

Jahresbericht und geprüfte Abschlüsse

iShares ETF (CH)

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
„Übrige Fonds für traditionelle Anlagen“

iSHARES ETF (CH)

INHALTSVERZEICHNIS

Überblick

| | |
|--------------------------|---|
| Allgemeine Informationen | 2 |
|--------------------------|---|

Performance

| | |
|------------------------------|---|
| Performance der Teilvermögen | 5 |
|------------------------------|---|

Governance

| | |
|------------------------------|---|
| Bericht der Prüfgesellschaft | 7 |
|------------------------------|---|

Jahresabschlüsse

| | |
|---|----|
| Vermögensrechnung | 8 |
| Veränderungen des Nettovermögens | 11 |
| Veränderungen der Anzahl Anteile im Umlauf | 13 |
| Rückzahlbares Nettovermögen von Anteilinhabern | 14 |
| Erfolgsrechnung | 15 |
| Verwendung des Erfolges | 18 |
| Anmerkungen zum Jahresbericht | 21 |
| Portfoliozusammensetzung und Bestandesveränderungen | 30 |

Zusätzliche Informationen

| | |
|--------------------|----|
| Haftungsausschluss | 63 |
|--------------------|----|

Dieser Jahresbericht und geprüfte Jahresabschlüsse („Jahresbericht“) kann in andere Sprachen übersetzt werden. Jegliche Übersetzungen dürfen nur dieselben Informationen enthalten und dieselbe Bedeutung haben wie der Jahresbericht in deutscher Sprache. Sofern der deutschsprachige Jahresbericht und der Jahresbericht in einer anderen Sprache an irgendeiner Stelle differieren, ist der deutschsprachige Jahresbericht massgeblich. Ausnahmsweise ist eine andere Sprache des Jahresberichts dann und insoweit massgeblich, wie das Gesetz eines Hoheitsgebietes, in dem die Anteile vertrieben werden, dies für Klagen, die sich auf Veröffentlichungen in einem Jahresbericht in einer anderen Sprache als Deutsch beziehen, verlangt. Streitigkeiten in Bezug auf die Bedingungen des Jahresberichts, ungeachtet der Sprache des Jahresberichts, unterliegen Schweizer Recht und dessen Auslegung.

iSHARES ETF (CH)

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Fondsleitung

BlackRock Asset Management Schweiz AG
Bahnhofstrasse 39
CH-8001 Zürich

Verwaltungsrat^{1,2}

David Blumer, Präsident
Barry O'Dwyer, Vizepräsident
Dr. Mirjam Staub-Bisang
Ellen Bakke Mawdsley
Søren Mose

¹ Mit Wirkung vom 7. Juli 2020 wurde Ellen Bakke Mawdsley zum Mitglied des Verwaltungsrats ernannt.

² Mit Wirkung vom 7. Juli 2020 wurde Søren Mose zum Mitglied des Verwaltungsrats ernannt.

Geschäftsleitung¹

Dr. Mirjam Staub-Bisang, CEO
Markus Studer, COO
Nathalie von Niederhäusern
Frank Rosenschon
Holger Schmidt
Jasmin Djalali
Robert Majewski
Edward Gordon

¹ Mit Wirkung vom 1. Januar 2020 wurde Markus Studer zum Mitglied der Geschäftsleitung ernannt.

Depotbank

State Street Bank International GmbH, München,
Zweigniederlassung Zürich
Beethovenstrasse 19
CH-8027 Zürich

Zahlstelle in der Schweiz

State Street Bank International GmbH, München,
Zweigniederlassung Zürich
Beethovenstrasse 19
CH-8027 Zürich

Zahlstelle und Vertreter in Liechtenstein

LGT Bank AG
Herrengasse 12
FL-9490 Vaduz

Prüfgesellschaft

Deloitte AG
General-Guisan-Quai 38
Postfach 2232
CH-8022 Zürich

Fondsadministrator

State Street Bank International GmbH, München,
Zweigniederlassung Zürich
Beethovenstrasse 19
CH-8027 Zürich

iSHARES ETF (CH)

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Allgemeine Informationen

Der iShares ETF (CH) ist ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art „Übrige Fonds für traditionelle Anlagen“ gemäss Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006, welcher in die folgenden Teilvermögen unterteilt ist:

Aktienindex – Exchange Traded Funds

- a) iShares SLI® ETF (CH) ¹
- b) iShares SMI® ETF (CH) ¹
- c) iShares SMIM® ETF(CH) ¹
- d) iShares Swiss Dividend ETF (CH) ¹
- e) iShares Core SPI® ETF (CH) ¹

Obligationenindex – Exchange Traded Funds

- f) iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) ¹
- g) iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) ¹
- h) iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) ¹
- i) iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) ¹

Delegation und Sub-Delegation der Anlageentscheide

Die Anlageentscheide hinsichtlich der folgenden Teilvermögen sind an BlackRock Advisors (UK) Limited, London, delegiert, welche diese ihrerseits an BlackRock Asset Management Deutschland AG, München sub-delegiert hat:

- a) iShares SLI® ETF (CH)
- b) iShares SMI® ETF (CH)
- c) iShares SMIM® ETF (CH)
- d) iShares Swiss Dividend ETF (CH)
- e) iShares Core SPI® ETF (CH)

Die Anlageentscheide hinsichtlich der folgenden Teilvermögen sind an BlackRock Advisors (UK) Limited, London, delegiert:

- f) iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH)
- g) iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH)
- h) iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH)
- i) iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH)

Die genaue Ausführung der Aufträge regeln ein zwischen der Fondsleitung und BlackRock Advisors (UK) Limited, London, abgeschlossener Vermögensverwaltungsvertrag sowie ein zwischen BlackRock Advisors (UK) Limited, und BlackRock Asset Management Deutschland AG, München, abgeschlossener Sub-Vermögensverwaltungsvertrag.

Delegation weiterer Teilaufgaben

Die Fondsleitung hat die Teilaufgaben der Fondsadministration an State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, delegiert.

Ein Dienstleistungsvertrag zwischen der Fondsleitung und der State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, regelt die delegierten Aufgaben, welche im Fondsprospekt spezifiziert sind.

¹ Haftungsausschluss:

Diese Wertschriften werden in keiner Weise von SIX Swiss Exchange AG unterstützt, abgetreten, verkauft oder beworben und SIX Swiss Exchange AG leistet in keiner Weise (weder ausdrücklich noch stillschweigend) Gewähr für die Ergebnisse, welche durch den Gebrauch des Swiss Leaders Index (SLI®), Swiss Market Index (SMI®), SMI MID Index (SMIM®), Swiss Bond Index Domestic Government (SBI® Domestic Government), SBI® Corporate Total Return, Swiss Performance Index (SPI®) und SPI® Select Dividend 20 Index („die Indizes“) erzielt werden können, und/oder für die Höhe der Indizes zu einer bestimmten Zeit an einem bestimmten Datum. SIX Swiss Exchange AG ist nicht haftbar (weder aus fahrlässigem noch aus anderem Verhalten) für irgendwelche Fehler, die die Indizes aufweisen, und SIX Swiss Exchange AG ist in keiner Weise verpflichtet, auf solche Fehler aufmerksam zu machen.

® SIX, SIX Swiss Exchange, SPI, Swiss Performance Index (SPI), SPI EXTRA, SPI ex SLI, SMI, SMI Swiss Market Index, Swiss Market Index (SMI), SMIM, SMI MID (SMIM), SMI Expanded, SXI, SXI Real Estate, SXI Swiss Real Estate, SXI Life Sciences, SXI Bio+Medtech, SLI, SLI Swiss Leader Index, SBI, SBI Swiss Bond Index, SAR, SAR SWISS AVERAGE RATE, SARON, SCR, SCR SWISS CURRENT RATE, SCRON, SAION, SCION, VSMI, SWX Immobilienfonds Index, MQM, MQM Market Quality Metrics, QQM, QQM Quotes Quality Metrics sind in der Schweiz und/oder im Ausland eingetragene respektive hinterlegte Marken von SIX Group AG bzw. SIX Swiss Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist.

iSHARES ETF (CH)

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Total Expense Ratio (TER)

| Teilvermögen | Anteils- klasse | Währung | Den Teil- vermögen belastete pauschale Verwaltungs- kommission % | Total Expense Ratio (TER) % | Den Teilvermögen belastete maximale Verwaltungs- kommission % |
|--|--------------------|---------|--|---|---|
| iShares SLI® ETF (CH) | A | CHF | 0,35 | 0,35 | 0,35 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | CHF | 0,35 | 0,35 | 0,35 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | CHF | 0,45 | 0,45 | 0,45 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | CHF | 0,15 | 0,15 | 0,15 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | CHF | 0,10 | 0,10 | 0,10 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | A | CHF | 0,15 | 0,15 | 0,15 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | A | CHF | 0,15 | 0,15 | 0,15 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | A | CHF | 0,15 | 0,15 | 0,15 |
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | A | CHF | 0,15 | 0,15 | 0,15 |

Die Total Expense Ratio („TER“) bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem Teilvermögen belastet werden. Sie wird rückwirkend als prozentualer Anteil des durchschnittlichen Teilvermögens ausgewiesen und gemäss der Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio („TER“) von kollektiven Kapitalanlagen der SFAMA berechnet. Allfällige Rückvergütungen/ Bestandespflegekommissionen von Zielfonds wurden dem Teilvermögen gutgeschrieben und reduzieren somit die TER.

Tracking Error

Der realisierte Tracking Error ist die annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditen zwischen einem Teilvermögen und seinem Referenzindex. Der Tracking Error zeigt die Konsistenz der Renditen gegenüber dem Referenzindex über einen festgelegten Zeitraum.

Cash-Management, effiziente Portfoliomanagementtechniken (Effektenleihen inbegriffen) und durch ein Rebalancing entstehende Transaktionskosten können sich auf den Tracking Error und auf das Renditegefälle zwischen einem Teilvermögen und seinem Referenzindex auswirken. Dabei ist zu beachten, dass diese Auswirkungen in Abhängigkeit von den Umständen sowohl positiv als auch negativ sein können.

Darüber hinaus können die Teilvermögen einen Tracking Error aufgrund von Quellensteuern aufweisen, welche den Teilvermögen für Erträge aus ihren Anlagen belastet wurden. Höhe und Umfang der durch Quellensteuern verursachten Tracking Error hängen von verschiedenen Faktoren ab, wie z. B. von Erstattungsanträgen, die im Namen der Teilvermögen bei diversen Steuerbehörden gestellt wurden, Steuererleichterungen, die die Teilvermögen im Rahmen eines Steuerabkommens erhalten haben, oder von den Teilvermögen getätigten Effektenleihgeschäften.

Die nachstehende Tabelle zeigt den tatsächlichen Tracking Error der Teilvermögen zum 31. Mai 2020. Der realisierte Tracking Error wurde annualisiert und anhand von Daten des vorhergehenden 36-monatigen Beobachtungszeitraums berechnet.

| Teilvermögen | Anteils- klasse | Maximum % | Minimum % | Durchschnitt % | 31. Mai 2020 % |
|--|--------------------|--------------|--------------|-------------------|-------------------|
| iShares SLI® ETF (CH) | A | 0,03 | 0,02 | 0,02 | 0,03 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | 0,05 | 0,03 | 0,03 | 0,04 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | 0,10 | 0,07 | 0,08 | 0,10 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | 0,02 | 0,02 | 0,02 | 0,02 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | A | 0,06 | 0,04 | 0,05 | 0,04 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | A | 0,05 | 0,05 | 0,05 | 0,05 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | A | 0,07 | 0,07 | 0,07 | 0,07 |
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | A | 0,07 | 0,04 | 0,05 | 0,07 |

iSHARES ETF (CH)

PERFORMANCE DER TEILVERMÖGEN

Performance der Teilvermögen im Vergleich zum Referenzindex

| Teilvermögen | Anteils- klasse | Währung | Lancierungsdatum | 1. Januar 2020 - 31. Mai 2020 | | 1. Juni 2019 - 31. Mai 2020 | | 1. Juni 2018 - 31. Mai 2019 | |
|--|--------------------|---------|------------------|----------------------------------|--------------------|--------------------------------|--------------------|--------------------------------|--------------------|
| | | | | Fonds % | Referenzindex % | Fonds % | Referenzindex % | Fonds % | Referenzindex % |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | CHF | Jun-07 | (7,93) | (7,74) | 3,05 | 3,48 | 6,73 | 7,10 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | CHF | Okt-99 | (4,51) | (4,37) | 6,36 | 6,73 | 15,95 | 16,37 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | CHF | Dez-04 | (10,08) | (9,85) | 2,96 | 3,49 | (4,02) | (3,58) |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | CHF | Apr-14 | (9,81) | (9,65) | 4,97 | 5,27 | 15,51 | 15,89 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | CHF | Apr-14 | (4,65) | (4,61) | 5,98 | 6,08 | 13,49 | 13,57 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | A | CHF | Jul-09 | (0,57) | (0,51) | (1,40) | (1,24) | (0,93) | (0,78) |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | A | CHF | Nov-03 | (0,57) | (0,50) | (1,64) | (1,50) | 0,55 | 0,72 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | A | CHF | Nov-03 | 0,13 | 0,19 | (0,01) | 0,13 | 4,02 | 4,21 |
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | A | CHF | Jan-14 | (2,08) | (2,06) | (1,81) | (1,77) | 2,33 | 2,41 |

| Teilvermögen | Anteils- klasse | Währung | Lancierungsdatum | 1. Januar 2019 - 31. Dezember 2019 | | 1. Januar 2018 - 31. Dezember 2018 | | 1. Januar 2017 - 31. Dezember 2017 | |
|---|--------------------|---------|------------------|---------------------------------------|--------------------|---------------------------------------|--------------------|---------------------------------------|--------------------|
| | | | | Fonds % | Referenzindex % | Fonds % | Referenzindex % | Fonds % | Referenzindex % |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | CHF | Jun-07 | 29,60 | 30,05 | (12,18) | (11,87) | 20,24 | 20,71 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | CHF | Okt-99 | 29,70 | 30,16 | (7,38) | (7,04) | 17,46 | 17,90 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | CHF | Dez-04 | 34,40 | 35,00 | (17,53) | (17,14) | 32,48 | 33,04 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | CHF | Apr-14 | 33,65 | 34,03 | (4,43) | (4,24) | 17,06 | 17,24 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | CHF | Apr-14 | 30,48 | 30,59 | (8,66) | (8,57) | 19,78 | 19,92 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | A | CHF | Jul-09 | (1,18) | (1,01) | (0,85) | (0,72) | (1,01) | (0,84) |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | A | CHF | Nov-03 | (0,54) | (0,39) | 0,12 | 0,34 | (0,76) | (0,59) |

iSHARES ETF (CH)

PERFORMANCE DER TEILVERMÖGEN (Fortsetzung)

Performance der Teilvermögen im Vergleich zum Referenzindex (Fortsetzung)

| Teilvermögen | Anteils- klasse | Währung | Lancierungsdatum | 1. Januar 2019 - 31. Dezember 2019 | | 1. Januar 2018 - 31. Dezember 2018 | | 1. Januar 2017 - 31. Dezember 2017 | |
|--|--------------------|---------|------------------|---------------------------------------|--------------------|---------------------------------------|--------------------|---------------------------------------|--------------------|
| | | | | Fonds % | Referenzindex % | Fonds % | Referenzindex % | Fonds % | Referenzindex % |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | A | CHF | Nov-03 | 2,60 | 2,77 | 1,00 | 1,26 | (0,03) | 0,16 |
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | A | CHF | Jan-14 | 2,69 | 2,73 | (0,47) | (0,35) | 0,56 | 0,66 |

Die Performance der Teilvermögen ist nach Abzug von TER angegeben.

Den Angaben zur Performance der Teilvermögen liegen publizierte Nettoinventarwerte („NIW“) zugrunde, die wiederum auf den Börsenschlusskursen am jeweiligen Monatsende basieren.

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die aktuelle oder zukünftige Performance dar. Bei den Performanceangaben wurden allfällige Rücknahmekommissionen nicht berücksichtigt.

Die Performance wurde gemäss den Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Performancedaten von kollektiven Kapitalanlagen der SFAMA berechnet.

Referenzindizes der Teilvermögen

Die jeweiligen Referenzindizes sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

| Teilvermögen | Referenzindex |
|--|---|
| iShares SLI® ETF (CH) | Swiss Leader Index (SLI®) |
| iShares SMI® ETF (CH) | Swiss Market Index (SMI®) |
| iShares SMIM® ETF (CH) | SMI MID Index (SMIM®) |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | SPI® Select Dividend 20 Index |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | Swiss Performance Index (SPI®) |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | Swiss Bond Index Domestic Government 1-3 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | Swiss Bond Index Domestic Government 3-7 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | Swiss Bond Index Domestic Government 7-15 |
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | SBI® Corporate Total Return |

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft an den Verwaltungsrat der Fondsleitung zur Jahresrechnung des

iShares ETF (CH) Umbrella-Fonds

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegende Jahresrechnung des Anlagefonds iShares ETF (CH) Umbrella-Fonds, mit den Teilvermögen:

- iShares SLI® ETF (CH)
- iShares SMI® ETF (CH)
- iShares SMIM® ETF (CH)
- iShares Swiss Dividend ETF (CH)
- iShares Core SPI® ETF (CH)
- iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH)
- iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH)
- iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH)
- iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH)

bestehend aus der Vermögensrechnung und der Erfolgsrechnung, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h für das am 31. Mai 2020 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie Fondsvertrag und dem Prospekt verantwortlich. Diese Verantwortung beinhaltet die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems, mit Bezug auf die Aufstellung der Jahresrechnung, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern ist. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat der Fondsleitung für die Auswahl und die Anwendung sachgemässer Rechnungslegungsmethoden sowie die Vornahme angemessener Schätzungen verantwortlich.

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Unsere Verantwortung ist es, aufgrund unserer Prüfung ein Prüfungsurteil über die Jahresrechnung abzugeben. Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Prüfungsstandards vorgenommen. Nach diesen Standards haben wir die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass wir hinreichende Sicherheit gewinnen, ob die Jahresrechnung frei von wesentlichen falschen Angaben ist.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in der Jahresrechnung enthaltenen Wertansätze und sonstigen Angaben. Die Auswahl der Prüfungshandlungen liegt im pflichtgemässen Ermessen des Prüfers. Dies schliesst eine Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Angaben in der Jahresrechnung als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein. Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der

Jahresrechnung von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungshandlungen festzulegen, nicht aber um ein Prüfungsurteil über die Existenz und Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Die Prüfung umfasst zudem die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vorgenommenen Schätzungen sowie eine Würdigung der Gesamtdarstellung der Jahresrechnung. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung entspricht die Jahresrechnung für das am 31. Mai 2020 abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

Wir bestätigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung sowie an die Unabhängigkeit gemäss Revisionsaufsichtsgesetz erfüllen und keine mit unserer Unabhängigkeit nicht vereinbare Sachverhalte vorliegen.

Deloitte AG

Marcel Meyer Oksana Zinchenko
Zugelassener Revisionsexperte
Leitender Prüfer

Zürich, 21. September 2020
MYM/OZI/ska

iSHARES ETF (CH)

VERMÖGENSRECHNUNG

Per 31. Mai 2020 und 31. Mai 2019

| | iShares SLI® ETF (CH) | | iShares SMI® ETF (CH) | | iShares SMIM® ETF (CH) | |
|---|-----------------------|---------------------|-----------------------|----------------------|------------------------|----------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Sichtguthaben | 1.246.269 | 1.136.633 | 8.257.166 | 1.386.521 | 3.368.788 | 7.016.294 |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | 354.494.446 | 367.650.761 | 1.887.310.082 | 1.899.489.840 | 1.087.511.390 | 1.208.316.774 |
| Derivative Finanzinstrumente | 232.958 | (87.679) | 2.651.587 | 19.160 | 945.442 | (282.686) |
| Sonstige Vermögenswerte | 3.417.684 | 4.174.687 | 20.157.240 | 22.592.879 | 7.051.447 | 7.574.773 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen abzüglich | 359.391.357 | 372.874.402 | 1.918.376.075 | 1.923.488.400 | 1.098.877.067 | 1.222.625.155 |
| Andere Verbindlichkeiten | 96.702 | 113.633 | 528.330 | 582.082 | 374.549 | 487.050 |
| Nettoteilfondsvermögen | 359.294.655 | 372.760.769 | 1.917.847.745 | 1.922.906.318 | 1.098.502.518 | 1.222.138.105 |

iSHARES ETF (CH)

VERMÖGENSRECHNUNG (Fortsetzung)

Per 31. Mai 2020 und 31. Mai 2019

| | iShares Swiss Dividend ETF (CH) | | iShares Core SPI® ETF (CH) | | iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | |
|---|------------------------------------|---------------------|----------------------------|----------------------|--|---------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Sichtguthaben | 5.745.254 | 1.345.048 | 7.081.220 | 6.225.964 | 47.817 | 80.119 |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | 712.066.064 | 452.359.327 | 1.532.299.200 | 1.383.225.852 | - | - |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | - | - | - | - | 66.128.106 | 36.737.639 |
| Derivative Finanzinstrumente | 793.215 | (50.589) | 949.454 | 256.710 | - | - |
| Sonstige Vermögenswerte | 7.724.721 | 5.854.480 | 16.208.815 | 13.423.135 | 906.575 | 17.466.566 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen abzüglich | 726.329.254 | 459.508.266 | 1.556.538.689 | 1.403.131.661 | 67.082.498 | 54.284.324 |
| Andere Verbindlichkeiten | 84.421 | 59.651 | 2.327.554 | 122.901 | 8.111 | 7.070 |
| Nettoteilfondsvermögen | 726.244.833 | 459.448.615 | 1.554.211.135 | 1.403.008.760 | 67.074.387 | 54.277.254 |

iSHARES ETF (CH)

VERMÖGENSRECHNUNG (Fortsetzung)

Per 31. Mai 2020 und 31. Mai 2019

| | iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | | iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | | iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | |
|---|--|---------------------|---|---------------------|---|----------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Sichtguthaben | 374.622 | 96.433 | 234.904 | 228.209 | 270.099 | 758.396 |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 123.161.939 | 126.337.253 | 193.348.795 | 161.819.765 | 1.302.984.962 | 1.422.420.197 |
| Derivative Finanzinstrumente | - | - | - | - | - | (13.366) |
| Sonstige Vermögenswerte | 2.079.074 | 17.029.874 | 4.366.363 | 2.112.303 | 11.520.388 | 13.722.696 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen abzüglich | 125.615.635 | 143.463.560 | 197.950.062 | 164.160.277 | 1.314.775.449 | 1.436.887.923 |
| Andere Verbindlichkeiten | 470.604 | 13.831.300 | 1.958.582 | 7.044.275 | 3.378.051 | 20.052.372 |
| Nettoteilfondsvermögen | 125.145.031 | 129.632.260 | 195.991.480 | 157.116.002 | 1.311.397.398 | 1.416.835.551 |

iSHARES ETF (CH)

VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares SLI® ETF (CH) | | iShares SMI® ETF (CH) | | iShares SMIM® ETF (CH) | |
|---|-----------------------|---------------------|-----------------------|----------------------|------------------------|----------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Nettoteilfondsvermögen zu Beginn des Berichtsjahres | 372.760.769 | 457.397.915 | 1.922.906.318 | 1.941.690.432 | 1.222.138.105 | 1.515.974.073 |
| Kapitalausschüttung | (3.046.874) | (3.821.880) | (9.799.160) | (11.762.160) | (11.622.170) | (10.111.628) |
| Ordentliche Ausschüttung/ Ertragsteuer auf thesaurierte Beträge | (646.307) | (1.273.960) | - | (4.523.907) | (1.780.816) | (1.195.999) |
| Zwischenausschüttungen | (8.418.319) | (7.806.066) | (46.092.282) | (51.154.609) | (13.686.349) | (14.082.668) |
| Ausgabe von Anteilen | 19.940.790 | 191.625.036 | 427.795.592 | 480.669.267 | 98.540.991 | 133.459.695 |
| Rücknahme von Anteilen | (31.640.494) | (290.240.007) | (508.255.296) | (744.306.209) | (230.871.069) | (334.771.798) |
| Gesamterfolg | 10.345.090 | 26.879.731 | 131.292.573 | 312.293.504 | 35.783.826 | (67.133.570) |
| Nettoteilfondsvermögen am Ende des Berichtsjahres | 359.294.655 | 372.760.769 | 1.917.847.745 | 1.922.906.318 | 1.098.502.518 | 1.222.138.105 |

| | iShares Swiss Dividend ETF (CH) | | iShares Core SPI® ETF (CH) | | iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | |
|---|------------------------------------|---------------------|-------------------------------|----------------------|--|---------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Nettoteilfondsvermögen zu Beginn des Berichtsjahres | 459.448.615 | 275.624.357 | 1.403.008.760 | 1.223.055.077 | 54.277.254 | 52.064.338 |
| Kapitalausschüttung | (244.500) | (277.500) | (6.612.000) | (6.660.000) | - | - |
| Ordentliche Ausschüttung/ Ertragsteuer auf thesaurierte Beträge | (1.059.500) | - | (1.824.000) | - | (507.500) | (602.000) |
| Zwischenausschüttungen | (19.271.000) | (15.148.500) | (34.552.500) | (32.358.000) | (465.000) | (525.000) |
| Ausgabe von Anteilen | 307.881.381 | 164.815.622 | 342.147.150 | 275.005.530 | 18.100.334 | 13.154.378 |
| Rücknahme von Anteilen | (35.021.976) | (17.410.679) | (239.044.425) | (225.714.985) | (3.612.954) | (9.341.292) |
| Gesamterfolg | 14.511.813 | 51.845.315 | 91.088.150 | 169.681.138 | (717.747) | (473.170) |
| Nettoteilfondsvermögen am Ende des Berichtsjahres | 726.244.833 | 459.448.615 | 1.554.211.135 | 1.403.008.760 | 67.074.387 | 54.277.254 |

iSHARES ETF (CH)

VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | | iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | | iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | |
|---|--|---------------------|---|---------------------|---|----------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Nettoteilfondsvermögen zu Beginn des Berichtsjahres | 129.632.260 | 155.987.015 | 157.116.002 | 130.048.654 | 1.416.835.551 | 1.342.979.901 |
| Ordentliche Ausschüttung/ Ertragsteuer auf thesaurierte Beträge | (1.281.000) | (1.462.000) | (1.431.000) | (1.125.000) | (6.017.972) | (6.584.882) |
| Zwischenausschüttungen | (1.111.500) | (1.440.500) | (1.479.000) | (1.196.000) | (5.262.202) | (6.423.212) |
| Ausgabe von Anteilen | 21.523.235 | 52.389.528 | 66.777.068 | 58.783.144 | 117.969.512 | 98.882.276 |
| Rücknahme von Anteilen | (21.313.100) | (76.256.871) | (23.906.501) | (35.216.451) | (189.602.226) | (44.675.531) |
| Gesamterfolg | (2.304.864) | 415.088 | (1.085.089) | 5.821.655 | (22.525.265) | 32.656.999 |
| Nettoteilfondsvermögen am Ende des Berichtsjahres | 125.145.031 | 129.632.260 | 195.991.480 | 157.116.002 | 1.311.397.398 | 1.416.835.551 |

iSHARES ETF (CH)

VERÄNDERUNGEN DER ANZAHL ANTEILE IM UMLAUF

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares SLI® ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares SMI® ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares SMIM® ETF (CH) Anteilsklasse - A | |
|---|--|---------------------|--|---------------------|---|---------------------|
| | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 |
| | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen |
| Anzahl Anteile zu Beginn des Berichtsjahres | 2.383.238 | 3.033.238 | 19.369.538 | 21.969.538 | 4.736.359 | 5.536.359 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 125.000 | 1.250.000 | 4.300.000 | 5.175.000 | 350.000 | 500.000 |
| Anzahl der zurückgenommenen Anteile | (200.000) | (1.900.000) | (4.950.000) | (7.775.000) | (850.000) | (1.300.000) |
| Anzahl am Ende des Berichtsjahres | 2.308.238 | 2.383.238 | 18.719.538 | 19.369.538 | 4.236.359 | 4.736.359 |

| | iShares Swiss Dividend ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares Core SPI® ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) Anteilsklasse - A | |
|---|---|---------------------|---|---------------------|---|---------------------|
| | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 |
| | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen |
| Anzahl Anteile zu Beginn des Berichtsjahres | 3.925.000 | 2.625.000 | 11.625.000 | 11.175.000 | 725.000 | 675.000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 2.450.000 | 1.450.000 | 2.850.000 | 2.400.000 | 250.000 | 175.000 |
| Anzahl der zurückgenommenen Anteile | (275.000) | (150.000) | (1.950.000) | (1.950.000) | (50.000) | (125.000) |
| Anzahl am Ende des Berichtsjahres | 6.100.000 | 3.925.000 | 12.525.000 | 11.625.000 | 925.000 | 725.000 |

| | iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) Anteilsklasse - A | |
|---|---|---------------------|--|---------------------|--|---------------------|
| | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 |
| | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen |
| Anzahl Anteile zu Beginn des Berichtsjahres | 1.475.000 | 1.750.000 | 1.300.000 | 1.100.000 | 14.063.504 | 13.511.504 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 250.000 | 600.000 | 550.000 | 500.000 | 1.192.112 | 1.002.000 |
| Anzahl der zurückgenommenen Anteile | (250.000) | (875.000) | (200.000) | (300.000) | (1.891.150) | (450.000) |
| Anzahl am Ende des Berichtsjahres | 1.475.000 | 1.475.000 | 1.650.000 | 1.300.000 | 13.364.466 | 14.063.504 |

iSHARES ETF (CH)

