30.376.237,38	22,37
Österreich	809.297,78	0,60
Portugal	1.503.060,53	1,11
Spanien	20.427.934,54	15,04
<b>2. Forderungen</b>	<b>483.665,77</b>	<b>0,36</b>
<b>3. Bankguthaben</b>	<b>521.700,05</b>	<b>0,38</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-45.029,28</b>	<b>-0,03</b>
Sonstige Verbindlichkeiten	-45.029,28	-0,03
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>135.810.524,41</b>	<b>100,00</b>

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

# JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

## Vermögensaufstellung zum 30.04.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>2)</sup>
<b>Wertpapiervermögen</b>								<b>134.850.187,87</b>	<b>99,29</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>134.850.187,87</b>	<b>99,29</b>
<b>Aktien</b>								<b>134.850.187,87</b>	<b>99,29</b>
ABN AMRO Bank N.V. Aand.op naam Dep.Rec./EO 1	NL0011540547	STK		34.191	534	5.880	EUR 11,995	410.121,05	0,30
Acciona S.A. Acciones Port. EO 1	ES0125220311	STK		2.021	2.255	234	EUR 187,500	378.937,50	0,28
ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port. EO -,50	ES0167050915	STK		20.951	1.702	6.490	EUR 24,590	515.185,09	0,38
Air France-KLM S.A. Actions Port. EO 1	FR0000031122	STK		24.897	11.540	8.251	EUR 3,954	98.442,74	0,07
Alstom S.A. Actions Port. EO 7	FR0010220475	STK		24.131	2.451	4.818	EUR 21,120	509.646,72	0,38
alstria office REIT-AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A0LD2U1	STK		1.170	233	16.131	EUR 13,310	15.572,70	0,01
Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01	ES0109067019	STK		36.866	2.670	8.183	EUR 60,400	2.226.706,40	1,64
Arkema S.A. Actions au Porteur EO 10	FR0010313833	STK		5.224	278	1.319	EUR 109,150	570.199,60	0,42
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	STK		33.261	1.950	8.038	EUR 548,000	18.227.028,00	13,42
ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16	NL0011872643	STK		11.299	12.615	1.316	EUR 43,340	489.698,66	0,36
Atos SE Actions au Porteur EO 1	FR0000051732	STK		8.233	466	1.400	EUR 23,400	192.652,20	0,14
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK		168.455	10.452	37.271	EUR 25,460	4.288.864,30	3,16
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835	STK		545.708	35.491	115.922	EUR 5,059	2.760.736,77	2,03
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37	STK		1.419.117	1.591.972	172.855	EUR 2,817	3.996.943,03	2,94
Bankinter S.A. Acciones Nom. EO -,30	ES0113679I37	STK		52.642	8.223	18.002	EUR 5,632	296.479,74	0,22
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003	STK		26.112	1.294	5.141	EUR 78,510	2.050.053,12	1,51
bioMerieux Actions au Porteur (P.S.) o.N.	FR0013280286	STK		3.869	4.326	457	EUR 90,780	351.227,82	0,26
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104	STK		92.914	5.643	20.676	EUR 49,705	4.618.290,37	3,40
Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12	FR0006174348	STK		23.689	803	4.482	EUR 27,430	649.789,27	0,48
Caixabank S.A. Acciones Port. EO 1	ES0140609019	STK		356.180	38.973	99.012	EUR 3,088	1.099.883,84	0,81
CNH Industrial N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0010545661	STK		81.500	5.164	17.102	EUR 13,730	1.118.995,00	0,82
Covivio S.A. Actions Port. EO 3	FR0000064578	STK		3.842	160	914	EUR 67,950	261.063,90	0,19
Crh Plc Registered Shares EO -,32	IE0001827041	STK		62.860	3.176	14.034	EUR 38,180	2.399.994,80	1,77
Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.	DE0005140008	STK		169.132	190.016	20.884	EUR 9,626	1.628.064,63	1,20
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055	STK		15.549	860	3.145	EUR 166,200	2.584.243,80	1,90
EDP - Energias de Portugal SA Açções Nom. EO 1	PTEDP0AM0009	STK		240.135	24.840	44.409	EUR 4,442	1.066.679,67	0,79
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367	STK		632.328	38.473	131.585	EUR 6,218	3.931.815,50	2,90
Engie S.A. Actions Port. EO 1	FR0010208488	STK		145.477	8.171	29.649	EUR 11,322	1.647.090,59	1,21
Ferrovial S.A. Acciones Port. EO -,20	ES0118900010	STK		40.809	2.707	8.968	EUR 24,590	1.003.493,31	0,74
Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005785802	STK		16.305	673	4.066	EUR 59,440	969.169,20	0,71
Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005785604	STK		33.823	2.091	7.018	EUR 33,800	1.143.217,40	0,84
Galp Energia SGPS S.A. Açções Nominativas EO 1	PTGALOAM0009	STK		37.522	586	6.468	EUR 11,630	436.380,86	0,32
Grifols S.A. Acciones Port. Class A EO -,25	ES0171996087	STK		24.021	1.845	5.486	EUR 16,000	384.336,00	0,28
Hera S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0001250932	STK		66.868	3.979	11.512	EUR 3,556	237.782,61	0,18
HUGO BOSS AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1PHFF7	STK		4.627	194	1.470	EUR 53,860	249.210,22	0,18
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14	STK		479.536	531.600	52.064	EUR 11,010	5.279.691,36	3,89
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	ES0148396007	STK		91.819	6.651	20.183	EUR 20,100	1.845.561,90	1,36
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004	STK		106.881	6.159	21.893	EUR 27,450	2.933.883,45	2,16
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618	STK		1.399.363	86.392	329.036	EUR 1,955	2.735.474,79	2,01
Italgas S.P.A. Azioni nom. o.N.	IT0005211237	STK		40.350	44.362	4.012	EUR 6,180	249.363,00	0,18
Iveco Group N.V. Aandelen op naam EUR 1	NL0015000LU4	STK		16.361	17.946	1.585	EUR 5,648	92.406,93	0,07
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485	STK		6.021	288	1.252	EUR 513,100	3.089.375,10	2,27
Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50	NL0000009827	STK		14.306	797	3.526	EUR 160,600	2.297.543,60	1,69
Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	NL0000009538	STK		72.285	4.727	17.978	EUR 25,000	1.807.125,00	1,33

# JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>2)</sup>	
Koninklijke Vopak N.V. Aandelen aan toonder EO -,50	NL0009432491		STK	5.461	5.519	6.409	EUR	25,620	139.910,82	0,10
Lanxess AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005470405		STK	7.064	249	1.444	EUR	37,090	262.003,76	0,19
LINEA DIRECTA ASEGURADORA S.A. Acciones Port. EO -,04	ES0105546008		STK	56.699	22.438	28.160	EUR	1,369	77.620,93	0,06
Merlin Properties SOCIMI S.A. Acciones Nominativas EO 1	ES0105025003		STK	27.044	30.478	3.434	EUR	10,410	281.528,04	0,21
METRO AG Inhaber-Stammaktien o.N.	DE000BFB0019		STK	10.386	175	1.929	EUR	8,380	87.034,68	0,06
Moncler S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0004965148		STK	17.245	1.849	3.252	EUR	50,280	867.078,60	0,64
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	11.472	11.472	-	EUR	227,300	2.607.585,60	1,92
Neste Oyj Registered Shs o.N.	FI0009013296		STK	35.250	2.062	7.263	EUR	41,200	1.452.300,00	1,07
OMV AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000743059		STK	11.783	13.158	1.375	EUR	49,100	578.545,30	0,43
Pirelli & C. S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005278236		STK	35.885	589	7.543	EUR	4,748	170.381,98	0,13
Poste Italiane S.p.A. Azioni nom. EO -,51	IT0003796171		STK	37.787	587	6.473	EUR	9,378	354.366,49	0,26
PostNL N.V. Aandelen aan toonder EO -,08	NL0009739416		STK	40.071	2.625	9.747	EUR	3,128	125.342,09	0,09
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783		STK	71.277	79.902	8.625	EUR	46,590	3.320.795,43	2,45
Rexel S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0010451203		STK	19.485	806	4.391	EUR	19,640	382.685,40	0,28
Saipem S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005252140		STK	47.327	4.244	14.562	EUR	1,082	51.207,81	0,04
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	94.102	5.837	19.288	EUR	101,180	9.521.240,36	7,01
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	89.484	5.442	18.597	EUR	97,560	8.730.059,04	6,43
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	65.390	3.986	14.407	EUR	117,780	7.701.634,20	5,67
Siemens Gamesa Renew. En. S.A. Acciones Port. EO -,17	ES0143416115		STK	18.325	1.568	4.619	EUR	15,325	280.830,63	0,21
Signify N.V. Registered Shares EO -,01	NL0011821392		STK	10.503	11.727	1.224	EUR	40,600	426.421,80	0,31
Société Générale S.A. Actions Port. EO 1,25	FR0000130809		STK	63.684	3.752	14.461	EUR	23,170	1.475.558,28	1,09
Sodexo S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121220		STK	6.757	277	1.435	EUR	72,120	487.314,84	0,36
STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04	NL0000226223		STK	53.700	59.949	6.249	EUR	35,770	1.920.849,00	1,41
Television Fse 1 S.A. (TF1) Actions Port. EO 0,2	FR0000054900		STK	8.142	159	3.309	EUR	8,085	65.828,07	0,05
Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22	IT0003242622		STK	115.138	6.815	23.276	EUR	7,766	894.161,71	0,66
UPM Kymmene Corp. Registered Shares o.N.	FI0009005987		STK	43.678	2.539	8.991	EUR	33,040	1.443.121,12	1,06
Valmet Oyj Registered Shares o.N.	FI4000074984		STK	13.573	3.045	2.272	EUR	25,660	348.283,18	0,26
Valéo S.E. Actions Port. EO 1	FR0013176526		STK	19.048	21.401	2.353	EUR	17,505	333.435,24	0,25
Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0000124141		STK	53.786	13.223	9.528	EUR	27,900	1.500.629,40	1,10
voestalpine AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000937503		STK	9.208	10.115	907	EUR	25,060	230.752,48	0,17
Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	DE0007664039		STK	15.020	16.770	1.750	EUR	148,940	2.237.078,80	1,65
Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	DE000A1ML7J1		STK	63.559	21.825	11.400	EUR	38,000	2.415.242,00	1,78
Warehouses De Pauw N.V. Actions Nom. o.N.	BE0974349814		STK	11.448	12.778	1.330	EUR	36,780	421.057,44	0,31
Wendel SE Actions Port. EO 4	FR0000121204		STK	2.244	33	372	EUR	95,500	214.302,00	0,16
Wärtsilä Corp. Reg. Shares o.N.	FI0009003727		STK	39.696	1.161	7.562	EUR	7,698	305.579,81	0,23
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>								<b>521.700,05</b>	<b>0,38</b>	
<b>Bankguthaben</b>								<b>521.700,05</b>	<b>0,38</b>	
<b>EUR-Guthaben</b>								<b>508.334,68</b>	<b>0,37</b>	
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			EUR	508.334,68			%	100,000	508.334,68	0,37
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>								<b>13.365,37</b>	<b>0,01</b>	
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			USD	14.099,80			%	100,000	13.365,37	0,01
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>483.665,77</b>	<b>0,36</b>	
Dividendenansprüche			EUR	357.827,57				357.827,57	0,26	
Quellensteuerrückerstattungsansprüche			EUR	125.838,20				125.838,20	0,09	

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>2)</sup>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>-45.029,28</b>	<b>-0,03</b>
Verwaltungsvergütung			EUR	-43.743,39				-43.743,39	-0,03
Sonstige Verbindlichkeiten			EUR	-1.285,89				-1.285,89	-0,00
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>135.810.524,41</b>	<b>100,00</b>
Anteilwert							EUR	13,72	
Umlaufende Anteile							STK	9.900.000	

