

The BlackRock logo, consisting of the word "BLACKROCK" in a white, sans-serif font, is centered within a dark gray square.

BLACKROCK®

Rapport annuel et comptes révisés

BlackRock Strategic Funds

R.C.S. Luxembourg: B 127481

Sommaire

Informations générales	2
Lettre du président aux Actionnaires	5
Rapport du Gestionnaire Financier par délégation	8
Rapport des Administrateurs	14
Rapport sur les rémunérations (non révisé)	18
Bilan	22
Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire	29
Compte de résultat et évolution de l'actif net	39
Variation du nombre d'actions en circulation	46
Portefeuille de titres	55
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	55
BlackRock Asia Extension Fund	117
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	134
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	137
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	174
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	180
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	183
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	195
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	199
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	209
BlackRock European Absolute Return Fund	215
BlackRock European Credit Strategies Fund	220
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	230
BlackRock European Opportunities Extension Fund	262
BlackRock European Select Strategies Fund	267
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	288
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	312
BlackRock Global Event Driven Fund	357
BlackRock Global Long/Short Equity Fund	364
BlackRock Global Real Asset Securities Fund	387
BlackRock Impact World Equity Fund	391
BlackRock Latin American Opportunities Fund	397
BlackRock Macro Opportunities Fund	399
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	408
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	410
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	412
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	414
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	416
BlackRock Style Advantage Fund	448
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund	560
BlackRock Systematic European Equity Fund	568
BlackRock Systematic Global Equity Fund	571
BlackRock Total Advantage Fund	580
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	625
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	629
Annexe aux États Financiers	631
Rapport d'audit	646
Appendice I – Catégories d'Actions (non révisé)	648
Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)	652
Informations supplémentaires (non révisées)	655

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

Informations générales

Conseil d'administration

Paul Freeman, président (nommé avec effet le 17 juillet 2017)
Francine Keiser
Geoffrey D. Radcliffe
Robert Hayes
Barry O'Dwyer
Michael Gruener (nommé avec effet le 21 décembre 2017)
Frank P. Le Feuvre (a quitté ses fonctions avec effet le 29 septembre 2017)

Tous les Administrateurs sont des Administrateurs non exécutifs.

Robert Hayes, Geoffrey D. Radcliffe, Barry O'Dwyer et Michael Gruener sont des employés du BlackRock Group (le groupe de sociétés BlackRock, dont la société holding faîtière est BlackRock, Inc., et dont la Société de Gestion et les Gestionnaires Financiers par délégation font partie). Paul Freeman est un ancien employé du BlackRock Group.

Francine Keiser est un Administrateur indépendant.

Geoffrey D. Radcliffe a rempli les fonctions de président du 31 mai 2017 au 16 juillet 2017.

Société de Gestion

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

Gestionnaires Financiers par délégation

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

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

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

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

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

Gestionnaires délégués

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

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

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

Sous-gestionnaires externes

À compter du : 2 février 2018
Acadian Asset Management LLC
260 Franklin Street,
Boston, MA 02110,
États-Unis

Benefit Street Partners LLC
9 West 57th Street, Suite 4920,
New York, NY 10019,
États-Unis

Boussard & Gavaudan Asset Management, LP
1 Vine Street,
Londres W1J 0AH,
Royaume-Uni

GLG Partners LP
1 Curzon Street,
Londres W1J 5HB,
Royaume-Uni

GSA Capital Partners, LLP
5 Stratton Street,
Londres W1J 8LA,
Royaume-Uni

LibreMax Capital, LLC
600 Lexington Avenue, 19^e étage,
New York, NY 10022,
États-Unis

Marathon Asset Management LP
One Bryant Park, 38th Floor,
New York, NY 10036,
États-Unis

Jusqu'au : 9 mars 2018
PINE RIVER CAPITAL MANAGEMENT LP
601 Carlson Parkway, Suite 330,
Minnetonka, MN 55305,
États-Unis

QMS Capital Management LP
240 Leigh Farm Road, Suite 230,
Durham, NC 27707,
États-Unis

Distributeur Principal

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

Informations générales suite

Dépositaire et Agent comptable

State Street Bank Luxembourg S.C.A.
49 avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Agent de Transfert et Teneur de registre

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

Commissaire aux comptes

Deloitte Audit, S.à.r.l.
560, rue de Neudorf,
L-2220 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Conseiller juridique

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

Agent de prêt de titres

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

Agents payeurs

Autriche

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

Belgique

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

République tchèque

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

France

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

Allemagne

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

Irlande (chef de file)

J.P. Morgan Administration Services (Ireland) Limited
J.P. Morgan House, International Financial Services Centre,
Dublin 1,
Irlande

Italie

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

BNP Paribas Securities Services

Succursale de Milan
Via Ansperto 5,
20123 Milan,
Italie

Société Générale Securities Services S.p.A.

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

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

Piazza Salimbeni 3,
53100 Sienne,
Italie

State Street Bank International GmbH

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

Banca Sella Holding S.p.A.

Piazza Gaudenzio Sella 1,
13900 Bielle (BI),
Italie

À compter du : 15 novembre 2017

CACEIS Bank S.A.
Succursale de Milan
Piazza Cavour, 2,
20121 Milan,
Italie

À compter du : 26 mars 2018

ICCREA Banca S.p.A.
Via Lucrezia Romana 41/47,
00178 Rome,
Italie

Informations générales suite

Luxembourg (Agent payeur central)

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

Suisse

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

Royaume-Uni

J.P. Morgan Trustee and Depositary Company Limited
Hampshire Building, 1st Floor,
Chaseside,
Bournemouth, BH7 7DA,
Royaume-Uni

Siège Social

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

Demandes de renseignements

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

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

Autres demandes de renseignements :

Téléphone : + 44 207 743 3300

Fax : + 44 207 743 1143

Adresse e-mail : investor.services@blackrock.com

Prospectus en vigueur

Le Prospectus de BlackRock Strategic Funds (la « Société ») et les DICl correspondants ainsi que des exemplaires du Bulletin de Souscription sont disponibles auprès de l'équipe locale de Services aux Investisseurs, de la Société de Gestion ou de tout autre Représentant ou Distributeur. Des exemplaires des Statuts de la Société, ainsi que du rapport annuel et des comptes révisés et du rapport intermédiaire et des comptes non révisés peuvent être également obtenus gratuitement auprès de ces bureaux et auprès de tout Agent Payeur. Tous ces documents sont également disponibles à l'adresse www.blackrockinternational.com.

Représentants

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

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

Portefeuille de titres

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

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

Le classement des instruments de liquidités est fait en fonction, essentiellement, du pays de l'émetteur des instruments de liquidité.

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

Achats et ventes

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

Agréments

La Société est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») aux termes de la Partie I de la législation luxembourgeoise du 17 décembre 2010 telle qu'amendée. Les consentements réglementaires ont été obtenus ou les notifications appropriées ont été effectuées pour la distribution des Actions des Compartiments de la Société dans les pays suivants : Autriche, Belgique, Chili, République tchèque, Danemark, Finlande, France, Allemagne, Grèce, Hongrie, Irlande, Italie, Luxembourg, Pays-Bas, Norvège, Pologne, Portugal, république de Slovaquie, Corée du Sud, Espagne, Suède, Suisse et Royaume-Uni.

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

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

Lettre du président aux Actionnaires

Juin 2018

Cher Actionnaire,

La présente lettre a pour but de vous communiquer nos récentes informations concernant les activités de BlackRock Strategic Funds (la « Société » ou « BSF »), au cours des 12 mois se terminant le 31 mai 2018. Au 31 mai 2018, la gamme BSF comprenait 35 compartiments (dénommés individuellement « Compartiment » et collectivement « Compartiments »).

La majorité des marchés d'actions mondiaux ont continué à engranger des gains durant la période examinée, soutenus par le maintien de l'expansion de l'économie mondiale. Cependant, ces gains étaient accompagnés d'une importante volatilité, les marchés commençant à craindre l'impact d'une inflation plus élevée et une guerre commerciale coûteuse. En particulier, les marchés de titres à revenu fixe ont considérablement fluctué.

Tandis que nous assistions à un dégel des relations entre les États-Unis et la Corée du Nord, culminant en un accord historique où Kim Jong-Un a promis une dénucléarisation de la péninsule coréenne, ailleurs des tensions allaient grandissant. Notamment, l'imposition par l'administration américaine d'un tarif douanier sur les importations d'acier et d'aluminium a détérioré les relations internationales et, en représailles, plusieurs pays ont imposé à leur tour des tarifs douaniers.

L'Europe aussi a eu sa part de problèmes politiques. Le résultat indécis de l'élection en Italie a porté les populistes au pouvoir, quoique avec une coalition fragile. Un fort sentiment anti-européen se développant au sein de plusieurs des principaux partis politiques, les craintes que la récente stabilité politique de la zone euro ne soit menacée se sont accrues. En outre, le fait qu'Angela Merkel n'ait pas réussi à obtenir une victoire décisive en Allemagne est venu s'ajouter aux difficultés que connaît la région.

Au Royaume-Uni, le Brexit a continué à avoir un impact, entraînant un ralentissement de la croissance et des luttes politiques internes. La paralysie qui touche la relation entre le Royaume-Uni et l'Europe a provoqué la colère de groupements économiques, les pro- et les anti-Brexit étant de plus en plus frustrés.

Un autre fait important durant la période examinée a été le changement de politique monétaire internationale. À l'amélioration de la croissance et des chiffres de l'emploi, la Réserve fédérale (la « Fed ») a répondu par une augmentation d'un quart de point du taux des fonds fédéraux en juin 2017. Elle a également annoncé deux autres hausses d'un quart de point au cours de l'année à venir, culminant à une augmentation globale de 2 %.

Ailleurs, les banquiers centraux ont continué à brider une politique monétaire souple. Au Royaume-Uni, les taux d'intérêt ont grimpé d'un quart de point en novembre 2017, après la déclaration de la Banque d'Angleterre selon laquelle la force de la croissance économique et une expansion des prêts à la consommation méritaient des taux plus élevés. La Banque centrale européenne (la « BCE ») a indiqué que l'assouplissement quantitatif sera peut-être réduit en Europe également.

Dans le même temps, l'économie mondiale a poursuivi sa progression. Aucune contraction n'est attendue dans les grandes économies en 2018, la hausse prévue pour l'économie mondiale dans son ensemble étant de 3,8 %.

La plupart des marchés d'actions ont progressé au cours de l'exercice, même si l'ensemble de ces gains ont masqué une volatilité sous-jacente considérable. Les sociétés du secteur des technologies se sont bien comportées pendant la majeure partie de l'exercice, à l'instar des petites sociétés. Dans le même temps, la nervosité des marchés s'est accrue concernant les entreprises surendettées, vulnérables à un environnement de taux d'intérêts plus élevés, ce qui a entraîné une réelle disparité entre les gagnants et les perdants du marché.

Le marché d'actions américain est resté en tête des marchés d'actions pendant la majeure partie de la période examinée, en dépit des inquiétudes quant aux valorisations. Après une brève pause au début de l'exercice, certaines grandes entreprises du secteur des technologies faisant l'objet d'attaques pour leur mauvaise gouvernance, les investisseurs ont reculé devant le caractère défensif des actifs américains et la faiblesse d'autres régions comme l'Europe.

Ailleurs, les marchés japonais ont toujours fait preuve de solidité, malgré une faiblesse passagère de l'économie japonaise. La banque centrale du Japon a continué à soutenir l'économie et les titres nationaux se sont bien comportés.

Après un court sursaut dans le sillage de l'élection d'Emmanuel Macron à la présidence française, les actions européennes ont été atones. Cette faiblesse a été exacerbée par un certain ralentissement du mouvement de croissance dans la région et une monnaie plus forte, mais pour l'essentiel les problèmes étaient d'ordre politique : l'élection italienne, l'échec de la coalition d'Angela Merkel et les difficultés persistantes en Espagne.

Lettre du président aux Actionnaires

Juin 2018 suite

Au Royaume-Uni, la stagnation des négociations sur le Brexit a continué à influencer aussi bien la popularité du marché d'actions britannique que le niveau de la livre sterling, malgré une certaine reprise de la performance relative durant le second semestre de la période examinée.

Les marchés émergents ont affiché une bonne reprise au cours de l'exercice, mais ont subi l'impact d'un dollar fort et de rendements obligataires américains plus élevés. Cette situation a été ressentie plus particulièrement dans des régions comme l'Argentine et la Turquie, qui ont toutes deux une forte dette en dollars US.

Les marchés obligataires, enfin, semblent accepter la variation des conditions de politique monétaire. Le rendement des bons du Trésor à 10 ans se dirigeait vers les 3 % à la fin de l'exercice, après être resté à un peu plus de 2 % au début de l'exercice. La faible inflation persistante a contenu les rendements, en dépit d'un rythme des hausses des taux d'intérêt plus rapide que prévu en début d'exercice. Des forces déflationnistes significatives sont encore à l'œuvre – forte dette, population vieillissante et faible investissement des entreprises.

Vous trouverez des informations plus détaillées sur la performance des Compartiments dans le rapport des Gestionnaires Financiers par délégation, où nous présentons également notre point de vue sur les perspectives d'investissement.

Dans l'ensemble, les actifs sous gestion (« ASG ») de la Société ont augmenté de 49,8 % passant de 19 216 millions d'USD au 31 mai 2017 à 28 786 millions d'USD au 31 mai 2018, avec des hausses particulières dans les portefeuilles indiciels gérés du groupe.

Le Compartiment BlackRock Managed Index Portfolios – Growth a enregistré la plus forte croissance d'actifs en pourcentage, avec une hausse de 375,1 % portant ces derniers à 153 45 millions d'EUR. De manière générale, la gamme a affiché de fortes croissances d'actifs avec des hausses de 185,8 % et de 99,7 % pour les portefeuilles Moderate et Defensive, portant ces derniers à respectivement 418,71 millions d'EUR et 117,36 millions d'EUR.

D'autres approches ont conservé leur popularité. Les ASG du Compartiment BlackRock Global Event Driven Fund ont progressé de 284,5 %, atteignant 1 379,84 millions d'USD. Les ASG du Compartiment BlackRock Systematic Global Equity Fund et du Compartiment BlackRock Style Advantage Fund ont progressé respectivement de 109,8 % pour atteindre 585,62 millions d'USD et de 467,6 % pour atteindre 3 328,39 millions d'USD.

Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund a aussi connu une forte croissance d'actifs à 138,92 millions d'USD, soit une hausse de 101,0 %. Le Compartiment BlackRock European Select Strategies Fund a atteint 572,29 millions d'EUR, soit une hausse de 64,9 %. Le Compartiment BlackRock Fixed Income Strategies Fund a également connu une forte croissance d'actifs, atteignant 9 955,46 millions d'EUR, soit une hausse de 43,5 %.

Parmi les points faibles, citons les compartiments Absolute Return Funds, notamment le Compartiment BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, dont les ASG ont chuté à 451,16 millions, soit un repli de 28,7 %. Les ASG du Compartiment BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund ont chuté à 254,10 millions d'EUR, soit un recul de 57,6 %. Le Compartiment BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund a vu lui aussi reculer ses ASG à 255,47 millions d'USD, soit une chute de 43,2 %. Le Compartiment BlackRock European Credit Strategies Fund a perdu 78,7 % de sa valeur à la fin de l'exercice, chutant à 82,99 millions d'EUR, ce qui a entraîné la fermeture du Compartiment avec effet le 17 juillet 2018.

Cette année, nous avons lancé six nouveaux compartiments dans la gamme : les Compartiments BlackRock Macro Opportunities Fund, BlackRock Global Real Asset Securities Fund, BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund, BlackRock Total Advantage Fund, BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund et BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative.

Les réglementations ont continué à évoluer dans toute l'Europe, et plusieurs des changements à venir pourraient avoir des conséquences pour les investisseurs. Parmi les principaux changements, notons :

- ▶ Les révisions de la directive sur les marchés d'instruments financiers avec l'introduction de la directive II sur les marchés d'instruments financiers (« MiFID II ») et le nouveau règlement concernant les marchés d'instruments financiers (« MiFIR ») : la directive révisée et le nouveau règlement sont entrés en vigueur début 2018. Les exigences introduites comprennent des restrictions sur la façon dont les gestionnaires financiers peuvent être rémunérés et une plus grande transparence relative au mode de paiement utilisé par les gestionnaires des actifs pour la recherche.
- ▶ Le règlement sur les produits dérivés négociés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux (European Market Infrastructure Regulation ou EMIR) : Ce, dans le but d'accroître la transparence et de réduire le risque lié aux instruments dérivés hors cote (OTC). Il est maintenant mis en œuvre par les organes de réglementation dans différents pays européens.

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

Lettre du président aux Actionnaires

Juin 2018 suite

- Les produits d'investissement packagés de détail et fondés sur l'assurance (« PRIIP ») : Le 7 juillet 2017, la Commission européenne a publié des orientations sur les documents d'informations clés pour les produits d'investissement de détail et fondés sur l'assurance. La nouvelle législation – qui régit la commercialisation et la distribution des produits financiers – est entrée en vigueur pour tous les fonds, à l'exception des fonds OPCVM, au début de l'année 2018. La Société bénéficiera de la période de transition dont dispose un OPCVM, et la législation ne sera pas applicable à la Société pour les périodes antérieures au 1^{er} janvier 2020.
- Le règlement sur les indices de référence s'applique également à compter du 1^{er} janvier 2018, sous réserve de certaines dispositions transitionnelles. Il apporte une orientation sur la structure et l'utilisation d'indices de référence pour mesurer la performance de fonds d'investissement.

Si vous avez des questions sur l'un des sujets de la présente lettre, veuillez nous contacter sur notre site Internet à l'adresse suivante : www.blackrockinternational.com

Veuillez agréer mes salutations distinguées,

Paul Freeman
Président

Septembre 2018

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Le 31 mai 2018

Examen du marché

La plupart des marchés d'actions ont progressé davantage durant la période examinée, avec cependant, à mi-parcours, une importante volatilité. Pendant la majeure partie de 2017, ils ont grimpé, une forte croissance économique et une faible inflation contrebalançant les tensions géopolitiques pour les investisseurs.

Toutefois, la situation a changé au début de l'année 2018. Tout d'abord, les marchés ont été troublés par la perspective de taux d'intérêt plus élevés aux États-Unis. Les données salariales progressant, les marchés d'actions ont pris peur, mais ont ensuite retrouvé leur équilibre. Puis, la montée de la guerre commerciale entre les États-Unis et le reste du monde, en particulier la Chine, a préoccupé les investisseurs. Mais à la fin de la période examinée, les marchés avaient atteint de nouveaux sommets.

Il y a eu une grande disparité entre les titres et les marchés individuels. En général, les investisseurs ont suivi les gains. La Chine a devancé les autres régions, ses actions Internet géantes montrant la voie. Le secteur des technologies et des télécommunications a également affiché une solide performance au cours de l'exercice, même si le leadership du marché était relativement étroit. Ceci a aidé les indices américains à atteindre de nouveaux sommets, malgré les préoccupations persistantes des investisseurs concernant les valorisations.

Le Japon et la région asiatique au sens large ont également fait preuve de solidité, les investisseurs ayant continué à rechercher les marchés qui offraient des gains résilients, mais aux valorisations moins importantes. Cependant, après une bonne année 2017, les marchés émergents ont connu une période difficile en 2018. La force du dollar US et la hausse des rendements obligataires américains ont exercé une pression sur leurs monnaies, et les investisseurs ont commencé à craindre un ralentissement de plus grande envergure.

L'Europe a été faible elle aussi, les investisseurs commençant à accorder davantage d'importance au risque politique attaché aux actifs de la région. Certains des marchés périphériques, comme l'Espagne et l'Italie ont considérablement reculé, alors que les actions françaises se sont beaucoup mieux comportées.

La prévisibilité et la solidité des bénéfices ont été récompensées, tandis que le marché a été impitoyable avec les sociétés affichant des faiblesses, même de courte durée. Les investisseurs ont également pris soin d'éviter les sociétés fortement endettées, croyant que celles-ci auraient des difficultés dans un monde où l'emprunt devient plus coûteux.