RÜCKZAHLBARES NETTOVERMÖGEN VON ANTEILINHABERN

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| | iShares SLI® ETF (CH) | iShares SMI® ETF (CH) | iShares SMIM® ETF (CH) | iShares Swiss Dividend ETF (CH) | iShares Core SPI® ETF (CH) | iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) |
|-------------------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Nettoinventarwert | CHF | CHF | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Per 31. Mai 2020 | 359.294.655 | 1.917.847.745 | 1.098.502.518 | 726.244.833 | 1.554.211.135 | 67.074.387 |
| Per 31. Mai 2019 | 372.760.769 | 1.922.906.318 | 1.222.138.105 | 459.448.615 | 1.403.008.760 | 54.277.254 |
| Per 31. Mai 2018 | 457.397.915 | 1.941.690.432 | 1.515.974.073 | 275.624.357 | 1.223.055.077 | 52.064.338 |
| Ausgegebene Anteile | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen |
| Per 31. Mai 2020 | 2.308.238 | 18.719.538 | 4.236.359 | 6.100.000 | 12.525.000 | 925.000 |
| Per 31. Mai 2019 | 2.383.238 | 19.369.538 | 4.736.359 | 3.925.000 | 11.625.000 | 725.000 |
| Per 31. Mai 2018 | 3.033.238 | 21.969.538 | 5.536.359 | 2.625.000 | 11.175.000 | 675.000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil | CHF | CHF | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Per 31. Mai 2020 | 155,66 | 102,45 | 259,30 | 119,06 | 124,09 | 72,51 |
| Per 31. Mai 2019 | 156,41 | 99,27 | 258,03 | 117,06 | 120,69 | 74,87 |
| Per 31. Mai 2018 | 150,80 | 88,38 | 273,82 | 105,00 | 109,45 | 77,13 |

| | iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) |
|-------------------------------------|---|--|--|
| Nettoinventarwert | CHF | CHF | CHF |
| Per 31. Mai 2020 | 125.145.031 | 195.991.480 | 1.311.397.398 |
| Per 31. Mai 2019 | 129.632.260 | 157.116.002 | 1.416.835.551 |
| Per 31. Mai 2018 | 155.987.015 | 130.048.654 | 1.342.979.901 |
| Ausgegebene Anteile | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen | Anzahl von Anteilen |
| Per 31. Mai 2020 | 1.475.000 | 1.650.000 | 13.364.466 |
| Per 31. Mai 2019 | 1.475.000 | 1.300.000 | 14.063.504 |
| Per 31. Mai 2018 | 1.750.000 | 1.100.000 | 13.511.504 |
| Nettoinventarwert pro Anteil | CHF | CHF | CHF |
| Per 31. Mai 2020 | 84,84 | 118,78 | 98,13 |
| Per 31. Mai 2019 | 87,89 | 120,86 | 100,75 |
| Per 31. Mai 2018 | 89,14 | 118,23 | 99,40 |

iSHARES ETF (CH)

ERFOLGSRECHNUNG

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares SLI® ETF (CH) | | iShares SMI® ETF (CH) | | iShares SMIM® ETF (CH) | |
|--|-----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------|------------------------|---------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 3 | 8 | - | 17.555 | 10 | 3.030 |
| Erträge der Effektenleihe | 20.276 | 47.710 | 156.931 | 60.933 | 152.982 | 358.508 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | - | - | - | - | - | - |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte einschliesslich Erträge aus Gratisaktien | 9.760.053 | 10.148.290 | 56.513.664 | 58.529.790 | 21.048.989 | 21.744.218 |
| Sonstige Erträge | - | - | - | - | - | - |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | (1.760) | (193.530) | (322.073) | (330.783) | 18.095 | 62.458 |
| Total Erträge abzüglich: | 9.778.572 | 10.002.478 | 56.348.522 | 58.277.495 | 21.220.076 | 22.168.214 |
| Passivzinsen | 159 | 197 | 151 | 2.419 | - | 688 |
| Negativzinsen | 2.922 | 4.891 | 22.188 | 34.068 | 9.841 | 25.264 |
| Reglementarische Vergütungen an: | | | | | | |
| - Die Fondsleitung | 1.302.103 | 1.499.649 | 6.776.508 | 7.128.118 | 5.453.979 | 6.137.829 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | (10.558) | 14.315 | (103.805) | (154.645) | 60.603 | 157.470 |
| Nettoertrag | 8.483.946 | 8.483.426 | 49.653.480 | 51.267.535 | 15.695.653 | 15.846.963 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 6.227.508 | 33.199.191 | 106.926.697 | 109.489.253 | 55.119.614 | 88.593.593 |
| Realisierter Erfolg | 14.711.454 | 41.682.617 | 156.580.177 | 160.756.788 | 70.815.267 | 104.440.556 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | (4.366.364) | (14.802.886) | (25.287.604) | 151.536.716 | (35.031.441) | (171.574.126) |
| Gesamterfolg | 10.345.090 | 26.879.731 | 131.292.573 | 312.293.504 | 35.783.826 | (67.133.570) |

iSHARES ETF (CH)

ERFOLGSRECHNUNG (Fortsetzung)

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares Swiss Dividend ETF (CH) | | iShares Core SPI® ETF (CH) | | iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | |
|--|------------------------------------|---------------------|----------------------------|---------------------|--|---------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 1 | 5 | 1 | 8 | - | - |
| Erträge der Effektenleihe | 50.070 | 8.602 | 172.411 | 220.363 | - | - |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | - | - | - | - | 1.176.110 | 1.072.167 |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte einschliesslich Erträge aus Gratisaktien | 22.129.729 | 16.722.063 | 40.148.726 | 35.299.262 | - | - |
| Sonstige Erträge | - | - | 1.103 | - | - | - |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | (89.978) | (37.395) | 305.685 | 174.930 | 114.810 | 83.733 |
| Total Erträge abzüglich: | 22.089.822 | 16.693.275 | 40.627.926 | 35.694.563 | 1.290.920 | 1.155.900 |
| Passivzinsen | 26.434 | 152 | 215 | 112 | - | - |
| Negativzinsen | 9.577 | 4.783 | 16.418 | 14.652 | 1.771 | 1.061 |
| Reglementarische Vergütungen an: | | | | | | |
| - Die Fondsleitung | 896.487 | 529.006 | 1.472.722 | 1.299.754 | 84.423 | 80.944 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | (2.932) | 463 | 163.560 | 136.770 | 22.615 | 50.055 |
| Nettoertrag | 21.160.256 | 16.158.871 | 38.975.011 | 34.243.275 | 1.182.111 | 1.023.840 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | (30.398.218) | 15.127.226 | 27.673.106 | 22.718.180 | (2.112.306) | (761.516) |
| Realisierter Erfolg | (9.237.962) | 31.286.097 | 66.648.117 | 56.961.455 | (930.195) | 262.324 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 23.749.775 | 20.559.218 | 24.440.033 | 112.719.683 | 212.448 | (735.494) |
| Gesamterfolg | 14.511.813 | 51.845.315 | 91.088.150 | 169.681.138 | (717.747) | (473.170) |

iSHARES ETF (CH)

ERFOLGSRECHNUNG (Fortsetzung)

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | | iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | | iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | |
|---|--|---------------------|---|---------------------|---|---------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Erträge der Bankguthaben | 37 | - | - | - | 4 | 4 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in: | | | | | | |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 2.281.791 | 2.966.239 | 3.380.852 | 2.721.124 | 12.217.428 | 14.444.591 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | 84.967 | 379.255 | 285.375 | 308.653 | 251.075 | 178.067 |
| Total Erträge abzüglich: | 2.366.795 | 3.345.494 | 3.666.227 | 3.029.777 | 12.468.507 | 14.622.662 |
| Passivzinsen | 321 | - | 1.456 | - | 14.365 | 303 |
| Negativzinsen | 1.408 | 1.846 | 2.908 | 2.215 | 22.657 | 15.934 |
| Reglementarische Vergütungen an: | | | | | | |
| - Die Fondsleitung | 194.312 | 214.238 | 269.115 | 210.592 | 2.046.381 | 2.076.886 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | 165.508 | 466.620 | 156.175 | 242.713 | 597.872 | 147.665 |
| Nettoertrag | 2.005.246 | 2.662.790 | 3.236.573 | 2.574.257 | 9.787.232 | 12.381.874 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | (4.731.877) | (3.941.597) | (141.034) | (1.011.725) | (3.101.539) | (5.729.123) |
| Realisierter Erfolg | (2.726.631) | (1.278.807) | 3.095.539 | 1.562.532 | 6.685.693 | 6.652.751 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | 421.767 | 1.693.895 | (4.180.628) | 4.259.123 | (29.210.958) | 26.004.248 |
| Gesamterfolg | (2.304.864) | 415.088 | (1.085.089) | 5.821.655 | (22.525.265) | 32.656.999 |

iSHARES ETF (CH)

VERWENDUNG DES ERFOLGES

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares SLI® ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares SMI® ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares SMIM® ETF (CH) Anteilsklasse - A | |
|--|--|---------------------|--|---------------------|---|---------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Nettoertrag des Berichtsjahres | 8.483.946 | 8.483.426 | 49.653.480 | 51.267.535 | 15.695.653 | 15.846.963 |
| Bilanz zu Beginn des Berichtsjahres | 21.693 | 11.640 | 391.045 | 278.119 | 5.020 | 40.541 |
| Zur Ausschüttung bestimmte Kapitalgewinne des Berichtsjahres | 1.154.119 | 3.145.874 | 4.867.080 | 10.072.160 | 3.727.996 | 11.746.170 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 9.659.758 | 11.640.940 | 54.911.605 | 61.617.814 | 19.428.669 | 27.633.674 |
| Zwischenausschüttung während des Berichtsjahres | 8.418.319 | 7.806.066 | 46.092.282 | 51.154.609 | 13.686.349 | 14.082.668 |
| Zur Ausschüttung vorgesehener Erfolg | - | 667.307 | 3.743.908 | - | 1.948.725 | 1.799.816 |
| Kapitalausschüttung aus den im Berichtsjahr erwirtschafteten Kapitalgewinnen | 1.154.119 | 3.145.874 | 4.867.080 | 10.072.160 | 3.727.996 | 11.746.170 |
| Bilanz am Ende des Berichtsjahres | 87.320 | 21.693 | 208.335 | 391.045 | 65.599 | 5.020 |
| Ordentliche Ausschüttung pro Anteil | | | | | | |
| Brutto | - | 0,28 | 0,20 | - | 0,46 | 0,38 |
| Eidgenössische Verrechnungssteuer von 35% | - | (0,10) | (0,07) | - | (0,16) | (0,13) |
| Nettoausschüttung aus Nettoertrag | - | 0,18 | 0,13 | - | 0,30 | 0,25 |
| Kapitalgewinnrendite pro Anteil | | | | | | |
| Brutto | 0,50 | 1,32 | 0,26 | 0,52 | 0,88 | 2,48 |
| Nettoausschüttung aus Kapitalgewinnen | 0,50 | 1,32 | 0,26 | 0,52 | 0,88 | 2,48 |

iSHARES ETF (CH)

VERWENDUNG DES ERFOLGES (Fortsetzung)

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares Swiss Dividend ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares Core SPI® ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) Anteilsklasse - A | |
|--|---|---------------------|---|---------------------|---|---------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Nettoertrag des Berichtsjahres | 21.160.256 | 16.158.871 | 38.975.011 | 34.243.275 | 1.182.111 | 1.023.840 |
| Bilanz zu Beginn des Berichtsjahres | 32.499 | 42.628 | 198.324 | 173.049 | 14 | 8.674 |
| Zur Ausschüttung bestimmte Kapitalgewinne des Berichtsjahres | 3.660.000 | 235.500 | 3.256.500 | 6.742.500 | - | - |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 24.852.755 | 16.436.999 | 39.173.335 | 42.429.835 | 1.182.125 | 1.032.514 |
| Zwischenausschüttung während des Berichtsjahres | 19.271.000 | 15.148.500 | 34.552.500 | 32.358.000 | 465.000 | 525.000 |
| Zur Ausschüttung vorgesehener Erfolg | 1.830.000 | 1.020.500 | 4.509.000 | 1.860.000 | 703.000 | 507.500 |
| Kapitalausschüttung aus den im Berichtsjahr erwirtschafteten Kapitalgewinnen | 3.660.000 | 235.500 | 3.256.500 | 6.742.500 | - | - |
| Bilanz am Ende des Berichtsjahres | 91.755 | 32.499 | 111.835 | 198.324 | 14.125 | 14 |
| Ordentliche Ausschüttung pro Anteil | | | | | | |
| Brutto | 0,30 | 0,26 | 0,36 | 0,16 | 0,76 | 0,70 |
| Eidgenössische Verrechnungssteuer von 35% | (0,11) | (0,09) | (0,13) | (0,06) | (0,27) | (0,25) |
| Nettoausschüttung aus Nettoertrag | 0,19 | 0,17 | 0,23 | 0,10 | 0,49 | 0,45 |
| Kapitalgewinnrendite pro Anteil | | | | | | |
| Brutto | 0,60 | 0,06 | 0,26 | 0,58 | - | - |
| Nettoausschüttung aus Kapitalgewinnen | 0,60 | 0,06 | 0,26 | 0,58 | - | - |

iSHARES ETF (CH)

VERWENDUNG DES ERFOLGES (Fortsetzung)

Für die am 31. Mai 2020 und am 31. Mai 2019 abgelaufenen Berichtszeiträume

| | iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) Anteilsklasse - A | | iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) Anteilsklasse - A | |
|---|---|---------------------|--|---------------------|--|---------------------|
| | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF | 31. Mai 2020 CHF | 31. Mai 2019 CHF |
| Nettoertrag des Berichtsjahres | 2.005.246 | 2.662.790 | 3.236.573 | 2.574.257 | 9.787.232 | 12.381.874 |
| Bilanz zu Beginn des Berichtsjahres | 14.738 | 31.448 | 14.725 | 14.468 | 213.503 | 161.513 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 2.019.984 | 2.694.238 | 3.251.298 | 2.588.725 | 10.000.735 | 12.543.387 |
| Zwischenausschüttung während des Berichtsjahres | 1.111.500 | 1.440.500 | 1.479.000 | 1.196.000 | 5.262.202 | 6.423.212 |
| Zur Ausschüttung vorgesehener Erfolg | 885.000 | 1.239.000 | 1.749.000 | 1.378.000 | 4.543.918 | 5.906.672 |
| Bilanz am Ende des Berichtsjahres | 23.484 | 14.738 | 23.298 | 14.725 | 194.615 | 213.503 |
| Ordentliche Ausschüttung pro Anteil | | | | | | |
| Brutto | 0,60 | 0,84 | 1,06 | 1,06 | 0,34 | 0,42 |
| Eidgenössische Verrechnungssteuer von 35% | (0,21) | (0,29) | (0,37) | (0,37) | (0,12) | (0,15) |
| Nettoausschüttung aus Nettoertrag | 0,39 | 0,55 | 0,69 | 0,69 | 0,22 | 0,27 |

iSHARES ETF (CH)

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

1. VERKAUFSRESTRIKTIONEN VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA (USA)

Anteile der Teilvermögen dürfen innerhalb der USA weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden. Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen Bürgern der USA und/oder Personen mit Wohnsitz oder Sitz in den USA und/oder anderen natürlichen wie juristischen Personen, deren Einkommen und/oder Erträge, ungeachtet der Herkunft, der US Einkommenssteuer unterliegen, sowie Personen, die gemäss Bestimmung S des US Securities Act von 1933 und/oder dem US Commodity Exchange Act in der jeweils gültigen Fassung als US-Personen gelten, weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

2. INFORMATIONEN BEZÜGLICH DER SFAMA-TRANSPARENZRICHTLINIE

Die Fondsleitung und deren Beauftragte bezahlen keine Retrozessionen zur Entschädigung der Vertriebstätigkeit von Teilvermögensanteilen in der Schweiz oder von der Schweiz aus. Die Fondsleitung und deren Beauftragte gewähren im Vertrieb in der Schweiz oder von der Schweiz aus keine Rabatte, um die auf die Anleger entfallenden und dem Teilvermögen belasteten Gebühren oder Kosten zu reduzieren.

3. SOFT COMMISSIONS

Die Fondsleitung hat keine „Commission Sharing Agreements“ oder Vereinbarungen bezüglich sogenannter „Soft Commissions“ geschlossen.

4. BERECHNUNG DES NETTOINVENTARWERTES

a) Der NIW jedes Teilvermögens wird in Schweizer Franken zum Verkehrswert auf Ende des Berichtszeitraums sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.

b) An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den Schlusskursen des Hauptmarktes am Auftragstag zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.

c) Der NIW eines Anteils eines Teilvermögens ergibt sich aus dem Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile dieses Teilvermögens. Er wird auf vier Nachkommastellen der Rechnungseinheit gerundet.

5. BEWERTUNG DER ANLAGEN

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|--------------------|------------|------------|--------------------|
| iShares SLI® ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | 354.494.446 | - | - | 354.494.446 |
| Derivative Finanzinstrumente | 232.958 | - | - | 232.958 |
| Total | 354.727.404 | - | - | 354.727.404 |

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|----------------------|------------|------------|----------------------|
| iShares SMI® ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | 1.887.310.082 | - | - | 1.887.310.082 |
| Derivative Finanzinstrumente | 2.651.587 | - | - | 2.651.587 |
| Total | 1.889.961.669 | - | - | 1.889.961.669 |

iSHARES ETF (CH)

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT (Fortsetzung)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

5. BEWERTUNG DER ANLAGEN (Fortsetzung)

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|----------------------|------------|------------|----------------------|
| iShares SMIM® ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | 1.087.511.390 | - | - | 1.087.511.390 |
| Derivative Finanzinstrumente | 945.442 | - | - | 945.442 |
| Total | 1.088.456.832 | - | - | 1.088.456.832 |

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|--------------------|------------|------------|--------------------|
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | 712.066.064 | - | - | 712.066.064 |
| Derivative Finanzinstrumente | 793.215 | - | - | 793.215 |
| Total | 712.859.279 | - | - | 712.859.279 |

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|----------------------|------------|------------|----------------------|
| iShares Core SPI® ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | 1.532.299.200 | - | - | 1.532.299.200 |
| Derivative Finanzinstrumente | 949.454 | - | - | 949.454 |
| Total | 1.533.248.654 | - | - | 1.533.248.654 |

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|------------|-------------------|------------|-------------------|
| iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | - | 66.128.106 | - | 66.128.106 |
| Total | - | 66.128.106 | - | 66.128.106 |

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|------------|--------------------|------------|--------------------|
| iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | - | 123.161.939 | - | 123.161.939 |
| Total | - | 123.161.939 | - | 123.161.939 |

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|------------|--------------------|------------|--------------------|
| iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | - | 193.348.795 | - | 193.348.795 |
| Total | - | 193.348.795 | - | 193.348.795 |

iSHARES ETF (CH)

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT (Fortsetzung)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

5. BEWERTUNG DER ANLAGEN (Fortsetzung)

| | Level 1 | Level 2 | Level 3 | Total |
|--|------------|----------------------|------------|----------------------|
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | CHF | CHF | CHF | CHF |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in: | | | | |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | - | 1.302.984.962 | - | 1.302.984.962 |
| Total | - | 1.302.984.962 | - | 1.302.984.962 |

Gemäss Art. 84 Abs. 2 der Kollektivanlageverordnung Eidgenössische Finanzmarktaufsicht („FINMA“) sind die Anlagen summarisch in einer Tabelle nach folgenden drei Bewertungskategorien aufgeteilt darzustellen:

Level 1 – Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden;

Level 2 – Anlagen, für die keine Kurse gemäss Level 1 verfügbar sind. Bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;

Level 3 – Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.

Die Festlegung der am Markt beobachtbaren Parameter erfordert ein erhebliches Beurteilungsvermögen der Fondsleitung, die die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifischen Faktoren berücksichtigen muss.

Die Fondsleitung betrachtet Preise am Primärmarkt als Marktdaten, die verfügbar sind, regelmässig verbreitet oder aktualisiert werden, zuverlässig, überprüfbar und nicht geschützt sind und die von unabhängigen Quellen, die aktiv an dem betreffenden Markt tätig sind, erhalten werden können.

6. AUSSERBILANZGESCHÄFTE

a) Effektenleihe

Der gemäss der Effektenleihevereinbarung bestellte Lending Agent (Vermittler für Effektenleihen) ist die BlackRock Advisors (UK) Limited. Die Teilvermögen profitieren von einer von BlackRock Inc. geleisteten Schadloshaltung, die einen vollständigen Ersatz der entliehenen Wertpapiere ermöglicht. BlackRock Inc. trägt sämtliche operativen Kosten, die in direktem Zusammenhang mit Effektenleihegeschäften stehen, sowie die Kosten für die Schadloshaltung gegen Ausfälle von Kreditnehmern. Die Teilvermögen tätigten im Berichtsjahr Effektenleihegeschäfte. Die Teilvermögen erhalten als Sicherheiten entweder Barsicherheiten oder Wertpapiere, deren Wert über dem Verkehrswert der entliehenen Wertpapiere liegt.

Die Erträge aus Effektenleihegeschäften werden im Verhältnis 62,5:37,5 zwischen dem Teilvermögen und dem Vermittler für Effektenleihen aufgeteilt, wobei alle operativen Kosten aus dem Anteil des Vermittlers für Effektenleihen gezahlt werden.

Die Borger der ausgeliehenen Effektenleihen während des Berichtsjahres waren: Barclays Capital Securities Limited, Citigroup Global Markets Limited, HSBC Bank plc, Macquarie Bank Limited, Societe Generale S.A., BNP Paribas und Morgan Stanley & Co. International. Bank of New York Mellon ist der Administrator für Sicherheiten.

Die nachstehende Tabelle zeigt den Wert der Effektenleihen als Anteil des leihbaren Gesamtvermögens und des Nettoinventarwertes sowie die im Berichtszeitraum bis 31. Mai 2020 erzielten Erträge der Effektenleihe. Das leihbare Gesamtvermögen entspricht dem Gesamtwert der leihbaren Effektenleihen des Wertpapierleihvermögens. Hiervon ausgeschlossen sind Vermögenswerte des Teilfonds, die aufgrund etwaiger Markt-, Anlage-, aufsichtsrechtlicher oder anderer Beschränkungen nicht als leihbar gelten.

iSHARES ETF (CH)

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT (Fortsetzung)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

6. AUSSERBILANZGESCHÄFTE (Fortsetzung)

a) Effektenleihe (Fortsetzung)

Effektenleihe

| Teilvermögen | Währung | Effektenleihen | | Erträge der Effektenleihe |
|---------------------------------|---------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | | % des leihbaren Vermögens | % des Nettoinventarwertes | |
| iShares SLI® ETF (CH) | CHF | 5,89 | 5,81 | 20.276 |
| iShares SMI® ETF (CH) | CHF | 2,93 | 2,89 | 156.931 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | CHF | 10,13 | 10,03 | 152.982 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | CHF | 9,46 | 9,28 | 50.070 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | CHF | 7,17 | 7,07 | 172.411 |

| Teilvermögen | Währung | 31. Mai 2020 | | 31. Mai 2019 | |
|---------------------------------|---------|---------------------------------|------------------------------|---------------------------------|------------------------------|
| | | Wert der ausgeliehenen Effekten | Wert gehaltener Sicherheiten | Wert der ausgeliehenen Effekten | Wert gehaltener Sicherheiten |
| iShares SLI® ETF (CH) | CHF | 20.890.060 | 22.650.032 | 24.152.542 | 27.074.741 |
| iShares SMI® ETF (CH) | CHF | 55.354.810 | 59.105.820 | 79.883.283 | 88.426.327 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | CHF | 110.202.485 | 119.838.812 | 53.529.274 | 57.006.692 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | CHF | 67.382.845 | 74.027.394 | 56.982.422 | 62.650.205 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | CHF | 109.810.700 | 119.953.000 | 25.878.856 | 29.158.578 |

Sicherheiten

| Art und Qualität der Sicherheiten | Grundsätzliche Fälligkeit | | |
|-----------------------------------|---------------------------|------------------|-------------------|
| | Mehr als 365 Tage | Offen | Total |
| iShares SLI® ETF (CH) | CHF | CHF | CHF |
| Obligationen | | | |
| Investment Grade | 13.980.990 | - | 13.980.990 |
| Aktien | | | |
| Aktienindex | - | 8.669.042 | 8.669.042 |
| Total | 13.980.990 | 8.669.042 | 22.650.032 |

| Art und Qualität der Sicherheiten | Grundsätzliche Fälligkeit | | |
|-----------------------------------|---------------------------|-------------------|-------------------|
| | Mehr als 365 Tage | Offen | Total |
| iShares SMI® ETF (CH) | CHF | CHF | CHF |
| Obligationen | | | |
| Investment Grade | 33.664.733 | - | 33.664.733 |
| Aktien | | | |
| Aktienindex | - | 25.441.087 | 25.441.087 |
| Total | 33.664.733 | 25.441.087 | 59.105.820 |

iSHARES ETF (CH)

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT (Fortsetzung)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

6. AUSSERBILANZGESCHÄFTE (Fortsetzung)

a) Effektenleihe (Fortsetzung)

| Art und Qualität der Sicherheiten | Grundsätzliche Fälligkeit | | |
|-----------------------------------|---------------------------|-------------------|--------------------|
| | Mehr als 365 Tage | Offen | Total |
| iShares SMIM® ETF (CH) | CHF | CHF | CHF |
| Obligationen | | | |
| Investment Grade | 83.926.277 | - | 83.926.277 |
| Aktien | | | |
| Aktienindex | - | 35.912.535 | 35.912.535 |
| Total | 83.926.277 | 35.912.535 | 119.838.812 |

| Art und Qualität der Sicherheiten | Grundsätzliche Fälligkeit | | |
|--|---------------------------|-------------------|-------------------|
| | Mehr als 365 Tage | Offen | Total |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | CHF | CHF | CHF |
| Obligationen | | | |
| Investment Grade | 21.141.528 | - | 21.141.528 |
| Aktien | | | |
| Aktienindex | - | 52.885.866 | 52.885.866 |
| Total | 21.141.528 | 52.885.866 | 74.027.394 |

| Art und Qualität der Sicherheiten | Grundsätzliche Fälligkeit | | |
|-----------------------------------|---------------------------|-------------------|--------------------|
| | Mehr als 365 Tage | Offen | Total |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | CHF | CHF | CHF |
| Obligationen | | | |
| Investment Grade | 71.371.416 | - | 71.371.416 |
| Aktien | | | |
| Aktienindex | - | 48.581.584 | 48.581.584 |
| Total | 71.371.416 | 48.581.584 | 119.953.000 |

b) Derivate Risikoposition

| Teilvermögen | 31. Mai 2020 | | 31. Mai 2019 | |
|---|--|--|--|--|
| | Basiswertäquivalent CHF/Teilvermögens- währung | In % des Nettoteilfonds- vermögens | Basiswertäquivalent CHF/Teilvermögens- währung | In % des Nettoteilfonds- vermögens |
| iShares SLI® ETF (CH) | | | | |
| - Total der engagementerhöhenden Positionen | 4.674.464 | 1,30 | 4.929.291 | 1,32 |
| iShares SMI® ETF (CH) | | | | |
| - Total der engagementerhöhenden Positionen | 30.477.619 | 1,59 | 22.952.792 | 1,19 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | | | | |
| - Total der engagementerhöhenden Positionen | 10.527.346 | 0,96 | 13.808.550 | 1,13 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | | | | |
| - Total der engagementerhöhenden Positionen | 13.979.569 | 1,92 | 6.854.339 | 1,49 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | | | | |
| - Total der engagementerhöhenden Positionen | 21.272.626 | 1,37 | 19.143.200 | 1,36 |

iSHARES ETF (CH)

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT (Fortsetzung)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

6. AUSSERBILANZGESCHÄFTE (Fortsetzung)

b) Derivate Risikoposition (Fortsetzung)

| Teilvermögen | 31. Mai 2020 | | 31. Mai 2019 | |
|---|--|----------------------------------|--|----------------------------------|
| | Basiswertäquivalent CHF/Teilvermögenswährung | In % des Nettoteilfondsvermögens | Basiswertäquivalent CHF/Teilvermögenswährung | In % des Nettoteilfondsvermögens |
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | | | | |
| - Total der engagementreduzierenden Positionen | - | - | 13.597.236 | 0,96 |

7. ÄNDERUNGEN DES PROSPEKTS / FONDSVERTRAGES

Dezember 2019

„FINMA“ hat die von der Fondsleitung und der Depotbank bekannt gegebenen Änderungen des Prospekts mit integriertem Fondsvertrag per 22. Januar 2020 zur Kenntnis genommen. Die nachstehende Änderung ist per 30. Dezember 2019 in Kraft getreten und lautet wie folgt:

a) Jährliches Update. Keine wesentlichen Änderungen.

Die Details zu dieser und weiteren Änderungen sind dem entsprechenden Prospekt mit integriertem Fondsvertrag per Dezember 2019 zu entnehmen.

8. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DER BERICHTSPERIODE

Mit Wirkung vom 31. Dezember 2019 ist Dr. Susanne Haury von Siebenthal aus dem Verwaltungsrat ausgeschieden.

Mit Wirkung vom 31. Dezember 2019 ist Dr. Peter Athanas aus dem Verwaltungsrat ausgeschieden.

Mit Wirkung vom 31. Dezember 2019 ist Dr. Michael Burch aus der Geschäftsleitung ausgeschieden.

Mit Wirkung vom 1. Januar 2020 wurde Markus Studer zum Mitglied der Geschäftsleitung ernannt.

Mit Wirkung vom 31. Mai 2020 ist André Bantli aus der Geschäftsleitung ausgeschieden.