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

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

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Wertpapiere</b>				
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN	LU1598757687	STK	1.240	66.372
Aéroports de Paris S.A. Actions au Port. EO 3	FR0010340141	STK	22	2.607
Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5	FR0000120172	STK	4.747	59.451
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007	STK	695	50.885
Danone S.A. Actions Port. EO -,25	FR0000120644	STK	1.458	65.925
Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50	ES0130960018	STK	-	21.214
Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N.	DE000EVNK013	STK	164	18.337
Naturgy Energy Group S.A. Acciones Port. EO 1	ES0116870314	STK	308	34.750
NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	NL0010773842	STK	535	31.551
Nokian Renkaat Oyj Registered Shares EO 0,2	FI0009005318	STK	110	12.311
Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50	ES0173093024	STK	23.063	23.063
SBM Offshore N.V. Aandelen op naam EO -,25	NL0000360618	STK	168	18.359
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972	STK	3.798	54.373
Siemens Energy AG Namens-Aktien o.N.	DE000ENER6Y0	STK	716	38.180
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271	STK	3.787	239.872
Wereldhave N.V. Aandelen aan toonder EO 1	NL0000289213	STK	48	4.582
<b>Andere Wertpapiere</b>				
ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Anrechte	ES06670509K6	STK	24.582	24.582
Ferrovial S.A. Anrechte	ES06189009I5	STK	45.893	45.893
Ferrovial S.A. Anrechte	ES06189009H7	STK	47.070	47.070
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
alstria office REIT-AG nachtr.z.Ver.k.eing.Inh.-Aktien	DE000A3MQCE1	STK	3.511	3.511
<b>Andere Wertpapiere</b>				
ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Anrechte	ES06670509J8	STK	27.327	27.327
Iberdrola S.A. Anrechte	ES06445809N8	STK	524.582	524.582
Veolia Environnement S.A. Anrechte	FR0014005GA0	STK	48.461	48.461
Vonovia SE Inhaber-Bezugsrechte	DE000A3MQB30	STK	52.324	52.324

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS  
ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

**Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)  
für den Zeitraum vom 01.05.2021 bis 30.04.2022**

**I. Erträge**

1. Dividenden inländischer Aussteller	EUR	793.658,24
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) <sup>3)</sup>	EUR	3.676.212,75
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-2.591,66
4. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR	-41.020,90
5. Sonstige Erträge	EUR	8.143,94
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>	<b>4.434.402,37</b>

**II. Aufwendungen**

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-624.000,93
2. Sonstige Aufwendungen	EUR	-136.640,59
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>	<b>-760.641,52</b>

<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>	<b>3.673.760,85</b>
--------------------------------------	------------	---------------------

**IV. Veräußerungsgeschäfte**

1. Realisierte Gewinne	EUR	8.801.630,00
2. Realisierte Verluste	EUR	-2.150.094,58
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>EUR</b>	<b>6.651.535,42</b>

<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>10.325.296,27</b>
---	------------	----------------------

1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-10.096.317,97
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-7.828.877,31

<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-17.925.195,28</b>
--	------------	-----------------------

<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-7.599.899,01</b>
--	------------	----------------------

<sup>3)</sup> darin enthalten sind Dividenden i.S.d. § 19 Absatz 1 REITG in Höhe von EUR 24.481,74

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

**Entwicklung des Sondervermögens**

		<b>2021/2022</b>
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>167.865.825,01</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr	EUR	-755.780,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR	-2.606.651,85
3. Mittelzufluss/Mittelabfluss (netto)	EUR	-21.814.125,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	2.305.315,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-24.119.440,00
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	721.155,26
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-7.599.899,01
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	-10.096.317,97
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-7.828.877,31
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>135.810.524,41</b>

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung (insgesamt und je Anteil)		insgesamt	je Anteil
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>	<b>EUR</b>	<b>34.342.123,30</b>	<b>3,47</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr <sup>4)</sup>	EUR	21.866.732,45	2,21
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	10.325.296,27	1,04
3. Zuführung aus dem Sondervermögen <sup>5)</sup>	EUR	2.150.094,58	0,22
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>	<b>EUR</b>	<b>-30.668.370,25</b>	<b>-3,10</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	-10.296.791,59	-1,04
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	-20.371.578,66	-2,06
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>EUR</b>	<b>3.673.753,05</b>	<b>0,37</b>
1. Zwischenausschüttung	EUR	2.606.651,85	0,26
2. Endausschüttung	EUR	1.067.101,20	0,11

4) Differenz zum Vorjahr aufgrund errechnetem Ertragsausgleich auf Vorträge.

5) Zuführung in Höhe der realisierten Verluste des Geschäftsjahres.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
2021/2022	EUR	135.810.524,41	13,72
2020/2021	EUR	167.865.825,01	14,73
2019/2020	EUR	140.970.681,26	10,89
2018/2019	EUR	201.981.107,64	13,20

Anhang

Angaben nach der Derivateverordnung:

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotenzial wurde für dieses Sondervermögen gem. der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

Anhang

Sonstige Angaben

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

Anteilwert	EUR	13,72
Umlaufende Anteile	STK	9.900.000

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:

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

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.04.2022

US-Dollar	(USD)	1,05495 = 1 Euro (EUR)
-----------	-------	------------------------

# JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

## Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 Abs. 1 Nr. 3 KARBV

**Gesamtkostenquote** gemäß § 101 Abs. 2 KAGB: 0,41%.

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Für das Sondervermögen ist gemäß den Anlagebedingungen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Pauschalgebühr von 0,40% p.a. auf Basis des durchschnittlichen Nettoinventarwertes vereinbart. Mit dieser Pauschalgebühr sind die Leistungen der Gesellschaft, insbesondere die Kosten für die Tätigkeit der Verwahrstelle für die gesetzlich geforderten Drucke, Versendungen und Veröffentlichungen im Zusammenhang mit dem Sondervermögen und für die Prüfung des Berichts, abgegolten. Davon entfallen bezogen auf den durchschnittlichen Nettoinventarwert 0,0109% p.a. auf die Verwahrstelle und 0,0287% p.a. auf Dritte (Druck- und Veröffentlichungskosten, Abschlussprüfung sowie Sonstige). Die Gesellschaft zahlt keine Vergütungen an Vermittler.