De manière générale, les stratégies de revenu ont été faibles. Elles n'ont pas réussi à prendre part au redressement fondé sur les technologies puisque les plus grands titres technologiques ne versent généralement pas de dividendes,

et en outre les sociétés réputées être des « bond proxies » ont connu un moment difficile. Au fur et à mesure que les rendements obligataires grimpaient, leur valeur pour les investisseurs diminuait. En revanche, les petites entreprises ont affiché de bons résultats, en grande partie grâce à des gains plus élevés.

Les stratégies fondées sur les titres à revenu fixe ont bataillé, particulièrement au cours du second semestre de la période examinée. Alors que les rendements obligataires grimpaient et que l'inflation et les chiffres de l'emploi aux États-Unis gagnaient du terrain, les hausses des taux d'intérêt semblaient pratiquement inévitables. Le rendement des obligations américaines a augmenté de près de 1 % durant la période de 12 mois.

Certaines parties du marché obligataire continuent à attirer des soutiens, et le haut rendement a été raisonnablement solide. Toutefois, le grand point faible a été les obligations mondiales des marchés émergents, où une sur-exubérance en 2017 a été punie en 2018, puisque les fonds ont été retirés du secteur et les devises locales vendues.

Performance des Compartiments

Performance des Compartiments Actions

Le Compartiment BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund a progressé de 0,7 % au cours de l'exercice, juste devant son indice de référence (taux LIBOR euro à 3 mois), qui a reculé de 0,4 %. Le Compartiment BlackRock European Absolute Return Fund a progressé de 2,9 % (EUR) – et son indice de référence a chuté de 0,4 %. Le Compartiment BlackRock UK Equity Absolute Return Fund a perdu 1,5 % contre un rendement de l'indice de référence de (0,2) %. Le Compartiment BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund s'est replié de 1,9 % au cours de l'exercice, significativement derrière son indice de référence, qui a gagné 1,4 %. Le Compartiment Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund a gagné 1,9 %, contre une hausse de 1,4 % de son indice de référence.

Les compartiments actions de la gamme BlackRock Strategic Funds se sont mieux comportés en termes absolus, même si certains d'entre eux ont été devancés par leur indice de référence : Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund a progressé de 14,4 % au cours de l'exercice, devant l'indice MSCI Emerging Markets Index, qui a progressé de 14,0 %. Le Compartiment BlackRock Latin American Opportunities Fund a progressé de 4,8 %, devant son indice de référence, le MSCI Emerging Market Latin America 10/40 (net), qui a engrangé 3,7 %). Le Compartiment BlackRock Asia Extension Fund a progressé de 19,3 % (USD), juste devant son indice de référence, le MSCI All Country Asia ex Japan SM, qui lui a progressé de 17,6 %.

Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund a reculé de 4,4 % (USD) au cours de l'exercice, loin derrière son indice de référence (l'indice LIBOR à 3 mois), qui a progressé de 1,4 %. Le Compartiment BlackRock Americas Diversified

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

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Le 31 mai 2018 suite

Equity Absolute Return Fund a progressé de 6,7 % (USD), devant l'indice LIBOR à 3 mois (USD), qui a gagné 1,4 %. Le Compartiment BlackRock Global Long/Short Equity Fund a gagné 6,0 % (USD), devant son indice de référence, le BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill Index, qui a progressé de 1,3 %.

Après avoir bien démarré la période examinée, les Compartiments européens ont montré des signes de faiblesse. Le Compartiment BlackRock European Opportunities Extension a grimpé de 6,0 % (EUR), devançant son indice de référence, le S&P Europe BMI Index (marchés développés uniquement), qui a progressé de 2,5 %.

Le Compartiment BlackRock Systematic European Equity Fund a progressé de 1,5 % (EUR), devant son indice de référence, l'indice MSCI Europe Index, (Net Total Return), qui a gagné 1,0 %.

Le Compartiment BlackRock European Select Strategies Fund a reculé de 0,9 %, en deçà de son indice de référence mixte actions et obligations, qui a progressé de 0,8 %. Le Compartiment BlackRock Global Event Driven Fund a progressé de 1,0 %, contre une hausse de 1,3 % pour son indice de référence. Le Compartiment BlackRock Impact World Equity Fund a progressé de 14,3 %, devant son indice de référence, qui lui a progressé de 11,6 %.

Le Compartiment BlackRock Style Advantage Fund a perdu 4,7 %, contre un rendement de 1,4 % pour son indice de référence. Le Compartiment BlackRock Systematic Global Equity Fund a progressé de 13,8 %, devant son indice de référence, qui a gagné 11,8 %.

Performance des Compartiments Obligations

Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund a reculé de 1,3 % (USD) au cours de l'exercice, derrière son indice de référence composite, qui a gagné 1,4 %.

Le Compartiment BlackRock Fixed Income Strategies Fund a perdu 0,5 % au cours de l'exercice, derrière son indice de référence (en EUR), l'indice Euro Overnight Index Average, qui a reculé de 0,4 %. Les compartiments de crédit ont également bataillé dans un contexte de marché obligataire volatil : Le Compartiment BlackRock European Credit Strategies Fund a chuté de 1,8 % (EUR), tandis que son indice de référence, le taux LIBOR euro à 3 mois, a reculé de 0,4 %.

Le Compartiment BlackRock Global Absolute Return Bond Fund a reculé de 0,8 % (EUR), devant son indice de référence, l'indice Euribor à 3 mois, qui a chuté de 0,3 %. Le Compartiment BlackRock Sustainable Euro Bond Fund a progressé de 0,1 % (EUR) au cours de l'exercice, légèrement derrière son indice de référence, qui a progressé de 0,5 %.

Performance des Compartiments diversifiés

Le Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund a grimpé de 1,9 % (EUR) au cours de l'exercice, affichant une surperformance par rapport à son indice de référence, l'indice Euro Overnight Index Average, qui a perdu 0,4 %.

Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Allocation Fund a progressé de 3,0 % (USD), au cours de l'exercice, mais est resté derrière son indice de référence (60 % MSCI Emerging Markets Index/40 % JPMorgan Emerging Markets Bond Index Plus), lequel a engrangé 6,8 % (USD).

Performance des Fonds de Fonds

Les Compartiments BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, Growth et Moderate – ont progressé respectivement de 0,4 %, 5,9 % et 3,5 %. Le Compartiment BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund a reculé de 2,9 % au cours de l'exercice. Il n'a pas d'indice de référence.

Nouveaux Compartiments

Aucun des compartiments nouvellement lancés ne dispose d'un compte rendu des performances sur 12 mois. Néanmoins, le Compartiment BlackRock Macro Opportunities Fund a baissé de 0,2 % depuis le début de l'exercice. Le Compartiment BlackRock Global Real Asset Securities Fund a reculé de 0,7 %, contre une chute de 0,8 % pour son indice de référence. Le Compartiment BlackRock Total Advantage Fund est en repli de 4,0 %, contre un recul de 0,2 % de son indice de référence. Le Compartiment BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund a perdu 0,4 % depuis le début de l'exercice.

Le Compartiment BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative a perdu 2,4 % au cours des trois derniers mois.

Perspective

La situation concernant les actions est maintenant variée. D'une part, nous assistons à une croissance mondiale synchronisée, mais nous avons également une augmentation de l'inflation et des taux d'intérêt. Sans compter la volatilité accrue des marchés d'actions et une plus grande incertitude économique. Selon nous, les deux principaux risques aujourd'hui pour les actifs à risque sont les guerres commerciales et une hausse des rendements réels.

La réforme fiscale américaine et les plans de dépenses publiques ont amplifié les estimations de la croissance et des gains à un moment où l'économie américaine est déjà forte. Ceci ajoute de l'incertitude à la perspective économique. Si cette situation crée le potentiel pour des dépenses plus importantes de la part des entreprises et pour une augmentation de la productivité, il y a également un risque de surchauffe. La reprise de l'inflation a été sensible ces derniers mois, si bien que la Réserve fédérale garde le cap des hausses des taux.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Le 31 mai 2018 suite

Toutefois, nous ne pensons pas que ce changement de politique monétaire soit susceptible de se produire ailleurs à grande échelle. La zone euro et le Japon ne subissent pas, à l'heure actuelle, de pressions inflationnistes. À notre avis, ceci laisse deviner un environnement favorable aux actifs à risque, mais nous prévoyons des rendements plus faibles et une volatilité plus forte qu'en 2017.

Un protectionnisme américain accru est, à nos yeux, la menace la plus claire s'agissant de la perspective mondiale à court terme. Néanmoins, nous pensons qu'il serait source de volatilité et non de déraillement complet des marchés.

L'effet des chocs géopolitiques sur les marchés mondiaux est souvent de courte durée, si l'on en croit notre analyse des réactions des prix des actifs à 50 événements à risque depuis 1962. Nous avons constaté, cependant, que l'impact tend à être plus aigu et durable lorsque le contexte économique est morose. Nous n'en sommes pas là aujourd'hui, et nous observons que les bons du Trésor américain ainsi que l'or servent de tampon en cas de cessions d'actifs à risque déclenchées par les crises géopolitiques. Ces refuges, perçus comme tels, ont tendance à se redresser face à des « inconnus connus » comme les élections politiques, puis sont de nouveau à la traîne une fois l'événement passé, l'attrait des actifs à risques étant inversement proportionnel à l'incertitude.

Un nouveau sursaut des rendements obligataires est un autre risque, mais nous pensons que les actions peuvent être rentables si les hausses des rendements sont régulières et fondées sur une amélioration de la croissance. La dynamique des gains est croissante pour les entreprises du monde entier, mais particulièrement aux États-Unis, où la diminution de l'impôt sur les sociétés a fait grimper les bénéfices. Il est possible que les obligations d'État aient du mal à progresser dans cet environnement, même si les obligations à court terme sont moins exposées aux hausses des taux.

Pour ce qui est des obligations d'entreprise, les écarts par rapport aux obligations d'État sont serrés, les rendements absolus restent faibles et le cycle est en voie de maturation. Cependant, une épargne mondiale abondante et une soif de revenu devraient limiter les hausses des rendements obligataires à long terme.

La récente volatilité et les bénéfices en hausse ont entraîné un retour des valorisations au sein des marchés d'actions à des niveaux plus réalistes, et le contexte économique demeure solide. Nous pensons que les marchés d'actions et d'obligations peuvent encore progresser dans cet environnement, mais il importe de faire preuve de discernement.

Juin 2018

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Le 31 mai 2018 suite

Vous trouverez, dans le tableau ci-dessous, les rendements de la catégorie d'actions primaire pour chaque Compartiment, qui a été choisie à titre représentatif. Conformément aux objectifs d'investissement respectifs décrits dans le prospectus, les Compartiments ne cherchent pas à reproduire la performance d'un indice de référence spécifique. Les rendements des indices de référence, dans le tableau ci-dessous, ne sont fournis qu'à titre de référence et aux seules fins du présent rapport et des comptes intermédiaires non révisés. La catégorie d'actions primaire pour les Compartiments BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund et BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund est la catégorie D de capitalisation, pour le Compartiment BlackRock European Credit Strategies Fund la catégorie H de capitalisation, et pour les Compartiments BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth and BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate la catégorie D de distribution. Pour tous les autres Compartiments, la catégorie d'actions primaire est la catégorie A de capitalisation. Pour les autres catégories de parts, les rendements de la performance peuvent être communiqués sur demande.

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

	Résultats de l'exercice comptable au 31 mai 2018	Résultats par année civile			Date de lancement
		1 an	2017	2016	2015
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist (USD)	6,66 %	4,89 %	(1,17) %	9,00 %	17 février 2012
LIBOR 3 Month Index (USD)	1,42 %	1,11 %	0,66 %	0,23 %	
BlackRock Asia Extension Fund 'A' Class Non Dist (USD)	19,29 %	35,80 %	5,23 %	(10,78) %	10 février 2012
MSCI All Country Asia ex Japan SM (USD)	17,60 %	42,08 %	5,76 %	(8,90) %	
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist (USD)	(1,88) %	0,18 %	7,88 %	–	31 août 2016
LIBOR 3 Month Index (USD)	1,42 %	1,11 %	(0,11) %	–	
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist (USD)	1,89 %	(3,15) %	–	–	22 février 2017
LIBOR 3 Month Index (USD)	1,42 %	0,97 %	–	–	
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund 'A' Class Non Dist (EUR)	1,86 %	6,52 %	(3,50) %	(1,26) %	28 janvier 2011
Euro Overnight Index Average (EUR)	(0,35) %	(0,35) %	(0,31) %	(0,11) %	
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund 'D' Class Non Dist (USD)	(4,40) %	(6,76) %	3,72 %	(0,15) %	15 novembre 2012
LIBOR 3 Month Index (USD)	1,42 %	1,11 %	0,66 %	0,23 %	
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund 'A' Class Non Dist (USD)	3,04 %	21,46 %	12,10 %	(10,42) %	15 novembre 2013
60 % MSCI Emerging Markets Index / 40 % JPMorgan Emerging Markets Bond Index Plus (USD)	6,77 %	24,97 %	10,80 %	(8,33) %	
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund 'A' Class Non Dist (USD)	14,35 %	32,10 %	18,42 %	4,69 %	18 septembre 2015
MSCI Emerging Markets Index (USD)	14,03 %	37,28 %	11,19 %	(3,87) %	

* Les sociétés ou succursales locales du BlackRock Group ou leurs agents administratifs.

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

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Le 31 mai 2018 suite

	Résultats de l'exercice comptable au 31 mai 2018	Résultats par année civile			Date de lancement
	1 an	2017	2016	2015	
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund 'A' Class Non Dist (USD)	(1,26) %	4,71 %	11,93 %	2,64 %	12 juin 2013
LIBOR 3 Month Index (USD) ^{b1}	1,42 %	1,11 %	0,66 %	(7,14) %	
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund 'A' Class Non Dist (USD)⁽¹⁾	(0,44) %	0,25 %	–	–	6 décembre 2017
JP Morgan Emerging Markets Bond Global Diversified 1-3 year Index (USD)	(0,29) %	0,21 %	–	–	
BlackRock European Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist (EUR)	2,88 %	2,88 %	(7,76) %	7,66 %	27 février 2009
3 Month Euro LIBOR Rate (EUR)	(0,38) %	(0,37) %	(0,28) %	(0,03) %	
BlackRock European Credit Strategies Fund 'H' Class Non Dist (EUR)	(1,75) %	1,29 %	(2,77) %	(3,59) %	16 février 2011
3 Month Euro LIBOR Rate (EUR)	(0,38) %	(0,37) %	(0,28) %	(0,03) %	
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist (EUR)	0,72 %	1,22 %	(11,82) %	4,59 %	6 août 2010
3 Month Euro LIBOR Rate (EUR)	(0,38) %	(0,37) %	(0,28) %	(0,03) %	
BlackRock European Opportunities Extension Fund 'A' Class Non Dist (EUR)	5,98 %	18,24 %	3,49 %	36,91 %	31 août 2007
S&P Europe BMI Index (Developed Markets only) (EUR) ^{b2}	2,47 %	12,00 %	3,05 %	10,85 %	
BlackRock European Select Strategies Fund 'A' Class Non Dist (EUR)	(0,86) %	3,81 %	1,45 %	0,58 %	19 août 2015
75 % Barclays Pan European Aggregate Index (Hedged EUR) / 25 % MSCI Europe Index (Hedged EUR)	0,78 %	3,79 %	5,08 %	(0,35) %	
BlackRock Fixed Income Strategies Fund 'A' Class Non Dist (EUR)	(0,45) %	1,67 %	0,66 %	2,09 %	30 septembre 2009
Euro Overnight Index Average (EUR)	(0,35) %	(0,35) %	(0,31) %	(0,11) %	
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund 'A' Class Non Dist (EUR)	(0,78) %	0,97 %	0,14 %	0,31 %	25 mai 2012
3 month Euribor Index (EUR)	(0,33) %	(0,33) %	(0,22) %	0,03 %	
BlackRock Global Event Driven Fund 'A' Class Non Dist (USD)	1,00 %	4,64 %	2,56 %	0,57 %	5 août 2015
BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill (USD)	1,28 %	0,86 %	0,33 %	0,05 %	
BlackRock Global Long/Short Equity Fund 'A' Class Non Dist (USD)	5,99 %	11,03 %	(5,80) %	(1,42) %	2 juin 2014
BofA Merrill Lynch 3 Month US Treasury Bill (USD)	1,28 %	0,86 %	0,33 %	0,05 %	
BlackRock Global Real Asset Securities Fund 'A' Class Non Dist (USD)⁽¹⁾	(0,67) %	1,41 %	–	–	30 novembre 2017
FTSE Custom Developed Core Infrastructure 50/50 EPRA/NAREIT Developed Dividend+ Net Total Return Index (USD)	(0,81) %	0,64 %	–	–	
BlackRock Impact World Equity Fund 'A' Class Non Dist (USD)	14,34 %	24,17 %	5,90 %	(1,80) %	20 août 2015
MSCI World Index (Net Total Return) (USD)	11,57 %	22,40 %	7,51 %	(1,45) %	
BlackRock Latin American Opportunities Fund 'A' Class Non Dist (USD)	4,84 %	32,18 %	15,24 %	(28,52) %	14 novembre 2007
MSCI Emerging Market Latin America 10/40 (net) (USD)	3,67 %	23,74 %	31,04 %	(31,04) %	
BlackRock Macro Opportunities Fund 'A' Class Non Dist (USD)⁽¹⁾	(0,15) %	(0,56) %	–	–	29 novembre 2017
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative 'A' Class Non Dist (EUR)⁽¹⁾	(2,41) %	–	–	–	26 janvier 2018
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive 'D' Class Dist (EUR)	0,39 %	3,56 %	3,67 %	(3,87) %	10 avril 2015
90 % Barclays Global Aggregate Index (Euro Hedged) / 10 % MSCI All Country World Net TR Index (EUR)	(0,15) %	2,52 %	3,33 %	(1,97) %	
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth 'D' Class Dist (EUR)	5,88 %	11,75 %	5,87 %	(6,44) %	10 avril 2015
80 % MSCI All Country World Net TR Index (EUR) / 20 % Barclays Global Aggregate Index (Euro Hedged)	6,60 %	13,30 %	9,42 %	(7,41) %	

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

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Le 31 mai 2018 suite

	Résultats de l'exercice comptable au 31 mai 2018	Résultats par année civile			Date de lancement
	1 an	2017	2016	2015	
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate 'D' Class Dist (EUR) 50 % Barclays Global Aggregate Index (Euro Hedged) / 50 % MSCI All Country World Net TR Index (EUR)	3,52 %	8,52 %	5,33 %	(5,70) %	10 avril 2015
	3,69 %	8,57 %	6,85 %	(5,00) %	
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund 'A' Class Non Dist (USD)	(2,92) %	0,25 %	2,17 %	–	28 janvier 2016
BlackRock Style Advantage Fund 'A' Class Non Dist (USD) 3 month LIBOR Index (USD)	(4,74) %	0,80 %	8,68 %	–	29 février 2016
	1,42 %	1,11 %	0,56 %	–	
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund 'A' Class Non Dist (EUR) Bloomberg Barclays Euro Aggregate 500+ Index (EUR)	0,10 %	0,52 %	(2,29) %	–	23 août 2016
	0,46 %	0,67 %	(2,48) %	–	
BlackRock Systematic European Equity Fund 'A' Class Non Dist (EUR) MSCI Europe Index (Net Total Return) (EUR)	1,48 %	12,03 %	(0,19) %	(2,90) %	16 mars 2015
	0,99 %	10,24 %	2,58 %	(7,60) %	
BlackRock Systematic Global Equity Fund 'A' Class Non Dist (USD) MSCI All Country World Index (Net Total Return) (USD)	13,81 %	28,08 %	5,14 %	1,27 %	18 septembre 2015
	11,84 %	23,97 %	7,86 %	1,82 %	
BlackRock Total Advantage Fund 'A' Class Non Dist (EUR)⁽¹⁾ 3 month Euribor Index (EUR)	(4,01) %	(1,24) %	–	–	11 décembre 2017
	(0,16) %	(0,02) %	–	–	
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund 'A' Class Non Dist (GBP) 3 month LIBOR Index (GBP)	(0,58) %	0,30 %	2,97 %	–	18 août 2016
	(0,24) %	(3,50) %	0,95 %	–	
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund 'A' Class Non Dist (USD)⁽¹⁾	0,30 %	–	–	–	8 janvier 2018

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

^{b1} L'indice de référence a changé, précédemment : 50 % JPMorgan EMBI Global Diversified / 50 % JPMorgan Government Bond Index – Emerging Markets Global Diversified Index (USD).