Der Ausbruch von COVID-19

Der Ausbruch der ansteckenden Atemwegserkrankung, die durch das neuartige Coronavirus COVID-19 verursacht wird, wurde erstmals im Dezember 2019 in China nachgewiesen und hat sich seither zu einer weltweiten Pandemie entwickelt. Infolge des Ausbruchs kam es neben einer allgemeinen Besorgnis und Unsicherheit ebenfalls zu Reisebeschränkungen, zur Schliessung internationaler Grenzen, zu verstärkten Tests auf die Krankheit an Einreise- und Einfuhrhäfen sowie anderenorts, zu Unterbrechungen und Verzögerungen in der Vorbereitung und Erbringung von Gesundheitspflegediensten, zu langen Quarantänezeiten, zu Kündigungen, zu Unterbrechungen von Lieferketten und zu einer niedrigeren Verbrauchernachfrage. Die wirtschaftlichen Auswirkungen von COVID-19 haben weltweit eine Vielzahl von Ländern sowie einzelne Emittenten und Kapitalmärkte getroffen und könnten auch zukünftig in nicht unbedingt absehbarem Ausmass fortbestehen. Darüber hinaus könnten sich ansteckende Krankheiten infolge des weniger ausgeprägten Gesundheitswesens stärker auf die Märkte der Schwellenländer auswirken. Durch den COVID-19-Ausbruch verursachte Krisen im Bereich der öffentlichen Gesundheit können andere bereits bestehende politische, soziale und wirtschaftliche Risiken in bestimmten Ländern oder weltweit verschärfen. Die Dauer des Ausbruchs von COVID-19 und seine Auswirkungen können nicht mit Sicherheit vorhergesagt werden.

9. EREIGNISSE NACH ABLAUF DER BERICHTSPERIODE

Mit Wirkung vom 7. Juli 2020 wurde Ellen Bakke Mawdsley zum Mitglied des Verwaltungsrats ernannt.

Mit Wirkung vom 7. Juli 2020 wurde Søren Mose zum Mitglied des Verwaltungsrats ernannt.

10. AUSSCHÜTTUNGEN AN DIE ANTEILINHABER

| Teilvermögen | Anteilsklasse | Art | Ex-Datum | Währung | Bruttobetrag pro Anteils- |
|-----------------------|---------------|---------|---------------|---------|---------------------------|
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Kapital | 16. Juli 2019 | CHF | 1,32 |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Ertrag | 16. Juli 2019 | CHF | 0,28 |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Ertrag | 3. März 2020 | CHF | 0,48 |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Ertrag | 19. März 2020 | CHF | 0,27 |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Ertrag | 30. März 2020 | CHF | 0,12 |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Ertrag | 3. April 2020 | CHF | 1,20 |

iSHARES ETF (CH)

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT (Fortsetzung)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

10. AUSSCHÜTTUNGEN AN DIE ANTEILINHABER (Fortsetzung)

| Teilvermögen | Anteilsklasse | Art | Ex-Datum | Währung | Brutto- betrag pro Anteils- |
|--|---------------|---------|-----------------|------------|-----------------------------------|
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Ertrag | 21. April 2020 | CHF | 0,56 |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Ertrag | 27. April 2020 | CHF | 0,50 |
| iShares SLI® ETF (CH) | A | Ertrag | 18. Mai 2020 | CHF | 0,52 |
| Total | | | | CHF | 5,25 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | Kapital | 16. Juli 2019 | CHF | 0,52 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | Ertrag | 3. März 2020 | CHF | 0,62 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | Ertrag | 19. März 2020 | CHF | 0,56 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | Ertrag | 30. März 2020 | CHF | 0,06 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | Ertrag | 3. April 2020 | CHF | 0,36 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | Ertrag | 21. April 2020 | CHF | 0,30 |
| iShares SMI® ETF (CH) | A | Ertrag | 27. April 2020 | CHF | 0,52 |
| Total | | | | CHF | 2,94 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | Kapital | 16. Juli 2019 | CHF | 2,48 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | Ertrag | 16. Juli 2019 | CHF | 0,38 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | Ertrag | 23. März 2020 | CHF | 0,40 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | Ertrag | 9. April 2020 | CHF | 0,40 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | Ertrag | 28. April 2020 | CHF | 1,10 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | Ertrag | 29. April 2020 | CHF | 0,46 |
| iShares SMIM® ETF (CH) | A | Ertrag | 15. Mai 2020 | CHF | 0,84 |
| Total | | | | CHF | 6,06 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | Kapital | 16. Juli 2019 | CHF | 0,06 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | Ertrag | 16. Juli 2019 | CHF | 0,26 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | Ertrag | 3. März 2020 | CHF | 0,64 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | Ertrag | 19. März 2020 | CHF | 0,46 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | Ertrag | 3. April 2020 | CHF | 1,36 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | Ertrag | 8. April 2020 | CHF | 0,34 |
| iShares Swiss Dividend ETF (CH) | A | Ertrag | 28. April 2020 | CHF | 0,50 |
| Total | | | | CHF | 3,62 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | Kapital | 16. Juli 2019 | CHF | 0,58 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | Ertrag | 16. Juli 2019 | CHF | 0,16 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | Ertrag | 3. März 2020 | CHF | 0,68 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | Ertrag | 19. März 2020 | CHF | 0,56 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | Ertrag | 3. April 2020 | CHF | 0,56 |
| iShares Core SPI® ETF (CH) | A | Ertrag | 27. April 2020 | CHF | 1,06 |
| Total | | | | CHF | 3,60 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | A | Ertrag | 16. Juli 2019 | CHF | 0,70 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 1-3 ETF (CH) | A | Ertrag | 21. Januar 2020 | CHF | 0,62 |
| Total | | | | CHF | 1,32 |

iSHARES ETF (CH)

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT (Fortsetzung)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

10. AUSSCHÜTTUNGEN AN DIE ANTEILINHABER (Fortsetzung)

| Teilvermögen | Anteilstklasse | Art | Ex-Datum | Währung | Brutto- betrag pro Anteils- |
|---|----------------|--------|-----------------|------------|-----------------------------------|
| iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | A | Ertrag | 16. Juli 2019 | CHF | 0,84 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 3-7 ETF (CH) | A | Ertrag | 21. Januar 2020 | CHF | 0,78 |
| Total | | | | CHF | 1,62 |
| | | | | | |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | A | Ertrag | 16. Juli 2019 | CHF | 1,06 |
| iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 ETF (CH) | A | Ertrag | 21. Januar 2020 | CHF | 1,02 |
| Total | | | | CHF | 2,08 |
| | | | | | |
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | A | Ertrag | 16. Juli 2019 | CHF | 0,42 |
| iShares Core CHF Corporate Bond ETF (CH) | A | Ertrag | 21. Januar 2020 | CHF | 0,40 |
| Total | | | | CHF | 0,82 |

11. WECHSELKURSE

| Wechselkurse am | | 31. Mai 2020 | 31. Mai 2019 |
|-----------------|-----|--------------|--------------|
| CHF1= | EUR | 0,935774 | 0,892165 |
| | GBP | 0,841954 | 0,788785 |
| | USD | 1,040908 | 0,994184 |

12. BESTIMMUNGEN DER RICHTLINIE ÜBER DIE VERWALTER ALTERNATIVER INVESTMENTFONDS

Die Richtlinie über die Verwalter alternativer Investmentfonds (die „Richtlinie“) sieht ausführliche und verbindliche Verpflichtungen für Fondsmanager mit Sitz innerhalb der Europäischen Union (die „EU“) vor. Für Manager mit Sitz ausserhalb der EU, wie beispielsweise BlackRock Asset Management Schweiz AG (die „Gesellschaft“), gelten diese jedoch gegenwärtig nicht. Vielmehr sind Nicht-EU-Manager nur dann an bestimmte Offenlegungs-, Berichts- und Transparenzpflichten der Richtlinie gebunden, wenn sie Fonds an EU-Investoren vertreiben.

Die Gesellschaft hat iShares ETF (CH) (der „Fonds“) zum Vertrieb an europäische Investoren in Liechtenstein angemeldet.

13. VERGÜTUNGSBERICHT

Laut der Richtlinie ist die Gesellschaft zur quantitativen Offenlegung der Vergütungen verpflichtet. Eine solche Offenlegung erfolgt gemäss der Auslegung gegenwärtiger aufsichtsrechtlicher Vorgaben für die quantitative Offenlegung von Vergütungen durch BlackRock. BlackRock behält sich das Recht auf Anpassung der Berechnung der quantitativen Vergütungsoffenlegung nach eigenem Ermessen gemäss aktueller Marktpraktiken und aufsichtsrechtlicher Verfahren vor. Im Falle derartiger Anpassungen sind die Offenlegungen in Verbindung mit dem Umbrella-Fonds ggf. nicht mit den Offenlegungen des Vorjahres oder mit anderen fondsspezifischen Offenlegungen von BlackRock desselben Jahres vergleichbar.

Vergütungen (a) der Mitarbeiter der Gesellschaft; (b) der Mitglieder der Geschäftsführung; sowie (c) der Mitarbeiter mit massgeblichem Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds werden veröffentlicht.

Sämtliche in den aggregierten Zahlen enthaltenen Personen werden gemäss der Vergütungspolitik von BlackRock für ihren Zuständigkeitsbereich innerhalb des relevanten BlackRock-Geschäftsbereiches vergütet. Da alle diese Personen mehrere Zuständigkeitsbereiche haben, werden lediglich die fondsbezogenen Leistungen bei der Veröffentlichung der aggregierten Zahlen berücksichtigt.

BlackRock verfolgt durch unterstützende Vergütungsprogramme eine klar definierte Philosophie der qualitätsabhängigen Leistungsvergütung.

BlackRock betreibt ein Gesamtvergütungsmodell für Vergütungen, das ein vertraglich festgelegtes Grundgehalt und ein Bonusprogramm mit Ermessensspielraum enthält. Obwohl alle Mitarbeiter berechtigt sind, einen Ermessensbonus zu erhalten, besteht keine vertragliche Verpflichtung, einen Ermessensbonus an Mitarbeiter zu vergeben. Für die Mitglieder der Geschäftsführung wird laufend ein beträchtlicher Prozentsatz der variablen Vergütung zurückgestellt. Die Rückerstattungspolitik gilt für sämtliche Mitarbeiter.

ANMERKUNGEN ZUM JAHRESBERICHT (Fortsetzung)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

13. VERGÜTUNGSBERICHT (Fortsetzung)

Vergütungsentscheidungen für Mitarbeiter werden auf der Grundlage des Ganzjahresergebnisses und anderer nicht-monetärer Zielsetzungen von BlackRock getroffen. Neben den finanziellen Ergebnissen beruht die Einzelvergütung auch auf strategischen und operativen Ergebnissen sowie weiteren Faktoren, wie beispielsweise Management- und Führungsfähigkeiten. Für die Festsetzung jährlicher Leistungsprämien bestehen keinerlei festgelegte Formeln oder Vergleichswerte.

Jährliche Anreizprämien werden aus einem Bonuspool gezahlt, der während des gesamten Jahres durch einen unabhängigen Vergütungsausschuss von BlackRock unter Berücksichtigung realer und geplanter Finanzinformationen in Verbindung mit durch die Abteilungen für Unternehmensrisiken und regulatorische Compliance zur Verfügung gestellten vergütungsrelevanten Tätigkeits-, Ereignis- und Störungsberichten geprüft wird, die eine Abwägung bei Vergütungsentscheidungen rechtfertigen. Die Mitarbeiter werden bei der Festlegung ihrer eigenen Vergütung nicht beteiligt.

Jede der Kontrollfunktionen (Unternehmensrisiken, Recht & Compliance und Interne Revision) hat jeweils eigene organisatorische Strukturen, die unabhängig von den Geschäftseinheiten sind. Funktionale Bonuspools für diese Kontrollfunktionen werden entsprechend der Leistung eines jeden Mitarbeiters festgesetzt, und die Vergütung der leitenden Mitarbeiter mit Kontrollaufgaben wird direkt durch den unabhängigen Vergütungsausschuss von BlackRock überwacht.

Mitarbeiter und Mitglieder der Geschäftsführung der Gesellschaft erbringen sowohl AIFMD-relevante als auch nicht AIFMD-relevante Leistungen für mehrere Fonds bzw. Umbrella-Fonds, Kunden und Abteilungen der Gesellschaft sowie innerhalb der BlackRock-Gruppe. Folglich stellen die offengelegten Zahlen die Summe des Vergütungsanteils eines jeden Mitarbeiters in Verbindung mit dem Fonds gemäss einer objektiven Verrechnungsmethode dar, die der Leistungsvielfalt der Gesellschaft Rechnung trägt. Entsprechend haben die Zahlen keinen repräsentativen Charakter bezüglich der tatsächlichen Vergütung oder den Vergütungsbestandteilen einzelner Mitarbeiter.

Die Höhe der Gesamtvergütung, die die Gesellschaft ihren Mitarbeitenden gewährt hat und die dem Fonds für das am 31. Dezember 2019 endende Geschäftsjahr der Gesellschaft zuzurechnen ist, beträgt CHF 12,35 Mio. Dieser Betrag setzt sich aus der Festvergütung von CHF 5,91 Mio. und einer variablen Vergütung von CHF 6,44 Mio. zusammen. Es gab insgesamt 111 Begünstigte der o. g. Vergütung.

Die Höhe der von der Gesellschaft gewährten Gesamtvergütung, die dem Fonds für das am 31. Dezember 2019 endende Geschäftsjahr der Gesellschaft zuzurechnen ist, belief sich für die Geschäftsführung auf CHF 0,43 Mio. und für Mitarbeitende, deren Handlungen wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil des Fonds haben, auf CHF 0,09 Mio.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN

iSHARES SLI® ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | |
| Aktien | | | | | | |
| Arzneimittel | | | | | | |
| Novartis AG RegS | 348.740 | 75.603 | 40.384 | 383.959 | 31.880.115 | 8,87 |
| Roche Holding AG | 116.255 | 21.684 | 40.064 | 97.875 | 32.563.012 | 9,06 |
| Vifor Pharma AG | 23.833 | 1.892 | 4.309 | 21.416 | 3.128.878 | 0,87 |
| | | | | | 67.572.005 | 18,80 |
| Banken | | | | | | |
| Credit Suisse Group AG RegS | 1.325.125 | 209.405 | 244.946 | 1.289.584 | 11.307.073 | 3,15 |
| UBS Group AG RegS | 2.391.739 | 359.899 | 1.051.954 | 1.699.684 [^] | 17.506.745 | 4,87 |
| | | | | | 28.813.818 | 8,02 |
| Baumaterialien | | | | | | |
| Geberit AG RegS | 22.966 | 1.806 | 3.957 | 20.815 | 9.726.850 | 2,71 |
| LafargeHolcim Ltd RegS | 297.903 | 31.011 | 44.023 | 284.891 | 11.321.568 | 3,15 |
| Sika AG RegS | 78.454 | 6.182 | 13.527 | 71.109 | 11.697.430 | 3,25 |
| | | | | | 32.745.848 | 9,11 |
| Chemie | | | | | | |
| Clariant AG RegS | 152.972 | 12.641 | 25.695 | 139.918 [^] | 2.464.656 | 0,68 |
| Givaudan SA RegS | 4.931 | 388 | 849 | 4.470 | 15.408.090 | 4,29 |
| | | | | | 17.872.746 | 4,97 |
| Computer | | | | | | |
| Logitech International SA RegS | 107.326 | 8.536 | 18.477 | 97.385 [^] | 5.519.782 | 1,54 |
| | | | | | 5.519.782 | 1,54 |
| Diversifizierte Finanzdienstleistungen | | | | | | |
| Julius Baer Group Ltd | 138.761 | 10.999 | 23.991 | 125.769 | 5.143.952 | 1,43 |
| | | | | | 5.143.952 | 1,43 |
| Einzelhandel | | | | | | |
| Cie Financiere Richemont SA RegS | 217.817 | 74.766 | 25.885 | 266.698 | 14.903.084 | 4,14 |
| Swatch Group AG | 19.121 | 1.457 | 4.318 | 16.260 [^] | 3.120.294 | 0,87 |
| | | | | | 18.023.378 | 5,01 |
| Elektronik | | | | | | |
| ABB Ltd RegS | 830.000 | 213.574 | 190.277 | 853.297 | 16.118.780 | 4,48 |
| | | | | | 16.118.780 | 4,48 |
| Gesundheitspflagedienste | | | | | | |
| Lonza Group AG RegS | 46.170 | 2.720 | 8.276 | 40.614 | 19.149.501 | 5,33 |
| | | | | | 19.149.501 | 5,33 |
| Gesundheitspflegeprodukte | | | | | | |
| Alcon Inc | 302.993 | 25.789 | 52.473 | 276.309 [^] | 17.098.001 | 4,76 |
| Sonova Holding AG RegS | 34.081 | 2.670 | 6.382 | 30.369 | 6.392.675 | 1,78 |
| | | | | | 23.490.676 | 6,54 |
| Gewerbliche Dienstleistungen | | | | | | |
| Adecco Group AG RegS | 103.277 | 8.094 | 19.580 | 91.791 | 4.187.505 | 1,17 |
| SGS SA RegS | 3.218 | 826 | 596 | 3.448 | 7.775.240 | 2,16 |
| | | | | | 11.962.745 | 3,33 |
| Halbleiter | | | | | | |
| ams AG | 49.514 | 105.650 | 9.311 | 145.853 | 2.107.576 | 0,59 |
| ams AG Rights | - | 43.954 | 43.954 | - | - | 0,00 |
| | | | | | 2.107.576 | 0,59 |
| Nahrungsmittel | | | | | | |
| Nestle SA RegS | 338.357 | 54.762 | 95.085 | 298.034 | 30.953.811 | 8,61 |
| | | | | | 30.953.811 | 8,61 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SLI® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | |
| Private Equity | | | | | | |
| Partners Group Holding AG | 14.066 | 1.107 | 2.424 | 12.749 | 10.127.806 | 2,82 |
| | | | | | 10.127.806 | 2,82 |
| Software | | | | | | |
| Temenos AG RegS | 39.351 | 3.753 | 6.094 | 37.010 | 5.429.367 | 1,51 |
| | | | | | 5.429.367 | 1,51 |
| Telekommunikation | | | | | | |
| Swisscom AG RegS | 15.753 | 1.244 | 2.719 | 14.278 [^] | 7.136.144 | 1,99 |
| | | | | | 7.136.144 | 1,99 |
| Transport | | | | | | |
| Kuehne + Nagel International AG RegS | 34.782 | 2.760 | 5.977 | 31.565 | 4.368.596 | 1,22 |
| | | | | | 4.368.596 | 1,22 |
| Versicherungen | | | | | | |
| Swiss Life Holding AG RegS | 21.218 | 1.612 | 4.899 | 17.931 | 6.049.920 | 1,68 |
| Swiss Re AG | 161.379 | 26.672 | 22.465 | 165.586 | 10.782.960 | 3,00 |
| Zurich Insurance Group AG | 48.136 | 42.409 | 6.473 | 84.072 | 26.020.284 | 7,24 |
| | | | | | 42.853.164 | 11,92 |
| Werkzeuge und Zubehör | | | | | | |
| Schindler Holding AG | 25.244 | 1.998 | 4.361 | 22.881 | 5.104.751 | 1,42 |
| | | | | | 5.104.751 | 1,42 |
| Total Aktien | | | | | 354.494.446 | 98,64 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 354.494.446 | 98,64 |
| Total Effekten | | | | | 354.494.446 | 98,64 |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| Futures auf Indizes | | | | | | |
| SLI Future Juni 2019 | 338 | - | 338 | - | - | 0,00 |
| SLI Future September 2019 | - | 333 | 333 | - | - | 0,00 |
| SLI Future Dezember 2019 | - | 290 | 290 | - | - | 0,00 |
| SLI Future März 2020 | - | 53 | 53 | - | - | 0,00 |
| SLI Future Juni 2020 | - | 557 | 237 | 320 | 232.958 | 0,06 |
| | | | | | 232.958 | 0,06 |
| Total derivative Finanzinstrumente | | | | | 232.958 | 0,06 |
| Total Anlagen | | | | | 354.727.404 | 98,70 |
| Sichtguthaben | | | | | 1.246.269 | 0,35 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 3.417.684 | 0,95 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 359.391.357 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (96.702) | (0,03) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 359.294.655 | 99,97 |

¹ Inklusive der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

[^] Diese Effekten wurden teilweise oder insgesamt im Rahmen einer Wertpapierleihe übertragen.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SMI® ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|----------------------|--|
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | |
| Aktien | | | | | | |
| Arzneimittel | | | | | | |
| Novartis AG RegS | 3.703.617 | 1.352.369 | 1.086.999 | 3.968.987 | 329.544.990 | 17,18 |
| Roche Holding AG | 1.234.630 | 400.923 | 654.706 | 980.847 | 326.327.797 | 17,01 |
| | | | | | 655.872.787 | 34,19 |
| Banken | | | | | | |
| Credit Suisse Group AG RegS | 5.297.824 | 1.955.993 | 1.882.375 | 5.371.442 | 47.096.803 | 2,45 |
| UBS Group AG RegS | 8.435.361 | 2.955.675 | 3.052.893 | 8.338.143 [^] | 85.882.873 | 4,48 |
| | | | | | 132.979.676 | 6,93 |
| Baumaterialien | | | | | | |
| Geberit AG RegS | 80.992 | 30.030 | 24.279 | 86.743 | 40.535.004 | 2,11 |
| LafargeHolcim Ltd RegS | 1.050.641 | 460.508 | 323.938 | 1.187.211 | 47.179.765 | 2,46 |
| Sika AG RegS | 276.688 | 102.575 | 82.926 | 296.337 | 48.747.437 | 2,54 |
| | | | | | 136.462.206 | 7,11 |
| Chemie | | | | | | |
| Givaudan SA RegS | 17.395 | 6.457 | 5.224 | 18.628 | 64.210.716 | 3,35 |
| | | | | | 64.210.716 | 3,35 |
| Einzelhandel | | | | | | |
| Cie Financiere Richemont SA RegS | 1.141.430 | 422.530 | 341.491 | 1.222.469 [^] | 68.311.568 | 3,56 |
| Swatch Group AG | 67.426 | 23.641 | 23.327 | 67.740 | 12.999.306 | 0,68 |
| | | | | | 81.310.874 | 4,24 |
| Elektronik | | | | | | |
| ABB Ltd RegS | 3.980.025 | 1.473.070 | 1.219.872 | 4.233.223 [^] | 79.965.582 | 4,17 |
| | | | | | 79.965.582 | 4,17 |
| Gesundheitspflegedienste | | | | | | |
| Lonza Group AG RegS | 162.837 | 60.274 | 48.707 | 174.404 [^] | 82.231.486 | 4,29 |
| | | | | | 82.231.486 | 4,29 |
| Gesundheitspflegeprodukte | | | | | | |
| Alcon Inc | 1.068.602 | 401.473 | 318.572 | 1.151.503 [^] | 71.255.006 | 3,71 |
| | | | | | 71.255.006 | 3,71 |
| Gewerbliche Dienstleistungen | | | | | | |
| Adecco Group AG RegS | 364.201 | 132.190 | 113.989 | 382.402 [^] | 17.445.179 | 0,91 |
| SGS SA RegS | 11.348 | 6.601 | 3.576 | 14.373 | 32.411.115 | 1,69 |
| | | | | | 49.856.294 | 2,60 |
| Nahrungsmittel | | | | | | |
| Nestle SA RegS | 3.593.350 | 1.144.423 | 1.610.129 | 3.127.644 | 324.837.106 | 16,93 |
| | | | | | 324.837.106 | 16,93 |
| Telekommunikation | | | | | | |
| Swisscom AG RegS | 55.556 | 20.688 | 16.739 | 59.505 [^] | 29.740.599 | 1,55 |
| | | | | | 29.740.599 | 1,55 |
| Versicherungen | | | | | | |
| Swiss Life Holding AG RegS | 74.829 | 26.457 | 26.567 | 74.719 | 25.210.191 | 1,32 |
| Swiss Re AG | 666.316 | 239.777 | 216.060 | 690.033 | 44.934.949 | 2,34 |
| Zurich Insurance Group AG | 330.952 | 121.030 | 101.602 | 350.380 | 108.442.610 | 5,65 |
| | | | | | 178.587.750 | 9,31 |
| Total Aktien | | | | | 1.887.310.082 | 98,38 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 1.887.310.082 | 98,38 |
| Total Effekten | | | | | 1.887.310.082 | 98,38 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SMI® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|---|--|--------------------|-----------------------|--|----------------------|--|
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| Futures auf Indizes | | | | | | |
| Swiss Market Index Future Juni 2019 | 241 | - | 241 | - | - | 0,00 |
| Swiss Market Index Future September 2019 | - | 233 | 233 | - | - | 0,00 |
| Swiss Market Index Future Dezember 2019 | - | 242 | 242 | - | - | 0,00 |
| Swiss Market Index Future März 2020 | - | 69 | 69 | - | - | 0,00 |
| Swiss Market Index Future Juni 2020 | - | 348 | 38 | 310 | 2.651.587 | 0,14 |
| | | | | | 2.651.587 | 0,14 |
| Total derivative Finanzinstrumente | | | | | 2.651.587 | 0,14 |
| Total Anlagen | | | | | 1.889.961.669 | 98,52 |
| Sichtguthaben | | | | | 8.257.166 | 0,43 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 20.157.240 | 1,05 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 1.918.376.075 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (528.330) | (0,03) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 1.917.847.745 | 99,97 |

¹ Inklusive der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

[^] Diese Effekten wurden teilweise oder insgesamt im Rahmen einer Wertpapierleihe übertragen.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SMIM® ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | |
| Aktien | | | | | | |
| Arzneimittel | | | | | | |
| Vifor Pharma AG | 274.147 | 22.764 | 60.567 | 236.344 ^A | 34.529.858 | 3,14 |
| | | | | | 34.529.858 | 3,14 |
| Autoteile und -zubehör | | | | | | |
| Georg Fischer AG RegS | 29.250 | 2.435 | 6.255 | 25.430 | 20.216.850 | 1,84 |
| | | | | | 20.216.850 | 1,84 |
| Bau- und Ingenieurwesen | | | | | | |
| Flughafen Zurich AG RegS | 134.900 | 11.312 | 28.911 | 117.301 ^A | 15.507.192 | 1,41 |
| | | | | | 15.507.192 | 1,41 |
| Biotechnologie | | | | | | |
| BB Biotech AG RegS | 395.050 | 33.112 | 84.625 | 343.537 ^A | 23.274.632 | 2,12 |
| | | | | | 23.274.632 | 2,12 |
| Chemie | | | | | | |
| Clariant AG RegS | 1.759.537 | 163.064 | 378.539 | 1.544.062 ^A | 27.198.652 | 2,47 |
| EMS-Chemie Holding AG RegS | 50.523 | 4.209 | 10.795 | 43.937 ^A | 31.217.239 | 2,84 |
| OC Oerlikon Corp AG RegS | 1.420.654 | 120.209 | 305.567 | 1.235.296 | 9.641.485 | 0,88 |
| | | | | | 68.057.376 | 6,19 |
| Computer | | | | | | |
| Logitech International SA RegS | 1.234.590 | 102.791 | 265.326 | 1.072.055 ^A | 60.764.077 | 5,53 |
| | | | | | 60.764.077 | 5,53 |
| Diversifizierte Finanzdienstleistungen | | | | | | |
| GAM Holding AG | 1.136.556 | 59.081 | 1.195.637 | - | - | 0,00 |
| Julius Baer Group Ltd | 1.596.295 | 132.698 | 343.193 | 1.385.800 ^A | 56.679.220 | 5,16 |
| | | | | | 56.679.220 | 5,16 |
| Einzelhandel | | | | | | |
| Dufry AG RegS | 249.532 | 23.788 | 69.991 | 203.329 ^A | 5.760.311 | 0,52 |
| Swatch Group AG RegS | 450.309 | 35.826 | 138.758 | 347.377 ^A | 12.971.057 | 1,18 |
| | | | | | 18.731.368 | 1,70 |
| Elektronik | | | | | | |
| dormakaba Holding AG | 21.791 | 1.838 | 4.681 | 18.948 ^A | 10.241.394 | 0,93 |
| | | | | | 10.241.394 | 0,93 |
| Gesundheitspflegeprodukte | | | | | | |
| Sonova Holding AG RegS | 392.070 | 32.354 | 89.667 | 334.757 ^A | 70.466.348 | 6,41 |
| Straumann Holding AG RegS | 80.225 | 6.662 | 17.247 | 69.640 | 54.179.920 | 4,93 |
| | | | | | 124.646.268 | 11,34 |
| Halbleiter | | | | | | |
| ams AG | 569.424 | 1.190.742 | 150.800 | 1.609.366 ^A | 23.255.339 | 2,12 |
| ams AG Rights | - | 518.019 | 518.019 | - | - | 0,00 |
| | | | | | 23.255.339 | 2,12 |
| Immobilien | | | | | | |
| PSP Swiss Property AG RegS | 287.153 | 40.058 | 60.736 | 266.475 | 29.072.423 | 2,65 |
| Swiss Prime Site AG RegS | 541.639 | 45.091 | 116.499 | 470.231 ^A | 42.038.651 | 3,82 |
| | | | | | 71.111.074 | 6,47 |
| Maschinenbau | | | | | | |
| Bucher Industries AG RegS | - | 47.252 | 6.074 | 41.178 ^A | 11.381.599 | 1,04 |
| | | | | | 11.381.599 | 1,04 |
| Metallerzeugnisse | | | | | | |
| VAT Group AG | 191.794 | 16.101 | 41.090 | 166.805 ^A | 28.890.626 | 2,63 |
| | | | | | 28.890.626 | 2,63 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SMIM® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|----------------------|--|
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | |
| Nahrungsmittel | | | | | | |
| Barry Callebaut AG RegS | 15.484 | 9.976 | 6.812 | 18.648 [^] | 36.027.936 | 3,28 |
| Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG | 7.669 | 681 | 1.667 | 6.683 | 53.530.830 | 4,87 |
| Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG RegS | 774 | 63 | 166 | 671 [^] | 55.961.400 | 5,09 |
| | | | | | 145.520.166 | 13,24 |
| Private Equity | | | | | | |
| Partners Group Holding AG | 161.824 | 13.422 | 34.711 | 140.535 [^] | 111.641.004 | 10,16 |
| | | | | | 111.641.004 | 10,16 |
| Software | | | | | | |
| Temenos AG RegS | 452.692 | 49.464 | 94.313 | 407.843 [^] | 59.830.568 | 5,45 |
| | | | | | 59.830.568 | 5,45 |
| Telekommunikation | | | | | | |
| Sunrise Communications Group AG | 242.525 | 18.834 | 68.314 | 193.045 [^] | 15.588.384 | 1,42 |
| | | | | | 15.588.384 | 1,42 |
| Transport | | | | | | |
| Kuehne + Nagel International AG RegS | 400.115 | 33.271 | 86.059 | 347.327 | 48.070.057 | 4,37 |
| | | | | | 48.070.057 | 4,37 |
| Versicherungen | | | | | | |
| Baloise Holding AG RegS | 348.056 | 28.382 | 89.574 | 286.864 [^] | 39.185.622 | 3,57 |
| Helvetia Holding AG RegS | 233.719 | 19.546 | 50.040 | 203.225 | 17.304.609 | 1,57 |
| | | | | | 56.490.231 | 5,14 |
| Werkzeuge und Zubehör | | | | | | |
| Schindler Holding AG | 290.407 | 24.144 | 62.408 | 252.143 | 56.253.104 | 5,12 |
| Schindler Holding AG RegS | 138.429 | 11.576 | 29.362 | 120.643 [^] | 26.831.003 | 2,44 |
| | | | | | 83.084.107 | 7,56 |
| Total Aktien | | | | | 1.087.511.390 | 98,96 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 1.087.511.390 | 98,96 |
| Total Effekten | | | | | 1.087.511.390 | 98,96 |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| Futures auf Indizes | | | | | | |
| Swiss Mid Cap Future Juni 2019 | 571 | - | 571 | - | - | 0,00 |
| Swiss Mid Cap Future September 2019 | - | 499 | 499 | - | - | 0,00 |
| Swiss Mid Cap Future Dezember 2019 | - | 407 | 407 | - | - | 0,00 |
| Swiss Mid Cap Future März 2020 | - | 104 | 104 | - | - | 0,00 |
| Swiss Mid Cap Future Juni 2020 | - | 588 | 158 | 430 | 945.442 | 0,09 |
| | | | | | 945.442 | 0,09 |
| Total derivative Finanzinstrumente | | | | | 945.442 | 0,09 |
| Total Anlagen | | | | | 1.088.456.832 | 99,05 |
| Sichtguthaben | | | | | 3.368.788 | 0,31 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 7.051.447 | 0,64 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 1.098.877.067 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (374.549) | (0,03) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 1.098.502.518 | 99,97 |