In der Kostenpauschale sind folgende Aufwendungen nicht enthalten:

- Kosten, die im Zusammenhang mit dem Erwerb und der Veräußerung von Vermögensgegenständen entstehen (Transaktionskosten),
- Bankübliche Depotgebühren, ggf. einschließlich der banküblichen Kosten für die Verwahrung ausländischer Wertpapiere im Ausland sowie damit im Zusammenhang stehende Steuern,
- Kosten, die im Zusammenhang mit der laufenden Kontoführung entstehen,
- Kosten für die Geltendmachung und Durchsetzung von Rechtsansprüchen des Sondervermögens,
- Kosten für die Information der Anleger des Sondervermögens mittels eines dauerhaften Datenträgers, mit Ausnahme der Kosten für Informationen bei Fondsverschmelzungen.

Details zur Vergütungsstruktur sind im aktuellen Verkaufsprospekt geregelt.

## Geleistete Vergütungen und erhaltene Rückvergütungen gem. § 16 Abs. 1 Nr. 3 c) KARBV

Im Berichtszeitraum 01.05.2021 bis 30.04.2022 erhielt die Kapitalverwaltungsgesellschaft BlackRock Asset Management Deutschland AG für das Sondervermögen iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE) keine Rückvergütung der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle oder an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwendererstattungen.

## Angaben zu den sonstigen Erträgen und sonstigen Aufwendungen gem. § 16 Abs. 1 Nr. 3 e) KARBV

Die sonstigen Erträge in Höhe von EUR 8.143,94 setzen sich wie folgt zusammen:

a) Erträge aus Quellensteuererstattungen/-ansprüchen:	EUR	4.223,43
b) Übrige Erträge:	EUR	3.920,51

Die sonstigen Aufwendungen in Höhe von EUR 136.640,59 setzen sich wie folgt zusammen:

a) Depotgebühren:	EUR	18.871,33
b) Abzug inländische Kapitalertragsteuer:	EUR	116.722,55
c) Übriger Aufwand:	EUR	1.046,71

## Angaben zu den Transaktionskosten gem. § 16 Abs. 1 Nr. 3 f) KARBV

Die im Berichtszeitraum gezahlten **Transaktionskosten** gemäß § 16 Abs. 1 Nr. 3 f) KARBV beliefen sich auf EUR 52.295,08.

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt EUR 0,00.

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

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums gem. § 16 Abs. 2 Nr. 1 KARBV 0,24 Prozentpunkte

Höhe der Annual Tracking Difference 0,16 Prozentpunkte

Der Dow Jones Sustainability Eurozone Index ex Alcohol, Tobacco, Gambling, Armaments & Firearms and Adult Entertainment (EUR) Performanceindex erzielte im Berichtszeitraum eine Wertentwicklung von -5,12%. Unter Berücksichtigung von Kosten, Ausschüttungen und Steuern erzielte der iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE) im selben Zeitraum eine Wertentwicklung von -4,96%.

## JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

### Angaben zur Mitarbeitervergütung gem. § 101 Abs. 4 KAGB

Die nachfolgenden Informationen beziehen sich auf die Vergütungsrichtlinien der BlackRock-Gruppe („BlackRock“), wie sie für die BlackRock Asset Management Deutschland AG (die „Gesellschaft“ oder „KVG“) zur Anwendung kommen. Die Offenlegung der Informationen erfolgt in Übereinstimmung mit der Richtlinie 2009/65/EG zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) in ihrer jeweils aktuellen Fassung, einschließlich der Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 (die „Richtlinie“) und den von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) veröffentlichten „Guidelines on sound remuneration policies under the UCITS Directive and AIFMD“.

Die OGAW-Vergütungsrichtlinie von BlackRock (die „OGAW-Vergütungsrichtlinie“) findet für solche EWR-Unternehmen der BlackRock-Gruppe Anwendung, die als Verwalter von OGAW-Fonds im Sinne der Richtlinie zugelassen sind, und stellt dadurch die Einhaltung der Anforderungen von Artikel 14b der Richtlinie sicher sowie für die britischen Unternehmen innerhalb der BlackRock-Gruppe, die von der FCA als Verwalter eines britischen OGAW-Fonds zugelassen sind.

Die Gesellschaft hat die Anwendung der OGAW-Vergütungsrichtlinie beschlossen. Nachfolgend erfolgt eine Zusammenfassung der OGAW-Vergütungsrichtlinie.

Es gab keine wesentlichen Änderungen an der festgelegten Vergütungspolitik im abgelaufenen Geschäftsjahr, zudem wurden im Rahmen der jährlichen Überprüfung keine Unregelmäßigkeiten festgestellt.

### Vergütungs-Governance

Die Vergütungs-Governance in der EMEA-Region wird bei BlackRock in einem mehrstufigen Aufsatz gesteuert; dieser umfasst: (a) das Management Development and Compensation Committee („MDCC“) (dies ist ein globaler, unabhängiger Vergütungsausschuss für die BlackRock, Inc. und alle ihre Tochterunternehmen, einschließlich der Gesellschaft); und (b) den Aufsichtsrat der Gesellschaft („Aufsichtsrat der Gesellschaft“). Diese Gremien sind für die Festlegung der Vergütungsrichtlinien von BlackRock zuständig.

#### a) MDCC

Die Aufgaben des MDCCs umfassen:

- die Überwachung:
  - der Vergütungsprogramme für Führungskräfte von BlackRock;
  - der Versorgungspläne für Mitarbeiter von BlackRock; und
  - der sonstigen Vergütungspläne, die BlackRock eventuell von Zeit zu Zeit einführt und für die das MDCC die Administration übernimmt;
- die Überprüfung und Erörterung der Ausführungen und Analysen zur Vergütung im jährlichen Proxy Statement von BlackRock, Inc. mit dem Management und Genehmigung der Aufnahme des MDCC-Berichts in das Proxy Statement;
- soweit angemessen, die Überprüfung, die Beurteilung und die Erstellung von Berichten und Empfehlungen für den Verwaltungsrat (Board of Directors) der BlackRock, Inc. („Verwaltungsrat der BlackRock, Inc.“) zur Nachwuchsförderung und Nachfolgeplanung bei BlackRock, mit Schwerpunkt auf der Leistungsanerkennung und Nachfolgeregelung auf den höchsten Management-Ebenen; und
- die Unterstützung der Geschäftsleitungen der in der EMEA-Region regulierten Unternehmen bei der Einhaltung ihrer gesetzlichen Verpflichtungen im Zusammenhang mit der Vergütung durch die Überwachung der Gestaltung und der Implementierung der EMEA-Vergütungsrichtlinie.