^{b2} Précédemment connu sous le nom de Citigroup BMI Europe Index.

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

Rapport des Administrateurs

Déclaration sur le gouvernement d'entreprise

Introduction

BlackRock Strategic Funds (la « Société ») est une société anonyme constituée, conformément aux lois du Grand-Duché de Luxembourg, en tant que société d'investissement à capital variable. La Société a été agréée par la Commission de surveillance du secteur financier (la « CSSF ») en tant qu'OPCVM conformément aux dispositions de la Partie I de la loi du 17 décembre 2010, telle qu'amendée, et est réglementée par cette loi. La Société respecte les principes fixés par la révision du code de conduite 2013 (le « Code ») de l'Association luxembourgeoise des fonds d'investissement (« ALFI ») publié par cette dernière en juin 2013.

Le Conseil d'administration de la Société (le « Conseil ») s'engage à maintenir les plus hauts niveaux de gouvernance d'entreprise et est responsable vis-à-vis des actionnaires de la gouvernance des affaires de la Société. Le Conseil a pris en compte les principes et les recommandations du Code et a mis en place un cadre de gouvernance d'entreprise qu'il juge approprié pour une adhésion aux principes du Code, au vu de la nature de sa structure en tant que société d'investissement. Cette déclaration résume la structure et les processus de gouvernance d'entreprise de la Société pour la période examinée allant du 1^{er} juin 2017 au 31 mai 2018.

Composition du Conseil

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

Les parcours professionnels des Administrateurs, aux pages 16 et 17, illustrent collectivement l'étendue de leurs connaissances et de leur expérience en matière d'investissement, leurs compétences dans le domaine des affaires et de la finance ainsi que leur maîtrise des réglementations, qui leur permettent d'assurer une gestion stratégique efficace, une supervision et une gouvernance appropriée de la Société. Le Conseil d'administration proposera, lors de l'assemblée générale annuelle des actionnaires, que le nombre d'administrateurs soit porté à sept, et proposera l'élection de Mme Martha Boeckenfeld en tant qu'Administrateur indépendant. BlackRock estime que cette composition constitue un bon équilibre pour le Conseil.

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

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

Les Administrateurs sont constamment tenus de veiller à ce qu'ils aient suffisamment de temps pour remplir leurs tâches. Des informations détaillées sur les autres nominations et engagements de chaque Administrateur (y compris le président) peuvent être obtenues auprès du Conseil et de BlackRock Investment Management (U.K.) Limited (« BIM UK »). Toutes les nouvelles nominations et tous les engagements importants requièrent l'autorisation préalable de BIM UK.

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

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

Responsabilités du Conseil

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

Rapport des Administrateurs suite

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

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

Assurance

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

Délégation des responsabilités

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

Gestion et administration

Le Conseil a délégué la gestion des investissements, la distribution et l'administration de la Société et de ses Compartiments à la Société de Gestion. La Société de Gestion a délégué la gestion du portefeuille de titres aux Gestionnaires Financiers par délégation. Les Gestionnaires Financiers par délégation observent les lignes directrices déterminées par le Conseil et indiquées dans le prospectus de la Société portant sur les Compartiments de cette dernière. Les Gestionnaires Financiers par délégation concernés sont directement responsables des décisions concernant la gestion quotidienne des Compartiments de la Société et répondent de la performance des investissements des Compartiments vis-à-vis de la Société de Gestion et de la Société. Le Conseil a également délégué l'exercice des droits de vote attachés

aux titres détenus dans le portefeuille aux Gestionnaires Financiers par délégation respectifs, qui peuvent à leur tour le déléguer à BIM UK. Le vote pour le compte d'actionnaires s'effectue de manière à servir au mieux les intérêts économiques des actionnaires en tant qu'investisseurs à long terme.

La Société de Gestion a délégué ses responsabilités relatives aux services administratifs de la Société et de ses Compartiments à State Street Bank Luxembourg S.C.A. (l'« Agent administratif »). L'Agent administratif est responsable de l'administration des affaires de la Société, y compris le calcul de la valeur nette d'inventaire et la préparation des états financiers de la Société, sous réserve de la supervision générale des Administrateurs et de la Société de Gestion. L'Agent administratif est une filiale de State Street Bank & Trust Co. La Société a nommé State Street Bank Luxembourg S.C.A. comme Dépositaire de ses actifs, avec pour responsabilité la garde de ces actifs, conformément aux réglementations. Le Dépositaire est une filiale de State Street Bank & Trust Co. La Société de Gestion a délégué les services d'agent de transfert et d'enregistrement des actions à J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.

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

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

Le Conseil est également responsable de l'établissement et du bon fonctionnement des systèmes de gestion des contrôles internes et des risques de la Société, en relation avec le processus de production de rapports financiers. Ces systèmes sont conçus pour gérer et non pour éliminer le risque de non-réalisation des objectifs de la Société s'agissant de la production de rapports financiers. La Société dispose de procédures visant à garantir la bonne tenue et l'accessibilité de tous les registres comptables concernés et, notamment, la production des états financiers annuels et intermédiaires. Ces procédures comprennent la désignation de l'Agent administratif pour la tenue des registres comptables de la Société, indépendamment du Gestionnaire Financier

Rapport des Administrateurs suite

par délégation et du Dépositaire. Les états financiers sont préparés conformément au droit applicable et aux principes comptables généralement reconnus, et sont approuvés par le Conseil d'administration de la Société. Les données comptables communiquées dans le rapport annuel doivent être révisées et le rapport du commissaire aux comptes agréé, y compris toute réserve, est entièrement reproduit dans le rapport annuel de la Société.

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

Les unités de BIM UK chargées de la gestion des risques d'audit et du risque opérationnel présentent, sur une base trimestrielle, un rapport à la Société de Gestion. La Société de Gestion reçoit également, de la part de l'Agent administratif et du Dépositaire, un rapport sur les contrôles internes des activités de garde et des activités administratives de la Société. Le Conseil reconnaît que ces systèmes de contrôle peuvent uniquement gérer et non éliminer les risques de non-réalisation des objectifs des fonds et qu'ils peuvent garantir de manière raisonnable mais non absolue contre toute anomalie ou perte importante ; ledit Conseil s'appuie sur les contrôles opérationnels mis en place par les prestataires de services.

Rapports financiers

La Société prépare ses états financiers conformément aux principes comptables généralement reconnus et sur une base de continuité des activités.

Rémunération

La Société est une société d'investissement et ne possède aucun employé ni aucun Administrateur exécutif. Aucun Administrateur (ancien ou actuel) n'a droit à une quelconque prestation de retraite de la part de la Société, et la Société n'a attribué aucune option sur actions ou prime de rendement à long terme. Aucun élément de rémunération des Administrateurs n'est lié au rendement. Les Administrateurs qui sont également des employés de BlackRock Group n'ont droit à aucune rémunération en tant qu'Administrateur (jeton). Tous les autres Administrateurs reçoivent une rémunération soumise à l'approbation des actionnaires lors de l'assemblée générale annuelle et communiquée à la page 636. Le Conseil estime que le niveau de rémunération des Administrateurs qui perçoivent un jeton correspond au temps consacré à cette fonction et aux responsabilités y afférentes. Le montant maximal de rémunération payable aux Administrateurs est approuvé par le Conseil.

Communication avec les actionnaires

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

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

Selon les procédures de production de rapports du Conseil, les communications entre les clients et BIM UK sont transmises au Conseil, y compris les plaintes des actionnaires. En outre, BIM UK a été nommée Distributeur Principal et est chargée de la gestion active de la relation entre la Société et ses actionnaires.

Parcours professionnels des Administrateurs

Paul Freeman (président) (Britannique) (nommé le 17 juillet 2017) : M. Freeman siège actuellement au conseil d'administration de plusieurs sociétés et fonds d'investissement du BlackRock Group. Jusqu'en décembre 2015, il était Managing Director de BlackRock, où il était entré en août 2005 (à l'époque l'entité était dénommée Merrill Lynch Investment Managers). Avant juillet 2011, Paul Freeman était directeur du développement de produits et de la gestion de la gamme pour la région EMEA, responsable du développement et de la gestion continue des produits de tous les fonds domiciliés dans cette région et distribués par BlackRock sur une base transfrontalière. Entre juillet 2011 et décembre 2015, M. Freeman a travaillé en étroite collaboration avec l'équipe de BlackRock chargée des affaires gouvernementales et siégé à différents comités de gouvernance internes de même qu'aux conseils de plusieurs filiales et fonds gérés du groupe. M. Freeman a œuvré dans le secteur des services financiers pendant plus de 35 ans et, avant son entrée chez BlackRock, a occupé des fonctions de haute direction chez Schroders, Rothschild Asset Management, Henderson Investors et GT Management (qui appartient aujourd'hui à Invesco). M. Freeman est expert-comptable.

Francine Keiser (Luxembourgeoise) : Mme Kaiser est une ancienne associée de Linklaters LLP et est actuellement consultante pour l'entreprise. Elle est membre du Barreau de Luxembourg depuis 1989. Mme Kaiser est une avocate expérimentée, spécialisée dans les fonds d'investissement, et possède de solides compétences dans tous les domaines de la gestion d'investissements, en particulier celui des OPCVM. Elle siège comme Administrateur aux Conseils d'administration de fonds phare de plusieurs grands promoteurs de fonds, y compris BlackRock Global Funds et BlackRock Global Index Funds.

Rapport des Administrateurs suite

Geoffrey D. Radcliffe (double nationalité britannique et luxembourgeoise, résident luxembourgeois) :

M. Radcliffe est Managing Director chez BlackRock et exerce ses activités à Luxembourg. Il est membre de l'équipe BlackRock Business Operations Global Fund Services et responsable de l'administration des fonds pour la région EMEA et la région Asie-Pacifique. M. Radcliffe est Membre de l'Institute of Chartered Accountants d'Angleterre et du Pays de Galles ainsi que du Chartered Institute of Bankers. Après 30 années d'expérience dans la banque, la comptabilité et les fonds acquise à l'île de Man, à Londres, aux Bermudes et à Luxembourg, M. Radcliffe a rejoint le Groupe BlackRock en 1998. Il siège comme Administrateur au conseil d'administration de la Société et aux conseils de plusieurs fonds dont BlackRock Global Funds et BlackRock Global Index Funds.

Barry O'Dwyer (Irlandais) : M. O'Dwyer est Managing Director chez BlackRock. Il est responsable de la gouvernance et des enregistrements/cotations des fonds pour la gamme de fonds communs de placement européens de BlackRock et est le directeur exécutif pour l'activité irlandaise réglementée de BlackRock. M. O'Dwyer occupe les fonctions d'Administrateur pour plusieurs sociétés, fonds et sociétés de gestion BlackRock en Irlande, au Luxembourg, en Suisse et en Allemagne, de même pour la société de BlackRock UK Life. Il siège au conseil de l'Irish Association of Investment Managers. De 2014 à 2017, M. O'Dwyer a été président de l'Irish Funds Industry Association, et il a été membre d'un comité consultatif dans le secteur des services financiers pour le chef du gouvernement irlandais de 2015 à 2018. Il a également siégé au conseil d'administration de Financial Services Ireland de 2017 à 2018. M. O'Dwyer est entré chez BlackRock Advisors (UK) Limited en 1999, en tant que responsable de la gestion du risque, et a intégré ses fonctions actuelles en 2006. Avant de travailler pour BlackRock Advisors (UK) Limited, M. O'Dwyer a occupé les fonctions de gestionnaire du risque chez Gartmore Investment Management et HypoVereinsbank ainsi qu'à la National Westminster Bank. M. O'Dwyer a étudié au Trinity College Dublin, où il a obtenu, en 1991, un diplôme en Business Studies and Economics. Il est membre de la Chartered Association of Certified Accountants et est titulaire d'un MBA de la London City University Business School.

Robert Hayes (Britannique) : M. Hayes est un Managing Director de BlackRock et est responsable de la surveillance des investissements pour l'activité d'investissements de détail de BlackRock dans la région EMEA. L'équipe préposée à la surveillance des investissements, qui fait partie de la gestion des produits stratégiques, est chargée d'établir et de contrôler les attentes en matière d'investissement pour tous les fonds de BlackRock destinés aux particuliers dans la région EMEA. Il préside également le comité d'investissement et siège au conseil de BlackRock Life Limited, BlackRock Global Funds et BlackRock Strategic Funds. Il travaille pour le groupe depuis 2001, en ce compris ses années au service de Merrill Lynch Investment Managers (MLIM), qui a fusionné avec BlackRock en 2006. Chez MLIM, il était responsable des conseils

stratégiques et, immédiatement avant ses fonctions actuelles, il était responsable de la stratégie clients pour notre activité Client Solutions. Avant de rejoindre le groupe, M. Hayes était associé chez Watson Wyatt Partners, en tant que consultant en investissement pour les grands fonds de pension et les investisseurs institutionnels. Plus tôt, au cours de sa carrière, M. Hayes a été responsable des investissements en actions au Royaume-Uni pour ICI Pension Fund et responsable des investissements institutionnels pour M&G Investment Management. En 1983, M. Hayes a obtenu un BSc en mathématiques à l'université de Southampton.

Michael Gruener (Allemand) (nommé le 21 décembre 2017) :

M. Gruener est un Managing Director de BlackRock et est responsable des activités de détail en Europe, au Moyen-Orient et en Afrique. Il est membre du comité exécutif européen et du comité directeur européen de BlackRock. M. Gruener a rejoint BlackRock en janvier 2012 en tant que directeur de l'équipe commerciale iShares de BlackRock pour l'Allemagne, l'Autriche et l'Europe de l'Est, et est devenu directeur du segment Patrimoine et Clients de détail dans la région EMEA en janvier 2014. En 2015, il est devenu co-directeur commercial pour les produits iShares dans la région EMEA. Michael occupe ses nouvelles fonctions depuis juillet 2017. M. Gruener possède plus de 20 ans d'expérience dans le secteur des services financiers. Avant d'entrer chez BlackRock, Michael a travaillé 10 ans chez Goldman Sachs Asset Management, où il a occupé différents postes de distribution à Chicago, Londres et Francfort. M. Gruener possède la qualification de banquier allemand et un diplôme de l'université polytechnique de Cambridge avec spécialisation en finance et contrôle. Il possède également un diplôme de l'École d'économie de Berlin, en gestion et finance.

Frank Le Feuvre (nationalité britannique, résident à Jersey) (a quitté ses fonctions le 29 septembre 2017) :

Jusqu'en septembre 2017, M. Le Feuvre était le Country Manager pour les Îles anglo-normandes, et membre du Global Client Group de BlackRock. Il était également Managing Director de BlackRock (Channel Islands) Limited. M. Le Feuvre travaillait pour le groupe depuis 1972, en ce compris ses années au service de MLIM, qui a fusionné avec BlackRock en 2006. Chez MLIM, il était responsable des activités à Jersey et Managing Director de Merrill Lynch Investment Management (Channel Islands) Limited. M. Le Feuvre a également siégé comme Administrateur aux Conseils d'administration de BlackRock Global Funds et de BlackRock Global Index Funds.

Rapport sur les rémunérations (non révisé)

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

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

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

Gouvernance en matière de rémunération

La gouvernance de BlackRock en matière de rémunération dans la région EMEA s'articule en une structure à plusieurs niveaux comprenant : (a) le comité de gestion, de développement et de rémunération (« CGDR ») (qui est le comité de rémunération indépendant et international de BlackRock Inc. et de toutes ses filiales, y compris la Société de Gestion) et (b) et le conseil d'administration de la Société de Gestion (le « Conseil de la Société de Gestion »). Le CGDR est responsable de la détermination des politiques de rémunération de BlackRock.

(a) CGDR

Le principal objectif du CGDR est de :

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

- conformément aux réglementations et orientations britanniques et européennes en vigueur, agir en tant que comité de rémunération pour les entités réglementées de BlackRock dans la région EMEA.

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

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

Le CGDR s'est réuni 10 fois en 2017. La charte du CGDR peut être consultée sur le site Internet de BlackRock, Inc. (www.blackrock.com).

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

(b) Le Conseil de la Société de Gestion

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

Le Conseil de la Société de Gestion (par suite d'un examen indépendant par les fonctions de contrôle concernées) demeure satisfait de la mise en œuvre de la politique de rémunération de l'OPCVM telle qu'appliquée à la Société de Gestion et à son Personnel identifié.

Processus de prise de décision

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

Aucune formule n'est établie et aucune donnée de référence n'est utilisée dans la détermination des primes annuelles. Pour déterminer certains montants de rémunération individuelle spécifiques, plusieurs facteurs sont pris en considération, notamment les objectifs non financiers, la performance financière générale et la performance en matière d'investissement. Ces résultats sont étudiés dans leur ensemble, sans pondération particulière, et il n'existe

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

aucun lien direct entre une mesure de performance donnée et la prime annuelle qui en découle. La rémunération variable attribuée à une ou plusieurs personnes physiques pour la performance d'une année en particulier peut aussi être égale à zéro.

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

Le montant de la somme globale prévue, comprenant les primes en liquidités et les primes en actions, est revu tout au long de l'année par le CGDR, et la somme globale définitive est approuvée après la clôture de l'exercice. Dans le cadre de cette révision, le CGDR reçoit des données financières réelles et prévisionnelles tout au long de l'exercice, ainsi que des données finales de clôture. Les données financières que le CGDR reçoit et examine comprennent le compte de résultat prévisionnel et autres mesures financières, en comparaison avec l'exercice précédent et le budget de l'exercice en cours. Le CGDR examine d'autres mesures de la performance financière de BlackRock (par exemple les entrées nettes d'actifs sous gestion (« ASG ») et la performance des investissements), de même que les données concernant les conditions du marché et les niveaux de rémunération concurrentiels.

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

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

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

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

Fonctions de contrôle

Chacune des fonctions de contrôle (risque d'entreprise, affaires juridiques et conformité, et audit interne) possède sa propre structure, laquelle est indépendante des unités d'entreprise. La personne responsable de chaque fonction de contrôle est soit un membre du comité exécutif international (« CEI »), le comité de gestion international de BlackRock, soit tenue de présenter un rapport au Conseil de la Société de Gestion.

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

Lien entre la paye et la performance

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

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

Pour instaurer une culture du haut rendement, il faut être en mesure d'évaluer les performances par rapport à des objectifs, des valeurs et des comportements, de façon claire et cohérente. Les Sociétés de Gestion à structure hiérarchique utilisent une échelle de notation à 5 points pour l'évaluation générale de la performance d'un employé ; en outre, les employés fournissent une autoévaluation. La note

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

générale finale fait l'objet d'un rapprochement lors de chaque évaluation de la performance d'un employé. Les employés sont évalués par rapport à la façon dont l'objectif est atteint et par rapport à la performance absolue en elle-même.

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

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

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

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

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

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

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

La part en actions est dévolue en trois versements égaux durant les trois années suivant l'attribution.

En plus de la prime annuelle discrétionnaire mentionnée ci-dessus, des attributions d'actions dans le cadre du « Plan de partenariat » et du « Plan ciblé d'attribution d'actions » sont accordées à des cadres dirigeants afin de renforcer le lien avec les résultats futurs de l'entreprise. Les attributions de primes à long terme ont été établies individuellement, afin d'offrir une incitation significative pour une performance constante sur plusieurs années en reconnaissance de la portée du travail de l'individu, de ses compétences professionnelles et de ses aptitudes au leadership.

Dans le cadre du « Système de primes au rendement de BlackRock » (« SPRB ») certains cadres dirigeants peuvent recevoir des primes ajustées au rendement sous forme d'actions. Les primes du SPRB couvrent une période de performance de trois ans, sur la base d'une évaluation de la marge d'exploitation ajustée⁽¹⁾ et de la croissance organique du chiffre d'affaires⁽²⁾. Le versement sera déterminé en fonction des résultats de l'entreprise par rapport aux résultats financiers cibles, à la fin de l'exercice. Le maximum d'actions pouvant être accordées est de 165 % de la prime, lorsque les deux paramètres atteignent les objectifs financiers préalablement fixés. Aucune action ne peut être accordée si les résultats de l'entreprise, pour les deux paramètres ci-dessus, sont inférieurs à un seuil de performance préétabli. Ces paramètres ont été choisis comme mesures clés de la valeur pour l'actionnaire, qui perdurent tout au long des différents cycles du marché.