¹ Inklusive der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

[^] Diese Effekten wurden teilweise oder insgesamt im Rahmen einer Wertpapierleihe übertragen.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SWISS DIVIDEND ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | |
| Aktien | | | | | | |
| Arzneimittel | | | | | | |
| Novartis AG RegS | 760.431 | 658.668 | 79.778 | 1.339.321 ^A | 111.203.823 | 15,31 |
| Roche Holding AG | 253.066 | 180.558 | 92.219 | 341.405 | 113.585.443 | 15,64 |
| | | | | | 224.789.266 | 30,95 |
| Automobilhersteller | | | | | | |
| Autoneum Holding AG | 7.083 | 4.333 | 11.416 | - | - | 0,00 |
| | | | | | - | 0,00 |
| Autoteile und -zubehör | | | | | | |
| Georg Fischer AG RegS | - | 10.306 | 259 | 10.047 | 7.987.365 | 1,10 |
| | | | | | 7.987.365 | 1,10 |
| Banken | | | | | | |
| Cembra Money Bank AG | 64.558 | 49.438 | 30.388 | 83.608 | 7.938.580 | 1,09 |
| | | | | | 7.938.580 | 1,09 |
| Baumaterialien | | | | | | |
| Geberit AG RegS | 59.661 | 35.355 | 95.016 | - | - | 0,00 |
| LafargeHolcim Ltd RegS | - | 1.870.210 | 50.185 | 1.820.025 | 72.327.793 | 9,96 |
| | | | | | 72.327.793 | 9,96 |
| Biotechnologie | | | | | | |
| BB Biotech AG RegS | - | 236.167 | 6.898 | 229.269 | 15.532.975 | 2,14 |
| | | | | | 15.532.975 | 2,14 |
| Chemie | | | | | | |
| OC Oerlikon Corp AG RegS | 322.760 | 192.859 | 515.619 | - | - | 0,00 |
| | | | | | - | 0,00 |
| Diversifizierte Finanzdienstleistungen | | | | | | |
| Vontobel Holding AG RegS | 64.848 | 42.947 | 32.987 | 74.808 ^A | 4.372.528 | 0,60 |
| | | | | | 4.372.528 | 0,60 |
| Einzelhandel | | | | | | |
| Cie Financiere Richemont SA RegS | - | 1.316.436 | 35.312 | 1.281.124 | 71.589.209 | 9,85 |
| Swatch Group AG RegS | 102.395 | 94.786 | 22.451 | 174.730 ^A | 6.524.418 | 0,90 |
| | | | | | 78.113.627 | 10,75 |
| Elektro | | | | | | |
| BKW AG | 32.673 | 19.508 | 52.181 | - | - | 0,00 |
| | | | | | - | 0,00 |
| Elektronik | | | | | | |
| ABB Ltd RegS | 3.598.963 | 2.017.319 | 5.616.282 | - | - | 0,00 |
| | | | | | - | 0,00 |
| Gewerbliche Dienstleistungen | | | | | | |
| Adecco Group AG RegS | 495.466 | 313.360 | 170.414 | 638.412 ^A | 29.124.355 | 4,01 |
| SGS SA RegS | 9.436 | 7.707 | 1.134 | 16.009 | 36.100.295 | 4,97 |
| | | | | | 65.224.650 | 8,98 |
| Maschinenbau | | | | | | |
| Inficon Holding AG RegS | 4.164 | 2.768 | 2.311 | 4.621 | 3.294.773 | 0,45 |
| Kardex AG RegS | 9.907 | 5.981 | 15.888 | - | - | 0,00 |
| Komax Holding AG RegS | - | 12.167 | 331 | 11.836 ^A | 1.782.502 | 0,25 |
| | | | | | 5.077.275 | 0,70 |
| Private Equity | | | | | | |
| Partners Group Holding AG | 36.837 | 21.831 | 58.668 | - | - | 0,00 |
| | | | | | - | 0,00 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SWISS DIVIDEND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | |
| Telekommunikation | | | | | | |
| Swisscom AG RegS | 74.636 | 48.940 | 36.230 | 87.346 ^A | 43.655.531 | 6,01 |
| | | | | | 43.655.531 | 6,01 |
| Transport | | | | | | |
| Kuehne + Nagel International AG RegS | - | 197.552 | 5.588 | 191.964 | 26.567.817 | 3,66 |
| | | | | | 26.567.817 | 3,66 |
| Versicherungen | | | | | | |
| Baloise Holding AG RegS | 103.452 | 66.433 | 25.691 | 144.194 | 19.696.900 | 2,71 |
| Swiss Life Holding AG RegS | - | 99.009 | 2.727 | 96.282 | 32.485.547 | 4,47 |
| Zurich Insurance Group AG | 210.656 | 158.867 | 42.932 | 326.591 | 101.079.915 | 13,92 |
| | | | | | 153.262.362 | 21,10 |
| Vertrieb und Grosshandel | | | | | | |
| Bossard Holding AG RegS | 8.854 | 7.389 | 1.104 | 15.139 ^A | 2.010.459 | 0,28 |
| | | | | | 2.010.459 | 0,28 |
| Werbung | | | | | | |
| DKSH Holding AG | 62.236 | 43.490 | 7.317 | 98.409 | 5.205.836 | 0,72 |
| | | | | | 5.205.836 | 0,72 |
| Total Aktien | | | | | 712.066.064 | 98,04 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 712.066.064 | 98,04 |
| Total Effekten | | | | | 712.066.064 | 98,04 |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| Futures auf Indizes | | | | | | |
| SLI Future Juni 2019 | 470 | - | 470 | - | - | 0,00 |
| SLI Future September 2019 | - | 470 | 470 | - | - | 0,00 |
| SLI Future Dezember 2019 | - | 436 | 436 | - | - | 0,00 |
| SLI Future März 2020 | - | 82 | 82 | - | - | 0,00 |
| SLI Future Juni 2020 | - | 1.501 | 544 | 957 | 793.215 | 0,11 |
| | | | | | 793.215 | 0,11 |
| Total derivative Finanzinstrumente | | | | | 793.215 | 0,11 |
| Total Anlagen | | | | | 712.859.279 | 98,15 |
| Sichtguthaben | | | | | 5.745.254 | 0,79 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 7.724.721 | 1,06 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 726.329.254 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (84.421) | (0,01) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 726.244.833 | 99,99 |

¹ Inklusive der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

^A Diese Effekten wurden teilweise oder insgesamt im Rahmen einer Wertpapierleihe übertragen.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE SPI® ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|---------------------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | | |
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | |
| Alternative Energiequellen | | | | | | | |
| Landis+Gyr Group AG | 22.041 | 6.669 | 4.569 | 24.141 ^A | 1.525.711 | 0,10 | |
| Meyer Burger Technology AG | 623.311 | 251.439 | 126.237 | 748.513 ^A | 130.616 | 0,01 | |
| | | | | | 1.656.327 | 0,11 | |
| Arzneimittel | | | | | | | |
| Cassiopea SpA | 4.786 | 1.284 | 906 | 5.164 ^A | 177.125 | 0,01 | |
| COSMO Pharmaceuticals NV | 6.422 | 2.723 | 3.012 | 6.133 | 491.867 | 0,03 | |
| Galenica AG | 50.006 | 15.030 | 10.058 | 54.978 | 3.903.438 | 0,25 | |
| IVF Hartmann Holding AG RegS | 820 | 197 | 151 | 866 | 129.900 | 0,01 | |
| Novartis AG RegS | 2.548.254 | 637.298 | 566.471 | 2.619.081 ^A | 217.462.295 | 13,97 | |
| ObsEva SA | 27.431 | 11.012 | 5.566 | 32.877 ^A | 124.604 | 0,01 | |
| Roche Holding AG | 701.910 | 197.343 | 132.806 | 766.447 | 254.996.917 | 16,39 | |
| Siegfried Holding AG RegS | 4.253 | 1.206 | 746 | 4.713 ^A | 1.879.544 | 0,12 | |
| Vifor Pharma AG | 38.412 | 10.488 | 7.185 | 41.715 ^A | 6.094.562 | 0,39 | |
| Ypsomed Holding AG RegS | 4.078 | 1.158 | 753 | 4.483 ^A | 630.310 | 0,04 | |
| | | | | | 485.890.562 | 31,22 | |
| Automobilhersteller | | | | | | | |
| Autoneum Holding AG | 2.869 | 813 | 538 | 3.144 ^A | 292.864 | 0,02 | |
| PIERER Mobility AG | 8.347 | 2.373 | 1.576 | 9.144 | 384.048 | 0,02 | |
| | | | | | 676.912 | 0,04 | |
| Autoteile und -zubehör | | | | | | | |
| Adval Tech Holding AG RegS | 293 | 76 | 61 | 308 ^A | 46.200 | 0,00 | |
| Georg Fischer AG RegS | 4.106 | 1.189 | 821 | 4.474 ^A | 3.556.830 | 0,23 | |
| | | | | | 3.603.030 | 0,23 | |
| Banken | | | | | | | |
| Bank Linth RegS | 211 | 38 | 34 | 215 | 108.575 | 0,01 | |
| Banque Cantonale de Geneve | 1.998 | 548 | 382 | 2.164 | 393.848 | 0,02 | |
| Banque Cantonale du Jura SA RegS | 814 | 211 | 140 | 885 | 48.233 | 0,00 | |
| Banque Cantonale Vaudoise RegS | 2.846 | 842 | 3.688 | - | - | 0,00 | |
| Banque Cantonale Vaudoise RegS | - | 31.260 | - | 31.260 | 2.919.684 | 0,19 | |
| Banque Profil de Gestion SA | 4.526 | - | 4.526 | - | - | 0,00 | |
| Basellandschaftliche Kantonalbank | 572 | 159 | 104 | 627 | 550.506 | 0,03 | |
| Basler Kantonalbank | 5.905 | 1.670 | 1.103 | 6.472 ^A | 467.278 | 0,03 | |
| Berner Kantonalbank AG RegS | 4.517 | 1.259 | 805 | 4.971 ^A | 1.120.960 | 0,07 | |
| Cembra Money Bank AG | 28.209 | 10.638 | 6.066 | 32.781 ^A | 3.112.556 | 0,20 | |
| Credit Suisse Group AG RegS | 2.420.672 | 671.546 | 589.126 | 2.503.092 | 21.947.111 | 1,41 | |
| Glarner Kantonalbank | 3.695 | 934 | 686 | 3.943 | 114.347 | 0,01 | |
| Graubuendner Kantonalbank | 749 | 203 | 130 | 822 | 1.233.000 | 0,08 | |
| Hypothekbank Lenzburg AG RegS | 72 | 1 | 1 | 72 | 306.720 | 0,02 | |
| Liechtensteinische Landesbank AG | 11.244 | 3.216 | 2.049 | 12.411 | 739.696 | 0,05 | |
| Luzerner Kantonalbank AG RegS | 3.270 | 878 | 564 | 3.584 ^A | 1.447.936 | 0,09 | |
| Schweizerische Nationalbank RegS | 81 | 41 | 26 | 96 | 444.480 | 0,03 | |
| St Galler Kantonalbank AG RegS | 2.936 | 795 | 511 | 3.220 ^A | 1.373.330 | 0,09 | |
| Thurgauer Kantonalbank | 4.044 | 1.105 | 763 | 4.386 | 471.495 | 0,03 | |
| UBS Group AG RegS | 3.854.142 | 960.323 | 929.750 | 3.884.715 | 40.012.564 | 2,57 | |
| Valiant Holding AG RegS | 15.779 | 4.314 | 2.756 | 17.337 | 1.487.515 | 0,10 | |
| VP Bank AG RegS | 3.042 | 840 | 571 | 3.311 | 431.092 | 0,03 | |
| Walliser Kantonalbank RegS | 4.731 | 1.346 | 872 | 5.205 ^A | 575.152 | 0,04 | |
| Zuger Kantonalbank AG | 144 | 14 | 158 | - ^A | - | 0,00 | |
| Zuger Kantonalbank AG | - | 173 | 15 | 158 | 976.440 | 0,06 | |
| | | | | | 80.282.518 | 5,16 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE SPI® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | |
| Bau- und Ingenieurwesen | | | | | | |
| Burkhalter Holding AG | 4.705 | 1.273 | 909 | 5.069 ^A | 340.130 | 0,02 |
| Flughafen Zurich AG RegS | 18.941 | 5.557 | 3.949 | 20.549 ^A | 2.716.577 | 0,17 |
| Implenia AG RegS | 14.502 | 3.940 | 4.573 | 13.869 ^A | 543.665 | 0,04 |
| | | | | | 3.600.372 | 0,23 |
| Baumaterialien | | | | | | |
| Arbonia AG | 45.681 | 25.632 | 10.069 | 61.244 ^A | 529.760 | 0,04 |
| Belimo Holding AG RegS | 498 | 137 | 91 | 544 ^A | 3.933.120 | 0,25 |
| Forbo Holding AG RegS | 1.003 | 608 | 323 | 1.288 | 1.767.136 | 0,12 |
| Geberit AG RegS | 37.008 | 10.421 | 7.009 | 40.420 ^A | 18.888.266 | 1,21 |
| LafargeHolcim Ltd RegS | 480.060 | 167.608 | 94.436 | 553.232 | 21.985.440 | 1,41 |
| Meier Tobler Group AG | 3.285 | 822 | 587 | 3.520 ^A | 36.608 | 0,00 |
| Meier Tobler Group AG Rights | - | 3.520 | - | 3.520 | 5.280 | 0,00 |
| Sika AG RegS | 126.428 | 35.609 | 23.957 | 138.080 ^A | 22.714.160 | 1,46 |
| | | | | | 69.859.770 | 4,49 |
| Bekleidung | | | | | | |
| Calida Holding AG RegS | 5.529 | 1.388 | 1.052 | 5.865 ^A | 164.220 | 0,01 |
| | | | | | 164.220 | 0,01 |
| Biotechnologie | | | | | | |
| Addex Therapeutics Ltd | 26.871 | 6.655 | 5.102 | 28.424 | 37.520 | 0,00 |
| Bachem Holding AG RegS «B» | 4.966 | 1.422 | 843 | 5.545 ^A | 1.355.752 | 0,09 |
| Basilea Pharmaceutica AG RegS | 10.883 | 3.068 | 2.011 | 11.940 ^A | 580.284 | 0,04 |
| BB Biotech AG RegS | 55.469 | 16.228 | 10.427 | 61.270 ^A | 4.151.042 | 0,27 |
| Evolva Holding SA | 780.580 | 232.957 | 146.353 | 867.184 ^A | 196.851 | 0,01 |
| Idorsia Ltd | 74.207 | 20.341 | 12.969 | 81.579 ^A | 2.383.738 | 0,15 |
| Kuros Biosciences AG RegS | 9.989 | 2.657 | 1.808 | 10.838 ^A | 22.868 | 0,00 |
| Kuros Biosciences AG RegS Rights | - | 10.064 | 10.064 | - | - | 0,00 |
| Molecular Partners AG | 16.121 | 4.459 | 3.032 | 17.548 ^A | 379.037 | 0,02 |
| Newron Pharmaceuticals SpA | 16.385 | 4.086 | 3.050 | 17.421 ^A | 32.403 | 0,00 |
| Polyphor AG | 9.293 | 2.233 | 1.976 | 9.550 ^A | 78.215 | 0,01 |
| Relief Therapeutics Holding AG | - | 735.701 | 93.647 | 642.054 ^A | 13.868 | 0,00 |
| Santhera Pharmaceuticals Holding AG RegS | 8.719 | 3.098 | 1.681 | 10.136 ^A | 91.731 | 0,01 |
| | | | | | 9.323.309 | 0,60 |
| Chemie | | | | | | |
| Clariant AG RegS | 246.557 | 73.366 | 47.742 | 272.181 ^A | 4.794.469 | 0,31 |
| CPH Chemie & Papier Holding AG RegS | 2.602 | 709 | 499 | 2.812 | 210.900 | 0,01 |
| EMS-Chemie Holding AG RegS | 7.096 | 2.020 | 1.330 | 7.786 ^A | 5.531.953 | 0,36 |
| Givaudan SA RegS | 7.946 | 2.233 | 1.502 | 8.677 | 29.909.619 | 1,92 |
| OC Oerlikon Corp AG RegS | 199.322 | 60.423 | 39.003 | 220.742 ^A | 1.722.891 | 0,11 |
| | | | | | 42.169.832 | 2,71 |
| Computer | | | | | | |
| Crealogix Holding AG RegS | 621 | 155 | 104 | 672 ^A | 62.765 | 0,00 |
| Crealogix Holding AG RegS Rights | - | 616 | 616 | - | - | 0,00 |
| Logitech International SA RegS | 173.209 | 48.633 | 32.945 | 188.897 ^A | 10.706.682 | 0,69 |
| Softwareone Holding AG | - | 51.812 | 6.367 | 45.445 | 965.706 | 0,06 |
| | | | | | 11.735.153 | 0,75 |
| Diverse Produzenten | | | | | | |
| Daetwyler Holding AG | 7.779 | 2.121 | 1.367 | 8.533 ^A | 1.515.461 | 0,10 |
| Gurit Holding AG | 355 | 81 | 53 | 383 ^A | 556.116 | 0,04 |
| Stadler Rail AG | 38.146 | 18.137 | 8.491 | 47.792 ^A | 1.942.267 | 0,12 |
| Sulzer AG RegS | 17.515 | 4.806 | 3.073 | 19.248 ^A | 1.463.810 | 0,09 |
| | | | | | 5.477.654 | 0,35 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE SPI® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | |
| Diversifizierte Finanzdienstleistungen | | | | | | |
| Bellevue Group AG | 7.790 | 1.551 | 857 | 8.484 | 197.677 | 0,01 |
| Cie Financiere Tradition SA | 2.523 | 799 | 481 | 2.841 | 311.090 | 0,02 |
| EFG International AG | 81.073 | 26.786 | 15.473 | 92.386 [^] | 581.108 | 0,04 |
| GAM Holding AG | 159.757 | 45.047 | 29.798 | 175.006 [^] | 416.864 | 0,03 |
| Julius Baer Group Ltd | 223.625 | 63.179 | 42.504 | 244.300 [^] | 9.991.870 | 0,64 |
| Leonteq AG | 9.723 | 2.626 | 1.915 | 10.434 [^] | 358.930 | 0,02 |
| LumX Group Ltd | - | 87.539 | 11.142 | 76.397 | 1.184 | 0,00 |
| Swissquote Group Holding SA RegS | 10.703 | 3.000 | 1.969 | 11.734 [^] | 750.976 | 0,05 |
| Valartis Group AG | 2.512 | 626 | 455 | 2.683 | 24.550 | 0,00 |
| Vontobel Holding AG RegS | 27.983 | 7.645 | 4.905 | 30.723 [^] | 1.795.759 | 0,12 |
| VZ Holding AG | 3.128 | 693 | 3.821 | - [^] | - | 0,00 |
| VZ Holding AG | - | 17.241 | - | 17.241 [^] | 1.231.007 | 0,08 |
| | | | | | 15.661.015 | 1,01 |
| Einzelhandel | | | | | | |
| Cie Financiere Richemont SA RegS | 521.527 | 146.782 | 98.852 | 569.457 | 31.821.257 | 2,04 |
| Dufry AG RegS | 35.037 | 10.226 | 8.405 | 36.858 | 1.044.187 | 0,07 |
| Mobilezone Holding AG RegS | 40.813 | 17.690 | 11.918 | 46.585 [^] | 380.134 | 0,03 |
| Swatch Group AG | 30.814 | 7.771 | 6.869 | 31.716 [^] | 6.086.300 | 0,39 |
| Swatch Group AG RegS | 63.224 | 15.942 | 17.667 | 61.499 | 2.296.373 | 0,15 |
| Valora Holding AG RegS | 3.140 | 900 | 569 | 3.471 [^] | 680.316 | 0,04 |
| Zur Rose Group AG | 7.412 | 3.587 | 1.408 | 9.591 [^] | 1.851.063 | 0,12 |
| | | | | | 44.159.630 | 2,84 |
| Eisen und Stahl | | | | | | |
| Schmolz + Bickenbach AG RegS | 473.766 | 117.752 | 89.059 | 502.459 [^] | 85.820 | 0,00 |
| Schmolz + Bickenbach AG RegS Rights | - | 466.736 | 466.736 | - | - | 0,00 |
| | | | | | 85.820 | 0,00 |
| Elektrische Bestandteile und Ausrüstung | | | | | | |
| Huber + Suhner AG RegS | 13.712 | 6.323 | 2.746 | 17.289 [^] | 1.141.074 | 0,08 |
| Leclanche SA RegS | 45.917 | 37.983 | 12.029 | 71.871 | 39.385 | 0,00 |
| | | | | | 1.180.459 | 0,08 |
| Elektro | | | | | | |
| BKW AG | 19.764 | 5.406 | 3.475 | 21.695 | 1.661.837 | 0,11 |
| Edisun Power Europe AG | - | 216 | 23 | 193 [^] | 20.072 | 0,00 |
| Edisun Power Europe AG Rights | - | 181 | 181 | - | - | 0,00 |
| Romande Energie Holding SA RegS | 345 | 81 | 52 | 374 | 390.830 | 0,02 |
| | | | | | 2.072.739 | 0,13 |
| Elektronik | | | | | | |
| ABB Ltd RegS | 1.818.514 | 510.832 | 357.067 | 1.972.279 [^] | 37.256.350 | 2,39 |
| Cicor Technologies Ltd RegS | 2.053 | 516 | 358 | 2.211 | 81.365 | 0,01 |
| dormakaba Holding AG | 3.060 | 911 | 593 | 3.378 [^] | 1.825.809 | 0,12 |
| LEM Holding SA RegS | 572 | 159 | 104 | 627 | 846.450 | 0,05 |
| Phoenix Mecano AG | 630 | 161 | 105 | 686 [^] | 256.221 | 0,02 |
| Schaffner Holding AG RegS | 516 | 114 | 86 | 544 [^] | 106.080 | 0,01 |
| Von Roll Holding AG | 232.266 | 63.849 | 42.983 | 253.132 [^] | 188.837 | 0,01 |
| | | | | | 40.561.112 | 2,61 |
| Fluggesellschaften | | | | | | |
| Perfect Holding SA | 78.417 | 25.041 | 14.751 | 88.707 | 2.617 | 0,00 |
| | | | | | 2.617 | 0,00 |
| Forstwirtschaft, Holz und Papier | | | | | | |
| Cham Group AG | 442 | 33 | 475 | - | - | 0,00 |
| | | | | | - | 0,00 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE SPI® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | |
| Freizeit | | | | | | |
| Bergbahnen Engelberg-Truebsee-Titlis AG BET RegS | 610 | 120 | 730 | - | - | 0,00 |
| Bergbahnen Engelberg-Truebsee-Titlis AG BET RegS | - | 3.366 | 110 | 3.256 | 184.290 | 0,01 |
| | | | | | 184.290 | 0,01 |
| Gesundheitspflegedienste | | | | | | |
| Lonza Group AG RegS | 74.402 | 20.940 | 14.091 | 81.251 | 38.309.846 | 2,46 |
| | | | | | 38.309.846 | 2,46 |
| Gesundheitspflegeprodukte | | | | | | |
| Alcon Inc | 488.261 | 140.546 | 92.279 | 536.528 [^] | 33.200.353 | 2,13 |
| Coltene Holding AG RegS | 3.023 | 2.448 | 771 | 4.700 [^] | 374.120 | 0,03 |
| Comet Holding AG RegS | 7.762 | 2.177 | 1.409 | 8.530 [^] | 1.003.128 | 0,07 |
| Medacta Group SA | 5.656 | 1.649 | 1.066 | 6.239 [^] | 509.726 | 0,03 |
| Medartis Holding AG | 4.537 | 1.196 | 845 | 4.888 | 189.654 | 0,01 |
| Sonova Holding AG RegS | 54.922 | 15.327 | 11.233 | 59.016 [^] | 12.422.868 | 0,80 |
| Straumann Holding AG RegS | 11.237 | 3.162 | 2.125 | 12.274 [^] | 9.549.172 | 0,61 |
| Tecan Group AG RegS | 11.771 | 3.623 | 2.351 | 13.043 | 4.377.231 | 0,28 |
| | | | | | 61.626.252 | 3,96 |
| Gewerbliche Dienstleistungen | | | | | | |
| Adecco Group AG RegS | 166.439 | 43.366 | 31.787 | 178.018 | 8.121.181 | 0,52 |
| MCH Group AG | 3.553 | 898 | 651 | 3.800 | 59.660 | 0,00 |
| Orell Fuessli Holding AG RegS | 802 | 206 | 140 | 868 | 75.516 | 0,01 |
| Poenina Holding AG | 1.780 | 430 | 323 | 1.887 [^] | 87.934 | 0,01 |
| SGS SA RegS | 5.185 | 2.516 | 989 | 6.712 | 15.135.560 | 0,97 |
| | | | | | 23.479.851 | 1,51 |
| Halbleiter | | | | | | |
| ams AG | 79.873 | 230.875 | 25.384 | 285.364 [^] | 4.123.510 | 0,27 |
| ams AG Rights | - | 84.516 | 84.516 | - | - | 0,00 |
| Sensirion Holding AG | 7.442 | 4.607 | 1.722 | 10.327 [^] | 386.746 | 0,02 |
| u-blox Holding AG | 6.485 | 2.442 | 1.532 | 7.395 [^] | 474.019 | 0,03 |
| | | | | | 4.984.275 | 0,32 |
| Holdingsgesellschaften, Konglomerate | | | | | | |
| Metall Zug AG RegS | 196 | 41 | 26 | 211 [^] | 434.660 | 0,03 |
| | | | | | 434.660 | 0,03 |
| Immobilien | | | | | | |
| Allreal Holding AG RegS | 14.241 | 4.147 | 2.723 | 15.665 | 2.916.823 | 0,19 |
| BFW Liegenschaften AG | 3.076 | 534 | 2.241 | 1.369 [^] | 59.141 | 0,00 |
| Fundamenta Real Estate AG | 25.166 | 6.947 | 4.660 | 27.453 [^] | 433.757 | 0,03 |
| Hiag Immobilien Holding AG | 2.833 | 800 | 531 | 3.102 | 288.486 | 0,02 |
| Intershop Holding AG | 1.314 | 286 | 401 | 1.199 [^] | 649.858 | 0,04 |
| Investis Holding SA | 2.817 | 743 | 509 | 3.051 | 259.945 | 0,02 |
| Mobimo Holding AG RegS | 6.594 | 1.780 | 1.141 | 7.233 [^] | 1.978.226 | 0,13 |
| Orascom Development Holding AG | 11.095 | 5.477 | 2.354 | 14.218 [^] | 134.644 | 0,01 |
| Peach Property Group AG | 4.418 | 1.130 | 797 | 4.751 | 165.810 | 0,01 |
| Plazza AG RegS | 1.266 | 592 | 243 | 1.615 | 442.510 | 0,03 |
| PSP Swiss Property AG RegS | 40.319 | 14.198 | 7.428 | 47.089 | 5.137.410 | 0,33 |
| SF Urban Properties AG | 2.761 | 754 | 530 | 2.985 [^] | 273.128 | 0,02 |
| Swiss Prime Site AG RegS | 75.887 | 21.463 | 14.555 | 82.795 | 7.401.873 | 0,47 |
| Varia US Properties AG | 4.567 | 1.138 | 842 | 4.863 [^] | 181.390 | 0,01 |
| Wartec Invest AG RegS | 136 | 90 | 43 | 183 | 371.490 | 0,02 |
| Wartec Invest AG RegS Rights | - | 136 | 136 | - | - | 0,00 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE SPI® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | |
| Zueblin Immobilien Holding AG RegS | 1.973 | 482 | 369 | 2.086 | 57.156 | 0,00 |
| Zug Estates Holding AG | 286 | 80 | 53 | 313 | 604.090 | 0,04 |
| | | | | | 21.355.737 | 1,37 |
| Immobilieninvestmentfonds | | | | | | |
| Private Equity Holding AG RegS | 2.429 | 612 | 448 | 2.593 | 122.390 | 0,01 |
| | | | | | 122.390 | 0,01 |
| Internet | | | | | | |
| Lastminute.com NV | 5.283 | 1.321 | 1.008 | 5.596 | 113.039 | 0,01 |
| WISeKey International Holding Ltd | 29.311 | 8.406 | 5.389 | 32.328 ^A | 28.643 | 0,00 |
| | | | | | 141.682 | 0,01 |
| Investmentgesellschaften | | | | | | |
| Aevis Victoria SA | 3.684 | - | 3.684 | - | - | 0,00 |
| AEVIS VICTORIA SA | - | 24.265 | 3.536 | 20.729 ^A | 248.748 | 0,02 |
| Arundel AG | 5.376 | - | 5.376 | - | - | 0,00 |
| Blackstone Resources AG | 10.727 | - | 10.727 | - | - | 0,00 |
| Novavest Real Estate AG | - | 7.796 | 681 | 7.115 ^A | 315.906 | 0,02 |
| Pargesa Holding SA | 37.941 | 11.357 | 7.701 | 41.597 | 3.015.782 | 0,19 |
| | | | | | 3.580.436 | 0,23 |
| Kosmetik und Körperpflege | | | | | | |
| Lalique Group SA | 1.676 | - | 15 | 1.661 | 55.810 | 0,00 |
| Lalique Group SA Rights | - | 1.661 | 1.661 | - | - | 0,00 |
| | | | | | 55.810 | 0,00 |
| Maschinenbau | | | | | | |
| Airopack Technology Group AG | 9.662 | - | 9.662 | - | - | 0,00 |
| Bobst Group SA RegS | 7.646 | 2.157 | 1.429 | 8.374 ^A | 484.017 | 0,03 |
| Bucher Industries AG RegS | 6.642 | 2.000 | 1.292 | 7.350 ^A | 2.031.540 | 0,13 |
| Burckhardt Compression Holding AG | 2.977 | 852 | 542 | 3.287 ^A | 648.196 | 0,04 |
| Carlo Gavazzi Holding AG | 403 | 114 | 88 | 429 | 78.722 | 0,00 |
| Conzzeta AG RegS | 1.466 | 403 | 260 | 1.609 ^A | 1.361.214 | 0,09 |
| Feintool International Holding AG RegS | 2.079 | 506 | 386 | 2.199 ^A | 104.123 | 0,01 |
| Inficon Holding AG RegS | 1.739 | 475 | 303 | 1.911 | 1.362.543 | 0,09 |
| Interroll Holding AG RegS | 662 | 161 | 105 | 718 ^A | 1.507.800 | 0,10 |
| Kardex AG RegS | 5.908 | 1.641 | 1.060 | 6.489 ^A | 1.071.983 | 0,07 |
| Klingelberg AG | 4.614 | 1.132 | 857 | 4.889 | 63.068 | 0,00 |
| Komax Holding AG RegS | 3.845 | 1.072 | 689 | 4.228 ^A | 636.737 | 0,04 |
| Perrot Duval Holding SA | - | 121 | 23 | 98 | 11.270 | 0,00 |
| Rieter Holding AG RegS | 3.276 | 891 | 624 | 3.543 ^A | 305.761 | 0,02 |
| SIG Combibloc Group AG | 131.871 | 179.350 | 34.287 | 276.934 ^A | 4.447.560 | 0,29 |
| Zehnder Group AG | 9.874 | 2.702 | 1.891 | 10.685 ^A | 396.413 | 0,02 |
| | | | | | 14.510.947 | 0,93 |
| Medien | | | | | | |
| TX Group AG | 3.276 | 905 | 601 | 3.580 ^A | 248.810 | 0,02 |
| | | | | | 248.810 | 0,02 |
| Metallerzeugnisse | | | | | | |
| SFS Group AG | 16.872 | 4.629 | 2.976 | 18.525 ^A | 1.606.118 | 0,10 |
| VAT Group AG | 26.915 | 7.892 | 5.240 | 29.567 ^A | 5.121.004 | 0,33 |
| | | | | | 6.727.122 | 0,43 |
| Nahrungsmittel | | | | | | |
| Aryzta AG | 992.310 | 279.449 | 182.501 | 1.089.258 ^A | 544.629 | 0,03 |
| Barry Callebaut AG RegS | 2.174 | 2.006 | 879 | 3.301 ^A | 6.377.532 | 0,41 |
| Bell Food Group AG RegS | 2.120 | 598 | 388 | 2.330 ^A | 535.900 | 0,03 |
| Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG | 1.074 | 295 | 192 | 1.177 | 9.427.770 | 0,61 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE SPI® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG RegS | 108 | 43 | 32 | 119 | 9.924.600 | 0,64 | |
| Emmi AG RegS | 1.997 | 530 | 338 | 2.189 ^A | 1.816.870 | 0,12 | |
| Groupe Minoteries SA RegS | 249 | 98 | 59 | 288 | 98.496 | 0,01 | |
| HOCHDORF Holding AG | 1.125 | 429 | 215 | 1.339 ^A | 83.822 | 0,01 | |
| Nestle SA RegS | 3.060.149 | 786.878 | 600.422 | 3.246.605 ^A | 337.192.395 | 21,66 | |
| Orior AG | 6.522 | 1.849 | 1.206 | 7.165 ^A | 530.210 | 0,03 | |
| | | | | | 366.532.224 | 23,55 | |
| Private Equity | | | | | | | |
| Airesis SA RegS | 33.385 | 8.353 | 6.072 | 35.666 ^A | 28.533 | 0,00 | |
| Partners Group Holding AG | 22.667 | 6.379 | 4.310 | 24.736 ^A | 19.650.278 | 1,26 | |
| Spice Private Equity AG | 2.008 | - | - | 2.008 ^A | 19.870 | 0,00 | |
| | | | | | 19.698.681 | 1,26 | |
| Software | | | | | | | |
| Kudelski SA | 39.831 | 10.770 | 7.350 | 43.251 ^A | 130.618 | 0,01 | |
| Temenos AG RegS | 63.415 | 19.785 | 11.418 | 71.782 ^A | 10.530.419 | 0,67 | |
| | | | | | 10.661.037 | 0,68 | |
| Telekommunikation | | | | | | | |
| Ascom Holding AG RegS | 36.019 | 10.134 | 6.754 | 39.399 ^A | 272.247 | 0,02 | |
| Sunrise Communications Group AG | 34.028 | 9.196 | 8.974 | 34.250 ^A | 2.765.687 | 0,18 | |
| Swisscom AG RegS | 25.386 | 7.154 | 4.743 | 27.797 ^A | 13.892.941 | 0,89 | |
| | | | | | 16.930.875 | 1,09 | |
| Transport | | | | | | | |
| BVZ Holding AG RegS | 114 | 38 | 38 | 114 ^A | 110.580 | 0,01 | |
| Jungfraubahn Holding AG RegS | 4.554 | 1.283 | 830 | 5.007 | 627.878 | 0,04 | |
| Kuehne + Nagel International AG RegS | 56.056 | 15.821 | 10.687 | 61.190 ^A | 8.468.696 | 0,54 | |
| Panalpina Welttransport Holding AG | - | 9.830 | 9.830 | - | - | 0,00 | |
| Panalpina Welttransport Holding AG RegS | 9.928 | 169 | 10.097 | - | - | 0,00 | |
| | | | | | 9.207.154 | 0,59 | |
| Verpackungen und Behälter | | | | | | | |
| Aluflexpack AG | - | 9.242 | 1.179 | 8.063 | 181.417 | 0,01 | |
| Vetropack Holding AG | 198 | 87 | 285 | - ^A | - | 0,00 | |
| Vetropack Holding AG | - | 13.716 | - | 13.716 | 822.960 | 0,05 | |
| | | | | | 1.004.377 | 0,06 | |
| Versicherungen | | | | | | | |
| Baloise Holding AG RegS | 48.760 | 13.366 | 11.325 | 50.801 ^A | 6.939.417 | 0,45 | |
| Helvetia Holding AG RegS | 32.828 | 9.424 | 6.571 | 35.681 ^A | 3.038.237 | 0,19 | |
| Swiss Life Holding AG RegS | 34.193 | 8.572 | 7.892 | 34.873 ^A | 11.766.150 | 0,76 | |
| Swiss Re AG | 304.449 | 78.130 | 61.027 | 321.552 | 20.939.466 | 1,34 | |
| Vaudoise Assurances Holding SA | 943 | 262 | 173 | 1.032 | 459.240 | 0,03 | |
| Zurich Insurance Group AG | 151.209 | 40.407 | 28.391 | 163.225 | 50.518.138 | 3,25 | |
| | | | | | 93.660.648 | 6,02 | |
| Vertrieb und Grosshandel | | | | | | | |
| ALSO Holding AG RegS | 6.256 | 1.713 | 1.114 | 6.855 ^A | 1.538.947 | 0,10 | |
| Bossard Holding AG RegS | 5.488 | 1.546 | 994 | 6.040 ^A | 802.112 | 0,05 | |
| | | | | | 2.341.059 | 0,15 | |
| Werbung | | | | | | | |
| APG SGA SA | 1.343 | 383 | 251 | 1.475 ^A | 268.450 | 0,02 | |
| DKSH Holding AG | 35.760 | 9.662 | 6.219 | 39.203 ^A | 2.073.839 | 0,13 | |
| | | | | | 2.342.289 | 0,15 | |
| Werkzeuge und Zubehör | | | | | | | |
| Mikron Holding AG RegS | 7.482 | 1.872 | 1.369 | 7.985 | 40.724 | 0,00 | |
| Schindler Holding AG | 40.683 | 11.500 | 7.726 | 44.457 | 9.918.357 | 0,64 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE SPI® ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|----------------------|--|
| Aktien (Fortsetzung) | | | | | | |
| Schindler Holding AG RegS | 19.439 | 5.576 | 3.674 | 21.341 [^] | 4.746.238 | 0,31 |
| Schlatter Industries AG | 450 | 114 | 103 | 461 | 12.908 | 0,00 |
| Schweiter Technologies AG | 982 | 260 | 164 | 1.078 [^] | 1.192.268 | 0,08 |
| Starrag Group Holding AG | 1.054 | 272 | 206 | 1.120 | 44.800 | 0,00 |
| Tornos Holding AG RegS | 8.150 | 2.036 | 1.488 | 8.698 [^] | 40.402 | 0,00 |
| | | | | | 15.995.697 | 1,03 |
| Total Aktien | | | | | 1.532.299.200 | 98,44 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 1.532.299.200 | 98,44 |
| Total Effekten | | | | | 1.532.299.200 | 98,44 |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| Futures auf Indizes | | | | | | |
| Swiss Market Index Future Juni 2019 | 201 | - | 201 | - | - | 0,00 |
| Swiss Market Index Future September 2019 | - | 173 | 173 | - | - | 0,00 |
| Swiss Market Index Future Dezember 2019 | - | 159 | 159 | - | - | 0,00 |
| Swiss Market Index Future März 2020 | - | 42 | 42 | - | - | 0,00 |
| Swiss Market Index Future Juni 2020 | - | 296 | 80 | 216 | 949.454 | 0,06 |
| | | | | | 949.454 | 0,06 |
| Total derivative Finanzinstrumente | | | | | 949.454 | 0,06 |
| Total Anlagen | | | | | 1.533.248.654 | 98,50 |
| Sichtguthaben | | | | | 7.081.220 | 0,46 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 16.208.815 | 1,04 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 1.556.538.689 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (2.327.554) | (0,15) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 1.554.211.135 | 99,85 |