Das MDCC arbeitet direkt mit dem unabhängigen Vergütungsberater Semler Brossy Consulting Group LLC zusammen, der in keiner Beziehung zu BlackRock, Inc. oder zum Verwaltungsrat der BlackRock, Inc. steht, welche seine unabhängige Beratung des MDCC in Vergütungsangelegenheiten beeinträchtigen würde.

Aufgrund eigener Feststellungen des Verwaltungsrats der BlackRock, Inc., sind alle Mitglieder des MDCC „unabhängig“ im Sinne der Börsenzulassungsbestimmungen der New Yorker Börse („NYSE“). Gemäß diesen Bestimmungen müssen sie den Status eines „nicht angestellten Verwaltungsratsmitgliedes“ haben.

2021 kam das MDCC zu 8 Sitzungen zusammen. Die Statuten des MDCC sind auf der Website der BlackRock, Inc. ([www.blackrock.com](http://www.blackrock.com)) abrufbar.

Im Rahmen seiner regelmäßigen Überprüfungen überzeugt sich das MDCC, dass die Vergütungsrichtlinie und der gewählte Ansatz fortlaufend angemessen sind.

#### b) Der Aufsichtsrat der Gesellschaft

Der Aufsichtsrat der Gesellschaft überwacht und beaufsichtigt die Anwendung der OGAW-Vergütungsrichtlinie bei der Gesellschaft und bei identifizierten Mitarbeitern (wie unten definiert).

### Entscheidungsprozess

Die Entscheidungen über die Vergütung von Mitarbeitern werden einmal jährlich im Januar nach Abschluss des Leistungsjahres getroffen. Dieser Zeitpunkt wurde gewählt, damit das Geschäftsergebnis für das volle Jahr neben anderen nicht-finanziellen Unternehmenszielen berücksichtigt werden können. Der Rahmen für Vergütungsentscheidungen ist zwar an das Geschäftsergebnis gebunden, es besteht aber ein erheblicher Ermessensspielraum bei der Festlegung der individuellen Vergütung, für die das Erreichen strategischer und operativer Ergebnisse sowie andere Aspekte wie Management- und Führungsqualitäten maßgeblich sind.

## **JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

Für die Festlegung der jährlichen Boni werden keine Formeln und keine festen Benchmarks verwendet. In die Festlegung der individuellen Vergütung fließen verschiedene Faktoren ein, wie nicht-finanzielle und andere Unternehmensziele sowie das gesamte Geschäfts- und Anlageergebnis. Diese Ergebnisse werden in ihrer Gesamtheit ohne spezielle Gewichtung betrachtet und es besteht kein direkter Zusammenhang zwischen einzelnen Leistungsbestandteilen und der Höhe des jährlichen Bonus. Die variable Vergütung, die einzelnen Mitarbeitern für ein bestimmtes Leistungsjahr zuerkannt wird, kann auch Null sein.

Die jährlichen Boni werden aus einem Bonuspool gezahlt.

Das Volumen des prognostizierten Bonuspools, der Bar- und Aktienkomponenten enthält, wird über das Jahr hinweg vom MDCC geprüft und die endgültige Höhe des Bonuspools nach Jahresende genehmigt. Für diese Prüfung werden dem MDCC während des Jahres aktuelle und prognostizierte Finanzinformationen sowie die endgültigen Jahresabschlussinformationen zur Verfügung gestellt. Zu den Finanzinformationen, die das MDCC erhält und berücksichtigt, zählen unter anderem die Prognose zur Ertrags- und Aufwandsrechnung für das laufende Jahr und andere Finanzkennzahlen, verglichen mit Vorjahresergebnissen und den Planzahlen für das laufende Jahr. Außerdem prüft das MDCC auch andere Finanzkennzahlen von BlackRock (z. B. Nettozufluss an verwaltetem Vermögen und Anlageerfolg) sowie Informationen zur Marktlage und zum Vergütungsniveau bei Konkurrenzunternehmen.

Das MDCC befasst sich regelmäßig mit den Empfehlungen des Managements zum Anteil des Betriebsergebnisses vor Bonuszahlungen, der im Jahresverlauf zurückgestellt und als Vergütungsaufwand für die Barkomponente des gesamten jährlichen Bonuspools ausgewiesen wird (der „Rückstellungsbetrag“). Der Rückstellungsbetrag für die Barkomponente des gesamten jährlichen Bonuspools kann vom MDCC im Laufe des Jahres auf der Grundlage der vorstehend beschriebenen Prüfung der Finanzinformationen angepasst werden. Das MDCC wendet auf die Informationen, die es für die Festlegung des Umfangs des gesamten Bonuspools oder der Rückstellungen für die Barkomponente des gesamten Bonuspools berücksichtigt, keine besonderen Gewichtungen oder Formeln an.

Nach Ablauf des Leistungsjahres genehmigt das MDCC die Höhe des endgültigen Bonuspools.

Im Rahmen der Prüfungen zum Jahresende berichten die Abteilungen Enterprise Risk und Regulatory Compliance dem MDCC über alle bei Vergütungsentscheidungen zu berücksichtigenden Aktivitäten, Vorfälle oder Ereignisse.

Einzelne Mitarbeiter werden bei der Festlegung ihrer eigenen Vergütung nicht einbezogen.

### **Kontrollfunktionen**

Jede der Kontrollfunktionen (Enterprise Risk, Legal & Compliance und Internal Audit) hat ihre eigene von den Geschäftsbereichen unabhängige Organisationsstruktur. Der Leiter jeder Kontrollfunktion ist entweder Mitglied des Global Executive Committee („GEC“) oder des globalen Managementkomitees oder hat eine Berichtspflicht gegenüber dem Verwaltungsrat der BlackRock Group Limited, der Muttergesellschaft der regulierten EMEA-Unternehmen von BlackRock, einschließlich der Gesellschaft.

Bonuspools nach Funktionen werden unter Bezugnahme auf die Leistung jeder einzelnen Funktion festgelegt. Die Vergütung der leitenden Angestellten der Kontrollfunktionen wird direkt vom MDCC überwacht.