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

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

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

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

Personnel identifié

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

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

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

Informations quantitatives relatives à la rémunération

La Société de Gestion doit, en vertu de l'OPCVM, communiquer des informations quantitatives sur la rémunération. De telles communications sont faites conformément à l'interprétation de BlackRock des orientations réglementaires actuellement disponibles en matière d'informations quantitatives sur la rémunération. En fonction de l'évolution des pratiques des marchés ou des pratiques réglementaires, BlackRock peut juger approprié de modifier la façon dont les informations quantitatives sur la rémunération sont calculées. Lorsque de telles modifications sont apportées, il est possible que les informations relatives à un compartiment ne soient pas comparables à celles communiquées l'année précédente, ou à celles d'autres compartiments BlackRock au cours de cette même année.

Des informations sont communiquées concernant (a) le personnel de la Société de Gestion, (b) le personnel de la haute direction et (c) le personnel qui est en capacité d'affecter de façon importante le profil de risque de la Société.

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

Les membres du personnel et la haute direction de la Société de Gestion fournissent habituellement des services OPCVM et non-OPCVM au niveau des compartiments multiples, des clients et des fonctions de la Société de Gestion, ainsi qu'à l'échelle de tout le BlackRock Group. Par conséquent, les chiffres communiqués sont une somme de la part de rémunération de chaque personne physique attribuable à l'activité OPCVM de la Société, conformément à une méthode de répartition objective qui reconnaît la nature multi-services de la Société de Gestion. Ainsi, les chiffres ne sont pas représentatifs de la rémunération réelle d'une quelconque personne physique ou de sa structure de rémunération.

Le montant de la rémunération totale versée par la Société de Gestion à son personnel, attribué à l'activité OPCVM de la Société de Gestion au titre de l'exercice comptable de la Société de Gestion clos le 31 décembre 2017, est de 89,7 millions d'USD. Ce chiffre est composé d'une rémunération fixe de 5,3 millions d'USD et d'une rémunération variable de 84,4 millions d'USD. Au total, la rémunération indiquée ci-dessus a été versée à 104 bénéficiaires.

Le montant de la rémunération globale versée par la Société de Gestion à sa haute direction, attribué à l'activité OPCVM de la Société de Gestion au titre de l'exercice comptable de la Société de Gestion clos le 31 décembre 2017, était de 0,2 million d'USD, et celui attribué aux membres de son personnel dont l'action a un impact important sur le profil de risque de l'activité OPCVM de la Société de Gestion était de 89,5 millions d'USD.

Bilan

au 31 mai 2018

		BlackRock Strategic Funds combinés	BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	BlackRock Asia Extension Fund	BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund
	Note	USD	USD	USD	USD	USD	EUR
Actif							
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		26.463.884.404	941.348.805	164.315.982	22.093.460	22.306.386	658.420.141
Plus-values/(moins-values) latentes		315.576.879	63.847	40	851.204	8	53.203.876
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	26.779.461.283	941.412.652	164.316.022	22.944.664	22.306.394	711.624.017
Avoir en banque	2(a)	1.478.226.606	–	–	3.468.500	–	30.298.519
Dépôts à terme	2(a)	10.721.849	–	–	–	–	–
Dus par le courtier	15	674.090.212	–	–	46.442	113.875	13.026.434
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	169.245.712	57.320	1.511.866	43.804	90.965	473.805
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	1.423.199.148	343.528.650	32.537.249	732.520	4.907.971	11.573.586
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	510.401.072	21.281.880	–	–	–	2.647.983
Plus-value nette non réalisée sur:							
Contrats à terme	2(d)	7.980.819	–	39.434	–	–	240.398
Opérations de change à terme en cours	2(d)	10.661.281	–	–	4.000	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	27.875.985	2.513.869	–	159.784	5.665	–
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) à la valeur de marché	2(d)	121.821.639	–	–	–	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	19.816.899	1.046.123	–	–	–	4.813.149
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	12.775.481	–	–	–	–	171.735
Autres éléments de l'actif		2.046.648	–	–	135.777	109.796	67
Total des actifs		31.248.324.634	1.309.840.494	198.404.571	27.535.491	27.534.666	774.869.693
Passif							
Sommes dues à la banque	2(a)	66.658.053	12.236.074	4.658.326	–	213.315	–
Dus au courtier	15	56.181.957	27.170.393	11.694.090	–	–	–
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	31.024.973	3.237.457	755.658	118.592	35.664	853.016
Distribution de revenu payable	2(a)	51.091.180	–	–	–	–	–
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	1.604.700.014	305.154.671	12.202.658	491.284	4.808.485	2.288.475
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	213.157.203	7.772.963	–	1.301	386	120.646
Moins-value nette non réalisée sur:							
Contrats à terme	2(d)	115.825.071	–	–	14.965	–	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	214.968.787	9.819.472	262.435	–	123.420	9.632.903
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	17.993.855	–	1.781.811	–	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	51.845.611	–	–	–	–	–
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	11.274.638	–	–	–	–	997.642
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	4,5,6,7,8	56.276.648	9.844.712	85.536	72.716	83.595	796.401
Total du passif		2.463.233.125	375.235.742	31.440.514	698.858	5.264.865	14.689.083
Total de l'actif net		28.785.091.509	934.604.752	166.964.057	26.836.633	22.269.801	760.180.610

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

Bilan

au 31 mai 2018 suite

		BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund ⁽¹⁾
	Note	USD	USD	USD	USD	USD
Actif						
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		20.100.460	69.451.296	143.621.248	3.497.081.765	58.368.228
Plus-values/(moins-values) latentes		(1.537.551)	(1.903.345)	(7.512.332)	(97.634.690)	(1.071.997)
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	18.562.909	67.547.951	136.108.916	3.399.447.075	57.296.231
Avoir en banque	2(a)	2.139.577	–	3.025.053	63.049.217	583.781
Dépôts à terme	2(a)	–	–	–	–	–
Dus par le courtier	15	–	2.359.276	–	63.881.471	168.752
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	51.099	984.427	282.381	52.767.998	815.288
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	1.606.132	3.057.273	6.513.689	3.100.966	–
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	100.289	56	403.881	1.019.517	–
Plus-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	3.932	7.668	–	7.529.197	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	–	–	–	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	386.561	–	538.774	–	–
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	3.211.452	12.693
Autres éléments de l'actif		6.387	5.454	266.655	268.210	14.566
Total des actifs		22.856.886	73.962.105	147.139.349	3.594.275.103	58.891.311
Passif						
Sommes dues à la banque	2(a)	–	929.906	–	–	–
Dus au courtier	15	794.675	–	3.275.251	–	–
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	194.281	91.692	93.764	9.250.655	62.726
Distribution de revenu payable	2(a)	–	–	–	47.466.781	–
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	491.919	2.587.994	1.985.031	–	–
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	193.773	–	1.976.317	1.150.352	–
Moins-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	–	–	–	–	50.125
Opérations de change à terme en cours	2(d)	333.694	22.900	577.669	52.440.796	378.160
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	918.218	–	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	24.297	–	31.978.868	142.324
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	4,5,6,7,8	129.661	190.498	309.466	3.312.087	56.678
Total du passif		2.138.003	4.765.505	8.217.498	145.599.539	690.013
Total de l'actif net		20.718.883	69.196.600	138.921.851	3.448.675.564	58.201.298

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

Bilan

au 31 mai 2018 suite

		BlackRock European Absolute Return Fund	BlackRock European Credit Strategies Fund	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	BlackRock European Opportunities Extension Fund	BlackRock European Select Strategies Fund
	Note	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Actif						
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		1.013.634.764	93.601.919	220.535.132	851.929.415	575.501.533
Plus-values/(moins-values) latentes		55.321.170	(21.186.102)	(10.292)	280.181.597	(3.536.015)
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	1.068.955.934	72.415.817	220.524.840	1.132.111.012	571.965.518
Avoir en banque	2(a)	12.630.353	48.829.853	26.524.098	–	1.825.374
Dépôts à terme	2(a)	–	–	–	–	–
Dus par le courtier	15	–	2.648.695	1.776.384	–	4.015.726
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	896.717	761.419	643.351	2.173.747	3.202.471
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	24.224.116	1.199.418	30.421.385	39.886.668	4.205.736
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	3.062.274	–	3.298.514	–	2.659.152
Plus-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	–	–	–	–	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	–	390.105	1.210.963	1.914.406	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	8.714.129	38.594	–	6.823.624	128.911
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	1.334.885
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	–	119.223	–	–	221.017
Autres éléments de l'actif		6.599	45.819	–	8.575	9.614
Total des actifs		1.118.490.122	126.448.943	284.399.535	1.182.918.032	589.568.404
Passif						
Sommes dues à la banque	2(a)	–	–	–	11.654.228	–
Dus au courtier	15	2.395.068	–	–	4.761.696	–
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	6.795.696	133.025	277.930	830.639	129.648
Distribution de revenu payable	2(a)	–	–	–	301.911	463.623
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	29.646.201	1.604.448	28.728.782	27.551.002	8.993.182
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	3.159.543	39.826.815	626.332	1.291.765	1.484.538
Moins-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	–	306.008	–	–	1.089.415
Opérations de change à terme en cours	2(d)	2.588.205	–	–	–	3.239.220
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	19.364	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	1.303.550	–	–	146.443
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	–	23.120	–	–	–
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	4,5,6,7,8	1.854.632	258.756	643.667	12.147.860	1.731.709
Total du passif		46.439.345	43.455.722	30.296.075	58.539.101	17.277.778
Total de l'actif net		1.072.050.777	82.993.221	254.103.460	1.124.378.931	572.290.626

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

Bilan

au 31 mai 2018 suite

		BlackRock Fixed Income Strategies Fund	BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	BlackRock Global Event Driven Fund	BlackRock Global Long/ Short Equity Fund	BlackRock Global Real Asset Securities Fund ⁽¹⁾
Note		EUR	EUR	USD	USD	USD
Actif						
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		9.258.767.597	424.533.241	1.098.850.344	103.036.223	5.125.811
Plus-values/(moins-values) latentes		(53.400.248)	(7.218.073)	(1.290.264)	(3.975)	(178.047)
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	9.205.367.349	417.315.168	1.097.560.080	103.032.248	4.947.764
Avoir en banque	2(a)	829.374.209	26.253.075	–	17.211.837	95.465
Dépôts à terme	2(a)	–	–	–	–	–
Dus par le courtier	15	185.829.830	12.193.196	7.905.462	–	73.897
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	55.570.987	3.536.839	3.461.564	232.017	18.477
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	145.212.594	195.407.955	59.755.300	10.708.603	–
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	23.692.708	57.271	351.258.471	7.039.314	–
Plus-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	–	–	32.699	–	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	–	–	–	–	13.850
« Contracts for difference »	2(d)	–	–	3.392.261	1.086.020	–
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) à la valeur de marché	2(d)	43.846.992	48.960.106	–	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	783.335	–	–	–
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	1.707.302	1.129.991	–	–	–
Autres éléments de l'actif		43.699	1.524	8.341	11.209	14.763
Total des actifs		10.490.645.670	705.638.460	1.523.374.178	139.321.248	5.164.216
Passif						
Sommes dues à la banque	2(a)	–	–	5.093.088	–	–
Dus au courtier	15	–	–	–	127.278	–
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	1.276.671	815	1.176.757	62.040	–
Distribution de revenu payable	2(a)	2.071.761	–	–	–	–
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	307.807.865	240.526.804	55.194.623	8.769.496	–
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	68.820.921	44.468	63.766.080	1.878.537	–
Moins-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	54.167.894	1.066.465	–	448.197	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	68.022.899	10.480.246	15.361.120	2.057.297	–
« Contracts for difference »	2(d)	–	–	–	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	13.805.193	–	1.342.691	–	–
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	6.540.561	1.711.700	–	–	32.606
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	4,5,6,7,8	12.674.392	648.531	1.598.050	398.885	22.376
Total du passif		535.188.157	254.479.029	143.532.409	13.741.730	54.982
Total de l'actif net		9.955.457.513	451.159.431	1.379.841.769	125.579.518	5.109.234

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

Bilan

au 31 mai 2018 suite

		BlackRock Impact World Equity Fund	BlackRock Latin American Opportunities Fund	BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ⁽¹⁾	BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive
Note		USD	USD	USD	EUR	EUR
Actif						
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		172.295.247	18.141.622	146.959.564	102.051.264	116.973.781
Plus-values/(moins-values) latentes		16.467.441	(122.415)	(550.624)	3.009.644	1.892.930
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	188.762.688	18.019.207	146.408.940	105.060.908	118.866.711
Avoir en banque	2(a)	2.094.398	268.731	–	39.223	201.010
Dépôts à terme	2(a)	–	–	–	–	–
Dus par le courtier	15	100.765	–	5.380.994	–	–
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	610.496	33.055	810.509	132.899	169.107
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	26.075	180.421	91.736.336	–	–
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	44.750	2.429	–	836.521	272.692
Plus-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	7.942	–	–	–	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	–	15	–	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	–	–	–
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) à la valeur de marché	2(d)	–	–	12.020.670	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	–	1.588.758	–	–
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	–	–	375.019	–	–
Autres éléments de l'actif		74.485	38.275	–	13.976	151.228
Total des actifs		191.721.599	18.542.133	258.321.226	106.083.527	119.660.748
Passif						
Sommes dues à la banque	2(a)	–	–	29.949.075	–	–
Dus au courtier	15	–	–	–	–	–
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	–	–	–	–	–
Distribution de revenu payable	2(a)	–	–	–	–	161.004
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	–	12.389	51.530.332	785.274	–
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	112	46.195	6.597	21.040	163.830
Moins-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	–	–	434.713	–	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	387.639	–	1.857.844	2.037.458	1.835.680
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	–	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	–	–	418.017	–	–
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	4,5,6,7,8	142.160	82.853	140.733	140.977	144.124
Total du passif		529.911	141.437	84.337.311	2.984.749	2.304.638
Total de l'actif net		191.191.688	18.400.696	173.983.915	103.098.778	117.356.110

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

Bilan

au 31 mai 2018 suite

		BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	BlackRock Style Advantage Fund	BlackRock Sustainable Euro Bond Fund
Note		EUR	EUR	USD	USD	EUR
Actif						
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		151.126.503	415.731.701	195.119.333	2.800.068.329	31.048.418
Plus-values/(moins-values) latentes		5.222.086	10.344.752	2.723.532	(878.025)	(86.330)
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	156.348.589	426.076.453	197.842.865	2.799.190.304	30.962.088
Avoir en banque	2(a)	259.962	289.267	30.773.725	198.464.618	263.278
Dépôts à terme	2(a)	–	–	10.721.849	–	–
Dus par le courtier	15	–	–	23.241.135	312.517.384	191.679
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	11.748	278.067	1.535.313	22.502.382	150.858
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	–	–	4.817.829	348.502.915	369.097
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	1.087.546	1.356.744	757.685	82.191.439	–
Plus-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	–	–	–	–	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	–	–	–	2.584.025	–
« Contracts for difference »	2(d)	–	–	–	–	–
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	100.188
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	10.651.116	–
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	–	–	5.267.470	–	5.375
Autres éléments de l'actif		130.059	171.833	641	108.720	95.945
Total des actifs		157.837.904	428.172.364	274.958.512	3.776.712.903	32.138.508
Passif						
Sommes dues à la banque	2(a)	–	–	–	–	–
Dus au courtier	15	–	–	–	–	–
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	–	–	178.393	3.623.601	450
Distribution de revenu payable	2(a)	–	112.523	–	–	–
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	823.138	507.749	12.296.496	384.305.605	429.674
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	300.486	436.753	190.667	583.870	–
Moins-value nette non réalisée sur:						
Contrats à terme	2(d)	–	–	1.467.280	43.546.992	63.651
Opérations de change à terme en cours	2(d)	3.072.771	8.057.224	3.755.064	–	37.200
« Contracts for difference »	2(d)	–	–	456.720	14.759.625	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	–	413.584	–	4.304
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	15.366
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	4,5,6,7,8	191.476	346.672	730.786	1.503.082	57.032
Total du passif		4.387.871	9.460.921	19.488.990	448.322.775	607.677
Total de l'actif net		153.450.033	418.711.443	255.469.522	3.328.390.128	31.530.831

Bilan

au 31 mai 2018 suite

		BlackRock Systematic European Equity Fund	BlackRock Systematic Global Equity Fund	BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾	BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund ⁽¹⁾
Note		EUR	USD	EUR	GBP	USD
Actif						
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		16.034.196	547.674.398	30.298.258	129.068.361	–
Plus-values/(moins-values) latentes		(3.427)	30.782.847	67.684	(4.290)	–
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	16.030.769	578.457.245	30.365.942	129.064.071	–
Avoir en banque	2(a)	121.440	5.214.925	2.461.848	7.903.995	154.031
Dépôts à terme	2(a)	–	–	–	–	–
Dus par le courtier	15	2.695	279.217	1.750.922	–	–
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a),2(d)	70.325	2.083.802	147.320	1.406.512	–
A recevoir sur placements vendus	2(a),2(d)	2.850	2.851	2.175.599	7.132.079	–
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	135.116	84.554	–	487.701	–
Plus-value nette non réalisée sur :						
Contrats à terme	2(d)	2.400	12.389	55.062	–	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	–	–	–	2.981.767	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	–	1.124.653	–
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Options/swaptions achetées à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Autres éléments de l'actif		92.961	11.184	13.425	24.860	18.178
Total des actifs		16.458.556	586.146.167	36.970.118	150.125.638	172.209
Passif						
Sommes dues à la banque	2(a)	–	–	–	–	–
Dus au courtier	15	–	–	–	3.597.475	–
Intérêts et dividendes à payer	2(a),2(d)	–	–	27.292	84.281	–
Distribution de revenu payable	2(a)	–	–	–	–	–
Placements achetés à payer	2(a),2(d)	31.533	–	2.433.017	3.791.452	–
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	–	92.718	–	–	–
Moins-value nette non réalisée sur :						
Contrats à terme	2(d)	–	–	–	2.865.986	–
Opérations de change à terme en cours	2(d)	–	7.164	483.377	–	237
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	47.138	–	–
Swaps à la valeur de marché	2(d)	–	–	141.714	–	–
Options/swaptions vendues à la valeur de marché	2(d)	–	–	–	–	–
Dépenses cumulées et autres éléments du passif	4,5,6,7,8	54.747	431.183	24.310	138.819	3.046
Total du passif		86.280	531.065	3.156.848	10.478.013	3.283
Total de l'actif net		16.372.276	585.615.102	33.813.270	139.647.625	168.926

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

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	934.604.752	664.750.490	620.900.487
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	134,30	125,91	124,09
Action de Catégorie A de capitalisation en dollars australiens	AUD	178,46	170,57	172,06
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	EUR	128,43	122,99	123,05
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	129,93	124,73	125,06
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	160,17	155,06	134,72
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	113,90	106,35	104,46
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	107,08	102,39	102,32
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en livres sterling	GBP	113,49	107,32	105,96
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	EUR	131,30	125,28	124,57
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	104,40	100,37	101,01
Action de capitalisation de Catégorie I ⁽¹⁾	USD	107,42	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	EUR	106,44	101,34	101,01
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais ⁽¹⁾	JPY	10.209,24	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	155,83	141,86	137,11
BlackRock Asia Extension Fund				
Total de l'actif net	USD	166.964.057	137.635.592	111.560.495
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	162,38	136,12	112,48
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	157,62	134,41	112,39
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	166,74	139,09	114,43
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	157,79	132,94	110,41
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	155,40	127,96	103,86
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	26.836.633	30.089.540	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	EUR	95,55	100,85	–
Action de Catégorie A de capitalisation en euros	EUR	94,62	101,03	–
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	92,34	98,22	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	100,48	102,41	–
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	EUR	96,33	102,35	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	96,93	101,70	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en livres sterling	GBP	97,44	101,37	–
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	93,90	101,01	–
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	95,99	101,71	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	102,57	103,74	–
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	100,25	102,43	–
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	96,30	101,16	–
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	EUR	96,89	101,42	–
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	22.269.801	20.078.542	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	99,78	98,51	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	EUR	96,99	98,09	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	100,42	98,64	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	96,76	97,39	–
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	96,39	97,96	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	102,06	98,99	–
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	100,79	98,66	–
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	EUR	98,23	98,34	–
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	98,19	97,52	–