¹ Inklusive der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

[^] Diese Effekten wurden teilweise oder insgesamt im Rahmen einer Wertpapierleihe übertragen.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SWISS DOMESTIC GOVERNMENT BOND 1-3 ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | |
| Obligationen | | | | | | |
| Schweiz | | | | | | |
| Swiss Confederation Government Bond 2% 28.04.2021 | 16.748.000 | 15.476.000 | 32.224.000 | - | - | 0,00 |
| Swiss Confederation Government Bond 2% 25.05.2022 | - | 37.903.000 | 10.634.000 | 27.269.000 | 28.744.253 | 42,85 |
| Swiss Confederation Government Bond 2,25% 06.07.2020 | 18.444.000 | - | 18.444.000 | - | - | 0,00 |
| Swiss Confederation Government Bond 4% 11.02.2023 | - | 34.040.000 | 888.000 | 33.152.000 | 37.383.853 | 55,73 |
| | | | | | 66.128.106 | 98,58 |
| Total Obligationen | | | | | 66.128.106 | 98,58 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 66.128.106 | 98,58 |
| Total Effekten | | | | | 66.128.106 | 98,58 |
| Total Anlagen | | | | | 66.128.106 | 98,58 |
| Sichtguthaben | | | | | 47.817 | 0,07 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 906.575 | 1,35 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 67.082.498 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (8.111) | (0,01) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 67.074.387 | 99,99 |

¹ Inklusive der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SWISS DOMESTIC GOVERNMENT BOND 3-7 ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | |
| Obligationen | | | | | | |
| Schweiz | | | | | | |
| Swiss Confederation Government Bond 1,25% 11.06.2024 | 26.255.000 | 23.603.000 | 8.558.000 | 41.300.000 | 44.511.075 | 35,43 |
| Swiss Confederation Government Bond 1,25% 28.05.2026 | 8.964.000 | 32.689.000 | 5.132.000 | 36.521.000 | 40.720.915 | 32,42 |
| Swiss Confederation Government Bond 1,5% 24.07.2025 | 21.948.000 | 19.933.000 | 7.779.000 | 34.102.000 | 37.929.949 | 30,20 |
| Swiss Confederation Government Bond 2% 25.05.2022 | 15.312.000 | - | 15.312.000 | - | - | 0,00 |
| Swiss Confederation Government Bond 4% 11.02.2023 | 38.409.000 | 3.710.000 | 42.119.000 | - | - | 0,00 |
| | | | | | 123.161.939 | 98,05 |
| Total Obligationen | | | | | 123.161.939 | 98,05 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 123.161.939 | 98,05 |
| Total Effekten | | | | | 123.161.939 | 98,05 |
| Total Anlagen | | | | | 123.161.939 | 98,05 |
| Sichtguthaben | | | | | 374.622 | 0,30 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 2.079.074 | 1,65 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 125.615.635 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (470.604) | (0,37) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 125.145.031 | 99,63 |

¹ Inklusiv der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES SWISS DOMESTIC GOVERNMENT BOND 7-15 ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | |
| Obligationen | | | | | | |
| Schweiz | | | | | | |
| Swiss Confederation Government Bond (Null-Kupon) 22.06.2029 | 13.520.000 | 29.151.000 | 21.683.000 | 20.988.000 | 22.010.116 | 11,12 |
| Swiss Confederation Government Bond (Null-Kupon) 26.06.2034 | - | 10.110.000 | 5.292.000 | 4.818.000 | 5.066.609 | 2,56 |
| Swiss Confederation Government Bond 0,5% 27.05.2030 | 11.076.000 | 25.056.000 | 19.302.000 | 16.830.000 | 18.526.464 | 9,36 |
| Swiss Confederation Government Bond 0,5% 27.06.2032 | 4.784.000 | 14.858.000 | 11.062.000 | 8.580.000 | 9.558.120 | 4,83 |
| Swiss Confederation Government Bond 1,25% 28.05.2026 | 11.804.000 | - | 11.804.000 | - | - | 0,00 |
| Swiss Confederation Government Bond 2,25% 22.06.2031 | 12.636.000 | 24.672.000 | 21.006.000 | 16.302.000 | 21.309.159 | 10,76 |
| Swiss Confederation Government Bond 3,25% 27.06.2027 | 13.832.000 | 24.905.000 | 21.445.000 | 17.292.000 | 22.104.363 | 11,16 |
| Swiss Confederation Government Bond 3,5% 08.04.2033 | 22.620.000 | 38.137.000 | 34.291.000 | 26.466.000 | 40.081.434 | 20,25 |
| Swiss Confederation Government Bond 4% 08.04.2028 | 33.228.000 | 56.372.000 | 49.604.000 | 39.996.000 | 54.692.530 | 27,63 |
| | | | | | 193.348.795 | 97,67 |
| Total Obligationen | | | | | 193.348.795 | 97,67 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 193.348.795 | 97,67 |
| Total Effekten | | | | | 193.348.795 | 97,67 |
| Total Anlagen | | | | | 193.348.795 | 97,67 |
| Sichtguthaben | | | | | 234.904 | 0,12 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 4.366.363 | 2,21 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 197.950.062 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (1.958.582) | (0,99) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 195.991.480 | 99,01 |