### **Zusammenhang zwischen Vergütung und Leistung**

BlackRock verfolgt eine klar definierte Philosophie der leistungsorientierten Bezahlung, und die Vergütungsprogramme sind darauf ausgelegt, die folgenden Kernziele zu erfüllen:

- das Geschäftsergebnis von BlackRock angemessen zwischen Aktionären und Mitarbeitern zu verteilen;
- Mitarbeiter anwerben, binden und motivieren, die einen wesentlichen Beitrag zum langfristigen Unternehmenserfolg leisten können;
- Abstimmung der Interessen führender Mitarbeiter mit denen der Aktionäre durch die Zuteilung von Aktien der BlackRock, Inc. als wesentlichen Bestandteil der jährlichen und langfristigen Leistungsanreize;
- Kontrolle der Fixkosten, indem sichergestellt wird, dass der Vergütungsaufwand je nach Profitabilität variiert;
- Kopplung eines wesentlichen Teils der Gesamtvergütung eines Mitarbeiters an das finanzielle und operative Ergebnis des Unternehmens sowie an die Entwicklung des Aktienkurses;
- Förderung eines soliden und wirksamen Risikomanagements in allen Risikokategorien, einschließlich des Nachhaltigkeitsrisikos;
- Vermeidung des Eingehens von übermäßigen Risiken (in Bezug auf die Nachhaltigkeit oder anderweitig); und
- Sicherstellung, dass sich die kurzfristige, mittelfristige und/oder langfristige Vergütung nicht negativ auf die Kundeninteressen auswirkt.

Voraussetzung für die Förderung einer Leistungskultur ist die Fähigkeit, Leistung anhand von Zielen, Werten und Verhalten klar und durchgängig messen zu können. Die Führungskräfte verwenden für die umfassende Beurteilung der Mitarbeiterleistung eine 5-stufige Skala. Zudem führen die Mitarbeiter eine Selbstbewertung durch. Die endgültige Gesamtbeurteilung wird bei der Leistungsbeurteilung jedes Mitarbeiters abgestimmt. Bei den Mitarbeitern wird sowohl bewertet, wie sie ihre Leistung erreichen, als auch die absolute Leistung selbst.

Entsprechend der Philosophie der leistungsorientierten Bezahlung werden die Beurteilungen verwendet, um individuelle Leistungen hervorzuheben und zu belohnen, aber nicht um die Vergütung im Voraus festzulegen. Die Vergütungsentscheidungen werden ermessensabhängig im Rahmen des Verfahrens zur Jahresvergütung getroffen.

## JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

Bei der Festlegung der Vergütungsniveaus werden neben der individuellen Leistung auch andere Faktoren berücksichtigt, darunter möglicherweise:

- die Leistung der KVG, der von der KVG verwalteten Fonds und/oder der betreffenden Funktion;
- für einen Mitarbeiter individuell relevante Faktoren; Beziehungen zu Kunden und Kollegen; Teamarbeit; Fähigkeiten; etwaige Verhaltensprobleme; und, vorbehaltlich geltender Grundsätze, potenzielle Auswirkungen, die eine Beurlaubung auf den Beitrag zum Geschäft gehabt haben könnte;
- Risikosteuerung im Rahmen der für Kunden von BlackRock angemessenen Risikoprofile;
- strategische Geschäftsanforderungen, unter anderem Pläne zur Mitarbeiterbindung;
- Marktwissen; und
- Bedeutung für das Geschäft.

Ein primärer Produktraspekt ist das Risikomanagement. So werden Mitarbeiter zwar für eine starke Performance bei der Verwaltung ihrer Kundenanlagen vergütet, müssen aber das Risiko innerhalb der für ihre Kunden angemessenen Risikoprofile steuern. Daher werden Mitarbeiter nicht für riskante Transaktionen außerhalb festgelegter Parameter belohnt. Die Vergütungspraktiken bieten keine unangemessenen Anreize zur kurzfristigen Planung oder für kurzfristige finanzielle Gewinne, sie belohnen keine unangemessenen Risiken und bieten ein angemessenes Gleichgewicht zwischen den zahlreichen und erheblichen mit dem Geschäft der Anlageverwaltung, des Risikomanagements und der Beratung verbundenen Risiken.

BlackRock wendet ein Gesamtvergütungsmodell an, das ein vertragliches Grundgehalt und ermessensabhängige Boni umfasst.

BlackRock wendet ein System jährlicher ermessensabhängiger Bonuszahlungen an. Grundsätzlich kommen zwar alle Mitarbeiter für einen ermessensabhängigen Bonus infrage, es besteht jedoch keine vertragliche Verpflichtung, einem Mitarbeiter einen ermessensabhängigen Bonus nach diesem System zu gewähren. Bei der Ermessensausübung im Zusammenhang mit der Gewährung eines ermessensabhängigen Bonus können die vorstehend (unter der Überschrift „Zusammenhang zwischen Bezahlung und Leistung“) aufgeführten Faktoren neben anderen Aspekten berücksichtigt werden, die bei der Ausübung von Ermessen im Laufe eines Performance-Jahres relevant werden können.

Ermessensabhängige Bonuszahlungen für alle Mitarbeiter, einschließlich Führungskräften, unterliegen einer Richtlinie, welche die Bar- und die BlackRock-Aktienkomponente der Bonuszahlung bestimmt und darüber hinaus zusätzliche Erdienungs-/Rückforderungsbedingungen festlegt. Die Zuerkennung von Aktien erfolgt vorbehaltlich einer weiteren Beurteilung der Wertentwicklung aufgrund der Veränderung des Aktienkurses der BlackRock, Inc. im Erdienungszeitraum. Mit der jährlichen Gesamtvergütung steigt auch die Aktienkomponente. Das MDCC hat diesen Ansatz 2006 beschlossen, um die Mitarbeiter stärker an das Unternehmen zu binden und das Vergütungspaket für entsprechende Mitarbeiter, wie Führungskräfte, stärker an den Interessen der Aktionäre auszurichten. Die Aktienkomponente wird in drei gleichmäßigen Raten über einen Zeitraum von drei Jahren nach Gewährung übertragen.