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund				
Total de l'actif net	EUR	760.180.610	856.511.784	1.003.733.533
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	116,23	114,11	111,52
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	118,35	116,42	114,12
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	121,40	118,38	114,99
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	112,68	111,19	109,20
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	123,73	120,38	116,65
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars canadiens	CAD	109,89	105,34	100,82
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	123,92	120,79	117,43
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	128,96	124,74	120,07
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	USD	20.718.883	65.725.617	82.878.242
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	100,76	107,55	100,15
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	103,91	109,24	100,75
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	EUR	97,69	105,06	98,23
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	103,80	110,21	102,41
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	111,06	116,17	106,99
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	105,22	112,54	105,28
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	95,94	103,62	97,58
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	116,28	125,32	101,21
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling ⁽²⁾	GBP	–	110,06	102,00
Action de capitalisation de Catégorie I ⁽²⁾	USD	–	112,82	102,18
Action de Catégorie I de capitalisation en euros	EUR	132,58	143,42	132,64
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	EUR	107,47	114,67	106,67
Action de capitalisation de Catégorie X ⁽¹⁾	USD	106,19	–	–
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund				
Total de l'actif net	USD	69.196.600	62.986.950	49.956.585
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	118,11	114,63	97,31
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	112,84	110,60	94,80
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	122,15	117,64	99,11
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	115,39	112,55	96,03
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	105,10	105,17	91,35
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	123,47	118,60	99,67
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	127,36	121,70	101,59
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund				
Total de l'actif net	USD	138.921.851	69.101.234	6.874.069
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	173,70	151,90	113,25
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	164,39	143,04	106,13
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	EUR	150,47	135,76	101,32
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	159,02	141,90	107,27
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	146,55	133,66	100,77
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	182,24	156,54	114,65
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	179,06	154,89	–
Action de Catégorie Z de capitalisation en livres sterling ⁽¹⁾	GBP	108,87	–	–

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

⁽²⁾ Catégorie d'actions fermée, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	3.448.675.564	2.042.255.082	374.821.757
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	96,74	103,24	96,69
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	114,01	115,46	104,33
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	EUR	108,21	112,29	102,96
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises ⁽¹⁾	SEK	94,89	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses	CHF	94,15	98,13	–
Action de distribution de Catégorie D	USD	104,96	110,02	102,72
Action de Catégorie D de distribution en euros ⁽¹⁾	EUR	101,75	–	–
Action de Catégorie D de distribution couverte en euros ⁽¹⁾	EUR	98,80	–	–
Action de Catégorie D de distribution couverte en livres sterling	GBP	96,47	102,89	96,38
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	100,48	108,97	89,26
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	118,75	119,35	107,02
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	113,75	117,13	106,51
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses	CHF	94,96	98,31	–
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	111,32	113,31	102,90
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	107,11	111,69	102,85
Action de Catégorie I de distribution en euros ⁽¹⁾	EUR	96,86	–	–
Action de Catégorie I de distribution couverte en euros	EUR	98,16	105,67	99,82
Action de distribution de Catégorie I (G) EUR hedged ⁽¹⁾	EUR	94,81	–	–
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	93,67	98,13	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	117,18	117,61	105,26
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros ⁽¹⁾	EUR	98,56	–	–
Action de Catégorie X de distribution en euros ⁽¹⁾	EUR	97,15	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	125,81	125,33	111,33
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars australiens	AUD	109,89	109,45	–
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars canadiens ⁽¹⁾	CAD	95,62	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en livres sterling	GBP	116,62	118,00	105,35
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund⁽³⁾				
Total de l'actif net	USD	58.201.298	–	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	99,56	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	99,72	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	EUR	98,40	–	–
Action de Catégorie E de distribution en euros	EUR	104,90	–	–
Action de Catégorie E de distribution couverte en euros	EUR	98,22	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	104,96	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	98,00	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	EUR	98,43	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	99,95	–	–
BlackRock European Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.072.050.777	1.098.315.801	1.918.944.831
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	EUR	128,62	125,02	132,43
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	128,77	125,17	132,59
Action de distribution de Catégorie D	EUR	131,36	127,04	133,89
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	133,58	129,19	136,16
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	130,60	126,99	134,50
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	138,17	132,34	138,40
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	124,06	121,19	129,02
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	135,51	130,68	137,34

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

⁽³⁾ Nouveau Compartiment lancé, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock European Credit Strategies Fund				
Total de l'actif net	EUR	82.993.221	390.507.619	415.469.917
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie H	EUR	108,26	110,19	105,58
Action de Catégorie H de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	105,09	107,43	103,50
Action de Catégorie H de capitalisation couverte en dollars US	USD	113,24	112,64	106,29
Action de Catégorie H de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	111,53	112,65	107,17
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en francs suisses ⁽²⁾	CHF	–	–	88,37
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises ⁽²⁾	SEK	–	–	917,10
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	112,60	113,77	108,28
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	116,30	116,64	110,19
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en dollars US	USD	118,03	116,61	109,29
Action de capitalisation de Catégorie T	EUR	101,12	101,94	96,96
Action de capitalisation de Catégorie U	EUR	110,86	112,28	107,05
Action de Catégorie U de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	91,88	93,46	89,59
Action de Catégorie U de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	97,07	97,96	81,58
Action de Catégorie U de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en dollars US	USD	116,23	115,06	108,02
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	127,47	127,53	120,11
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	EUR	254.103.460	598.978.706	1.076.919.611
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	119,43	118,58	127,72
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	116,01	115,59	125,01
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	122,35	121,63	131,38
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	123,94	122,07	130,47
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	90,42	89,62	96,53
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	USD	126,32	122,37	129,11
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	122,06	120,58	129,22
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	129,04	126,33	134,35
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	115,79	115,52	125,04
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	126,98	125,08	133,67
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	903,17	891,11	955,04
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	149,53	145,84	154,30
BlackRock European Opportunities Extension Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.124.378.931	1.162.728.559	661.263.993
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	316,35	297,35	219,61
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	363,99	343,45	291,04
Action de Catégorie D de distribution (G)	EUR	135,63	129,49	111,05
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	321,60	301,11	222,74
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	372,41	349,99	295,59
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	351,69	333,18	282,90
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	196,43	184,18	155,39
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	217,94	200,35	165,64
BlackRock European Select Strategies Fund				
Total de l'actif net	EUR	572.290.626	347.020.186	174.059.791
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	EUR	104,16	105,44	102,05
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	104,45	105,36	101,56
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes tchèques	CZK	1.000,65	1.017,79	–
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	USD	107,62	106,69	101,24
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	106,21	106,49	102,03
Action de distribution de Catégorie E	EUR	102,83	104,24	101,16
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	103,01	104,42	101,16
Action de distribution de Catégorie I	EUR	102,49	103,72	101,43
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	102,92	102,99	–
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	108,57	107,98	102,61

⁽²⁾ Catégorie d'actions fermée, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers..

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Fixed Income Strategies Fund				
Total de l'actif net	EUR	9.955.457.513	6.938.433.444	5.875.091.172
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	EUR	104,56	105,02	103,36
Action de Catégorie A de distribution couverte en francs suisses	CHF	101,67	102,54	101,45
Action de Catégorie A de distribution couverte en dollars US	USD	108,85	106,82	103,49
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	120,04	120,58	118,67
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	101,98	102,86	101,77
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	USD	109,24	107,23	103,88
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	103,48	103,04	100,65
Action de distribution de Catégorie D	EUR	103,54	104,01	102,23
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	USD	107,22	105,05	101,38
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	106,18	105,68	103,04
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	124,17	124,22	121,77
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	102,86	103,34	101,83
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	USD	109,96	107,50	103,77
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	107,23	106,37	103,49
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	115,20	116,29	115,02
Action de distribution de Catégorie I	EUR	122,42	122,86	120,91
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	124,51	124,34	121,65
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	1.048,88	1.049,13	1.028,92
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	USD	100,36	–	–
Action de distribution de Catégorie X	EUR	101,50	101,98	100,22
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	130,82	129,85	126,28
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	451.159.431	632.439.093	510.715.268
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	103,33	104,14	102,85
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	1.007,84	1.018,19	1.007,77
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	USD	105,39	103,77	100,94
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	106,28	106,58	104,74
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	99,65	100,39	99,18
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	100,39	101,69	100,93
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	102,28	102,37	100,41
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	1.015,24	1.018,16	1.000,77
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	111,46	111,01	108,33
BlackRock Global Event Driven Fund				
Total de l'actif net	USD	1.379.841.769	358.838.226	240.168.604
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros ⁽¹⁾	EUR	97,81	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	108,80	107,72	101,38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	102,79	104,70	100,34
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	EUR	101,60	102,89	98,34
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	109,96	108,32	101,75
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	103,48	104,79	100,09
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	EUR	103,30	104,13	98,61
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	104,61	104,56	98,77
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	106,24	109,72	104,54
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	103,02	104,85	100,97
Action de Catégorie I de distribution couverte en euros ⁽¹⁾	EUR	100,86	–	–
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	101,81	100,31	–
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	100,26	100,27	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	EUR	104,31	104,87	98,79
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais ⁽¹⁾	JPY	9.902,97	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni ⁽¹⁾	USD	100,72	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses	CHF	99,14	100,21	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	116,86	113,52	103,76
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	112,32	110,10	102,59
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	106,78	107,64	102,05
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	EUR	107,93	108,23	102,19
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	110,10	109,39	102,68

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Global Long/Short Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	125.579.518	147.886.337	257.072.181
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	107,34	101,27	95,75
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	EUR	98,90	95,42	91,62
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	990,94	958,76	921,40
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling ⁽²⁾	GBP	–	98,51	94,22
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	99,45	94,76	90,50
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	105,07	98,54	92,62
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	105,02	100,71	96,12
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	105,65	100,49	95,14
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	100,51	97,45	94,08
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros ⁽²⁾	EUR	–	98,34	93,26
Action de distribution de Catégorie J	USD	109,94	103,12	96,93
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	116,59	107,71	99,86
BlackRock Global Real Asset Securities Fund⁽³⁾				
Total de l'actif net	USD	5.109.234	–	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	99,33	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	99,65	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	101,30	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	100,06	–	–
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	99,83	–	–
BlackRock Impact World Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	191.191.688	250.403.999	236.454.799
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	130,51	114,14	98,89
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	EUR	126,43	114,26	99,20
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	130,76	119,17	104,39
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	EUR	121,31	108,06	–
Action de Catégorie I de capitalisation en yens japonais	JPY	12.596,01	11.174,42	9.671,26
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais	JPY	13.560,05	12.020,65	10.467,85
Action de Catégorie X de distribution en dollars australiens	AUD	265,59	238,61	213,64
Action de Catégorie X de capitalisation en livres sterling	GBP	157,72	141,17	106,48
BlackRock Latin American Opportunities Fund				
Total de l'actif net	USD	18.400.696	24.992.395	34.123.055
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	104,34	99,52	85,21
Action de Catégorie A de capitalisation en euros	EUR	86,37	85,79	74,16
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	75,19	74,00	56,38
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	92,98	89,56	77,45
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	107,26	101,66	86,39
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	EUR	90,76	89,41	76,73
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	GBP	77,98	76,18	57,58
BlackRock Macro Opportunities Fund⁽³⁾				
Total de l'actif net	USD	173.983.915	–	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	99,85	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	105,40	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	98,74	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	100,54	–	–
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	100,20	–	–
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en BRL	USD	88,34	–	–
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	98,61	–	–
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	EUR	98,83	–	–
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en livres sterling	GBP	99,31	–	–

⁽²⁾ Catégorie d'actions fermée, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Nouveau Compartiment lancé, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative⁽³⁾				
Total de l'actif net	EUR	103.098.778	–	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	EUR	97,61	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	97,59	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	USD	98,49	–	–
Action de distribution de Catégorie D	EUR	97,71	–	–
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	97,79	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	USD	98,68	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	98,08	–	–
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Balance	EUR	97,59	–	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive				
Total de l'actif net	EUR	117.356.110	58.777.460	26.965.752
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	EUR	102,19	102,89	101,22
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling ⁽¹⁾	GBP	100,15	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	USD	109,60	107,50	103,91
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	103,71	103,96	102,04
Action de distribution de Catégorie D	EUR	98,49	99,04	97,46
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	USD	108,13	106,22	103,03
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	100,99	100,72	98,18
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	105,89	105,49	102,90
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	99,88	99,93	97,97
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	USD	111,64	108,83	104,52
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	104,16	102,88	99,49
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	USD	100,89	–	–
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Substanz ⁽¹⁾	EUR	97,72	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	103,15	102,31	99,33
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth				
Total de l'actif net	EUR	153.450.033	32.297.310	22.196.718
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	EUR	116,45	110,69	100,88
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling ⁽¹⁾	GBP	99,76	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	USD	129,86	120,90	108,78
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	113,60	107,98	98,41
Action de distribution de Catégorie D	EUR	109,64	103,59	94,00
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	USD	120,93	111,92	100,19
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	110,99	103,99	93,91
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	123,52	116,68	105,66
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	108,14	102,43	93,23
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	USD	131,05	121,23	108,35
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	111,34	104,29	94,09
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	USD	102,85	–	–
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Chance ⁽¹⁾	EUR	96,15	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	111,81	105,17	94,79

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

⁽³⁾ Nouveau Compartiment lancé, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate				
Total de l'actif net	EUR	418.711.443	146.505.148	54.836.044
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	EUR	111,05	107,95	101,12
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling ⁽¹⁾	GBP	99,92	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	USD	121,39	115,50	106,68
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	109,65	106,59	99,84
Action de distribution de Catégorie D	EUR	104,95	101,88	95,30
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	USD	115,75	109,84	101,33
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	106,72	102,70	95,47
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	116,17	112,22	104,44
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	104,84	101,62	95,04
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	USD	122,94	116,25	106,66
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	108,51	103,91	96,19
Action de distribution de Catégorie I ⁽¹⁾	EUR	101,79	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	USD	102,07	–	–
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Wachstum ⁽¹⁾	EUR	96,64	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	108,38	104,21	96,51
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund				
Total de l'actif net	USD	255.469.522	449.807.572	149.272.130
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	USD	99,86	102,86	100,24
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	EUR	95,68	101,01	99,95
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	99,84	102,84	100,21
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	EUR	95,36	100,61	99,54
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	946,11	999,87	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	101,25	103,52	100,14
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	EUR	94,25	99,95	97,14
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	96,39	101,35	99,89
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	97,26	101,91	100,09
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	97,78	101,51	–
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	91,82	98,59	96,97
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	94,63	100,38	99,65
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	102,20	104,19	100,51
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	EUR	98,01	102,37	100,20
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	964,23	1.008,82	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses	CHF	96,83	101,53	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	106,37	106,65	101,12
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en euros	EUR	101,48	104,64	100,77
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	102,21	104,23	100,55
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	EUR	97,83	102,23	100,16
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	99,91	103,45	100,55

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Style Advantage Fund				
Total de l'actif net	USD	3.328.390.128	586.420.943	91.768.028
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	USD	108,61	114,00	100,40
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	EUR	104,64	112,56	100,30
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	106,88	112,20	98,61
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros ⁽¹⁾	EUR	92,47	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	SEK	94,21	101,14	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	108,95	113,52	99,12
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses ⁽¹⁾	CHF	94,16	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	EUR	103,48	111,81	98,18
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	104,46	111,39	98,57
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en livres sterling	GBP	97,66	103,41	–
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	101,13	110,60	98,07
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	102,41	110,56	98,82
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en CHF ⁽¹⁾	CHF	96,06	–	–
Action PF de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	EUR	105,47	111,91	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL ⁽¹⁾	USD	86,97	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en francs suisses ⁽¹⁾	CHF	94,43	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	EUR	104,90	111,67	98,64
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en livres sterling	GBP	97,80	103,35	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni ⁽¹⁾	USD	96,53	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en yens japonais	JPY	10.592,54	11.245,06	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	111,12	114,70	99,06
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars australiens	AUD	112,90	116,22	99,53
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en euros ⁽¹⁾	EUR	96,68	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars néo-zélandais	NZD	112,02	115,16	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	109,28	–	–
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	109,28	113,59	98,86
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	EUR	104,87	111,68	98,62
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	–	–	98,85
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	31.530.831	35.690.553	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	EUR	97,59	97,54	–
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	97,66	97,56	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	98,24	97,80	–
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	96,79	97,25	–
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	98,49	97,92	–
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	99,11	98,18	–
BlackRock Systematic European Equity Fund				
Total de l'actif net	EUR	16.372.276	16.616.512	14.807.626
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	108,45	106,87	93,84
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	109,85	107,82	94,28
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	106,69	105,67	93,26
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	112,15	109,39	95,05
BlackRock Systematic Global Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	585.615.102	279.133.927	231.591.282
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	135,81	119,33	101,28
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	EUR	134,32	121,92	103,70
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	131,11	120,03	102,99
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	128,22	116,03	100,55
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	115,00	100,42	–
Action de Catégorie I de capitalisation en euros	EUR	132,27	119,79	101,65
Action de capitalisation de Catégorie X ⁽¹⁾	USD	102,79	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation en euros ⁽¹⁾	EUR	105,39	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation en livres sterling	GBP	163,96	147,29	108,76

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

Récapitulatif sur trois ans des Valeurs Nettes d'Inventaire

au 31 mai 2018 suite

	Monnaie	31 mai 2018	31 mai 2017	31 mai 2016
BlackRock Total Advantage Fund⁽³⁾				
Total de l'actif net	EUR	33.813.270	-	-
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	95,99	-	-
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	96,23	-	-
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	USD	97,36	-	-
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	GBP	96,66	-	-
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	99,53	-	-
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	96,32	-	-
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	96,60	-	-
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund				
Total de l'actif net	GBP	139.647.625	146.561.755	-
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	EUR	100,95	102,50	-
Action de capitalisation de Catégorie A	GBP	103,11	103,71	-
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	EUR	101,56	103,09	-
Action de capitalisation de Catégorie D	GBP	104,24	104,17	-
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	EUR	103,89	104,10	-
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	CHF	101,98	103,21	-
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	EUR	102,75	103,56	-
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	USD	102,89	101,40	-
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	EUR	99,94	101,42	-
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	EUR	100,16	102,20	-
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros ⁽¹⁾	EUR	99,21	-	-
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais	JPY	10.358,51	10.380,70	-
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	USD	100,96	-	-
Action de capitalisation de Catégorie X	GBP	107,28	106,03	-
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund⁽³⁾				
Total de l'actif net	USD	168.926	-	-
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution de Catégorie A	USD	100,28	-	-
Action de Catégorie A de distribution en euros	EUR	102,90	-	-
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	EUR	99,23	-	-
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	100,30	-	-
Action de Catégorie A de capitalisation en euros	EUR	102,94	-	-
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	EUR	99,27	-	-
Action de distribution de Catégorie D	USD	100,22	-	-
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	100,23	-	-

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

⁽³⁾ Nouveau Compartiment lancé, pour plus d'informations voir le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2018