¹ Inklusive der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | | |
| Obligationen | | | | | | |
| Australien | | | | | | |
| AMP Group Finance Services Ltd 0,2031% 03.06.2024 | - | 5.400.000 | 3.600.000 | 1.800.000 | 1.778.400 | 0,13 |
| AMP Group Finance Services Ltd 0,75% 19.12.2022 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.513.500 | 0,11 |
| AMP Group Finance Services Ltd 0,8% 18.07.2023 | 2.000.000 | 300.000 | - | 2.300.000 | 2.317.250 | 0,18 |
| Commonwealth Bank of Australia 0,113% 10.12.2029 | - | 2.000.000 | - | 2.000.000 | 1.940.000 | 0,15 |
| Commonwealth Bank of Australia 0,4% 25.09.2026 | 4.500.000 | - | - | 4.500.000 | 4.558.500 | 0,35 |
| Commonwealth Bank of Australia 1,5% 07.02.2022 | 3.030.000 | - | 1.000.000 | 2.030.000 | 2.072.630 | 0,16 |
| Macquarie Bank Ltd 0,625% 04.09.2023 | 2.850.000 | - | - | 2.850.000 | 2.858.550 | 0,22 |
| Macquarie Bank Ltd 0,75% 05.02.2024 | 2.500.000 | - | 700.000 | 1.800.000 | 1.818.000 | 0,14 |
| Macquarie Bank Ltd 3% 29.11.2022 | 2.660.000 | - | 1.000.000 | 1.660.000 | 1.760.430 | 0,13 |
| National Australia Bank Ltd 0,065% 29.01.2029 | - | 1.700.000 | - | 1.700.000 | 1.672.800 | 0,13 |
| National Australia Bank Ltd 0,125% 21.06.2027 | - | 3.300.000 | 1.000.000 | 2.300.000 | 2.296.550 | 0,17 |
| National Australia Bank Ltd 0,25% 19.01.2023 | 4.110.000 | - | 2.000.000 | 2.110.000 | 2.116.330 | 0,16 |
| National Australia Bank Ltd 0,25% 13.03.2024 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.502.500 | 0,19 |
| National Australia Bank Ltd 0,3% 31.10.2025 | 1.750.000 | - | - | 1.750.000 | 1.757.000 | 0,13 |
| National Australia Bank Ltd 0,35% 05.08.2022 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.513.750 | 0,19 |
| National Australia Bank Ltd 1% 10.12.2021 | 3.475.000 | - | 500.000 | 2.975.000 | 3.024.087 | 0,23 |
| National Australia Bank Ltd 1,625% 05.09.2023 | 2.460.000 | 2.960.000 | 2.460.000 | 2.960.000 | 3.097.640 | 0,24 |
| Transurban Queensland Finance Pty Ltd 0,625% 23.06.2023 | 2.750.000 | - | 1.000.000 | 1.750.000 | 1.760.500 | 0,13 |
| Transurban Queensland Finance Pty Ltd 0,65% 02.11.2026 | 2.050.000 | - | - | 2.050.000 | 2.053.075 | 0,16 |
| Transurban Queensland Finance Pty Ltd 1% 08.12.2025 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.045.000 | 0,16 |
| Westpac Banking Corp 0,3% 28.11.2025 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.026.000 | 0,15 |
| Westpac Banking Corp 0,4% 09.06.2023 | 3.100.000 | 500.000 | 1.000.000 | 2.600.000 | 2.619.500 | 0,20 |
| Westpac Banking Corp 0,4% 06.06.2024 | 500.000 | 1.000.000 | 500.000 | 1.000.000 | 1.007.500 | 0,08 |
| Westpac Banking Corp 0,5% 02.02.2022 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.009.000 | 0,08 |
| Westpac Banking Corp 0,5% 16.05.2028 | 1.950.000 | - | - | 1.950.000 | 1.964.625 | 0,15 |
| Woodside Finance Ltd 1% 11.12.2023 | 2.100.000 | - | - | 2.100.000 | 2.157.750 | 0,16 |
| | | | | | 56.240.867 | 4,28 |
| Bermuda | | | | | | |
| CBQ Finance Ltd 0,38% 19.10.2023 | - | 1.700.000 | - | 1.700.000 | 1.603.100 | 0,12 |
| CBQ Finance Ltd 0,697% 22.03.2021 | 2.600.000 | - | - | 2.600.000 | 2.574.520 | 0,20 |
| CBQ Finance Ltd 1,115% 17.10.2022 | 2.000.000 | - | 1.000.000 | 1.000.000 | 980.000 | 0,07 |
| Holcim Overseas Finance Ltd 3,375% 10.06.2021 | 6.540.000 | - | 800.000 | 5.740.000 | 5.909.904 | 0,45 |
| | | | | | 11.067.524 | 0,84 |
| Britische Jungferninseln | | | | | | |
| Sinochem Offshore Capital Co Ltd 0,76% 17.06.2022 | 2.750.000 | - | - | 2.750.000 | 2.750.000 | 0,21 |
| | | | | | 2.750.000 | 0,21 |
| Chile | | | | | | |
| Banco de Chile 0,25% 05.12.2024 | - | 600.000 | - | 600.000 | 539.700 | 0,04 |
| Banco de Chile 0,568% 21.11.2023 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 939.000 | 0,07 |
| Banco de Credito e Inversiones SA 0,1% 18.09.2026 | - | 1.300.000 | - | 1.300.000 | 1.202.500 | 0,09 |
| Banco de Credito e Inversiones SA 0,25% 29.10.2025 | - | 1.500.000 | - | 1.500.000 | 1.395.000 | 0,11 |
| Banco de Credito e Inversiones SA 0,25% 24.09.2029 | - | 500.000 | - | 500.000 | 450.000 | 0,03 |
| Banco de Credito e Inversiones SA 0,4% 22.11.2024 | 1.350.000 | 1.500.000 | 1.100.000 | 1.750.000 | 1.655.500 | 0,13 |
| Banco del Estado de Chile 0,01% 04.10.2027 | - | 700.000 | - | 700.000 | 558.600 | 0,04 |
| Banco del Estado de Chile 0,24% 06.06.2025 | 700.000 | 1.000.000 | - | 1.700.000 | 1.530.850 | 0,12 |
| Banco del Estado de Chile 0,575% 07.04.2027 | 1.450.000 | - | - | 1.450.000 | 1.276.725 | 0,10 |
| Banco del Estado de Chile 0,6925% 04.12.2024 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 966.000 | 0,07 |
| Banco Santander Chile 0,135% 29.08.2029 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 825.000 | 0,06 |
| Banco Santander Chile 0,35% 30.05.2025 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 930.000 | 0,07 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|-------------------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Banco Santander Chile 0,375% 19.05.2022 | 1.750.000 | - | - | 1.750.000 | 1.722.000 | 0,13 | |
| Banco Santander Chile 0,384% 27.09.2024 | 2.050.000 | - | 1.000.000 | 1.050.000 | 1.008.000 | 0,08 | |
| Banco Santander Chile 0,441% 21.12.2023 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.452.000 | 0,11 | |
| Coopeuch Ltda 1,05% 15.10.2021 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.437.000 | 0,11 | |
| Tanner Servicios Financieros SA 0,6% 07.11.2022 | - | 2.210.000 | - | 2.210.000 | 1.900.600 | 0,15 | |
| Tanner Servicios Financieros SA 1% 03.12.2021 | - | 500.000 | - | 500.000 | 436.000 | 0,03 | |
| Tanner Servicios Financieros SA 2,125% 15.11.2019 | 2.000.000 | - | 2.000.000 | - | - | 0,00 | |
| | | | | | 20.224.475 | 1,54 | |
| Dänemark | | | | | | | |
| Danske Bank A/S 0,625% 24.11.2022 | 1.000.000 | 1.200.000 | - | 2.200.000 | 2.179.100 | 0,17 | |
| | | | | | 2.179.100 | 0,17 | |
| Deutschland | | | | | | | |
| Commerzbank AG 1,1% 11.07.2025 | 1.200.000 | - | - | 1.200.000 | 1.172.400 | 0,09 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 0,1% 01.12.2025 | 1.200.000 | - | - | 1.200.000 | 1.208.400 | 0,09 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 0,1% 19.06.2029 | 540.000 | 9.780.000 | 7.480.000 | 2.840.000 | 2.791.720 | 0,21 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 0,45% 08.11.2030 | 3.750.000 | - | 500.000 | 3.250.000 | 3.331.250 | 0,25 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 0,5% 18.07.2028 | 4.000.000 | - | - | 4.000.000 | 4.140.000 | 0,32 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 0,5% 19.06.2034 | 495.000 | 1.100.000 | - | 1.595.000 | 1.594.203 | 0,12 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 1,375% 24.07.2023 | 6.040.000 | 3.340.000 | 4.040.000 | 5.340.000 | 5.612.340 | 0,43 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 1,5% 21.02.2024 | 200.000 | - | - | 200.000 | 213.100 | 0,02 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 1,5% 26.08.2024 | 4.080.000 | - | 2.000.000 | 2.080.000 | 2.233.920 | 0,17 | |
| Deutsche Bahn Finance GMBH 1,75% 03.06.2020 | 2.545.000 | - | 2.545.000 | - | - | 0,00 | |
| Deutsche Bank AG 0,625% 08.02.2023 | 2.500.000 | - | 1.000.000 | 1.500.000 | 1.455.000 | 0,11 | |
| Deutsche Bank AG 0,625% 19.12.2023 | 3.350.000 | - | - | 3.350.000 | 3.189.200 | 0,24 | |
| Deutsche Bank AG 0,75% 05.07.2021 | 250.000 | - | 250.000 | - | - | 0,00 | |
| Deutsche Bank AG 0,75% 21.03.2022 | 4.500.000 | - | 1.000.000 | 3.500.000 | 3.438.750 | 0,26 | |
| Deutsche Bank AG 0,8% 07.02.2025 | - | 1.600.000 | - | 1.600.000 | 1.476.000 | 0,11 | |
| Deutsche Bank AG 1,625% 12.09.2022 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.481.250 | 0,11 | |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 0,125% 05.06.2023 | 1.000.000 | 1.200.000 | 1.000.000 | 1.200.000 | 1.167.000 | 0,09 | |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 0,3% 02.11.2021 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.461.000 | 0,11 | |
| Deutsche Telekom AG 0,435% 06.02.2032 | - | 2.700.000 | - | 2.700.000 | 2.717.550 | 0,21 | |
| DVB Bank SE 0,575% 17.06.2022 | 500.000 | - | - | 500.000 | 474.250 | 0,04 | |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main 3,238% 30.08.2023 | 50.000 | - | - | 50.000 | 52.225 | 0,00 | |
| Henkel AG & Co KGaA 0,2725% 28.04.2023 | - | 2.350.000 | - | 2.350.000 | 2.367.625 | 0,18 | |
| Muenchener Hypothekenbank eG 0,1% 17.12.2025 | - | 2.200.000 | - | 2.200.000 | 2.162.600 | 0,17 | |
| Muenchener Hypothekenbank eG 0,125% 18.11.2027 | - | 500.000 | - | 500.000 | 486.000 | 0,04 | |
| Muenchener Hypothekenbank eG 0,3% 20.12.2024 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.995.000 | 0,15 | |
| Muenchener Hypothekenbank eG 0,35% 12.12.2023 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.469.250 | 0,11 | |
| | | | | | 47.690.033 | 3,63 | |
| Finnland | | | | | | | |
| Nordea Bank Abp 0,25% 27.11.2023 | 3.750.000 | - | 1.200.000 | 2.550.000 | 2.561.475 | 0,19 | |
| Nordea Bank Abp 0,55% 23.06.2025 | 3.750.000 | - | 800.000 | 2.950.000 | 2.992.775 | 0,23 | |
| Nordea Bank Abp 1,125% 02.10.2020 | 3.310.000 | - | 3.310.000 | - | - | 0,00 | |
| Nordea Bank Abp 2,75% 22.03.2021 | 670.000 | - | 670.000 | - | - | 0,00 | |
| OP Corporate Bank Plc 1% 14.07.2021 | 3.660.000 | - | 500.000 | 3.160.000 | 3.193.180 | 0,24 | |
| | | | | | 8.747.430 | 0,66 | |
| Frankreich | | | | | | | |
| Accor SA 1,75% 27.06.2022 | 1.850.000 | - | 400.000 | 1.450.000 | 1.435.500 | 0,11 | |
| Auchan Holding SA 1,5% 03.06.2024 | 1.490.000 | - | - | 1.490.000 | 1.513.095 | 0,12 | |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,2% 12.06.2026 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.488.750 | 0,11 | |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,2% 03.11.2028 | - | 1.800.000 | - | 1.800.000 | 1.792.800 | 0,14 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,25% 10.07.2025 | 2.500.000 | - | 1.200.000 | 1.300.000 | 1.307.150 | 0,10 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,25% 24.10.2029 | - | 800.000 | - | 800.000 | 790.000 | 0,06 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,32% 10.02.2025 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.006.000 | 0,15 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,366% 10.10.2024 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.503.750 | 0,12 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,4% 12.02.2024 | 2.000.000 | - | 400.000 | 1.600.000 | 1.611.200 | 0,12 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,4% 19.12.2025 | 2.200.000 | - | - | 2.200.000 | 2.229.700 | 0,17 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,55% 08.12.2023 | 3.500.000 | - | - | 3.500.000 | 3.549.000 | 0,27 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,6% 05.04.2027 | 2.400.000 | - | - | 2.400.000 | 2.462.400 | 0,19 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 2% 22.05.2024 | 1.620.000 | - | 1.000.000 | 620.000 | 667.430 | 0,05 |
| BNP Paribas SA 0,15% 10.03.2028 | - | 1.800.000 | - | 1.800.000 | 1.695.600 | 0,13 |
| BNP Paribas SA 0,3% 15.10.2027 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 944.000 | 0,07 |
| BNP Paribas SA 1% 06.06.2025 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.028.000 | 0,15 |
| BNP Paribas SA 1,75% 05.06.2025 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.021.500 | 0,08 |
| BNP Paribas SA 1,875% 12.09.2022 | 1.740.000 | - | - | 1.740.000 | 1.805.250 | 0,14 |
| BPCE SA 0,5% 08.11.2023 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.502.250 | 0,11 |
| BPCE SA 1,5% 30.04.2021 | 2.020.000 | - | 800.000 | 1.220.000 | 1.235.372 | 0,09 |
| Credit Agricole SA 0,1275% 27.07.2028 | - | 2.000.000 | - | 2.000.000 | 1.989.000 | 0,15 |
| Credit Agricole SA 0,2% 30.10.2023 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.507.500 | 0,19 |
| Credit Agricole SA 0,25% 10.10.2029 | - | 1.500.000 | - | 1.500.000 | 1.467.000 | 0,11 |
| Credit Agricole SA 0,3% 18.04.2024 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.018.000 | 0,15 |
| Credit Agricole SA 0,45% 14.03.2022 | 2.400.000 | - | 500.000 | 1.900.000 | 1.878.150 | 0,14 |
| Credit Agricole SA 0,55% 01.09.2022 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.503.750 | 0,12 |
| Credit Agricole SA 0,55% 14.12.2026 | 1.200.000 | - | 1.200.000 | - | - | 0,00 |
| Credit Agricole SA 0,625% 15.09.2023 | 1.250.000 | - | - | 1.250.000 | 1.261.875 | 0,10 |
| Credit Agricole SA 0,625% 12.07.2024 | 1.200.000 | - | - | 1.200.000 | 1.207.200 | 0,09 |
| Credit Agricole SA 1% 08.10.2021 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.715.470 | 0,13 |
| Credit Agricole SA 1% 27.01.2025 | 1.050.000 | - | 1.050.000 | - | - | 0,00 |
| Credit Agricole SA 1% 07.11.2025 | 1.400.000 | - | - | 1.400.000 | 1.432.900 | 0,11 |
| Credit Agricole SA 1,25% 17.07.2020 | 1.840.000 | - | 1.840.000 | - | - | 0,00 |
| Credit Agricole SA 1,75% 13.03.2023 | 1.290.000 | - | - | 1.290.000 | 1.337.085 | 0,10 |
| Credit Agricole SA 2,125% 30.10.2024 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.853.850 | 0,14 |
| Credit Agricole SA 2,125% 29.09.2025 | 2.500.000 | - | 1.000.000 | 1.500.000 | 1.552.500 | 0,12 |
| Electricite de France SA 0,3% 14.10.2024 | 4.500.000 | - | 700.000 | 3.800.000 | 3.815.200 | 0,29 |
| Electricite de France SA 0,65% 13.10.2028 | 1.500.000 | 1.000.000 | 1.100.000 | 1.400.000 | 1.400.000 | 0,11 |
| Engie SA 1,125% 09.10.2020 | 4.490.000 | - | 4.490.000 | - | - | 0,00 |
| Engie SA 1,625% 09.10.2024 | 280.000 | 500.000 | - | 780.000 | 803.790 | 0,06 |
| mFinance France SA 1,005% 28.03.2023 | 2.850.000 | - | - | 2.850.000 | 2.767.350 | 0,21 |
| Orange SA 0,2% 24.11.2025 | - | 12.800.000 | 8.700.000 | 4.100.000 | 4.126.650 | 0,31 |
| Orange SA 0,625% 22.06.2029 | - | 1.400.000 | 500.000 | 900.000 | 927.000 | 0,07 |
| RCI Banque SA 0,5% 20.04.2022 | 2.000.000 | - | 1.000.000 | 1.000.000 | 988.000 | 0,08 |
| RCI Banque SA 0,5% 18.07.2024 | - | 2.500.000 | - | 2.500.000 | 2.331.250 | 0,18 |
| RCI Banque SA 0,55% 30.05.2023 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.628.600 | 0,12 |
| Societe Generale SA 0,25% 08.10.2026 | - | 1.600.000 | - | 1.600.000 | 1.506.400 | 0,12 |
| Societe Generale SA 0,25% 25.02.2027 | - | 1.400.000 | - | 1.400.000 | 1.326.500 | 0,10 |
| Societe Generale SA 0,4% 22.02.2022 | 2.450.000 | - | 1.000.000 | 1.450.000 | 1.435.500 | 0,11 |
| Societe Generale SA 0,7% 26.02.2025 | 1.400.000 | - | 600.000 | 800.000 | 785.600 | 0,06 |
| Societe Generale SA 0,875% 28.02.2024 | 1.600.000 | - | - | 1.600.000 | 1.598.400 | 0,12 |
| Societe Generale SA 2,375% 19.09.2022 | 600.000 | - | - | 600.000 | 627.900 | 0,05 |
| Total Capital International SA 0,166% 21.12.2029 | - | 2.500.000 | 900.000 | 1.600.000 | 1.548.000 | 0,12 |
| Total Capital International SA 0,288% 13.07.2026 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.027.000 | 0,15 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|---|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | |
| Total Capital International SA 0,5% 01.06.2027 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.022.000 | 0,15 |
| Total Capital International SA 1% 29.08.2024 | 9.050.000 | - | 1.300.000 | 7.750.000 | 8.075.500 | 0,61 |
| Unibail-Rodamco-Westfield SE 2% 20.11.2023 | 350.000 | - | - | 350.000 | 371.700 | 0,03 |
| Vinci SA 3% 24.01.2022 | 200.000 | 500.000 | - | 700.000 | 734.300 | 0,06 |
| | | | | | 95.159.667 | 7,24 |
| Guernsey | | | | | | |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 0,625% 21.08.2020 | 3.350.000 | - | 3.350.000 | - | - | 0,00 |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 1% 14.04.2023 | 13.380.000 | - | 3.300.000 | 10.080.000 | 10.211.040 | 0,78 |
| | | | | | 10.211.040 | 0,78 |
| Irland | | | | | | |
| Intesa Sanpaolo Bank Ireland Plc 0,25% 30.09.2024 | - | 3.200.000 | 600.000 | 2.600.000 | 2.410.200 | 0,18 |
| Russian Railways Via RZD Capital Plc 0,898% 03.10.2025 | - | 7.500.000 | 500.000 | 7.000.000 | 6.790.000 | 0,52 |
| Russian Railways Via RZD Capital Plc 1,195% 03.04.2028 | - | 1.500.000 | - | 1.500.000 | 1.451.250 | 0,11 |
| Russian Railways Via RZD Capital Plc 2,1% 02.10.2023 | 11.200.000 | - | - | 11.200.000 | 11.569.600 | 0,88 |
| UniCredit Bank Ireland Plc 4,25% 19.10.2022 | 1.960.000 | - | - | 1.960.000 | 2.067.800 | 0,16 |
| | | | | | 24.288.850 | 1,85 |
| Jersey | | | | | | |
| Glencore Finance Europe Co Regs 2,125% 23.12.2019 | 895.000 | - | 895.000 | - | - | 0,00 |
| Glencore Finance Europe Ltd 0,35% 10.09.2025 | - | 3.000.000 | - | 3.000.000 | 2.808.000 | 0,21 |
| Glencore Finance Europe Ltd 1,25% 01.12.2020 | 4.150.000 | - | 4.150.000 | - | - | 0,00 |
| Glencore Finance Europe Ltd 1,25% 09.10.2024 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.507.500 | 0,11 |
| Glencore Finance Europe Ltd 2,25% 10.05.2021 | 3.600.000 | - | 1.000.000 | 2.600.000 | 2.620.800 | 0,20 |
| Heathrow Funding Ltd 0,45% 15.10.2026 | 1.500.000 | 500.000 | 400.000 | 1.600.000 | 1.508.000 | 0,12 |
| Heathrow Funding Ltd 0,5% 17.05.2024 | 5.000.000 | 300.000 | 1.000.000 | 4.300.000 | 4.145.200 | 0,32 |
| | | | | | 12.589.500 | 0,96 |
| Kaimaninseln | | | | | | |
| ADCB Finance Cayman Ltd 0,375% 23.01.2023 | 2.200.000 | - | 500.000 | 1.700.000 | 1.650.700 | 0,12 |
| ADCB Finance Cayman Ltd 0,5% 29.11.2024 | 1.000.000 | 500.000 | - | 1.500.000 | 1.403.250 | 0,11 |
| ADCB Finance Cayman Ltd 0,725% 15.02.2024 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.473.000 | 0,11 |
| BOS Funding Ltd 1,5% 29.11.2023 | - | 500.000 | - | 500.000 | 471.000 | 0,04 |
| | | | | | 4.997.950 | 0,38 |
| Kanada | | | | | | |
| Bank of Montreal 0,05% 30.12.2022 | 4.500.000 | - | - | 4.500.000 | 4.482.000 | 0,34 |
| Bank of Nova Scotia 0,3% 16.09.2022 | 4.900.000 | - | 500.000 | 4.400.000 | 4.395.600 | 0,33 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 0,05% 15.10.2026 | - | 4.000.000 | 500.000 | 3.500.000 | 3.437.000 | 0,26 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 0,15% 31.07.2023 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.500.000 | 0,19 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 0,6% 30.01.2025 | 2.600.000 | 1.400.000 | 2.200.000 | 1.800.000 | 1.820.700 | 0,14 |
| Royal Bank of Canada 0,1% 18.07.2023 | 3.000.000 | - | - | 3.000.000 | 2.982.000 | 0,23 |
| | | | | | 19.617.300 | 1,49 |
| Liechtenstein | | | | | | |
| Hilti AG 0,05% 02.07.2025 | - | 375.000 | - | 375.000 | 375.375 | 0,03 |
| Hilti AG 0,2% 08.11.2024 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.013.000 | 0,08 |
| Hilti AG 0,4% 08.11.2027 | 1.900.000 | - | 1.000.000 | 900.000 | 910.800 | 0,07 |
| Hilti AG 1,875% 30.10.2023 | 930.000 | - | - | 930.000 | 993.240 | 0,08 |
| LGT Bank AG 0,2% 12.10.2026 | 4.000.000 | - | 700.000 | 3.300.000 | 3.275.250 | 0,25 |
| LGT Bank AG 0,375% 05.07.2028 | - | 1.600.000 | - | 1.600.000 | 1.560.000 | 0,12 |
| LGT Bank AG 0,375% 15.11.2029 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 960.000 | 0,07 |
| LGT Bank AG 0,5% 12.05.2027 | 3.050.000 | - | - | 3.050.000 | 3.086.600 | 0,23 |
| LGT Bank AG 0,625% 25.11.2025 | 3.000.000 | - | - | 3.000.000 | 3.067.500 | 0,23 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | |
| LGT Bank AG 1,5% 10.05.2021 | 3.730.000 | - | 3.730.000 | - | - | 0,00 |
| LGT Bank AG 1,875% 08.02.2023 | 2.925.000 | - | - | 2.925.000 | 3.068.325 | 0,23 |
| Liechtensteinische Landesbank AG 0,125% 28.05.2026 | - | 3.800.000 | 1.800.000 | 2.000.000 | 1.965.000 | 0,15 |
| VP Bank AG 0,5% 07.04.2021 | 1.550.000 | - | - | 1.550.000 | 1.553.100 | 0,12 |
| VP Bank AG 0,6% 29.11.2029 | - | 1.800.000 | - | 1.800.000 | 1.778.400 | 0,14 |
| VP Bank AG 0,875% 07.10.2024 | 300.000 | - | - | 300.000 | 305.100 | 0,02 |
| | | | | | 23.911.690 | 1,82 |
| Luxemburg | | | | | | |
| ArcelorMittal SA 2,5% 03.07.2020 | 1.000.000 | - | 1.000.000 | - | - | 0,00 |
| Aroundtown SA 0,732% 30.01.2025 | 2.750.000 | - | 800.000 | 1.950.000 | 1.876.875 | 0,14 |
| Aroundtown SA 1,72% 05.03.2026 | 2.200.000 | 2.700.000 | 2.600.000 | 2.300.000 | 2.311.500 | 0,18 |
| Banque Internationale a Luxembourg SA 0,55% 11.10.2022 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.515.750 | 0,12 |
| Banque Internationale a Luxembourg SA 1% 10.07.2025 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 983.500 | 0,07 |
| CPI Property Group SA 1,63% 25.10.2023 | 2.200.000 | - | - | 2.200.000 | 2.134.000 | 0,16 |
| DH Switzerland Finance Sarl 0,5% 08.12.2023 | 6.300.000 | 500.000 | 1.500.000 | 5.300.000 | 5.247.000 | 0,40 |
| DH Switzerland Finance Sarl 1,125% 08.12.2028 | 1.850.000 | - | - | 1.850.000 | 1.888.850 | 0,14 |
| Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 2,85% 25.10.2019 | 13.950.000 | - | 13.950.000 | - | - | 0,00 |
| Grand City Properties SA 0,57% 24.06.2024 | - | 1.500.000 | - | 1.500.000 | 1.473.750 | 0,11 |
| Grand City Properties SA 0,956% 01.09.2026 | 2.000.000 | - | 500.000 | 1.500.000 | 1.455.750 | 0,11 |
| Mediobanca International Luxembourg SA 0,55% 02.03.2023 | 2.000.000 | 2.500.000 | 2.500.000 | 2.000.000 | 1.948.000 | 0,15 |
| | | | | | 20.834.975 | 1,58 |
| Mexiko | | | | | | |
| Banco Mercantil del Norte SA 0,45% 18.12.2023 | - | 1.700.000 | - | 1.700.000 | 1.559.750 | 0,12 |
| Banco Mercantil del Norte SA 0,5% 06.12.2024 | - | 1.900.000 | - | 1.900.000 | 1.710.000 | 0,13 |
| Banco Mercantil del Norte SA 1,55% 11.10.2022 | 3.500.000 | - | - | 3.500.000 | 3.361.750 | 0,25 |
| Petroleos Mexicanos 1,5% 08.12.2020 | 6.350.000 | - | 6.350.000 | - | - | 0,00 |
| Petroleos Mexicanos 1,75% 04.12.2023 | 2.500.000 | 4.000.000 | 6.500.000 | - | - | 0,00 |
| Petroleos Mexicanos 2,375% 14.12.2021 | 3.700.000 | 4.500.000 | 8.200.000 | - | - | 0,00 |
| | | | | | 6.631.500 | 0,50 |
| Neuseeland | | | | | | |
| ANZ New Zealand Int'l Ltd 0,25% 25.10.2023 | 2.300.000 | - | - | 2.300.000 | 2.295.400 | 0,18 |
| ANZ New Zealand Int'l Ltd 0,25% 22.09.2025 | 2.000.000 | - | 500.000 | 1.500.000 | 1.491.750 | 0,11 |
| ANZ New Zealand Int'l Ltd 0,35% 22.10.2024 | 2.750.000 | - | 1.000.000 | 1.750.000 | 1.749.125 | 0,13 |
| ASB Finance Ltd 0,2% 02.08.2024 | 2.500.000 | - | 1.000.000 | 1.500.000 | 1.488.750 | 0,11 |
| ASB Finance Ltd 0,45% 30.01.2025 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.505.000 | 0,19 |
| BNZ International Funding Ltd 0,111% 24.07.2028 | - | 2.750.000 | - | 2.750.000 | 2.678.500 | 0,21 |
| BNZ International Funding Ltd 0,25% 24.06.2022 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.501.250 | 0,19 |
| BNZ International Funding Ltd 1,375% 03.02.2021 | 1.560.000 | - | 1.560.000 | - | - | 0,00 |
| Kiwibank Ltd 0,25% 18.10.2023 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.995.000 | 0,15 |
| Transpower New Zealand Ltd 0,02% 16.12.2027 | - | 1.300.000 | - | 1.300.000 | 1.285.700 | 0,10 |
| Westpac Securities NZ Ltd 0,125% 15.12.2022 | 2.550.000 | - | 1.000.000 | 1.550.000 | 1.556.200 | 0,12 |
| Westpac Securities NZ Ltd 0,375% 05.02.2024 | 4.600.000 | - | - | 4.600.000 | 4.625.300 | 0,35 |
| Westpac Securities NZ Ltd 0,625% 02.09.2020 | 4.650.000 | - | 4.650.000 | - | - | 0,00 |
| | | | | | 24.171.975 | 1,84 |
| Niederlande | | | | | | |
| ABN AMRO Bank NV 0,3% 18.12.2024 | 1.700.000 | - | 800.000 | 900.000 | 886.950 | 0,07 |
| ABN AMRO Bank NV 0,5% 29.07.2022 | 2.250.000 | - | - | 2.250.000 | 2.257.875 | 0,17 |
| ABN AMRO Bank NV 3,125% 27.04.2021 | 400.000 | - | 400.000 | - | - | 0,00 |
| ABN AMRO Bank NV 3,125% 28.06.2021 | 580.000 | - | - | 580.000 | 597.400 | 0,05 |
| Achmea Bank NV 0,5% 15.11.2022 | 700.000 | - | - | 700.000 | 693.700 | 0,05 |
| Achmea Bank NV 0,5% 27.10.2023 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 982.000 | 0,08 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|---|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|-------------------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Achmea Bank NV 0,5% 03.10.2025 | 3.000.000 | - | 1.000.000 | 2.000.000 | 1.903.000 | 0,15 | |
| BMW International Investment BV 0,3% 05.09.2024 | 1.900.000 | 700.000 | - | 2.600.000 | 2.564.900 | 0,20 | |
| BMW International Investment BV 0,75% 03.09.2027 | 3.000.000 | 500.000 | 700.000 | 2.800.000 | 2.807.000 | 0,21 | |
| Cooperatieve Rabobank UA 0,25% 25.11.2027 | 1.600.000 | 3.000.000 | 2.200.000 | 2.400.000 | 2.355.600 | 0,18 | |
| Cooperatieve Rabobank UA 1,125% 08.04.2021 | 2.060.000 | - | 2.060.000 | - | - | 0,00 | |
| Cooperatieve Rabobank UA 1,25% 15.10.2020 | 3.980.000 | - | 3.980.000 | - | - | 0,00 | |
| Cooperatieve Rabobank UA 2% 16.09.2021 | 6.595.000 | - | 2.000.000 | 4.595.000 | 4.716.768 | 0,36 | |
| Cooperatieve Rabobank UA 3,125% 15.09.2026 | 4.555.000 | 500.000 | 700.000 | 4.355.000 | 5.175.917 | 0,39 | |
| Cooperatieve Rabobank UA 3,5% 31.08.2023 | 2.270.000 | - | - | 2.270.000 | 2.518.565 | 0,19 | |
| Daimler International Finance BV 0,25% 14.11.2022 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.991.000 | 0,15 | |
| Daimler International Finance BV 0,85% 14.11.2025 | 2.500.000 | 1.500.000 | 2.500.000 | 1.500.000 | 1.494.000 | 0,11 | |
| EBN BV 0,5% 22.09.2022 | 1.600.000 | - | - | 1.600.000 | 1.622.400 | 0,12 | |
| EBN BV 0,875% 22.09.2026 | 1.040.000 | - | - | 1.040.000 | 1.086.800 | 0,08 | |
| EBN BV 1,125% 04.07.2024 | 2.210.000 | - | 1.400.000 | 810.000 | 843.210 | 0,06 | |
| EBN BV 1,625% 03.10.2023 | 1.915.000 | - | - | 1.915.000 | 2.019.368 | 0,15 | |
| Enel Finance International NV 0,55% 03.09.2024 | 3.450.000 | - | - | 3.450.000 | 3.425.850 | 0,26 | |
| Enel Finance International NV 3% 23.06.2020 | 1.760.000 | - | 1.760.000 | - | - | 0,00 | |
| Enel Finance International NV 4% 26.10.2027 | 380.000 | - | - | 380.000 | 459.230 | 0,04 | |
| LeasePlan Corp NV 2,375% 15.10.2020 | 750.000 | 250.000 | 1.000.000 | - | - | 0,00 | |
| Shell International Finance BV 0,375% 21.08.2023 | 8.750.000 | - | 800.000 | 7.950.000 | 7.989.750 | 0,61 | |
| Shell International Finance BV 0,875% 21.08.2028 | 5.610.000 | - | 1.000.000 | 4.610.000 | 4.828.975 | 0,37 | |
| | | | | | 53.220.258 | 4,05 | |
| Norwegen | | | | | | | |
| DNB Bank ASA 0,05% 13.03.2024 | 2.300.000 | - | 1.000.000 | 1.300.000 | 1.300.000 | 0,10 | |
| DNB Bank ASA 0,125% 30.11.2023 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 989.500 | 0,08 | |
| Norske Tog AS 1,125% 02.05.2023 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.751.000 | 0,13 | |
| SpareBank 1 Nord Norge 0,125% 11.12.2025 | 1.400.000 | - | - | 1.400.000 | 1.358.000 | 0,10 | |
| SpareBank 1 Nord Norge 0,3% 16.09.2022 | 1.750.000 | - | 1.000.000 | 750.000 | 749.250 | 0,06 | |
| SpareBank 1 Nord Norge 0,875% 02.12.2020 | 1.400.000 | - | 1.400.000 | - | - | 0,00 | |
| SpareBank 1 SMN 0,35% 05.04.2023 | 2.250.000 | - | - | 2.250.000 | 2.223.000 | 0,17 | |
| Statnett SF 2,375% 08.02.2021 | 1.690.000 | - | 1.690.000 | - | - | 0,00 | |
| | | | | | 8.370.750 | 0,64 | |
| Österreich | | | | | | | |
| BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0,01% 15.09.2021 | 2.115.000 | - | - | 2.115.000 | 2.106.117 | 0,16 | |
| HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG (Null-Kupon) 30.12.2020 | 1.000.000 | - | 1.000.000 | - | - | 0,00 | |
| HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG 0,1% 27.11.2024 | 700.000 | 500.000 | - | 1.200.000 | 1.176.600 | 0,09 | |
| HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG 0,125% 17.10.2023 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 976.000 | 0,07 | |
| HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG 0,2% 31.03.2022 | 1.900.000 | - | 700.000 | 1.200.000 | 1.200.000 | 0,09 | |
| Hypo Vorarlberg Bank AG 0,125% 06.10.2021 | 2.650.000 | - | 1.000.000 | 1.650.000 | 1.647.195 | 0,13 | |
| Hypo Vorarlberg Bank AG 0,125% 03.09.2029 | - | 1.650.000 | - | 1.650.000 | 1.532.025 | 0,12 | |
| Hypo Vorarlberg Bank AG 0,125% 03.09.2029 | - | 1.000.000 | 1.000.000 | - | - | 0,00 | |
| Hypo Vorarlberg Bank AG 0,125% 27.03.2030 | - | 1.300.000 | - | 1.300.000 | 1.197.300 | 0,09 | |
| Hypo Vorarlberg Bank AG 0,45% 05.03.2024 | 1.750.000 | - | - | 1.750.000 | 1.730.750 | 0,13 | |
| Hypo Vorarlberg Bank AG 1,625% 29.11.2029 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 945.500 | 0,07 | |
| Raiffeisen Bank International AG 4,75% 24.10.2022 | 3.450.000 | - | 800.000 | 2.650.000 | 2.782.500 | 0,21 | |
| Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG 0,175% 29.10.2026 | - | 800.000 | - | 800.000 | 783.600 | 0,06 | |
| | | | | | 16.077.587 | 1,22 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | 31. Mai 2020 Anzahl/ Nominalwert | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|--|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--|
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | |
| Panama | | | | | | |
| Multibank Inc 2% 11.01.2021 | 1.500.000 | - | 1.500.000 | - | - | 0,00 |
| | | | | | - | 0,00 |
| Philippinen | | | | | | |
| Bank of the Philippine Islands (Null-Kupon) 24.09.2021 | - | 500.000 | - | 500.000 | 485.050 | 0,04 |
| | | | | | 485.050 | 0,04 |
| Polen | | | | | | |
| mBank SA 0,565% 07.06.2022 | 2.450.000 | - | - | 2.450.000 | 2.392.425 | 0,18 |
| Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA 0,3% 02.11.2021 | 4.900.000 | - | 1.000.000 | 3.900.000 | 3.841.500 | 0,29 |
| | | | | | 6.233.925 | 0,47 |
| Schweden | | | | | | |
| Svenska Handelsbanken AB 1,375% 05.10.2022 | 2.600.000 | - | 500.000 | 2.100.000 | 2.152.500 | 0,16 |
| Swedish Match AB 2,125% 26.06.2023 | 15.000 | - | - | 15.000 | 15.878 | 0,00 |
| | | | | | 2.168.378 | 0,16 |
| Schweiz | | | | | | |
| Aarekraftwerk Klingnau AG 0,625% 03.08.2029 | - | 500.000 | - | 500.000 | 500.000 | 0,04 |
| ABB Ltd 0,3% 06.08.2024 | 3.700.000 | - | - | 3.700.000 | 3.725.900 | 0,28 |
| ABB Ltd 1% 07.05.2029 | 2.000.000 | - | 1.000.000 | 1.000.000 | 1.060.500 | 0,08 |
| ABB Ltd 2,25% 11.10.2021 | 3.140.000 | - | - | 3.140.000 | 3.230.746 | 0,25 |
| Adecco Group AG 0,875% 27.11.2025 | - | 2.000.000 | - | 2.000.000 | 2.024.000 | 0,15 |
| Adecco Group AG 0,875% 18.09.2026 | 1.000.000 | 500.000 | 600.000 | 900.000 | 906.300 | 0,07 |
| Adecco Group AG 2,625% 18.12.2020 | 1.230.000 | - | 1.230.000 | - | - | 0,00 |
| Aduno Holding AG 1,125% 16.07.2021 | 3.350.000 | - | 1.000.000 | 2.350.000 | 2.367.625 | 0,18 |
| Aeroport International de Geneve 0,31% 27.06.2029 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 976.000 | 0,07 |
| Aeroport International de Geneve 0,4% 20.09.2027 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.988.000 | 0,15 |
| Aeroport International de Geneve 1,05% 26.05.2023 | - | 1.400.000 | - | 1.400.000 | 1.414.000 | 0,11 |
| AKEB AG fuer Kernenergie Beteiligungen 1,625% 09.06.2023 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.999.000 | 0,15 |
| Allreal Holding AG 0,4% 26.09.2029 | - | 600.000 | - | 600.000 | 559.800 | 0,04 |
| Allreal Holding AG 0,5% 19.04.2023 | 2.000.000 | - | 1.000.000 | 1.000.000 | 1.008.500 | 0,08 |
| Allreal Holding AG 0,625% 10.05.2024 | 1.300.000 | - | - | 1.300.000 | 1.319.500 | 0,10 |
| Allreal Holding AG 0,75% 31.03.2021 | 1.370.000 | - | 1.370.000 | - | - | 0,00 |
| Allreal Holding AG 0,75% 19.06.2026 | 1.935.000 | - | - | 1.935.000 | 1.950.480 | 0,15 |
| Allreal Holding AG 0,875% 30.03.2027 | 1.850.000 | - | - | 1.850.000 | 1.858.325 | 0,14 |
| Allreal Holding AG 1,375% 31.03.2025 | 1.600.000 | 500.000 | 1.300.000 | 800.000 | 841.200 | 0,06 |
| Allreal Holding AG 2% 23.09.2020 | 840.000 | - | 840.000 | - | - | 0,00 |
| Alpiq Holding AG 2,125% 30.06.2023 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.067.000 | 0,16 |
| Alpiq Holding AG 2,25% 20.09.2021 | 475.000 | - | - | 475.000 | 483.265 | 0,04 |
| Alpiq Holding AG 2,625% 29.07.2024 | 3.030.000 | - | - | 3.030.000 | 3.187.560 | 0,24 |
| Alpiq Holding AG 3% 16.05.2022 | 2.315.000 | - | 1.000.000 | 1.315.000 | 1.370.888 | 0,10 |
| Amag Leasing AG 0,125% 12.07.2022 | - | 2.200.000 | 1.000.000 | 1.200.000 | 1.170.600 | 0,09 |
| Amag Leasing AG 0,125% 12.02.2024 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 965.000 | 0,07 |
| Amag Leasing AG 0,35% 27.10.2021 | 4.150.000 | - | 1.000.000 | 3.150.000 | 3.104.955 | 0,24 |
| Amag Leasing AG 0,5% 12.11.2025 | - | 1.800.000 | - | 1.800.000 | 1.732.500 | 0,13 |
| Amag Leasing AG 0,55% 10.02.2023 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.475.000 | 0,19 |
| Amag Leasing AG 0,875% 25.10.2024 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 992.500 | 0,08 |
| Axpo Holding AG 1,75% 29.05.2024 | 3.000.000 | - | - | 3.000.000 | 3.111.000 | 0,24 |
| Axpo Holding AG 3,125% 26.02.2025 | 4.085.000 | - | 1.000.000 | 3.085.000 | 3.413.552 | 0,26 |
| Baloise Holding AG (Null-Kupon) 23.09.2022 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 997.500 | 0,08 |
| Baloise Holding AG (Null-Kupon) 25.09.2026 | - | 1.250.000 | - | 1.250.000 | 1.225.000 | 0,09 |
| Baloise Holding AG (Null-Kupon) 25.09.2029 | - | 1.350.000 | - | 1.350.000 | 1.299.375 | 0,10 |
| Baloise Holding AG 0,5% 28.11.2025 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.513.500 | 0,12 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|---|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|-----------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Baloise Holding AG 1,125% 19.12.2024 | 1.450.000 | 500.000 | - | 1.950.000 | 2.033.850 | 0,15 | |
| Baloise Holding AG 1,75% 26.04.2023 | 1.980.000 | - | - | 1.980.000 | 2.061.180 | 0,16 | |
| Baloise Holding AG 2% 12.10.2022 | 1.060.000 | - | - | 1.060.000 | 1.107.700 | 0,08 | |
| Baloise Holding AG 2,875% 14.10.2020 | 3.335.000 | - | 3.335.000 | - | - | 0,00 | |
| Baloise Holding AG 3% 07.07.2021 | 4.975.000 | 2.225.000 | 4.225.000 | 2.975.000 | 3.061.572 | 0,23 | |
| Bank Cler AG 0,375% 26.04.2027 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.010.500 | 0,08 | |
| Bank Cler AG 0,5% 28.11.2025 | 2.250.000 | - | - | 2.250.000 | 2.270.250 | 0,17 | |
| Banque Cantonale de Geneve 0,125% 23.04.2026 | 1.000.000 | 500.000 | - | 1.500.000 | 1.496.250 | 0,11 | |
| Banque Cantonale de Geneve 0,5% 10.06.2024 | 1.410.000 | - | - | 1.410.000 | 1.429.740 | 0,11 | |
| Banque Cantonale de Geneve 1,125% 28.06.2027 | 1.085.000 | - | - | 1.085.000 | 1.093.138 | 0,08 | |
| Banque Cantonale Vaudoise 0,25% 28.11.2025 | 3.250.000 | - | - | 3.250.000 | 3.282.500 | 0,25 | |
| Banque Cantonale Vaudoise 0,4% 07.04.2031 | 300.000 | - | - | 300.000 | 300.300 | 0,02 | |
| Banque Cantonale Vaudoise 0,5% 13.12.2028 | 940.000 | - | - | 940.000 | 963.500 | 0,07 | |
| Banque Cantonale Vaudoise 0,5% 12.07.2029 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.532.250 | 0,12 | |
| Banque Cantonale Vaudoise 1,5% 28.03.2024 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.057.500 | 0,08 | |
| Banque Cantonale Vaudoise 1,625% 30.11.2026 | 1.280.000 | - | - | 1.280.000 | 1.416.320 | 0,11 | |
| Bell Food Group AG 0,375% 01.02.2024 | 2.205.000 | - | 600.000 | 1.605.000 | 1.588.950 | 0,12 | |
| Bell Food Group AG 0,625% 24.03.2025 | 4.000.000 | - | 1.200.000 | 2.800.000 | 2.794.400 | 0,21 | |
| Bell Food Group AG 0,75% 01.02.2028 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.488.000 | 0,11 | |
| Bell Food Group AG 1,75% 16.05.2022 | 1.950.000 | - | - | 1.950.000 | 1.995.825 | 0,15 | |
| Berner Kantonalbank AG 0,1% 30.09.2039 | - | 800.000 | - | 800.000 | 752.000 | 0,06 | |
| Berner Kantonalbank AG 0,3% 29.05.2030 | - | 600.000 | - | 600.000 | 600.300 | 0,05 | |