Ergänzend zu den vorstehend beschriebenen jährlichen ermessensabhängigen Bonuszahlungen kann an ausgewählte Mitarbeiter eine Aktienkomponente geleistet werden, um die Vergütung stärker an künftige Geschäftsergebnisse zu koppeln. Diese langfristigen Leistungsanreize werden individuell bestimmt, um sinnvolle Anreize für eine kontinuierliche Leistung über mehrere Jahre zu bieten, bei der die Bedeutung der Rolle des betreffenden Mitarbeiters, seine fachliche Kompetenz und seine Führungsqualitäten berücksichtigt werden.

Ausgewählte leitende Führungskräfte haben Anspruch auf leistungsorientierte, aktienbasierte Boni aus dem „BlackRock Performance Incentive Plan“ („BPIP“). Für die Boni aus dem BPIP gilt ein dreijähriger Performance-Zeitraum, der auf der Messung der bereinigten operativen Marge\* und des organischen Umsatzwachstums\*\* basiert.

Die tatsächliche Höhe des Bonus wird basierend auf der Performance von BlackRock mit Blick auf die angestrebten Finanzergebnisse am Ende des Performance-Zeitraums bestimmt. Die Höchstzahl der Aktien, die eine Führungskraft erwerben kann, beläuft sich auf 165 % des Bonus, wenn beide Kennzahlen die zuvor festgelegten finanziellen Ziele erreichen. Wenn das finanzielle Ergebnis von BlackRock bei beiden vorstehend genannten Kennzahlen unterhalb einer zuvor definierten Performance-Grenze liegt, werden keine Aktien zugeteilt. Diese Kennzahlen wurden als Schlüssell Kennzahlen für einen über Marktzyklen hinweg gültigen Shareholder Value ausgewählt.

Eine begrenzte Anzahl von Mitarbeitern im Investmentbereich erhalten einen Teil des jährlichen ermessensabhängigen Bonus (wie vorstehend beschrieben) in Form einer aufgeschobenen Barzahlung, die eine Anlage in ausgewählte, von dem Mitarbeiter verwaltete Produkte nominell nachbildet. Hintergrund ist die Absicht, Mitarbeiter im Investmentbereich entsprechend dem Anlageertrag der von ihnen verwalteten Produkte zu vergüten, indem die Vergütung in diese Produkte umgewandelt wird. Kunden und externe Gutachter beurteilen diese Produkte zunehmend positiv, bei denen für wichtige Anleger aufgrund ihrer bedeutenden persönlichen Anlagen „viel auf dem Spiel steht“.

### Identifizierte Mitarbeiter

Die OGAW-Vergütungsrichtlinie legt das Verfahren fest, das zur Identifizierung von Mitarbeitern, d.h. Kategorien von Mitarbeitern der KVG, verwendet wird, darunter Führungskräfte, Risikoträger, Kontrollfunktionen und andere Mitarbeiter, die sich aufgrund Ihrer Gesamtvergütung in derselben Einkommensstufe befinden wie die Geschäftsleitung und Risikoträger und deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf die Risikoprofile der KVG oder der von ihr verwalteten Fonds haben.

Die Liste identifizierter Mitarbeiter wird regelmäßig überprüft, wobei eine formale Überprüfung unter anderem in folgenden Fällen erfolgt:

- organisatorische Veränderungen;
- neue Geschäftsinitiativen;
- Änderungen der Liste von Funktionen mit wesentlichem Einfluss;
- Änderungen von Aufgabenbereichen; und
- Veränderung des regulatorischen Umfelds.

\* Bereinigte operative Marge: bezeichnet in der externen Berichterstattung von BlackRock den bereinigten Betriebsgewinn geteilt durch den Gesamtumsatz nach Aufwendungen für Vertrieb und Serviceleistungen sowie Abschreibung der aufgeschobenen Verkaufsprovision.

\*\* Organisches Umsatzwachstum: entspricht den im Jahr netto generierten neuen Basisgebühren zuzüglich des neuen Aladdin-Nettoumsatzes (in Dollar).

# JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

## Quantitative Offenlegung der Vergütung

Die Gesellschaft ist gemäß der Richtlinie zu einer quantitativen (numerischen) Offenlegung der Vergütung verpflichtet. Diese Offenlegung erfolgt in Übereinstimmung mit BlackRocks Verständnis der gegenwärtig verfügbaren regulatorischen Leitlinien über die quantitative Offenlegung der Vergütung. Aufgrund von Entwicklungen der Markt- oder regulatorischen Praxis, behält sich BlackRock das Recht vor, entsprechende Änderungen an der Art und Weise vorzunehmen, in der die quantitative Offenlegung der Vergütung berechnet wird. Werden solche Änderungen vorgenommen, kann dies zu Unterschieden zwischen den Offenlegungen eines Fonds im Vergleich zwischen dem aktuellen und dem Vorjahr, oder im Vergleich zu Offenlegungen anderer BlackRock - Fonds im selben Jahr, führen.

Offenlegungen werden vorgenommen in Bezug auf (a) die Mitarbeiter der Gesellschaft; (b) Mitglieder der Geschäftsleitung; und (c) Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben, einschließlich Personen, die, wenn sie auch nicht direkt von der Gesellschaft beschäftigt sind, von ihrem Arbeitgeber damit beauftragt sind, Leistungen direkt für die Gesellschaft zu erbringen.

Alle Personen, die in die offengelegten aggregierten Werte eingeschlossen sind, werden gemäß der Vergütungsrichtlinie von BlackRock für ihre Verantwortlichkeiten im relevanten Geschäftsbereich von BlackRock vergütet. Da alle Personen Verantwortlichkeiten in einer Reihe von Gebieten erfüllen, wird nur jener Anteil der Vergütung für solche Leistungen von Personen in die offengelegten aggregierten Werte eingeschlossen, der dem Fonds zuzuordnen ist.