		BlackRock Strategic Funds combinés	BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	BlackRock Asia Extension Fund	BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund
Note	USD	USD	USD	USD	USD	USD	EUR
Actif net au début de l'exercice		19.215.834.951	664.750.490	137.635.592	30.089.540	20.078.542	856.511.784
Revenus							
Intérêt bancaire	2(c)	15.595.971	9.855.283	162.902	12.447	121.325	–
Intérêts obligataires	2(c)	415.850.727	7.191.920	2.009.013	18.779	198.603	1.065.576
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> »	2(c)	32.112	–	–	32.112	–	–
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	5.753.943	170.503	–	–	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	59.265.676	–	–	530.818	–	4.042.231
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source	2(d)	221.550.417	42.688.564	5.223.437	405	1.845.430	–
Prêts de titres	2(c)	1.541.375	–	–	1.434	–	39.774
Remise sur la commission de gestion	4	1.758.741	–	–	–	–	234.358
Autre revenu		12.810	–	–	–	–	–
Total des revenus		721.361.772	59.906.270	7.395.352	595.995	2.165.358	5.381.939
Frais							
Intérêt bancaire	2(c)	9.175.421	–	–	–	–	76.907
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	102.926.893	26.082.818	4.515.031	–	1.179.558	–
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	55.327.693	–	–	–	–	549.245
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	11.198.210	15.749	27.700	–	–	603.676
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source	2(d)	201.237.549	53.965.458	1.328.533	538.404	1.512.138	–
Commissions d'administration	5	36.794.712	2.007.754	80.176	31.479	27.022	706.379
Commissions du Dépositaire	2(i),6	10.958.471	784.572	118.929	109.560	82.855	155.638
Fiscalité	8	8.356.739	353.120	16.002	5.313	4.787	187.510
Commissions de performance	7	19.978.076	8.114.721	–	–	–	–
Commissions de distribution	4	8.889.714	42.218	152	93	57	24.765
Commissions d'engagement de prêt	14	221.902	7.271	1.522	292	110	11.570
Commissions de gestion et commissions des gestionnaires délégués externes	4	188.980.755	9.192.153	3.619	56.946	32.779	5.205.213
Autres frais		99.689	–	–	–	–	65.985
Total des dépenses avant remboursement		654.145.824	100.565.834	6.091.664	742.087	2.839.306	7.586.888
Remboursement des dépenses	4	1.746.728	–	–	73.235	109.578	–
Total des dépenses après remboursement		652.399.096	100.565.834	6.091.664	668.852	2.729.728	7.586.888
Revenu/(déficit) net de l'investissement		68.962.676	(40.659.564)	1.303.688	(72.857)	(564.370)	(2.204.949)
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:							
Placements	2(a),2(b)	436.336.078	756.877	1.759	3.542.239	562	31.906.720
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	(179.266)	–	–	–	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	145.356.951	94.936.373	37.830.334	(3.479.200)	1.105.671	–
Contrats à terme	2(d)	3.521.268	(78.778)	988.016	(486.591)	–	(962.649)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d), 2(e), (2j)	(36.503.791)	20.524.506	470.593	226.683	172.391	20.959.579
Opérations de swap	2(d)	54.798.013	(3.943.665)	–	–	–	18.494.458
Contrats d'option	2(d)	70.880	–	–	(16.938)	–	(1.308.518)
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		603.400.133	112.195.313	39.290.702	(213.807)	1.278.624	69.089.590
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes sur:							
Placements	2(a)	(282.716.331)	(146.887)	(3.565)	(853.469)	8	(15.194.489)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	2.742.294	–	–	–	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	(13.873.381)	(644.051)	(10.451.824)	600.793	(348)	–
Contrats à terme	2(d)	(66.411.075)	–	(180.262)	66.185	–	(645.454)
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d), 2(e), (2j)	(339.236.319)	(24.004.036)	(479.429)	13.846	(101.686)	(23.946.911)
Opérations de swap	2(d)	27.589.995	1.802.735	–	–	–	(8.682.434)
Contrats d'option	2(d)	176.767	–	–	16.415	–	543.366
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes pour l'exercice		(671.728.050)	(22.992.239)	(11.115.080)	(156.230)	(102.026)	(47.925.922)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		634.759	48.543.510	29.479.310	(442.894)	612.228	18.958.719
Mouvements du capital social							
Encaissement net sur l'émission d'actions		19.665.311.191	641.321.265	93.739	1.311.809	1.579.440	135.929.961
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(10.491.351.967)	(420.010.513)	(244.584)	(4.121.822)	(409)	(251.219.854)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		9.173.959.224	221.310.752	(150.845)	(2.810.013)	1.579.031	(115.289.893)
Dividendes déclarés	11	(58.204.839)	–	–	–	–	–
Ajustement de change	2(f)	452.867.414*	–	–	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		28.785.091.509	934.604.752	166.964.057	26.836.633	22.269.801	760.180.610

* Les chiffres combinés ont été calculés à l'aide des taux de change moyens tout au long de l'exercice. L'ajustement des taux de change obtenu, de 452.867.414 USD, représente la variation des taux de change entre le 31 mai 2017 et le 31 mai 2018. Il s'agit d'un montant notionnel, qui n'a aucun impact sur l'actif net de chacun des Compartiments.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

		BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund ⁽¹⁾
Note		USD	USD	USD	USD	USD
	Actif net au début de l'exercice	65.725.617	62.986.950	69.101.234	2.042.255.082	–
	Revenus					
	Intérêt bancaire 2(c)	3.223	125.791	–	356.432	33.438
	Intérêts obligataires 2(c)	22.251	1.977.658	–	181.151.972	889.055
	Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> » 2(c)	–	–	–	–	–
	Intérêts et dividendes des swaps 2(c)	–	669	91	–	–
	Dividendes, après déduction des retenues à la source 2(c)	1.047.750	–	2.619.148	36.417	–
	Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source 2(d)	166.421	1.161.786	515.026	–	–
	Prêts de titres 2(c)	36.305	–	82.465	493.715	21
	Remise sur la commission de gestion 4	809	–	6.168	–	–
	Autre revenu	–	–	–	–	–
	Total des revenus	1.276.759	3.265.904	3.222.898	182.038.536	922.514
	Frais					
	Intérêt bancaire 2(c)	–	–	16.920	–	–
	Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	61.561	756.972	407.357	–	–
	Intérêts et dividendes des swaps 2(c)	–	–	–	37.571.443	70.980
	Rendement négatif sur actifs financiers 2(c)	–	191	–	38.548	–
	Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source 2(d)	722.065	11.601	478.558	–	–
	Commissions d'administration 5	81.928	174.467	248.571	2.607.600	9.709
	Commissions du Dépositaire 2(i),6	189.745	68.298	343.027	2.050.677	37.659
	Fiscalité 8	14.870	34.863	43.937	607.502	5.237
	Commissions de performance 7	–	–	–	–	–
	Commissions de distribution 4	4.861	40.537	12.808	302.195	29
	Commissions d'engagement de prêt 14	770	679	358	11.582	43
	Commissions de gestion et commissions des gestionnaires délégués externes 4	401.711	907.541	739.725	16.932.904	22.963
	Autres frais	–	–	–	–	–
	Total des dépenses avant remboursement	1.477.511	1.995.149	2.291.261	60.122.451	146.620
	Remboursement des dépenses 4	3.774	3.298	252.224	230.356	14.566
	Total des dépenses après remboursement	1.473.737	1.991.851	2.039.037	59.892.095	132.054
	Revenu/(déficit) net de l'investissement	(196.978)	1.274.053	1.183.861	122.146.441	790.460
	Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur :					
	Placements 2(a),2(b)	7.902.980	(78.147)	14.278.368	(9.869.176)	(384.004)
	Contrats sur titres à déterminer (TBAs) 2(d)	–	–	–	–	–
	« <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	(7.838.209)	4.976.894	5.592.333	–	–
	Contrats à terme 2(d)	(420.997)	204.932	–	18.893.061	41.619
	Devises étrangères et opérations de change à terme 2(d), 2(e), 2(j)	4.762.311	(135.828)	853.945	(34.897.363)	(659.651)
	Opérations de swap 2(d)	–	25.058	(5.048)	(9.131.687)	17.581
	Contrats d'option 2(d)	–	–	–	10.391.479	(11.607)
	Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice	4.406.085	4.992.909	20.719.598	(24.613.686)	(996.062)
	Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes sur :					
	Placements 2(a)	(6.160.120)	(2.611.421)	(11.133.749)	(159.438.446)	(1.071.997)
	Contrats sur titres à déterminer (TBAs) 2(d)	–	–	–	–	–
	« <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	1.143.209	(1.756.539)	(126.161)	–	–
	Contrats à terme 2(d)	110.688	(43.974)	–	7.529.197	(50.125)
	Devises étrangères et opérations de change à terme 2(d), 2(e), 2(j)	(2.115.177)	(58.459)	(973.003)	(77.516.257)	(383.046)
	Opérations de swap 2(d)	–	(114.503)	1.619	39.113.759	133.963
	Contrats d'option 2(d)	–	–	–	(1.092.011)	1.708
	Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes pour l'exercice	(7.021.400)	(4.584.896)	(12.231.294)	(191.403.758)	(1.369.497)
	Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations	(2.812.293)	1.682.066	9.672.165	(93.871.003)	(1.575.099)
	Mouvements du capital social					
	Encaissement net sur l'émission d'actions	15.755.513	8.117.005	119.082.271	2.757.656.370	59.776.402
	Paiements nets résultant du rachat d'actions	(57.949.954)	(3.589.421)	(58.933.819)	(1.204.422.893)	–
	Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social	(42.194.441)	4.527.584	60.148.452	1.553.233.477	59.776.402
	Dividendes déclarés 11	–	–	–	(52.941.992)	(5)
	Ajustement de change 2(f)	–	–	–	–	–
	Actif net à la clôture de l'exercice	20.718.883	69.196.600	138.921.851	3.448.675.564	58.201.298

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

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

		BlackRock European Absolute Return Fund	BlackRock European Credit Strategies Fund	BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	BlackRock European Opportunities Extension Fund	BlackRock European Select Strategies Fund
Note		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
	Actif net au début de l'exercice	1.098.315.801	390.507.619	598.978.706	1.162.728.559	347.020.186
	Revenus					
	Intérêt bancaire	400.216	32.940	—	—	—
2(c)	Intérêts obligataires	900.853	7.679.987	10.858	—	4.062.020
2(c)	Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> »	—	—	—	—	—
2(c)	Intérêts et dividendes des swaps	—	—	—	—	—
2(c)	Dividendes, après déduction des retenues à la source	5.077.899	28.939	4.678	12.407.661	5.372.105
	Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source	3.996.556	1.129.632	34.654.190	8.532.532	—
2(d)	Prêts de titres	59.419	—	—	96.086	57.748
2(c)	Remise sur la commission de gestion	—	—	—	—	1.014
4	Autre revenu	—	—	5.987	—	—
	Total des revenus	10.434.943	8.871.498	34.675.713	21.036.279	9.492.887
	Frais					
	Intérêt bancaire	—	—	1.969.980	345.456	53.753
2(c)	Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> »	5.388.128	70.372	13.343.463	5.611.591	5.474
2(d)	Intérêts et dividendes des swaps	—	5.066.846	—	—	307.714
2(c)	Rendement négatif sur actifs financiers	2.594.308	2.634.794	1.491.391	669.483	41.860
2(c)	Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source	13.833.437	260.214	32.294.120	7.397.462	64.503
2(d)	Commissions d'administration	2.394.481	190.076	970.973	3.025.868	618.504
5	Commissions du Dépositaire	391.293	97.072	548.230	564.792	221.624
2(i),6	Fiscalité	404.281	37.231	148.805	508.636	164.684
8	Commissions de performance	—	—	—	9.934.221	—
7	Commissions de distribution	132.631	—	34.036	533.975	1.214.422
4	Commissions d'engagement de prêt	20.769	3.676	11.308	7.603	3.351
14	Commissions de gestion et commissions des gestionnaires délégués externes	13.348.492	2.337.640	5.445.286	14.090.758	4.416.811
4	Autres frais	—	—	—	—	—
	Total des dépenses avant remboursement	38.507.820	10.697.921	56.257.592	42.689.845	7.112.700
	Remboursement des dépenses	—	45.819	—	—	4.612
4	Total des dépenses après remboursement	38.507.820	10.652.102	56.257.592	42.689.845	7.108.088
	Revenu/(déficit) net de l'investissement	(28.072.877)	(1.780.604)	(21.581.879)	(21.653.566)	2.384.799
	Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur:					
	Placements	32.106.198	311.829	299.881	67.899.252	4.640.142
2(a),2(b)	Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	—	—	—	—	—
2(d)	« <i>Contracts for difference</i> »	25.824.306	(1.782.070)	9.912.120	(2.621.475)	79.043
2(d)	Contrats à terme	(4.129.003)	(863.371)	—	—	(506.942)
2(d), 2(e),	Devises étrangères et opérations de change à terme	215.586	(4.172.576)	(10.786.808)	(14.898.127)	2.631.376
(2)	Opérations de swap	—	(5.264.598)	—	—	328.220
2(d)	Contrats d'option	—	(561.745)	—	—	(59.406)
2(d)	Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice	54.017.087	(12.332.531)	(574.807)	50.379.650	7.112.433
	Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes sur:					
	Placements	710.949	900.618	(32.393)	28.030.273	(9.006.538)
2(a)	Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	—	—	—	—	58.446
2(d)	« <i>Contracts for difference</i> »	1.053.565	(1.375.291)	5.855.460	1.654.178	179.604
2(d)	Contrats à terme	5.807.310	461.541	—	—	(557.665)
2(d), 2(e),	Devises étrangères et opérations de change à terme	(2.242.665)	928.414	5.129.007	8.464.197	(6.184.000)
(2)	Opérations de swap	—	7.889.048	—	—	158.069
2(d)	Contrats d'option	—	68.616	—	—	68.024
2(d)	Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes pour l'exercice	5.329.159	8.872.946	10.952.074	38.148.648	(15.284.060)
	Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations	31.273.369	(5.240.189)	(11.204.612)	66.874.732	(5.786.828)
	Mouvements du capital social					
	Encaissement net sur l'émission d'actions	645.373.095	10.303.218	114.906.433	48.188.013	352.150.287
	Paiements nets résultant du rachat d'actions	(702.911.488)	(312.577.427)	(448.577.067)	(152.422.281)	(120.624.433)
	Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social	(57.538.393)	(302.274.209)	(333.670.634)	(104.234.268)	231.525.854
	Dividendes déclarés	—	—	—	(990.092)	(468.586)
11	Ajustement de change	—	—	—	—	—
2(f)	Actif net à la clôture de l'exercice	1.072.050.777	82.993.221	254.103.460	1.124.378.931	572.290.626

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

		BlackRock Fixed Income Strategies Fund	BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	BlackRock Global Event Driven Fund	BlackRock Global Long/ Short Equity Fund	BlackRock Global Real Asset Securities Fund ⁽¹⁾
Note		EUR	EUR	USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		6.938.433.444	632.439.093	358.838.226	147.886.337	–
Revenus						
Intérêt bancaire	2(c)	–	–	3.699.091	–	–
Intérêts obligataires	2(c)	119.034.888	17.761.004	9.673.979	1.455.050	–
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> »	2(c)	–	–	–	–	–
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	–	180.971	–	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	215.201	745.311	702.353	–	121.949
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source	2(d)	–	–	7.622.744	3.655.758	–
Prêts de titres	2(c)	330.049	10.611	6.906	–	–
Remise sur la commission de gestion	4	233.357	56.064	–	–	–
Autre revenu		–	–	–	5.695	–
Total des revenus		119.813.495	18.753.961	21.705.073	5.116.503	121.949
Frais						
Intérêt bancaire	2(c)	4.723.513	148.557	–	14.933	424
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	8.324.390	1.899.173	–
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	7.158.196	–	1.045.722	–	–
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	1.145.154	15.628	3.817	3.464	–
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source	2(d)	–	–	3.204.963	3.422.816	–
Commissions d'administration	5	13.747.833	762.352	1.703.433	397.680	1.324
Commissions du Dépositaire	2(i),6	647.760	677.668	199.922	189.714	21.782
Fiscalité	8	3.471.935	175.631	326.793	65.059	357
Commissions de performance	7	–	–	54.549	–	–
Commissions de distribution	4	5.032.560	5.618	20.146	143.132	13
Commissions d'engagement de prêt	14	68.875	6.169	2.913	2.106	9
Commissions de gestion et commissions des gestionnaires délégués externes	4	61.934.628	3.483.802	7.557.842	2.295.718	404
Autres frais		–	–	–	–	–
Total des dépenses avant remboursement		97.930.454	5.275.425	22.444.490	8.433.795	24.313
Remboursement des dépenses	4	–	–	5.153	10.544	14.763
Total des dépenses après remboursement		97.930.454	5.275.425	22.439.337	8.423.251	9.550
Revenu/(déficit) net de l'investissement		21.883.041	13.478.536	(734.264)	(3.306.748)	112.399
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur :						
Placements	2(a),2(b)	130.717.096	2.677.337	3.710.431	1.286	76.408
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	–	(150.850)	–	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	5.117.446	12.656.501	–
Contrats à terme	2(d)	(13.691.128)	8.150.342	1.242.664	964.846	–
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d), 2(e), (2j)	2.660.694	(10.826.636)	11.650.750	5.452.439	(2.437)
Opérations de swap	2(d)	16.412.628	(1.780.334)	(557.310)	–	–
Contrats d'option	2(d)	(1.969.540)	(1.563.056)	1.680.860	(791.985)	(7.760)
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		134.129.750	(3.493.197)	22.844.841	18.283.087	66.211
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes sur :						
Placements	2(a)	(94.595.968)	692.163	(2.891.169)	3.242	(178.047)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	1.942.785	237.053	–	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	2.944.154	(524.881)	–
Contrats à terme	2(d)	(26.506.764)	(850.133)	39.612	(581.672)	–
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d), 2(e), (2j)	(98.595.906)	(23.280.994)	(22.736.776)	(4.824.510)	13.426
Opérations de swap	2(d)	163.163	1.533.873	79.714	–	–
Contrats d'option	2(d)	1.314.992	(499.067)	–	–	(9.513)
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes pour l'exercice		(216.277.698)	(22.167.105)	(22.564.465)	(5.927.821)	(174.134)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(60.264.907)	(12.181.766)	(453.888)	9.048.518	4.476
Mouvements du capital social						
Encaissement net sur l'émission d'actions		7.032.464.676	135.340.739	1.323.236.721	54.313.336	5.108.823
Paielements nets résultant du rachat d'actions		(3.952.892.635)	(304.438.635)	(301.747.408)	(85.668.673)	(4.065)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		3.079.572.041	(169.097.896)	1.021.489.313	(31.355.337)	5.104.758
Dividendes déclarés	11	(2.283.065)	–	(31.882)	–	–
Ajustement de change	2(f)	–	–	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		9.955.457.513	451.159.431	1.379.841.769	125.579.518	5.109.234

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

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

		BlackRock Impact World Equity Fund	BlackRock Latin American Opportunities Fund	BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ⁽¹⁾	BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive
Note	USD	USD	USD	EUR	EUR	
Actif net au début de l'exercice	250.403.999	24.992.395	–	–	58.777.460	
Revenus						
Intérêt bancaire 2(c)	–	575	35.490	–	–	
Intérêts obligataires 2(c)	–	74.140	1.098.206	–	–	
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> » 2(c)	–	–	–	–	–	
Intérêts et dividendes des swaps 2(c)	–	–	291.060	–	–	
Dividendes, après déduction des retenues à la source 2(c)	4.468.929	445.273	27.852	266.894	1.039.972	
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source 2(d)	–	–	–	–	–	
Prêts de titres 2(c)	28.480	28	–	3.929	20.115	
Remise sur la commission de gestion 4	–	–	1.382	52.822	166.028	
Autre revenu	–	–	–	–	–	
Total des revenus	4.497.409	520.016	1.453.990	323.645	1.226.115	
Frais						
Intérêt bancaire 2(c)	4.836	–	–	1.574	4.173	
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	–	–	–	–	–	
Intérêts et dividendes des swaps 2(c)	–	–	–	–	–	
Rendement négatif sur actifs financiers 2(c)	–	–	–	–	–	
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source 2(d)	–	–	–	–	–	
Commissions d'administration 5	118.017	78.183	63.983	15.085	46.333	
Commissions du Dépositaire 2(i),6	225.163	81.742	47.500	67.887	157.686	
Fiscalité 8	23.754	12.780	22.568	8.704	42.458	
Commissions de performance 7	–	478	7	–	–	
Commissions de distribution 4	1.657	3.022	11	–	–	
Commissions d'engagement de prêt 14	2.719	424	87	–	449	
Commissions de gestion et commissions des gestionnaires délégués externes 4	95.260	515.892	128.508	232.772	546.193	
Autres frais	–	–	–	–	–	
Total des dépenses avant remboursement	471.406	692.521	262.664	326.022	797.292	
Remboursement des dépenses 4	69.056	35.316	–	11.850	142.833	
Total des dépenses après remboursement	402.350	657.205	262.664	314.172	654.459	
Revenu/(déficit) net de l'investissement	4.095.059	(137.189)	1.191.326	9.473	571.656	
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur :						
Placements 2(a),2(b)	33.399.066	5.957.921	(125.212)	168.081	(1.270.111)	
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) 2(d)	–	–	–	–	–	
« <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	–	–	–	–	–	
Contrats à terme 2(d)	(56.933)	–	448.188	–	–	
Devises étrangères et opérations de change à terme 2(d), 2(e), 2(i)	4.730.402	(931.260)	(9.897.006)	(1.129.979)	(202.664)	
Opérations de swap 2(d)	–	–	(167.743)	–	–	
Contrats d'option 2(d)	–	–	381.766	–	–	
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice	38.072.535	5.026.661	(9.360.007)	(961.898)	(1.472.775)	
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes sur :						
Placements 2(a)	(6.058.461)	(2.671.113)	(550.624)	3.009.644	2.252.597	
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) 2(d)	–	–	77.194	–	–	
« <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	–	–	–	–	–	
Contrats à terme 2(d)	(31.543)	–	(434.713)	–	–	
Devises étrangères et opérations de change à terme 2(d), 2(e), 2(i)	(866.424)	(724)	(1.899.291)	(2.035.590)	(1.641.400)	
Opérations de swap 2(d)	–	–	(141.287)	–	–	
Contrats d'option 2(d)	–	–	(324.482)	–	–	
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes pour l'exercice	(6.956.428)	(2.671.837)	(3.273.203)	974.054	611.197	
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations	35.211.166	2.217.635	(11.441.884)	21.629	(289.922)	
Mouvements du capital social						
Encaissement net sur l'émission d'actions	9.602.488	1.005.573	186.080.190	104.288.612	95.688.709	
Paievements nets résultant du rachat d'actions	(104.024.128)	(9.814.907)	(654.391)	(1.211.459)	(36.520.094)	
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social	(94.421.640)	(8.809.334)	185.425.799	103.077.153	59.168.615	
Dividendes déclarés 11	(1.837)	–	–	(4)	(300.043)	
Ajustement de change 2(f)	–	–	–	–	–	
Actif net à la clôture de l'exercice	191.191.688	18.400.696	173.983.915	103.098.778	117.356.110	