| Berner Kantonalbank AG 0,4% 03.05.2027 | 1.500.000 | 1.000.000 | 500.000 | 2.000.000 | 2.035.000 | 0,15 | |
| Berner Kantonalbank AG 0,75% 14.07.2025 | 2.250.000 | - | - | 2.250.000 | 2.324.250 | 0,18 | |
| BKW AG 0,25% 29.07.2027 | - | 2.900.000 | 1.200.000 | 1.700.000 | 1.700.000 | 0,13 | |
| BKW AG 0,75% 15.10.2025 | 1.900.000 | - | - | 1.900.000 | 1.938.000 | 0,15 | |
| BKW AG 2,5% 15.10.2030 | 3.710.000 | - | 600.000 | 3.110.000 | 3.700.900 | 0,28 | |
| BKW AG 3% 27.04.2022 | 1.115.000 | - | - | 1.115.000 | 1.172.980 | 0,09 | |
| Bobst Group SA 0,5% 17.02.2026 | - | 1.150.000 | - | 1.150.000 | 1.085.600 | 0,08 | |
| Bobst Group SA 1,125% 27.09.2024 | 2.500.000 | - | 500.000 | 2.000.000 | 1.989.000 | 0,15 | |
| Bucher Industries AG 0,625% 02.10.2020 | 1.900.000 | - | 1.900.000 | - | - | 0,00 | |
| Bucher Industries AG 1,375% 02.10.2024 | 200.000 | - | - | 200.000 | 206.800 | 0,02 | |
| Buehler Holding AG 0,1% 21.12.2022 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.962.000 | 0,15 | |
| Buehler Holding AG 0,6% 21.12.2026 | 3.000.000 | - | 800.000 | 2.200.000 | 2.161.500 | 0,16 | |
| Cembra Money Bank AG (Null-Kupon) 19.05.2023 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 983.500 | 0,08 | |
| Cembra Money Bank AG 0,1525% 14.10.2026 | - | 2.000.000 | - | 2.000.000 | 1.960.000 | 0,15 | |
| Cembra Money Bank AG 0,18% 05.10.2023 | 1.600.000 | - | - | 1.600.000 | 1.579.200 | 0,12 | |
| Cembra Money Bank AG 0,25% 23.05.2024 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.971.000 | 0,15 | |
| Cembra Money Bank AG 0,285% 19.08.2027 | - | 2.700.000 | 1.000.000 | 1.700.000 | 1.637.950 | 0,12 | |
| Cembra Money Bank AG 0,375% 27.06.2025 | 1.850.000 | - | - | 1.850.000 | 1.832.425 | 0,14 | |
| Cembra Money Bank AG 0,5% 15.09.2021 | 2.300.000 | - | - | 2.300.000 | 2.301.150 | 0,18 | |
| Cembra Money Bank AG 0,875% 08.06.2026 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.011.000 | 0,08 | |
| Cembra Money Bank AG 1,25% 14.10.2022 | 1.725.000 | - | - | 1.725.000 | 1.753.463 | 0,13 | |
| Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG 0,3% 06.10.2027 | 3.175.000 | - | 1.000.000 | 2.175.000 | 2.206.537 | 0,17 | |
| Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG 0,5% 08.10.2020 | 5.300.000 | - | 5.300.000 | - | - | 0,00 | |
| Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG 1% 08.10.2024 | 2.400.000 | - | - | 2.400.000 | 2.504.400 | 0,19 | |
| Clariant AG 1,125% 15.04.2026 | 2.500.000 | 300.000 | 800.000 | 2.000.000 | 2.011.000 | 0,15 | |
| Clientis AG 0,5% 29.06.2022 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.500.000 | 0,11 | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 0,25% 31.07.2020 | 3.100.000 | - | 3.100.000 | - | - | 0,00 | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 0,25% 30.09.2022 | 3.100.000 | - | 1.000.000 | 2.100.000 | 2.107.350 | 0,16 | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 0,5% 19.05.2026 | 4.350.000 | - | - | 4.350.000 | 4.328.250 | 0,33 | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 0,5% 29.09.2027 | 3.250.000 | - | 1.500.000 | 1.750.000 | 1.732.500 | 0,13 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|-----------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 0,75% 05.05.2023 | - | 3.000.000 | - | 3.000.000 | 3.052.500 | 0,23 | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 0,75% 06.06.2025 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.542.500 | 0,19 | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 0,875% 16.06.2021 | 2.600.000 | - | 1.000.000 | 1.600.000 | 1.612.960 | 0,12 | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 0,875% 31.07.2024 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.729.750 | 0,13 | |
| Coop-Gruppe Genossenschaft 1% 29.09.2023 | 1.040.000 | - | - | 1.040.000 | 1.071.200 | 0,08 | |
| Credit Suisse AG 0,55% 15.04.2024 | 2.950.000 | - | - | 2.950.000 | 2.964.750 | 0,23 | |
| Credit Suisse AG 1% 24.09.2021 | 2.950.000 | - | - | 2.950.000 | 2.983.040 | 0,23 | |
| Credit Suisse AG 3,125% 12.11.2030 | 500.000 | - | - | 500.000 | 576.500 | 0,04 | |
| CRH Finance Switzerland AG 1,375% 30.09.2022 | 3.870.000 | - | 800.000 | 3.070.000 | 3.140.610 | 0,24 | |
| Daetwyler Holding AG 0,625% 30.05.2024 | 1.080.000 | - | - | 1.080.000 | 1.102.140 | 0,08 | |
| dormakaba Finance AG 0,375% 13.10.2021 | 3.950.000 | - | 600.000 | 3.350.000 | 3.341.290 | 0,25 | |
| dormakaba Finance AG 1% 13.10.2025 | 3.500.000 | - | - | 3.500.000 | 3.510.500 | 0,27 | |
| Electricite D'emossion SA 1,375% 02.11.2022 | 1.855.000 | - | - | 1.855.000 | 1.879.115 | 0,14 | |
| Emissions- und Finanz AG 0,45% 11.07.2022 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.661.750 | 0,13 | |
| EMMI Finanz AG 0,5% 21.06.2029 | 1.450.000 | - | 500.000 | 950.000 | 957.125 | 0,07 | |
| EMMI Finanz AG 1,625% 12.07.2023 | 2.210.000 | - | 300.000 | 1.910.000 | 1.992.130 | 0,15 | |
| Engadiner Kraftwerk AG 0,125% 02.03.2022 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.998.000 | 0,15 | |
| Engadiner Kraftwerk AG 1,625% 25.04.2024 | 600.000 | - | - | 600.000 | 627.300 | 0,05 | |
| FCA Capital Suisse SA 0,1% 23.10.2023 | - | 2.000.000 | 700.000 | 1.300.000 | 1.233.700 | 0,09 | |
| FCA Capital Suisse SA 0,2% 24.07.2020 | 1.750.000 | - | 1.750.000 | - | - | 0,00 | |
| FCA Capital Suisse SA 0,75% 29.11.2021 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 994.500 | 0,08 | |
| Firmenich International SA 1% 19.12.2023 | - | 2.400.000 | - | 2.400.000 | 2.434.800 | 0,19 | |
| Flughafen Zurich AG 0,2% 26.02.2035 | - | 3.420.000 | - | 3.420.000 | 3.098.520 | 0,24 | |
| Flughafen Zurich AG 0,625% 24.05.2029 | 4.650.000 | - | 1.200.000 | 3.450.000 | 3.434.475 | 0,26 | |
| Flughafen Zurich AG 0,7% 22.05.2024 | - | 1.800.000 | - | 1.800.000 | 1.836.000 | 0,14 | |
| Flughafen Zurich AG 1,25% 03.07.2020 | 2.965.000 | - | 2.965.000 | - | - | 0,00 | |
| Flughafen Zurich AG 1,5% 17.04.2023 | 3.945.000 | - | - | 3.945.000 | 4.063.350 | 0,31 | |
| Galenica AG 0,5% 15.06.2023 | 2.180.000 | - | - | 2.180.000 | 2.154.930 | 0,16 | |
| Galenica AG 1% 15.12.2026 | 2.500.000 | - | 500.000 | 2.000.000 | 2.018.000 | 0,15 | |
| Geberit AG 0,1% 17.10.2024 | 500.000 | 500.000 | - | 1.000.000 | 1.007.000 | 0,08 | |
| Geberit AG 0,3% 17.04.2023 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.510.500 | 0,12 | |
| Geberit AG 0,35% 20.10.2022 | - | 1.750.000 | - | 1.750.000 | 1.764.875 | 0,13 | |
| Geberit AG 0,6% 17.10.2028 | 1.550.000 | - | - | 1.550.000 | 1.618.200 | 0,12 | |
| Georg Fischer AG 1,05% 20.04.2028 | 2.500.000 | - | 700.000 | 1.800.000 | 1.814.400 | 0,14 | |
| Georg Fischer Finanz AG 0,875% 12.05.2026 | 3.150.000 | - | - | 3.150.000 | 3.154.725 | 0,24 | |
| Georg Fischer Finanz AG 2,5% 12.09.2022 | 510.000 | - | - | 510.000 | 531.930 | 0,04 | |
| Givaudan SA (Null-Kupon) 07.12.2022 | 1.050.000 | 500.000 | 1.550.000 | - | - | 0,00 | |
| Givaudan SA 0,375% 09.04.2025 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.003.000 | 0,08 | |
| Givaudan SA 0,625% 05.12.2031 | 2.450.000 | - | - | 2.450.000 | 2.392.425 | 0,18 | |
| Givaudan SA 1% 18.09.2020 | 940.000 | - | 940.000 | - | - | 0,00 | |
| Givaudan SA 1,75% 19.03.2024 | 2.250.000 | - | - | 2.250.000 | 2.373.750 | 0,18 | |
| Givaudan SA 2,125% 07.12.2021 | 1.920.000 | - | - | 1.920.000 | 1.976.640 | 0,15 | |
| Grande Dixence SA 0,8% 17.06.2026 | - | 500.000 | - | 500.000 | 497.500 | 0,04 | |
| Grande Dixence SA 1,125% 04.07.2024 | 2.000.000 | 1.000.000 | 1.600.000 | 1.400.000 | 1.418.200 | 0,11 | |
| Grande Dixence SA 1,25% 06.06.2023 | 1.250.000 | - | - | 1.250.000 | 1.270.625 | 0,10 | |
| Grande Dixence SA 1,375% 18.02.2025 | 1.300.000 | - | - | 1.300.000 | 1.324.700 | 0,10 | |
| Grande Dixence SA 1,75% 12.05.2022 | 2.380.000 | - | - | 2.380.000 | 2.428.790 | 0,18 | |
| Grande Dixence SA 2,375% 10.06.2021 | 310.000 | - | - | 310.000 | 314.960 | 0,02 | |
| GZO AG 1,875% 12.06.2024 | 750.000 | - | - | 750.000 | 777.375 | 0,06 | |
| Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG 0,75% 28.10.2020 | 3.050.000 | - | 3.050.000 | - | - | 0,00 | |
| Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG 1,5% 28.04.2025 | 1.350.000 | - | - | 1.350.000 | 1.397.925 | 0,11 | |
| Hiag Immobilien Holding AG 0,8% 30.05.2022 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 985.500 | 0,08 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|---|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|-----------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Hiag Immobilien Holding AG 0,875% 08.05.2024 | 1.000.000 | 1.000.000 | - | 2.000.000 | 1.972.000 | 0,15 | |
| Hiag Immobilien Holding AG 1% 01.07.2021 | 2.010.000 | - | - | 2.010.000 | 2.008.392 | 0,15 | |
| Hiag Immobilien Holding AG 1% 26.10.2022 | 500.000 | - | - | 500.000 | 494.000 | 0,04 | |
| Hiag Immobilien Holding AG 1% 04.07.2023 | 1.750.000 | - | 700.000 | 1.050.000 | 1.039.500 | 0,08 | |
| Implenia AG 1% 20.03.2026 | 1.000.000 | - | 1.000.000 | - | - | 0,00 | |
| Implenia AG 1,625% 15.10.2024 | 2.350.000 | - | 2.350.000 | - | - | 0,00 | |
| Intershop Holding AG 1,125% 17.04.2023 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 991.500 | 0,08 | |
| Investis Holding SA 0,05% 09.10.2023 | - | 2.000.000 | - | 2.000.000 | 1.903.000 | 0,14 | |
| Investis Holding SA 0,35% 12.06.2020 | 1.500.000 | - | 1.500.000 | - | - | 0,00 | |
| Investis Holding SA 0,55% 15.11.2021 | 1.500.000 | - | 500.000 | 1.000.000 | 982.500 | 0,07 | |
| Investis Holding SA 0,75% 03.10.2022 | 1.900.000 | - | - | 1.900.000 | 1.881.000 | 0,14 | |
| Investis Holding SA 0,773% 15.02.2021 | 700.000 | - | 700.000 | - | - | 0,00 | |
| Julius Baer Group Ltd 0,375% 06.12.2024 | 2.800.000 | - | 700.000 | 2.100.000 | 2.046.450 | 0,16 | |
| Kantonsspital Aarau AG 0,75% 28.05.2032 | 1.400.000 | - | - | 1.400.000 | 1.409.800 | 0,11 | |
| Kantonsspital Baden AG 0,7% 23.05.2028 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.015.000 | 0,08 | |
| Kantonsspital Baden AG 1,1% 23.05.2033 | - | 2.200.000 | 1.000.000 | 1.200.000 | 1.252.200 | 0,10 | |
| Kernkraftwerk Goesgen-Daeniken AG 2% 30.09.2020 | 1.320.000 | - | 1.320.000 | - | - | 0,00 | |
| Kernkraftwerk Leibstadt AG 1,5% 16.12.2022 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.014.000 | 0,15 | |
| Kernkraftwerk Leibstadt AG 1,5% 07.08.2024 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.522.500 | 0,12 | |
| Kernkraftwerk Leibstadt AG 2% 14.02.2025 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.552.500 | 0,12 | |
| Kinderspital Zuerich-Eleonorenstiftung 0,75% 28.07.2036 | 2.250.000 | - | 300.000 | 1.950.000 | 2.001.675 | 0,15 | |
| Kraftwerk Hinterrhein AG 2,375% 28.07.2022 | 550.000 | - | - | 550.000 | 573.925 | 0,04 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 0,5% 09.09.2021 | 1.650.000 | - | - | 1.650.000 | 1.646.535 | 0,13 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 1,25% 11.09.2024 | 2.750.000 | - | - | 2.750.000 | 2.792.625 | 0,21 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 1,5% 06.12.2022 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.545.000 | 0,19 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 2% 11.12.2023 | 3.000.000 | - | 1.000.000 | 2.000.000 | 2.100.000 | 0,16 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 2,375% 10.12.2026 | 2.315.000 | - | 500.000 | 1.815.000 | 1.996.500 | 0,15 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 2,75% 09.06.2023 | 3.105.000 | - | 1.000.000 | 2.105.000 | 2.224.985 | 0,17 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 2,875% 30.06.2031 | 1.380.000 | - | - | 1.380.000 | 1.628.400 | 0,12 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 2,875% 27.03.2042 | 2.350.000 | - | 500.000 | 1.850.000 | 2.215.375 | 0,17 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 3% 02.04.2048 | 2.695.000 | - | 300.000 | 2.395.000 | 3.030.872 | 0,23 | |
| Kraftwerke Linth-Limmern AG 3% 27.09.2052 | 900.000 | - | - | 900.000 | 1.193.400 | 0,09 | |
| Kraftwerke Oberhasli AG 0,7% 30.01.2026 | 1.950.000 | - | 600.000 | 1.350.000 | 1.353.375 | 0,10 | |
| Kraftwerke Oberhasli AG 1,875% 21.02.2025 | 1.135.000 | - | - | 1.135.000 | 1.204.235 | 0,09 | |
| Kuehne + Nagel International AG 0,02% 18.11.2022 | 1.250.000 | 500.000 | - | 1.750.000 | 1.744.750 | 0,13 | |
| Kuehne + Nagel International AG 0,2% 18.06.2025 | 2.025.000 | 200.000 | - | 2.225.000 | 2.164.925 | 0,16 | |
| LafargeHolcim Helvetia Finance Ltd 1,05% 11.04.2022 | - | 2.050.000 | 250.000 | 1.800.000 | 1.817.100 | 0,14 | |
| LafargeHolcim Ltd 0,375% 03.12.2021 | 500.000 | - | - | 500.000 | 499.500 | 0,04 | |
| LafargeHolcim Ltd 1% 11.12.2024 | 5.000.000 | - | - | 5.000.000 | 5.070.000 | 0,39 | |
| LafargeHolcim Ltd 1% 04.12.2025 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.030.000 | 0,15 | |
| LafargeHolcim Ltd 2% 09.06.2022 | 1.685.000 | - | - | 1.685.000 | 1.737.235 | 0,13 | |
| LafargeHolcim Ltd 3% 22.11.2022 | 5.070.000 | 500.000 | 2.000.000 | 3.570.000 | 3.794.910 | 0,29 | |
| Limeco 0,375% 25.09.2026 | 800.000 | - | - | 800.000 | 794.800 | 0,06 | |
| Lonza Swiss Finanz AG 0,125% 01.11.2021 | 250.000 | - | - | 250.000 | 249.500 | 0,02 | |
| Lonza Swiss Finanz AG 0,2% 12.07.2021 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.698.810 | 0,13 | |
| Lonza Swiss Finanz AG 0,625% 22.09.2020 | 2.500.000 | - | 2.500.000 | - | - | 0,00 | |
| Lonza Swiss Finanz AG 0,7% 12.07.2024 | 1.200.000 | - | - | 1.200.000 | 1.217.400 | 0,09 | |
| Lonza Swiss Finanz AG 1% 28.04.2023 | - | 2.850.000 | - | 2.850.000 | 2.915.550 | 0,22 | |
| Lonza Swiss Finanz AG 1,25% 22.09.2023 | 750.000 | - | - | 750.000 | 776.625 | 0,06 | |
| Lonza Swiss Finanz AG 3% 11.10.2022 | 3.650.000 | - | 1.000.000 | 2.650.000 | 2.820.925 | 0,21 | |
| Luzerner Kantonalbank AG 3% 27.12.2021 | 2.350.000 | - | - | 2.350.000 | 2.446.350 | 0,19 | |
| Migros Bank AG 0,25% 10.12.2027 | - | 1.800.000 | - | 1.800.000 | 1.787.400 | 0,14 | |
| Mobimo Holding AG 0,25% 23.03.2028 | - | 1.900.000 | - | 1.900.000 | 1.831.600 | 0,14 | |
| Mobimo Holding AG 0,75% 20.03.2026 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.027.000 | 0,15 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|---|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|-----------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Mobimo Holding AG 0,875% 02.10.2023 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.014.500 | 0,08 | |
| Mobimo Holding AG 1,625% 19.05.2021 | 2.720.000 | - | 1.000.000 | 1.720.000 | 1.738.232 | 0,13 | |
| Mobimo Holding AG 1,875% 16.09.2024 | 2.100.000 | - | - | 2.100.000 | 2.230.200 | 0,17 | |
| Nant de Drance SA 1,25% 23.10.2023 | 1.750.000 | - | 700.000 | 1.050.000 | 1.064.175 | 0,08 | |
| Nant de Drance SA 1,25% 25.06.2027 | - | 335.000 | - | 335.000 | 337.513 | 0,03 | |
| Nant de Drance SA 1,5% 15.02.2021 | 2.375.000 | - | 2.375.000 | - | - | 0,00 | |
| Nant de Drance SA 1,55% 19.08.2025 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.542.000 | 0,12 | |
| Nant de Drance SA 1,75% 18.07.2024 | 3.770.000 | - | - | 3.770.000 | 3.905.720 | 0,30 | |
| Nant de Drance SA 2% 02.02.2026 | 2.900.000 | - | 1.000.000 | 1.900.000 | 2.003.550 | 0,15 | |
| Nant de Drance SA 2,375% 15.02.2028 | 3.035.000 | - | - | 3.035.000 | 3.300.562 | 0,25 | |
| Nestle SA 0,25% 28.06.2024 | 8.040.000 | 500.000 | 2.000.000 | 6.540.000 | 6.696.960 | 0,51 | |
| Nestle SA 0,75% 28.06.2028 | 7.700.000 | - | 1.100.000 | 6.600.000 | 6.930.000 | 0,53 | |
| Novartis AG 0,25% 13.05.2025 | 5.350.000 | - | - | 5.350.000 | 5.414.200 | 0,41 | |
| Novartis AG 0,625% 13.11.2029 | 5.845.000 | - | 1.000.000 | 4.845.000 | 5.128.432 | 0,39 | |
| Novartis AG 1,05% 11.05.2035 | 3.580.000 | - | 700.000 | 2.880.000 | 3.263.040 | 0,25 | |
| OC Oerlikon Corp AG 2,625% 17.06.2024 | 1.650.000 | - | - | 1.650.000 | 1.697.850 | 0,13 | |
| Orior AG 0,625% 26.09.2023 | 1.600.000 | - | - | 1.600.000 | 1.593.600 | 0,12 | |
| Panalpina Welttransport Holding AG 1% 12.12.2022 | 1.450.000 | - | - | 1.450.000 | 1.432.600 | 0,11 | |
| Partners Group Holding AG 0,15% 07.06.2024 | 3.750.000 | 500.000 | 1.000.000 | 3.250.000 | 3.220.750 | 0,25 | |
| Partners Group Holding AG 0,4% 21.06.2027 | 2.000.000 | 6.800.000 | 4.800.000 | 4.000.000 | 3.980.000 | 0,30 | |
| PSP Swiss Property AG (Null-Kupon) 01.09.2023 | 3.500.000 | - | 1.000.000 | 2.500.000 | 2.475.000 | 0,19 | |
| PSP Swiss Property AG (Null-Kupon) 06.02.2030 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 954.000 | 0,07 | |
| PSP Swiss Property AG 0,06% 11.02.2022 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 996.000 | 0,08 | |
| PSP Swiss Property AG 0,15% 02.02.2029 | - | 1.500.000 | - | 1.500.000 | 1.469.250 | 0,11 | |
| PSP Swiss Property AG 0,375% 29.04.2026 | 2.750.000 | - | 700.000 | 2.050.000 | 2.066.400 | 0,16 | |
| PSP Swiss Property AG 0,5% 16.02.2024 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.530.000 | 0,19 | |
| PSP Swiss Property AG 0,55% 04.02.2028 | 1.200.000 | 500.000 | - | 1.700.000 | 1.729.750 | 0,13 | |
| PSP Swiss Property AG 0,7% 08.02.2027 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.543.500 | 0,12 | |
| PSP Swiss Property AG 1% 06.02.2025 | 1.150.000 | - | - | 1.150.000 | 1.193.700 | 0,09 | |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 0,3% 22.04.2025 | 4.250.000 | - | 1.500.000 | 2.750.000 | 2.755.500 | 0,21 | |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 0,35% 16.02.2024 | 5.250.000 | - | 1.000.000 | 4.250.000 | 4.271.250 | 0,33 | |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 0,75% 22.04.2031 | 1.200.000 | - | - | 1.200.000 | 1.247.400 | 0,10 | |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 1,625% 07.02.2022 | 1.920.000 | - | - | 1.920.000 | 1.966.080 | 0,15 | |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 2% 21.09.2023 | 4.205.000 | - | 1.000.000 | 3.205.000 | 3.394.095 | 0,26 | |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 2,625% 04.02.2026 | 810.000 | - | - | 810.000 | 916.920 | 0,07 | |
| Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 3,875% 21.12.2021 | 3.640.000 | - | - | 3.640.000 | 3.785.600 | 0,29 | |
| Roche Kapitalmarkt AG 0,1% 23.09.2024 | 9.355.000 | - | 2.000.000 | 7.355.000 | 7.476.357 | 0,57 | |
| Roche Kapitalmarkt AG 0,25% 24.09.2025 | 4.000.000 | - | - | 4.000.000 | 4.084.000 | 0,31 | |
| Roche Kapitalmarkt AG 0,45% 23.03.2029 | 2.650.000 | - | - | 2.650.000 | 2.713.600 | 0,21 | |
| Roche Kapitalmarkt AG 0,75% 24.09.2030 | 5.500.000 | - | 1.000.000 | 4.500.000 | 4.716.000 | 0,36 | |
| Roche Kapitalmarkt AG 1,625% 23.09.2022 | 5.570.000 | - | 1.000.000 | 4.570.000 | 4.777.935 | 0,36 | |
| Schindler Holding AG 0,25% 05.06.2023 | 4.600.000 | - | 700.000 | 3.900.000 | 3.923.400 | 0,30 | |
| See-Spital 1,25% 03.07.2026 | 1.500.000 | - | 800.000 | 700.000 | 717.150 | 0,05 | |
| Services Industriels de Geneve SIG 1,25% 30.06.2025 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.585.500 | 0,12 | |
| SGS SA 0,25% 08.05.2023 | 3.115.000 | - | - | 3.115.000 | 3.119.672 | 0,24 | |
| SGS SA 0,45% 06.11.2023 | - | 500.000 | - | 500.000 | 502.250 | 0,04 | |
| SGS SA 0,55% 03.03.2026 | 2.750.000 | - | 1.000.000 | 1.750.000 | 1.770.125 | 0,13 | |
| SGS SA 0,75% 29.10.2025 | 3.500.000 | - | - | 3.500.000 | 3.563.000 | 0,27 | |
| SGS SA 0,875% 08.05.2030 | 2.100.000 | - | 500.000 | 1.600.000 | 1.624.800 | 0,12 | |
| SGS SA 0,95% 06.11.2026 | - | 2.600.000 | - | 2.600.000 | 2.700.100 | 0,21 | |
| SGS SA 1,25% 27.10.2028 | 2.750.000 | - | - | 2.750.000 | 2.919.125 | 0,22 | |
| SGS SA 1,375% 25.02.2022 | 4.700.000 | - | 2.000.000 | 2.700.000 | 2.748.600 | 0,21 | |
| SGS SA 1,75% 27.02.2024 | 3.190.000 | - | - | 3.190.000 | 3.351.095 | 0,26 | |
| SGS SA 3% 27.05.2021 | 895.000 | - | 895.000 | - | - | 0,00 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|---|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | |
| Sika AG 0,125% 12.07.2021 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.000.200 | 0,08 |
| Sika AG 0,6% 27.03.2026 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.504.500 | 0,11 |
| Sika AG 0,625% 12.07.2024 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.551.250 | 0,19 |
| Sika AG 1,125% 12.07.2028 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.560.000 | 0,12 |
| Sika AG 1,75% 12.07.2022 | 1.770.000 | - | - | 1.770.000 | 1.826.640 | 0,14 |
| Sika AG 1,875% 14.11.2023 | 2.410.000 | - | 700.000 | 1.710.000 | 1.815.165 | 0,14 |
| Sika AG Regs 1,125% 14.11.2019 | 310.000 | - | 310.000 | - | - | 0,00 |
| Sonova Holding AG (Null-Kupon) 11.10.2029 | - | 500.000 | - | 500.000 | 468.500 | 0,04 |
| Sonova Holding AG 0,01% 11.10.2021 | 4.100.000 | - | - | 4.100.000 | 4.079.090 | 0,31 |
| Sonova Holding AG 0,4% 11.10.2034 | - | 675.000 | - | 675.000 | 634.163 | 0,05 |
| Sonova Holding AG 0,55% 06.04.2022 | - | 2.150.000 | - | 2.150.000 | 2.163.975 | 0,16 |
| Sonova Holding AG 0,75% 06.10.2028 | - | 950.000 | - | 950.000 | 957.125 | 0,07 |
| Spital Limmattal 0,55% 15.05.2025 | 150.000 | - | - | 150.000 | 150.225 | 0,01 |
| Spital Limmattal 1,875% 29.11.2023 | 2.500.000 | - | 600.000 | 1.900.000 | 2.029.200 | 0,15 |
| St Galler Kantonalbank AG 1% 30.11.2027 | 1.500.000 | - | 800.000 | 700.000 | 721.000 | 0,06 |
| St Galler Kantonalbank AG 2,625% 30.06.2021 | 2.300.000 | - | - | 2.300.000 | 2.347.150 | 0,18 |
| Stadler Rail AG 0,375% 20.11.2026 | - | 2.100.000 | - | 2.100.000 | 2.060.100 | 0,16 |
| Straumann Holding AG 1% 03.10.2023 | - | 2.650.000 | - | 2.650.000 | 2.679.150 | 0,20 |
| Sulzer AG 0,375% 11.07.2022 | 4.200.000 | - | 1.500.000 | 2.700.000 | 2.683.800 | 0,20 |
| Sulzer AG 0,875% 10.07.2026 | 1.400.000 | - | - | 1.400.000 | 1.374.800 | 0,10 |
| Sulzer AG 1,3% 06.07.2023 | 3.100.000 | - | - | 3.100.000 | 3.135.650 | 0,24 |
| Sulzer AG RegS 0,625% 22.10.2021 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.000.400 | 0,15 |
| Sulzer AG RegS 1,6% 22.10.2024 | 3.450.000 | - | 1.100.000 | 2.350.000 | 2.360.575 | 0,18 |
| Sunrise Communications AG 1,5% 27.06.2024 | 2.700.000 | - | 700.000 | 2.000.000 | 2.042.000 | 0,16 |
| Swiss Life Holding AG (Null-Kupon) 06.06.2025 | - | 510.000 | - | 510.000 | 495.210 | 0,04 |
| Swiss Life Holding AG 0,25% 11.10.2023 | 3.000.000 | - | 400.000 | 2.600.000 | 2.590.900 | 0,20 |
| Swiss Life Holding AG 0,35% 06.03.2029 | - | 2.400.000 | - | 2.400.000 | 2.344.800 | 0,18 |
| Swiss Life Holding AG 1,875% 21.06.2023 | 2.450.000 | - | - | 2.450.000 | 2.556.575 | 0,19 |
| Swiss Prime Site AG 0,375% 30.09.2031 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 940.500 | 0,07 |
| Swiss Prime Site AG 0,5% 03.11.2025 | 3.850.000 | - | 1.000.000 | 2.850.000 | 2.807.250 | 0,21 |
| Swiss Prime Site AG 0,825% 11.05.2026 | 1.850.000 | - | - | 1.850.000 | 1.843.525 | 0,14 |
| Swiss Prime Site AG 1% 16.07.2024 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.515.750 | 0,12 |
| Swiss Prime Site AG 1,25% 02.04.2027 | 3.400.000 | 500.000 | - | 3.900.000 | 4.020.900 | 0,31 |
| Swiss Prime Site AG 1,75% 16.04.2021 | 3.570.000 | - | 1.300.000 | 2.270.000 | 2.291.565 | 0,17 |
| Swiss Prime Site AG 2% 21.10.2020 | 2.270.000 | - | 2.270.000 | - | - | 0,00 |
| Swiss Prime Site AG 2% 10.12.2024 | 1.050.000 | 500.000 | - | 1.550.000 | 1.636.025 | 0,12 |
| Swiss Reinsurance Co Ltd 0,75% 21.01.2027 | 4.300.000 | - | 1.000.000 | 3.300.000 | 3.415.500 | 0,26 |
| Swiss Reinsurance Co Ltd 1% 17.09.2024 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.040.500 | 0,08 |
| Swisscom AG (Null-Kupon) 30.08.2044 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 915.000 | 0,07 |
| Swisscom AG 0,125% 15.09.2032 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.431.250 | 0,19 |
| Swisscom AG 0,25% 17.04.2023 | 3.300.000 | - | - | 3.300.000 | 3.334.650 | 0,25 |
| Swisscom AG 0,375% 31.05.2027 | 3.900.000 | - | 2.500.000 | 1.400.000 | 1.440.600 | 0,11 |
| Swisscom AG 0,375% 15.12.2027 | 1.500.000 | - | - | 1.500.000 | 1.544.250 | 0,12 |
| Swisscom AG 0,375% 31.03.2028 | 2.700.000 | - | - | 2.700.000 | 2.778.300 | 0,21 |
| Swisscom AG 0,5% 15.03.2029 | 2.700.000 | 300.000 | - | 3.000.000 | 3.108.000 | 0,24 |
| Swisscom AG 0,75% 12.10.2028 | 2.500.000 | - | 500.000 | 2.000.000 | 2.114.000 | 0,16 |
| Swisscom AG 0,75% 24.11.2033 | 3.650.000 | - | 500.000 | 3.150.000 | 3.400.425 | 0,26 |
| Swisscom AG 1% 17.04.2035 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.898.900 | 0,14 |
| Swisscom AG 1,5% 14.07.2026 | 3.150.000 | - | 1.000.000 | 2.150.000 | 2.358.550 | 0,18 |
| Swisscom AG 1,5% 28.09.2029 | 2.715.000 | - | 1.000.000 | 1.715.000 | 1.937.093 | 0,15 |
| Swisscom AG 1,75% 10.07.2024 | 3.580.000 | - | - | 3.580.000 | 3.855.660 | 0,29 |
| Swisscom AG 2,625% 31.08.2022 | 4.960.000 | - | 500.000 | 4.460.000 | 4.743.210 | 0,36 |
| Swissgrid AG (Null-Kupon) 30.06.2028 | - | 1.100.000 | - | 1.100.000 | 1.092.300 | 0,08 |
| Swissgrid AG 0,05% 30.06.2050 | - | 1.400.000 | - | 1.400.000 | 1.252.300 | 0,10 |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|---|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Swissgrid AG 0,2% 30.06.2032 | - | 1.390.000 | - | 1.390.000 | 1.378.880 | 0,11 | |
| Swissgrid AG 0,625% 25.02.2030 | 1.650.000 | - | 500.000 | 1.150.000 | 1.204.050 | 0,09 | |
| Swissgrid AG 1,625% 30.01.2025 | 3.650.000 | - | - | 3.650.000 | 3.947.475 | 0,30 | |
| Syngenta Finance AG 0,125% 09.12.2022 | - | 2.300.000 | - | 2.300.000 | 2.240.200 | 0,17 | |
| Syngenta Finance AG 0,7% 09.12.2026 | - | 3.550.000 | - | 3.550.000 | 3.322.800 | 0,25 | |
| UBS AG 0,17% 13.05.2022 | - | 1.300.000 | - | 1.300.000 | 1.303.250 | 0,10 | |
| UBS Group AG 0,625% 18.05.2024 | 4.200.000 | - | - | 4.200.000 | 4.225.200 | 0,32 | |
| UBS Group AG 0,75% 22.02.2022 | 3.600.000 | - | 800.000 | 2.800.000 | 2.812.600 | 0,21 | |
| UBS Group AG 0,875% 30.01.2025 | 4.600.000 | - | 800.000 | 3.800.000 | 3.847.500 | 0,29 | |
| UBS Group AG 1,25% 23.02.2026 | 1.600.000 | - | 600.000 | 1.000.000 | 1.038.000 | 0,08 | |
| Universitaetsspital Zuerich 0,55% 28.09.2028 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 1.049.000 | 0,08 | |
| Vifor Pharma AG 0,75% 13.09.2022 | 4.000.000 | - | - | 4.000.000 | 4.016.000 | 0,31 | |
| Zug Estates Holding AG 0,7% 17.02.2022 | 1.750.000 | - | - | 1.750.000 | 1.747.375 | 0,13 | |
| Zurich Insurance Co Ltd 0,1% 27.08.2032 | - | 2.400.000 | - | 2.400.000 | 2.331.600 | 0,18 | |
| Zurich Insurance Co Ltd 0,5% 18.12.2024 | 4.000.000 | - | 1.000.000 | 3.000.000 | 3.033.000 | 0,23 | |
| Zurich Insurance Co Ltd 0,625% 22.07.2020 | 2.230.000 | - | 2.230.000 | - | - | 0,00 | |
| Zurich Insurance Co Ltd 0,75% 22.10.2027 | 2.500.000 | - | 600.000 | 1.900.000 | 1.973.150 | 0,15 | |
| Zurich Insurance Co Ltd 1% 30.10.2028 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.102.000 | 0,16 | |
| Zurich Insurance Co Ltd 1,5% 22.07.2026 | 1.370.000 | - | - | 1.370.000 | 1.477.545 | 0,11 | |
| Zurich Insurance Co Ltd 1,875% 18.09.2023 | 950.000 | - | - | 950.000 | 1.004.625 | 0,08 | |
| Zurich Insurance Co Ltd 2,875% 27.07.2021 | 3.470.000 | - | 500.000 | 2.970.000 | 3.063.258 | 0,23 | |
| | | | | | 612.507.622 | 46,59 | |
| Spanien | | | | | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0,125% 27.08.2026 | - | 1.400.000 | - | 1.400.000 | 1.323.700 | 0,10 | |
| Banco Santander SA 0,2% 19.11.2027 | - | 1.500.000 | - | 1.500.000 | 1.419.000 | 0,11 | |
| Banco Santander SA 0,75% 12.06.2023 | 4.400.000 | - | 1.000.000 | 3.400.000 | 3.384.700 | 0,26 | |
| Banco Santander SA 1% 10.12.2024 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 2.000.000 | 0,15 | |
| Banco Santander SA 1,125% 20.07.2027 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.925.000 | 0,14 | |
| Cellnex Telecom SA 0,775% 18.02.2027 | - | 1.850.000 | - | 1.850.000 | 1.803.750 | 0,14 | |
| Santander Consumer Finance SA 0,15% 10.12.2024 | - | 1.800.000 | - | 1.800.000 | 1.791.000 | 0,13 | |
| Santander Consumer Finance SA 0,5% 05.10.2020 | 1.500.000 | - | 1.500.000 | - | - | 0,00 | |
| Santander Consumer Finance SA 0,6% 23.03.2021 | 1.500.000 | - | 1.500.000 | - | - | 0,00 | |
| Santander Consumer Finance SA 0,625% 24.10.2022 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.705.950 | 0,13 | |
| Telefonica Emisiones SA 2,595% 23.10.2020 | 2.520.000 | - | 2.520.000 | - | - | 0,00 | |
| Telefonica Emisiones SA 3,45% 14.12.2022 | 1.670.000 | - | - | 1.670.000 | 1.806.940 | 0,14 | |
| | | | | | 17.160.040 | 1,30 | |
| Südkorea | | | | | | | |
| GS Caltex Corp 0,633% 31.01.2024 | 1.500.000 | - | 500.000 | 1.000.000 | 920.000 | 0,07 | |
| Hyundai Capital Services Inc 0,26% 11.02.2025 | - | 2.900.000 | - | 2.900.000 | 2.770.950 | 0,21 | |
| Hyundai Capital Services Inc 0,695% 27.06.2023 | 2.500.000 | 200.000 | - | 2.700.000 | 2.705.400 | 0,21 | |
| Hyundai Capital Services Inc 0,7325% 26.02.2024 | 3.000.000 | 600.000 | 1.000.000 | 2.600.000 | 2.568.800 | 0,20 | |
| KEB Hana Bank 0,4075% 14.09.2023 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 993.500 | 0,08 | |
| Korea Expressway Corp 0,25% 07.06.2024 | 2.400.000 | - | - | 2.400.000 | 2.400.000 | 0,18 | |
| Korea Gas Corp (Null-Kupon) 28.11.2023 | 1.500.000 | 2.200.000 | 1.000.000 | 2.700.000 | 2.679.750 | 0,20 | |
| Korea Gas Corp 0,2075% 02.08.2023 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.993.000 | 0,15 | |
| Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd (Null-Kupon) 19.07.2024 | - | 3.100.000 | 800.000 | 2.300.000 | 2.289.650 | 0,17 | |
| Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd 0,05% 19.07.2027 | - | 2.000.000 | 1.000.000 | 1.000.000 | 965.500 | 0,07 | |
| Korea National Oil Corp (Null-Kupon) 04.10.2024 | - | 3.000.000 | - | 3.000.000 | 2.953.500 | 0,23 | |
| Korea National Oil Corp 0,373% 01.06.2023 | 4.250.000 | 500.000 | - | 4.750.000 | 4.757.125 | 0,36 | |
| Korea National Oil Corp 0,875% 21.04.2025 | - | 1.800.000 | - | 1.800.000 | 1.845.000 | 0,14 | |
| Korea Railroad Corp (Null-Kupon) 19.11.2024 | - | 1.500.000 | - | 1.500.000 | 1.479.750 | 0,11 | |
| Korea Railroad Corp (Null-Kupon) 13.06.2025 | - | 2.100.000 | 1.000.000 | 1.100.000 | 1.079.100 | 0,08 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|-------------------|---------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | | |
| Korea Water Resources Corp 0,15% 20.09.2023 | 2.100.000 | 1.000.000 | 1.500.000 | 1.600.000 | 1.594.400 | 0,12 | |
| Korea Western Power Co Ltd 0,125% 27.02.2024 | 2.950.000 | - | 500.000 | 2.450.000 | 2.431.625 | 0,19 | |
| | | | | | 36.427.050 | 2,77 | |
| Vereinigte Arabische Emirate | | | | | | | |
| Emirates NBD Bank PJSC 0,625% 09.02.2023 | 3.500.000 | - | 1.000.000 | 2.500.000 | 2.446.250 | 0,19 | |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 0,07% 18.10.2027 | - | 1.500.000 | - | 1.500.000 | 1.351.500 | 0,10 | |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 0,205% 04.12.2025 | - | 1.600.000 | - | 1.600.000 | 1.548.800 | 0,12 | |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 0,3225% 27.09.2023 | 1.000.000 | - | - | 1.000.000 | 982.500 | 0,07 | |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 0,401% 02.10.2024 | 3.000.000 | 500.000 | 1.200.000 | 2.300.000 | 2.244.800 | 0,17 | |
| First Gulf Bank PJSC 0,625% 27.05.2022 | 2.000.000 | - | - | 2.000.000 | 1.970.000 | 0,15 | |
| | | | | | 10.543.850 | 0,80 | |
| Vereinigte Staaten von Amerika | | | | | | | |
| Amgen Inc 0,41% 08.03.2023 | 8.300.000 | - | 1.400.000 | 6.900.000 | 6.951.750 | 0,53 | |
| Apple Inc 0,375% 25.11.2024 | 9.675.000 | - | 1.400.000 | 8.275.000 | 8.494.287 | 0,65 | |
| Apple Inc 0,75% 25.02.2030 | 4.130.000 | - | 700.000 | 3.430.000 | 3.634.085 | 0,28 | |
| AT&T Inc 1,375% 04.12.2024 | 5.010.000 | - | 700.000 | 4.310.000 | 4.480.245 | 0,34 | |
| AT&T Inc 1,875% 04.12.2030 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.843.650 | 0,14 | |
| Bank of America Corp 0,2525% 12.06.2026 | 2.900.000 | 2.600.000 | 2.000.000 | 3.500.000 | 3.437.000 | 0,26 | |
| Citigroup Inc 0,5% 22.11.2024 | 4.250.000 | - | 1.000.000 | 3.250.000 | 3.271.125 | 0,25 | |
| Citigroup Inc 0,5% 01.11.2028 | - | 3.000.000 | - | 3.000.000 | 2.913.000 | 0,22 | |
| Citigroup Inc 0,75% 02.04.2026 | 2.500.000 | - | - | 2.500.000 | 2.531.250 | 0,19 | |
| Citigroup Inc 3,125% 27.09.2021 | 2.490.000 | - | - | 2.490.000 | 2.583.126 | 0,20 | |
| Coca-Cola Co 0,25% 22.12.2022 | 5.805.000 | - | 1.000.000 | 4.805.000 | 4.843.440 | 0,37 | |
| Coca-Cola Co 1% 02.10.2028 | 6.410.000 | - | 700.000 | 5.710.000 | 6.006.920 | 0,46 | |
| Eli Lilly and Co 0,15% 24.05.2024 | 6.725.000 | - | 1.500.000 | 5.225.000 | 5.266.800 | 0,40 | |
| Eli Lilly and Co 0,45% 24.05.2028 | 4.070.000 | - | - | 4.070.000 | 4.063.895 | 0,31 | |
| Goldman Sachs Group Inc 0,5% 04.12.2024 | 3.250.000 | - | - | 3.250.000 | 3.219.125 | 0,24 | |
| Goldman Sachs Group Inc 0,55% 09.09.2021 | 3.200.000 | - | 1.000.000 | 2.200.000 | 2.203.960 | 0,17 | |
| Goldman Sachs Group Inc 1% 24.11.2025 | 3.500.000 | - | 700.000 | 2.800.000 | 2.840.600 | 0,22 | |
| Jackson National Life Global Funding 0,125% 14.07.2028 | - | 750.000 | 750.000 | - | - | 0,00 | |
| Jackson National Life Global Funding 0,3% 18.12.2023 | 2.000.000 | - | 2.000.000 | - | - | 0,00 | |
| Jackson National Life Global Funding 0,375% 18.07.2025 | 2.900.000 | - | 2.900.000 | - | - | 0,00 | |
| JPMorgan Chase & Co 0,45% 11.11.2026 | 2.400.000 | - | 500.000 | 1.900.000 | 1.900.950 | 0,14 | |
| JPMorgan Chase & Co 0,5% 04.12.2023 | 7.780.000 | - | 1.000.000 | 6.780.000 | 6.881.700 | 0,52 | |
| JPMorgan Chase & Co 1,125% 06.11.2020 | 1.350.000 | - | 1.350.000 | - | - | 0,00 | |
| McDonald's Corp 0,17% 04.10.2024 | 4.250.000 | - | - | 4.250.000 | 4.258.500 | 0,32 | |
| Metropolitan Life Global Funding I 0,125% 11.06.2027 | 2.000.000 | - | 2.000.000 | - | - | 0,00 | |
| Mondelez International Inc 0,617% 30.09.2024 | 1.700.000 | - | - | 1.700.000 | 1.704.250 | 0,13 | |
| Mondelez International Inc 0,625% 06.10.2020 | 1.500.000 | - | 1.500.000 | - | - | 0,00 | |
| Mondelez International Inc 0,625% 30.12.2021 | 3.500.000 | - | 700.000 | 2.800.000 | 2.800.000 | 0,21 | |
| Mondelez International Inc 0,65% 26.07.2022 | 1.550.000 | - | - | 1.550.000 | 1.552.325 | 0,12 | |
| Mondelez International Inc 1,125% 21.12.2023 | 2.250.000 | - | - | 2.250.000 | 2.304.000 | 0,17 | |
| Mondelez International Inc 1,125% 30.12.2025 | 2.300.000 | - | 600.000 | 1.700.000 | 1.751.000 | 0,13 | |
| Nestle Holdings Inc 0,25% 04.10.2027 | 3.800.000 | - | - | 3.800.000 | 3.879.800 | 0,29 | |
| Nestle Holdings Inc 0,55% 04.10.2032 | 3.250.000 | - | 1.600.000 | 1.650.000 | 1.673.925 | 0,13 | |
| Philip Morris International Inc 1% 18.09.2020 | 4.325.000 | - | 4.325.000 | - | - | 0,00 | |
| Philip Morris International Inc 1,625% 16.05.2024 | 1.900.000 | 1.000.000 | 500.000 | 2.400.000 | 2.484.000 | 0,19 | |
| Philip Morris International Inc 2% 06.12.2021 | 3.350.000 | - | 1.000.000 | 2.350.000 | 2.408.750 | 0,18 | |
| Verizon Communications Inc 0,375% 31.05.2023 | 7.250.000 | - | 1.800.000 | 5.450.000 | 5.509.950 | 0,42 | |
| Verizon Communications Inc 1% 30.11.2027 | 4.000.000 | - | - | 4.000.000 | 4.188.000 | 0,32 | |
| Wells Fargo & Co 0,375% 02.06.2022 | 2.800.000 | - | 500.000 | 2.300.000 | 2.296.550 | 0,17 | |
| Wells Fargo & Co 0,5% 02.11.2023 | 5.500.000 | - | - | 5.500.000 | 5.502.750 | 0,42 | |
| Wells Fargo & Co 0,625% 03.09.2020 | 1.950.000 | 1.700.000 | 3.650.000 | - | - | 0,00 | |