Mitarbeiter und Mitglieder der Geschäftsleitung der Gesellschaft erbringen üblicherweise sowohl OGAW-bezogene Leistungen als auch Leistungen ohne Bezug zu OGAW im Zusammenhang mit mehreren Fonds, Kunden und Funktionen der Gesellschaft und im Rahmen der breiteren BlackRock-Gruppe. Die offengelegten Zahlen bilden jedoch eine Summe jenes Teils der individuellen Vergütung des betreffenden Mitarbeiters, die nach einer objektiven Aufteilungsmethode, die das Multi-Service-Modell der Gesellschaft berücksichtigt, der Gesellschaft zuzurechnen ist. Dementsprechend sind die Zahlen nicht repräsentativ für eine tatsächliche Vergütung oder die Vergütungsstruktur des jeweiligen Mitarbeiters.

Die Gesamtsumme der von der Gesellschaft an ihre Mitarbeiter für das OGAW-Geschäft der Gesellschaft in Bezug auf das am 31. Dezember 2021 endende Geschäftsjahr betrug 4,22 Mio. EUR. Dieser Betrag setzt sich zusammen aus einer festen Vergütung in Höhe von 3,20 Mio. EUR und der variablen Vergütung in Höhe 1,02 Mio. EUR. Diese Vergütung nach den oben beschriebenen Vorgaben erfolgte an insgesamt 22 Mitarbeiter. Die Gesamtsumme der Vergütung der höheren Führungsebene, die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Gesellschaft dem am 31. Dezember 2021 endenden Geschäftsjahr zugewiesen wurde, beläuft sich auf 1,10 Mio. EUR. Die Vergütung an solche Mitarbeiter, deren Tätigkeiten wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben, betrug 0,62 Mio. EUR.

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

### Erläuterung zur Berechnung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste

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

### Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

In Erfüllung der Anforderung, der zum 1.1.2020 in Kraft getretenen Umsetzung der zweiten Aktionärsrechterichtlinie, berichten wir gem. § 134c Abs. 4 AktG Folgendes:

#### **1) Wesentliche mittel- bis langfristigen Risiken:**

Hinsichtlich der mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens verweisen wir auf die Darstellung im Tätigkeitsbericht. Die im Tätigkeitsbericht aufgeführten Risiken sind vergangenheitsbezogen, jedoch erwarten wir mittel- bis langfristig keine Änderung der dort dargestellten Risikoeinschätzung.

#### **2) Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten:**

Hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios verweisen wir auf die Vermögensaufstellung. Die Portfolioumsätze können ebenfalls der Vermögensaufstellung sowie der Angabe zu den während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, entnommen werden. Die Portfolioumsatzkosten sind den Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 Abs. 1 Nr. 3 KARBV zu entnehmen.

#### **3) Die Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung:**

Die Anlageziele und Anlagepolitik des Sondervermögens werden im Tätigkeitsbericht dargestellt. Das Sondervermögen bildet möglichst genau die Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index ab, sodass die mittel- bis langfristige Entwicklung der jeweiligen Gesellschaften kein primäres Entscheidungskriterium für Investitionen ist.

#### **4) Einsatz von Stimmrechtsberatern:**

BlackRock folgte nicht den Abstimmungsempfehlungen eines einzelnen Stimmrechtsberaters obwohl BlackRock vertragliche Beziehungen zu zwei Stimmrechtsberatern unterhält. Unsere Analyse der Stimmabgabe und unseres Engagements wird durch mehrere Informationen bestimmt, darunter die eigenen Angaben eines Unternehmens und unsere Aufzeichnungen über frühere Engagements.

#### **5) Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten:**

Im Geschäftsjahr 2021/2022 hat das Sondervermögen keinerlei Wertpapierleihegeschäfte getätigt. Interessenkonflikte werden identifiziert und überwacht.

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS  
ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

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

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

**München, den 24. August 2022**

**BlackRock Asset Management Deutschland AG (KVG)**



Peter Scharl



Harald Klug

# JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022

## VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

---

An die BlackRock Asset Management Deutschland AG, München

### Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE) – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Mai 2021 bis zum 30. April 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. April 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Mai 2021 bis zum 30. April 2022 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der BlackRock Asset Management Deutschland AG, München, unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

### Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen den Hinweis und Lizenzvermerk, die ergänzenden Angaben für Anleger in Österreich und der Schweiz, den Bericht des Vorstands und die allgemeinen Informationen.

Unser Prüfungsurteil zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen und dementsprechend geben wir diesbezüglich weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung ab.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht des Sondervermögens iShares Dow Jones Eurozone Sustainability Screened UCITS ETF (DE) unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

### Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der BlackRock Asset Management Deutschland AG, München, sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung des Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Investmentvermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die BlackRock Asset Management Deutschland AG, München, zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

### Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus Verstößen oder Unrichtigkeiten resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

## **JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher – beabsichtigter oder unbeabsichtigter – falscher Darstellungen im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der BlackRock Asset Management Deutschland AG, München, abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der BlackRock Asset Management Deutschland AG, München, bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die BlackRock Asset Management Deutschland AG, München, aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die BlackRock Asset Management Deutschland AG, München, nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresberichts, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

München, den 25. August 2022

**Deloitte GmbH**  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

(René Rumpelt)  
Wirtschaftsprüfer

(Anna-Lena Müller)  
Wirtschaftsprüferin

**JAHRESBERICHT FÜR ISHARES DOW JONES EUROZONE SUSTAINABILITY SCREENED UCITS  
ETF (DE) FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM VOM 01.05.2021 BIS 30.04.2022**

**Allgemeine Informationen**

---

**Verwaltungsgesellschaft**

BlackRock Asset Management Deutschland AG  
Lenbachplatz 1  
80333 München

Grundkapital per 31.12.2021: 5 Mio. EUR

Haftendes Eigenkapital per 31.12.2021: 67,07 Mio. EUR

**Gesellschafter**

BlackRock Investment Management (UK) Limited

**Geschäftsführung**

Dirk Schmitz  
Vorstandsvorsitzender  
Frankfurt

Harald Klug  
Vorstand  
München

Peter Scharl  
Vorstand  
München

Birgit Ludwig\*  
Vorstand  
Frankfurt

**Aufsichtsrat**

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

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

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

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

**Verwahrstelle**

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

**Wirtschaftsprüfer**

Deloitte GmbH  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Rosenheimer Platz 4  
81669 München, Deutschland

(\*) seit 01.11.2021

(\*\*) seit 09.08.2021

(\*\*\*) bis 09.08.2021

## Want to know more?

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

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

**iShares**  
by BlackRock

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