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

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

		BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	BlackRock Style Advantage Fund	BlackRock Sustainable Euro Bond Fund
Note	EUR	EUR	USD	USD	EUR	
Actif net au début de l'exercice	32.297.310	146.505.148	449.807.572	586.420.943	35.690.553	
Revenus						
Intérêt bancaire 2(c)	–	–	289.877	–	10.612	
Intérêts obligataires 2(c)	–	–	8.808.213	21.427.796	284.075	
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> » 2(c)	–	–	–	–	–	
Intérêts et dividendes des swaps 2(c)	–	–	–	5.076.559	–	
Dividendes, après déduction des retenues à la source 2(c)	152.522	1.901.148	1.001.487	–	–	
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source 2(d)	–	–	4.094.146	91.300.061	–	
Prêts de titres 2(c)	11.393	35.861	–	–	176	
Remise sur la commission de gestion 4	180.214	549.054	12	–	–	
Autre revenu	–	–	–	–	–	
Total des revenus	344.129	2.486.063	14.193.735	117.804.416	294.863	
Frais						
Intérêt bancaire 2(c)	7.541	16.947	–	399.803	–	
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	–	–	2.364.438	27.351.664	–	
Intérêts et dividendes des swaps 2(c)	–	–	1.082.908	–	8.681	
Rendement négatif sur actifs financiers 2(c)	–	–	–	9.949	4.812	
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source 2(d)	–	–	3.699.007	65.863.918	–	
Commissions d'administration 5	50.576	147.215	649.308	1.124.149	19.535	
Commissions du Dépositaire 2(i),6	142.510	194.383	606.835	348.376	86.363	
Fiscalité 8	48.069	133.539	101.805	290.881	4.248	
Commissions de performance 7	–	–	–	–	–	
Commissions de distribution 4	–	–	9.802	12.439	338	
Commissions d'engagement de prêt 14	285	854	3.110	6.411	350	
Commissions de gestion et commissions des gestionnaires délégués externes 4	640.063	1.663.722	5.931.768	7.094.953	13.524	
Autres frais	–	–	21.274	–	–	
Total des dépenses avant remboursement	889.044	2.156.660	14.470.255	102.502.543	137.851	
Remboursement des dépenses 4	125.939	164.534	679	83.066	70.118	
Total des dépenses après remboursement	763.105	1.992.126	14.469.576	102.419.477	67.733	
Revenu/(déficit) net de l'investissement	(418.976)	493.937	(275.841)	15.384.939	227.130	
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur :						
Placements 2(a),2(b)	2.052.317	3.145.504	10.091.921	(87.407)	269.654	
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) 2(d)	–	–	–	–	–	
« <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	–	–	–	(41.708.114)	–	
Contrats à terme 2(d)	–	–	(3.974.406)	86.404	33.949	
Devises étrangères et opérations de change à terme 2(d), 2(e), 2(i)	(577.058)	328.693	14.882.586	(33.866.581)	25.519	
Opérations de swap 2(d)	–	–	(346.105)	35.278.632	(1.467)	
Contrats d'option 2(d)	–	–	(5.059.286)	–	(3.732)	
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice	1.475.259	3.474.197	15.594.710	(40.297.066)	323.923	
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes sur :						
Placements 2(a)	4.281.371	9.105.898	(3.212.072)	(802.742)	(138.702)	
Contrats sur titres à déterminer (TBAs) 2(d)	–	–	–	–	4.358	
« <i>Contracts for difference</i> » 2(d)	–	–	(352.547)	(13.415.325)	–	
Contrats à terme 2(d)	–	–	(783.698)	(43.838.136)	(15.081)	
Devises étrangères et opérations de change à terme 2(d), 2(e), 2(i)	(3.182.907)	(7.846.724)	(12.173.964)	(5.064.284)	(90.509)	
Opérations de swap 2(d)	–	–	972.249	(15.344.930)	(5.625)	
Contrats d'option 2(d)	–	–	(197.713)	–	3.903	
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes pour l'exercice	1.098.464	1.259.174	(15.747.745)	(78.465.417)	(241.656)	
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations	2.154.747	5.227.308	(428.876)	(103.377.544)	309.397	
Mouvements du capital social						
Encaissement net sur l'émission d'actions	149.027.545	324.551.487	122.148.058	2.964.513.866	2.922.357	
Paiements nets résultant du rachat d'actions	(30.027.950)	(57.215.999)	(316.057.232)	(119.167.137)	(7.391.476)	
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social	118.999.595	267.335.488	(193.909.174)	2.845.346.729	(4.469.119)	
Dividendes déclarés 11	(1.619)	(356.501)	–	–	–	
Ajustement de change 2(f)	–	–	–	–	–	
Actif net à la clôture de l'exercice	153.450.033	418.711.443	255.469.522	3.328.390.128	31.530.831	

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

		BlackRock Systematic European Equity Fund	BlackRock Systematic Global Equity Fund	BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾	BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund ⁽¹⁾
Note		EUR	USD	EUR	GBP	USD
Actif net au début de l'exercice		16.616.512	279.133.927	–	146.561.755	–
Revenus						
Intérêt bancaire	2(c)	–	–	–	276.357	2.114
Intérêts obligataires	2(c)	–	–	60.288	423.385	8.536
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> »	2(c)	–	–	–	–	–
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	–	–	–	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(c)	492.747	10.459.656	–	56.931	–
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source	2(d)	–	–	491.990	3.935.674	–
Prêts de titres	2(c)	3.287	97.654	–	–	–
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	–	–	–
Autre revenu		–	–	–	–	–
Total des revenus		496.034	10.557.310	552.278	4.692.347	10.650
Frais						
Intérêt bancaire	2(c)	774	2.860	1.740	–	–
Intérêts sur « <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	69.279	658.144	–
Intérêts et dividendes des swaps	2(c)	–	–	–	–	–
Rendement négatif sur actifs financiers	2(c)	–	–	138.289	66	–
Dividendes des « <i>Contracts for difference</i> », après déduction des retenues à la source	2(d)	–	–	339.559	1.560.570	–
Commissions d'administration	5	10.790	237.094	8.033	116.356	3.999
Commissions du Dépositaire	2(i),6	104.248	518.567	21.438	62.587	2.716
Fiscalité	8	2.025	51.725	2.277	21.930	14
Commissions de performance	7	–	–	–	2.042	–
Commissions de distribution	4	1.501	1.728	5	98	–
Commissions d'engagement de prêt	14	168	19.392	52	823	–
Commissions de gestion et commissions des gestionnaires délégués externes	4	7.192	603.007	80	1.293.034	11.449
Autres frais		–	–	–	–	–
Total des dépenses avant remboursement		126.698	1.434.373	580.752	3.715.650	18.178
Remboursement des dépenses	4	84.570	878	13.425	24.860	18.178
Total des dépenses après remboursement		42.128	1.433.495	567.327	3.690.790	–
Revenu/(déficit) net de l'investissement		453.906	9.123.815	(15.049)	1.001.557	10.650
Plus-values/(moins-values) nettes réalisées sur :						
Placements	2(a),2(b)	885.378	39.371.335	(1.624)	19.421	–
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	–	–	–	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	(374.404)	(534.863)	–
Contrats à terme	2(d)	493	915.106	(365.278)	(439.148)	–
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d), 2(e), (2)	(291.779)	3.700.204	(15.569)	(3.304.308)	(199)
Opérations de swap	2(d)	–	–	108.891	–	–
Contrats d'option	2(d)	–	–	–	–	–
Plus-values/(moins-values) nettes pour l'exercice		594.092	43.986.645	(647.984)	(4.258.898)	(199)
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes sur :						
Placements	2(a)	(696.748)	(1.008.061)	67.684	(9.109)	–
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(d)	–	–	–	–	–
« <i>Contracts for difference</i> »	2(d)	–	–	(47.138)	8.040	–
Contrats à terme	2(d)	2.860	(28.497)	55.062	(1.301.016)	–
Devises étrangères et opérations de change à terme	2(d), 2(e), (2)	2.783	(69.713)	(461.831)	(1.354.359)	(237)
Opérations de swap	2(d)	–	–	(141.714)	–	–
Contrats d'option	2(d)	–	–	–	–	–
Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes pour l'exercice		(691.105)	(1.106.271)	(527.937)	(2.656.444)	(237)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		356.893	52.004.189	(1.190.970)	(5.913.785)	10.214
Mouvements du capital social						
Encaissement net sur l'émission d'actions		3.018.566	294.169.530	35.004.240	109.388.572	33.570.983
Palements nets résultant du rachat d'actions		(3.619.695)	(39.692.544)	–	(110.388.917)	(33.411.892)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(601.129)	254.476.986	35.004.240	(1.000.345)	159.091
Dividendes déclarés	11	–	–	–	–	(379)
Ajustement de change	2(f)	–	–	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		16.372.276	585.615.102	33.813.270	139.647.625	168.926

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

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	207.154	195.930	209.118	193.966
Action de Catégorie A de capitalisation en dollars australiens	452	203	303	352
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	1.310.497	672.723	650.963	1.332.257
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	10.361.602	1.916.190	2.315.740	9.962.052
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	113	1	20	94
Action de capitalisation de Catégorie D	836.980	753.704	488.721	1.101.963
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	27.808	20.883	6.728	41.963
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en livres sterling	17.445	213	15.953	1.705
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	1.172.009	986.231	964.829	1.193.411
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	43.066	143.911	17.777	169.200
Action de capitalisation de Catégorie I ⁽¹⁾	–	386.755	72.771	313.984
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	258.533	635.872	297.854	596.551
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais ⁽¹⁾	–	1.143.554	–	1.143.554
Action de capitalisation de Catégorie X	107.233	29.769	35.967	101.035
BlackRock Asia Extension Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	1.249	32	57	1.224
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	32	–	–	32
Action de capitalisation de Catégorie D	101	–	–	101
Action de capitalisation de Catégorie E	101	335	–	436
Action de capitalisation de Catégorie X	1.073.998	260	1.725	1.072.533
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	1.514	–	1.470	44
Action de Catégorie A de capitalisation en euros	2.286	–	–	2.286
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	41	–	–	41
Action de capitalisation de Catégorie D	2.948	–	2.898	50
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	45	–	–	45
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	45	–	–	45
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en livres sterling	4.439	725	1.605	3.559
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	44	–	–	44
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	114	101	20	195
Action de capitalisation de Catégorie X	199.650	–	–	199.650
Action de capitalisation de Catégorie Z	78.002	–	34.237	43.765
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en francs suisses	48	11.910	–	11.958
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	339	–	–	339
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	100	–	–	100
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	94	–	–	94
Action de capitalisation de Catégorie D	100	–	–	100
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	47	–	–	47
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	94	253	–	347
Action de capitalisation de Catégorie X	149.400	144	–	149.544
Action de capitalisation de Catégorie Z	7.079	5.688	–	12.767
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	94	–	–	94
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	36.143	7.048	–	43.191
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	614.873	17.866	35.902	596.837
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	4.155.041	280.796	950.599	3.485.238
Action de capitalisation de Catégorie D	421.828	111.880	368.971	164.737
Action de capitalisation de Catégorie E	38.382	211.517	10.109	239.790
Action de capitalisation de Catégorie I	5.057.653	709.603	1.486.185	4.281.071
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars canadiens	68	–	–	68
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	418.499	–	14.269	404.230
Action de capitalisation de Catégorie X	549.552	45.037	57.826	536.763

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	36	–	–	36
Action de capitalisation de Catégorie A	22.234	5.632	7.517	20.349
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	154.247	217	126.876	27.588
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	80	–	–	80
Action de capitalisation de Catégorie D	5.186	478	1.773	3.891
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	186.641	91.791	199.819	78.613
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	8.130	5.840	6.028	7.942
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	33	–	–	33
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	1.588	–	1.588	–
Action de capitalisation de Catégorie I	8.185	–	8.185	–
Action de Catégorie I de capitalisation en euros	35	–	–	35
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	145.649	24.889	134.802	35.736
Action de capitalisation de Catégorie X ⁽¹⁾	–	50	–	50
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	502.743	14.547	7.749	509.541
Action de capitalisation de Catégorie C	50	–	–	50
Action de capitalisation de Catégorie D	50	277	–	327
Action de capitalisation de Catégorie E	36.731	33.500	16.034	54.197
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	10.148	15.497	5.372	20.273
Action de capitalisation de Catégorie I	50	2.382	791	1.641
Action de capitalisation de Catégorie X	50	188	–	238
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	72.063	28.247	11.882	88.428
Action de capitalisation de Catégorie D	117.945	124.738	101.656	141.027
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	41.380	31.684	41.435	31.629
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	85.812	163.995	76.746	173.061
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	13.163	41.881	38.053	16.991
Action de capitalisation de Catégorie X	49.900	22.182	51.510	20.572
Action de capitalisation de Catégorie Z	75.518	267.973	31.275	312.216
Action de Catégorie Z de capitalisation en livres sterling ⁽¹⁾	–	8.008	6.550	1.458
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	8.718	1	3.180	5.539
Action de capitalisation de Catégorie A	634.199	769.140	748.583	654.756
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	599.201	699.477	1.165.843	132.835
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises ⁽¹⁾	–	7.224	4.888	2.336
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses	51	52	52	51
Action de distribution de Catégorie D	803.319	329.916	548.663	584.572
Action de Catégorie D de distribution en euros ⁽¹⁾	–	141	–	141
Action de Catégorie D de distribution couverte en euros ⁽¹⁾	–	42	–	42
Action de Catégorie D de distribution couverte en livres sterling	842.269	1.294.310	409.221	1.727.358
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	410.206	107.436	268.704	248.938
Action de capitalisation de Catégorie D	1.017.520	612.972	823.315	807.177
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	1.408.748	950.051	804.400	1.554.399
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses	2.401	220	–	2.621
Action de capitalisation de Catégorie E	73.900	54.449	36.425	91.924
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	204.997	437.502	75.110	567.389
Action de Catégorie I de distribution en euros ⁽¹⁾	–	2.409.891	2.151.900	257.991
Action de Catégorie I de distribution couverte en euros	3.152.405	4.261.363	768.606	6.645.162
Action de distribution (G) de Catégorie I couverte en EUR ⁽¹⁾	–	2.061.077	–	2.061.077
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	136.084	375.185	–	511.269
Action de capitalisation de Catégorie I	3.033.506	1.193.768	1.055.877	3.171.397
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros ⁽¹⁾	–	1.072.599	39.790	1.032.809
Action de Catégorie X de distribution en euros ⁽¹⁾	–	44	–	44
Action de capitalisation de Catégorie X	1.578.271	2.505.531	784.306	3.299.496
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars australiens	4.309.062	1.521.191	–	5.830.253
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars canadiens ⁽¹⁾	–	2.600.064	–	2.600.064
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en livres sterling	5.608	66.466	7.617	64.457

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund⁽²⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	–	353	–	353
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	148.653	–	148.653
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	–	43	–	43
Action de Catégorie E de distribution en euros	–	41	–	41
Action de Catégorie E de distribution couverte en euros	–	43	–	43
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	–	41	–	41
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	–	41	–	41
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	–	160.043	–	160.043
Action de capitalisation de Catégorie X	–	249.750	–	249.750
BlackRock European Absolute Return Fund				
Action de distribution de Catégorie A	155.778	30.188	57.095	128.871
Action de capitalisation de Catégorie A	4.751.556	1.690.941	2.454.851	3.987.646
Action de distribution de Catégorie D	34.277	19.058	20.616	32.719
Action de capitalisation de Catégorie D	1.349.485	957.352	1.190.718	1.116.119
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	16.844	16.399	6.635	26.608
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	69.793	598	67.902	2.489
Action de capitalisation de Catégorie E	510.908	63.287	412.110	162.085
Action de capitalisation de Catégorie I	1.767.242	2.122.656	1.195.885	2.694.013
BlackRock European Credit Strategies Fund				
Action de capitalisation de Catégorie H	260.180	177	131.360	128.997
Action de Catégorie H de capitalisation couverte en francs suisses	49.118	–	22.112	27.006
Action de Catégorie H de capitalisation couverte en dollars US	199.661	–	104.563	95.098
Action de Catégorie H de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	39.418	–	26.286	13.132
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.305.233	73.218	1.186.044	192.407
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	665.347	–	498.255	167.092
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en dollars US	15.512	–	7.087	8.425
Action de capitalisation de Catégorie T	690.460	6.475	696.889	46
Action de capitalisation de Catégorie U	72.336	304	42.367	30.273
Action de Catégorie U de capitalisation couverte en francs suisses	10.923	–	7.473	3.450
Action de Catégorie U de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	1.618	–	360	1.258
Action de Catégorie U de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en dollars US	95.646	2.179	25.908	71.917
Action de capitalisation de Catégorie X	27.367	8.490	35.821	36
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	1.028.587	354.874	1.084.267	299.194
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en francs suisses	715	–	556	159
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	21.859.334	1.681.946	14.330.257	9.211.023
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	1.743	1.224	112	2.855
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	4.074	–	1.100	2.974
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	56.355	9.374	21.424	44.305
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	368.504	182.223	461.202	89.525
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	56.519	–	53.466	3.053
Action de capitalisation de Catégorie E	73.141	108.145	138.245	43.041
Action de capitalisation de Catégorie I	986.089	87.983	440.176	633.896
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	88.266	–	88.265	1
Action de capitalisation de Catégorie X	38.325	16.019	11.501	42.843
BlackRock European Opportunities Extension Fund				
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	6.763	–	–	6.763
Action de capitalisation de Catégorie A	1.352.005	939	207.574	1.145.370
Action de Catégorie D de distribution (G)	476.474	24	–	476.498
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	18.366	6.243	355	24.254
Action de capitalisation de Catégorie D	1.041.391	102.060	148.449	995.002
Action de capitalisation de Catégorie E	335.347	70	37.226	298.191
Action de capitalisation de Catégorie I	824.344	40.222	70.003	794.563
Action de capitalisation de Catégorie X	37	–	–	37