iSHARES ETF (CH)

PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG UND BESTANDESVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

iSHARES CORE CHF CORPORATE BOND ETF (CH) (FORTSETZUNG)

Für das am 31. Mai 2020 abgelaufene Berichtsjahr

| Wertpapierbezeichnung | 31. Mai 2019 | | 31. Mai 2020 | | Verkehrswert CHF | % des Gesamten Teilfonds- vermögens |
|--|------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|----------------------|--|
| | Anzahl/ Nominalwert | Käufe ¹ | Verkäufe ¹ | Anzahl/ Nominalwert | | |
| Obligationen (Fortsetzung) | | | | | | |
| Wells Fargo & Co 0,75% 27.05.2025 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 999.000 | 0,08 |
| Wells Fargo & Co 1,125% 26.05.2028 | - | 1.000.000 | - | 1.000.000 | 1.005.000 | 0,08 |
| Wells Fargo & Co 1,25% 03.09.2024 | 2.740.000 | - | 1.200.000 | 1.540.000 | 1.580.040 | 0,12 |
| | | | | | 123.264.748 | 9,37 |
| Vereinigtes Königreich | | | | | | |
| Barclays Plc 1,125% 12.07.2023 | 2.000.000 | - | 400.000 | 1.600.000 | 1.612.800 | 0,12 |
| BAT International Finance Plc 0,625% 08.09.2021 | 4.880.000 | - | 1.000.000 | 3.880.000 | 3.888.148 | 0,30 |
| BAT International Finance Plc 1,375% 08.09.2026 | 2.650.000 | - | - | 2.650.000 | 2.746.725 | 0,21 |
| BP Capital Markets Plc 0,75% 27.09.2021 | 2.200.000 | - | - | 2.200.000 | 2.211.000 | 0,17 |
| BP Capital Markets Plc 1% 28.08.2020 | 3.210.000 | - | 3.210.000 | - | - | 0,00 |
| BP Capital Markets Plc 1,75% 28.02.2024 | 2.020.000 | - | - | 2.020.000 | 2.093.730 | 0,16 |
| Lloyds Banking Group Plc 1% 04.03.2025 | 4.500.000 | - | 800.000 | 3.700.000 | 3.714.800 | 0,28 |
| NatWest Markets Plc 0,125% 13.09.2023 | - | 2.600.000 | - | 2.600.000 | 2.512.900 | 0,19 |
| Vodafone Group Plc 0,375% 03.12.2024 | 3.300.000 | - | - | 3.300.000 | 3.319.800 | 0,25 |
| Vodafone Group Plc 0,5% 19.09.2031 | 2.000.000 | - | 300.000 | 1.700.000 | 1.722.100 | 0,13 |
| Vodafone Group Plc 0,625% 15.03.2027 | 1.950.000 | - | 600.000 | 1.350.000 | 1.389.825 | 0,11 |
| | | | | | 25.211.828 | 1,92 |
| Total Obligationen | | | | | 1.302.984.962 | 99,10 |
| Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden | | | | | 1.302.984.962 | 99,10 |
| Total Effekten | | | | | 1.302.984.962 | 99,10 |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | |
| Fixed Income Futures | | | | | | |
| Swiss Confederation Bond Future Juni 2019 | (85) | 85 | - | - | - | 0,00 |
| Swiss Confederation Bond Future September 2019 | - | 78 | 78 | - | - | 0,00 |
| | | | | | - | 0,00 |
| Total derivative Finanzinstrumente | | | | | - | 0,00 |
| Total Anlagen | | | | | 1.302.984.962 | 99,10 |
| Sichtguthaben | | | | | 270.099 | 0,02 |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | 11.520.388 | 0,88 |
| Gesamtes Teilfondsvermögen | | | | | 1.314.775.449 | 100,00 |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | (3.378.051) | (0,26) |
| Nettoteilfondsvermögen | | | | | 1.311.397.398 | 99,74 |

¹ Inklusive der Kapitalmassnahmen, soweit anwendbar.

HAFTUNGSAUSSCHLUSS

Verwendung der Marken SBI®, SLI®, SMI®, SMIM® und SPI®

Diese Wertschriften werden in keiner Weise von SIX Swiss Exchange AG unterstützt, abgetreten, verkauft oder beworben und SIX Swiss Exchange AG leistet in keiner Weise (weder ausdrücklich noch stillschweigend) Gewähr für die Ergebnisse, welche durch den Gebrauch des Swiss Leaders Index (SLI®), Swiss Market Index (SMI®), SMI MID Index (SMIM®), Swiss Bond Index Domestic Government (SBI® Domestic Government), SBI® Corporate Total Return, Swiss Performance Index (SPI®) und SPI® Select Dividend 20 Index («die Indizes») erzielt werden können, und/oder für die Höhe der Indizes zu einer bestimmten Zeit an einem bestimmten Datum. SIX Swiss Exchange AG ist nicht haftbar (weder aus fahrlässigem noch aus anderem Verhalten) für irgendwelche Fehler, die die Indizes aufweisen, und SIX Swiss Exchange AG ist in keiner Weise verpflichtet, auf solche Fehler aufmerksam zu machen.

® SIX, SIX Swiss Exchange, SPI, Swiss Performance Index (SPI), SPI EXTRA, SPI ex SLI, SMI, SMI Swiss Market Index, Swiss Market Index (SMI), SMIM, SMI MID (SMIM), SMI Expanded, SXI, SXI Real Estate, SXI Swiss Real Estate, SXI Life Sciences, SXI Bio+Medtech, SLI, SLI Swiss Leader Index, SBI, SBI Swiss Bond Index, SAR, SAR SWISS AVERAGE RATE, SARON, SCR, SCR SWISS CURRENT RATE, SCRON, SAION, SCION, VSMI, SWX Immobilienfonds Index, MQM, MQM Market Quality Metrics, QQM, QQM Quotes Quality Metrics sind in der Schweiz und/oder im Ausland eingetragene respektive hinterlegte Marken von SIX Group AG bzw. SIX Swiss Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist.

Erfahren Sie mehr?

iShares.com | +41 (0) 800 33 66 88

© 2020 BlackRock, Inc. Alle Rechte vorbehalten. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS, ALADDIN, iSHARES, LIFEPATH, WAS ALSO SOLL ICH MIT MEINEM GELD TUN, INVESTIEREN IN EINER NEUEN WELT und BUILT FOR THESE TIMES sind eingetragene und nicht eingetragene Handelsmarken von BlackRock, Inc. oder ihren Niederlassungen in den USA und anderen Ländern. Alle anderen Marken sind Eigentum ihrer jeweiligen Rechteinhaber.

iShares
by BlackRock

Go paperless... 
It's Easy, Economical and Green!
Go to www.icsdelivery.com