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock European Select Strategies Fund				
Action de distribution de Catégorie A	18.894	18.372	5.228	32.038
Action de capitalisation de Catégorie A	11.015	153.830	7.195	157.650
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes tchèques	10.626	43.284	493	53.417
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	4.987	–	–	4.987
Action de capitalisation de Catégorie D	103.659	58.007	76.203	85.463
Action de distribution de Catégorie E	422.700	1.108.984	219.221	1.312.463
Action de capitalisation de Catégorie E	915.377	1.250.053	259.426	1.906.004
Action de distribution de Catégorie I	400.147	48.000	60.097	388.050
Action de capitalisation de Catégorie I	1.464.086	726.387	540.619	1.649.854
Action de capitalisation de Catégorie X	43	–	–	43
BlackRock Fixed Income Strategies Fund				
Action de distribution de Catégorie A	4.905.391	1.209.829	1.303.776	4.811.444
Action de Catégorie A de distribution couverte en francs suisses	93.161	10.992	22.263	81.890
Action de Catégorie A de distribution couverte en dollars US	42.343	5.798	17.296	30.845
Action de capitalisation de Catégorie A	13.851.094	11.187.894	6.336.714	18.702.274
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en francs suisses	1.199.378	239.553	250.027	1.188.904
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	750.520	188.868	379.971	559.417
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	5.945	20.329	2.899	23.375
Action de distribution de Catégorie D	472.543	1.951.436	105.063	2.318.916
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	9.177	18.146	2.651	24.672
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	52.784	29.646	30.694	51.736
Action de capitalisation de Catégorie D	16.089.651	15.150.236	15.892.876	15.347.011
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	859.858	292.115	217.557	934.416
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	4.016.792	2.941.337	1.851.035	5.107.094
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	154.024	569.334	278.862	444.496
Action de capitalisation de Catégorie E	7.950.653	3.625.288	2.368.427	9.207.514
Action de distribution de Catégorie I	236.262	192.631	6.041	422.852
Action de capitalisation de Catégorie I	5.547.613	19.121.180	3.643.319	21.025.474
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	51.695	3.000	95	54.600
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	–	814.642	18.758	795.884
Action de distribution de Catégorie X	896.804	–	–	896.804
Action de capitalisation de Catégorie X	2.114.734	788.102	100.480	2.802.356
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	32.667	6.418	32.016	7.069
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	3.008.057	477.251	1.814.149	1.671.159
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	3.407	1	2.339	1.069
Action de capitalisation de Catégorie D	266.600	85.673	180.875	171.398
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	84.265	75.638	107.787	52.116
Action de capitalisation de Catégorie E	11.478	2.674	4.072	10.080
Action de capitalisation de Catégorie I	973.286	517.333	499.499	991.120
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	19.287	17.678	17.144	19.821
Action de capitalisation de Catégorie X	1.587.213	119.593	276.907	1.429.899

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Global Event Driven Fund				
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros ⁽¹⁾	–	43	–	43
Action de capitalisation de Catégorie A	40.312	108.805	34.606	114.511
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en francs suisses	18.349	37.423	6.210	49.562
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	121.466	3.255.771	56.523	3.320.714
Action de capitalisation de Catégorie D	267.798	405.083	77.384	595.497
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	151.743	140.455	50.723	241.475
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	386.051	576.950	259.476	703.525
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	153.066	449.950	32.661	570.355
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	4.513	40.516	1.657	43.372
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	16.046	50.753	4.421	62.378
Action de Catégorie I de distribution couverte en euros ⁽¹⁾	–	43	–	43
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni	50	167.215	23.693	143.572
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	39	164.111	93.539	70.611
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	508.978	3.184.536	1.108.715	2.584.799
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais ⁽¹⁾	–	688.209	–	688.209
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni ⁽¹⁾	–	1.789.527	624.239	1.165.288
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses	50	285.710	24.823	260.937
Action de capitalisation de Catégorie X	49	14.083	699	13.433
Action de capitalisation de Catégorie Z	172.927	–	41.974	130.953
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en francs suisses	52.882	–	–	52.882
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros	873.904	–	73.974	799.930
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	239.320	–	5.608	233.712
BlackRock Global Long/Short Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	175.644	6.600	97.924	84.320
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	362.283	92.132	12.872	441.543
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	816	2.983	3.150	649
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	1	–	1	–
Action de capitalisation de Catégorie C	5.472	1.902	2.913	4.461
Action de capitalisation de Catégorie D	241.765	60.393	298.137	4.021
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	171.802	242.107	154.429	259.480
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	1.036	4.073	2.268	2.841
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	275.727	39.594	123.515	191.806
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	5.203	–	5.203	–
Action de distribution de Catégorie J	159.917	–	68.318	91.599
Action de capitalisation de Catégorie X	1	231	–	232
BlackRock Global Real Asset Securities Fund⁽²⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	–	1.162	42	1.120
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	50	–	50
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	–	43	–	43
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	49.800	–	49.800
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	50	–	50
BlackRock Impact World Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	1.847	8.021	3.921	5.947
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	20.768	10.307	17.569	13.506
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	2.194	194	87	2.301
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	132.384	–	–	132.384
Action de Catégorie I de capitalisation en yens japonais	6.984	827	1.343	6.468
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais	3.125	3.216	1.000	5.341
Action de Catégorie X de distribution en dollars australiens	242	1.089	6	1.325
Action de Catégorie X de capitalisation en livres sterling	1.266.508	34.475	501.202	799.781

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

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

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Latin American Opportunities Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	102.350	3.928	26.940	79.338
Action de Catégorie A de capitalisation en euros	60.448	2.306	42.151	20.603
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	82.755	1.015	10.577	73.193
Action de capitalisation de Catégorie C	4.488	–	3.517	971
Action de capitalisation de Catégorie D	2.142	1.829	174	3.797
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	3.545	35	1.955	1.625
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling	770	–	229	541
BlackRock Macro Opportunities Fund⁽²⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	–	50	–	50
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	–	41	–	41
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	–	41	–	41
Action de capitalisation de Catégorie X	–	499.700	–	499.700
Action de capitalisation de Catégorie Z	–	9.283	582	8.701
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en BRL	–	914.845	6.086	908.759
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en francs suisses	–	50	–	50
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	–	302.997	–	302.997
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en livres sterling	–	58.308	137	58.171
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative⁽²⁾				
Action de distribution de Catégorie A	–	50	–	50
Action de capitalisation de Catégorie A	–	309	–	309
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	–	50	–	50
Action de distribution de Catégorie D	–	50	–	50
Action de capitalisation de Catégorie D	–	20.493	498	19.995
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	–	114.474	162	114.312
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	–	50	–	50
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Balance	–	948.517	11.830	936.687
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive				
Action de distribution de Catégorie A	97.677	202.125	22.381	277.421
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling ⁽¹⁾	–	38	–	38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	72.526	43.256	50.470	65.312
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	62.222	24.104	12.195	74.131
Action de distribution de Catégorie D	26.511	11.999	15.313	23.197
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	145.650	4.665	132.111	18.204
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	100	3	11	92
Action de capitalisation de Catégorie D	15.286	29.642	9.410	35.518
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	12.313	1.102	3.255	10.160
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	43.158	284.672	50.016	277.814
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	101.710	48.259	77.350	72.619
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	–	50	–	50
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Substanz ⁽¹⁾	–	322.755	2.635	320.120
Action de capitalisation de Catégorie X	50	–	–	50
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth				
Action de distribution de Catégorie A	79.787	247.341	26.495	300.633
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling ⁽¹⁾	–	38	–	38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	44.703	29.618	24.891	49.430
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	44.246	39.199	11.775	71.670
Action de distribution de Catégorie D	33.196	42.459	7.288	68.367
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	8.222	3.687	2.847	9.062
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	2.428	347	(1)	2.776
Action de capitalisation de Catégorie D	2.558	41.212	5.282	38.488
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	4.263	1.800	1.270	4.793
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	34.662	270.487	162.822	142.327
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	40.912	38.820	22.999	56.733
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	–	50	–	50
IndexInvest ChancAction de distribution de Catégorie E ⁽¹⁾	–	715.775	13.034	702.741
Action de capitalisation de Catégorie X	43	–	–	43

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

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

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate				
Action de distribution de Catégorie A	105.852	318.934	26.517	398.269
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling ⁽¹⁾	–	38	–	38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US	209.165	139.718	114.119	234.764
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	234.067	135.276	37.394	331.949
Action de distribution de Catégorie D	77.454	48.703	12.518	113.639
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US	100.514	101.290	182.149	19.655
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	224.679	294	1.965	223.008
Action de capitalisation de Catégorie D	76.325	85.488	14.025	147.788
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	17.382	7.528	5.393	19.517
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	122.870	393.322	108.064	408.128
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	181.318	318.008	54.974	444.352
Action de distribution de Catégorie I ⁽¹⁾	–	263.186	–	263.186
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	–	50	–	50
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Wachstum ⁽¹⁾	–	1.345.568	13.049	1.332.519
Action de capitalisation de Catégorie X	50	–	–	50
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund				
Action de distribution de Catégorie A	20.660	7.102	16.246	11.516
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	27.589	8.533	16.942	19.180
Action de capitalisation de Catégorie A	144.994	21.159	109.312	56.841
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	860	588	17	1.431
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	187.456	15.124	166.518	36.062
Action de capitalisation de Catégorie D	30.914	68.102	9.287	89.729
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	13.612	400	8.085	5.927
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	1.228	27.588	1.985	26.831
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	483.116	218.185	639.358	61.943
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	40.485	17.485	2.325	55.645
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	1.050	1.095	259	1.886
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	15.517	4.777	5.357	14.937
Action de capitalisation de Catégorie I	9.061	106.661	1.542	114.180
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	811.198	322.443	759.140	374.501
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises	898.787	125.271	374.652	649.406
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses	193.604	42.142	84.784	150.962
Action de capitalisation de Catégorie X	50	–	–	50
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en euros	50.458	34.915	85.326	47
Action de capitalisation de Catégorie Z	754.999	2.500	333.821	423.678
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	295.829	12.322	75.813	232.338
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	25.068	12.307	9.414	27.961

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Style Advantage Fund				
Action de distribution de Catégorie A	516	1.533	4	2.045
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	5.594	16.070	13.861	7.803
Action de capitalisation de Catégorie A	36.183	68.389	38.726	65.846
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros ⁽¹⁾	–	255.658	79.100	176.558
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises	440	1.272	170	1.542
Action de capitalisation de Catégorie D	17.674	218.129	43.310	192.493
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses ⁽¹⁾	–	2.348	–	2.348
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	916	240	–	1.156
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	155.645	1.890.375	571.922	1.474.098
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en livres sterling	40	54.192	6.542	47.690
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	46	353	89	310
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	3.535	19.791	2.511	20.815
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en CHF ⁽¹⁾	–	288.992	–	288.992
Action PF de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	45	120.208	56	120.197
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL ⁽¹⁾	–	159.916	–	159.916
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en francs suisses ⁽¹⁾	–	191.337	348	190.989
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros	1.338.290	3.396.275	71.961	4.662.604
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en livres sterling	40	1.256.456	39.040	1.217.456
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni ⁽¹⁾	–	802.922	2.297	800.625
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en yens japonais	612.966	5.220.142	33.229	5.799.879
Action de capitalisation de Catégorie X	372.185	256.807	14.567	614.425
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars australiens	637.425	12.153.070	42.947	12.747.548
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en euros ⁽¹⁾	–	42	–	42
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars néo-zélandais	645.873	235.296	–	881.169
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	1.144.088	1.662.331	1.339	2.805.080
Action de capitalisation de Catégorie Z	50	–	–	50
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros	79.409	–	–	79.409
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund				
Action de distribution de Catégorie A	1.875	1.495	–	3.370
Action de capitalisation de Catégorie A	45	–	–	45
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	61.756	27.504	75.086	14.174
Action de capitalisation de Catégorie E	223	704	50	877
Action de capitalisation de Catégorie I	45	–	–	45
Action de capitalisation de Catégorie X	299.821	–	–	299.821
BlackRock Systematic European Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	150	50	100	100
Action de capitalisation de Catégorie D	19.526	3.539	13.831	9.234
Action de capitalisation de Catégorie E	2.987	2.514	2.170	3.331
Action de capitalisation de Catégorie X	129.626	21.587	17.542	133.671
BlackRock Systematic Global Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	947	5.365	5.602	710
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	2.009	40.973	4.430	38.552
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	931	437	694	674
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	653	2.585	931	2.307
Action de capitalisation de Catégorie I	50	1.919.011	267.891	1.651.170
Action de Catégorie I de capitalisation en euros	115.390	28.401	49.646	94.145
Action de capitalisation de Catégorie X ⁽¹⁾	–	50	–	50
Action de Catégorie X de capitalisation en euros ⁽¹⁾	–	509.775	–	509.775
Action de Catégorie X de capitalisation en livres sterling	1.387.621	46.690	2.584	1.431.727

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

Variation du nombre d'actions en circulation

pour l'exercice clos le 31 mai 2018 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
BlackRock Total Advantage Fund⁽²⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	–	50	–	50
Action de capitalisation de Catégorie D	–	50	–	50
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	–	60	–	60
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling	–	45	–	45
Action de capitalisation de Catégorie E	–	41	–	41
Action de capitalisation de Catégorie I	–	50	–	50
Action de capitalisation de Catégorie X	–	349.750	–	349.750
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund				
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	1.335	179	214	1.300
Action de capitalisation de Catégorie A	39	–	–	39
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	45	–	–	45
Action de capitalisation de Catégorie D	6.404	32.084	4.556	33.932
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses	49	–	–	49
Action de Catégorie D de capitalisation en euros	62	–	13	49
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros	92.853	36.998	45.560	84.291
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US	5.799	2.089	5.636	2.252
Action de Catégorie E de capitalisation en euros	45	50	–	95
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros	45	98	–	143
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros ⁽¹⁾	–	417.398	77.190	340.208
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais	1.765.331	935.413	1.327.919	1.372.825
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US ⁽¹⁾	–	50	–	50
Action de capitalisation de Catégorie X	77.266	–	77.229	37
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund⁽²⁾				
Action de distribution de Catégorie A	–	56.611	56.561	50
Action de Catégorie A de distribution en euros	–	50	–	50
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros	–	50	–	50
Action de capitalisation de Catégorie A	–	8.867	8.317	550
Action de Catégorie A de capitalisation en euros	–	50	–	50
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros	–	50	–	50
Action de distribution de Catégorie D	–	3.301	2.501	800
Action de capitalisation de Catégorie D	–	266.658	266.608	50

⁽¹⁾ Nouvelle catégorie d'actions lancée, pour plus d'informations voir l'Appendice I.

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

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 3.500.000	Danske Corp 2/8/2018 (Zero Coupon)	3.486.407	0,37	USD 13.100.000	Old Line Funding LLC 30/7/2018 (Zero Coupon)	13.051.479	1,40
USD 5.550.000	Fairway Finance Corp 5/7/2018 (Zero Coupon)	5.538.049	0,59	USD 10.250.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 8/6/2018 (Zero Coupon)	10.245.675	1,10
USD 7.950.000	HSBC Bank Plc RegS 2,337% 11/4/2019	7.950.000	0,85	USD 7.000.000	PFIZER Inc 1/8/2018 (Zero Coupon)	6.976.634	0,75
USD 14.650.000	ING US Funding LLC 2,098% 9/7/2018	14.650.000	1,57	USD 9.500.000	Prudential Plc 27/6/2018 (Zero Coupon)	9.485.317	1,01
USD 9.250.000	JP Morgan Securities 22/2/2019 (Zero Coupon)	9.080.499	0,97	USD 8.000.000	Standard Chartered Bank 20/6/2018 (Zero Coupon)	7.990.204	0,85
USD 7.800.000	JP Morgan Securities LLC 7/8/2018 (Zero Coupon)	7.775.031	0,83	USD 10.750.000	Starbird Funding Corp 24/9/2018 (Zero Coupon)	10.663.119	1,14
USD 363.000	Jupiter Securitization Co LLC 2/7/2018 (Zero Coupon)	362.375	0,04	USD 7.000.000	UBS AG/London 4/4/2019 (Zero Coupon)	7.000.000	0,75
USD 4.950.000	Kells Funding LLC 23/7/2018 (Zero Coupon)	4.933.912	0,53	USD 11.230.000	United Overseas Bank Ltd 14/6/2018 (Zero Coupon)	11.222.417	1,20
USD 10.150.000	Liberty Street Funding LLC 6/9/2018 (Zero Coupon)	10.086.278	1,08	USD 7.600.000	United Overseas Bank Ltd 21/11/2018 (Zero Coupon)	7.510.703	0,80
USD 9.000.000	Macquarie Bank Ltd 12/7/2018 (Zero Coupon)	8.976.527	0,96	USD 26.300.000	Versailles Commercial Paper LLC 31/8/2018 (Zero Coupon)	26.150.419	2,80
USD 2.000.000	Macquarie Bank Ltd 2,148% 9/8/2018	2.000.000	0,21	USD 19.600.000	Victory Receivables Corp 5/6/2018 (Zero Coupon)	19.595.252	2,10
USD 17.300.000	Manhattan Asset Funding Co LLC 18/6/2018 (Zero Coupon)	17.284.233	1,85	USD 3.823.000	Victory Receivables Corp 7/6/2018 (Zero Coupon)	3.821.726	0,41
USD 5.000.000	Manhattan Asset Funding Co LLC 21/6/2018 (Zero Coupon)	4.994.667	0,53			542.841.650	58,08
USD 5.000.000	Manhattan Asset Funding Co LLC 28/6/2018 (Zero Coupon)	4.992.725	0,53	Total des billets de trésorerie		586.141.291	62,72
USD 10.100.000	Mizuho Corporate Bank 11/6/2018 (Zero Coupon)	10.094.305	1,08	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		941.412.652	100,73
USD 1.000.000	Mont Blanc Capital Corp 15/6/2018 (Zero Coupon)	999.109	0,11	Portefeuille de titres à la valeur de marché		941.412.652	100,73
USD 20.400.000	Nederlandse Waterschapsbank NV RegS 7/6/2018 (Zero Coupon)	20.393.058	2,18	Autres éléments du passif net		(6.807.900)	(0,73)
USD 6.750.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 13/6/2018 (Zero Coupon)	6.745.500	0,72	Total de l'actif net (USD)		934.604.752	100,00
USD 15.150.000	NRW. Bank 16/7/2018 (Zero Coupon)	15.111.178	1,62				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Brésil				Brésil suite			
188.874	AES Tiete Energia SA (Unit)	Goldman Sachs	(26.597)	201	Cia de Gas de Sao Paulo - COMGAS (Right)	Goldman Sachs	(34)
504.688	AES Tiete Energia SA (Unit)	Morgan Stanley	(107.349)	73.300	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	Goldman Sachs	(41.200)
13.100	Agrenco Ltd BDR*	Morgan Stanley	(574)	177.100	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	Morgan Stanley	(338.839)
(194.845)	Aliansce Shopping Centers SA	Goldman Sachs	40.569	81.700	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	Morgan Stanley	(182.960)
(210.500)	Aliansce Shopping Centers SA	Morgan Stanley	34.539	73.922	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	Goldman Sachs	(73.623)
(155.566)	Alliar Medicos A Frente SA	Goldman Sachs	63.689	55.469	Cia de Saneamento do Parana (Pref)	Goldman Sachs	(14.811)
(406.917)	Alliar Medicos A Frente SA	Morgan Stanley	68.231	90.027	Cia de Saneamento do Parana (Pref)	Morgan Stanley	(21.342)
(38.300)	Alpargatas SA (Pref)	Goldman Sachs	9.579	43.500	Cia de Saneamento do Parana (Unit)	Goldman Sachs	(57.694)
(50.900)	Alpargatas SA (Pref)	Morgan Stanley	14.916	44.300	Cia de Saneamento do Parana (Unit)	Morgan Stanley	(102.509)
(85.279)	Alupar Investimento SA (Unit)	Goldman Sachs	25.183	233.575	Cia Ferro Ligas da Bahia - FERBASA (Pref)	Morgan Stanley	(146.165)
(706.061)	Alupar Investimento SA (Unit)	Morgan Stanley	181.390	195.474	Cia Ferro Ligas da Bahia - FERBASA (Pref)	Goldman Sachs	(33.263)
164.100	Ambev SA	Goldman Sachs	(95.843)	291.100	Cia Hering	Goldman Sachs	(18.681)
119.500	Ambev SA	Morgan Stanley	(195.328)	135.719	Cia Hering	Morgan Stanley	(70.809)
(53.714)	Anima Holding SA	Goldman Sachs	1.564	(486.300)	Cia Siderurgica Nacional SA	Goldman Sachs	238.174
(89.850)	Anima Holding SA	Morgan Stanley	6.610	(197.100)	Cia Siderurgica Nacional SA	Morgan Stanley	88.640
(1.000)	Arezzo Industria e Comercio SA	Goldman Sachs	799	(380.952)	Cielo SA	Morgan Stanley	695.675
(23.700)	Arezzo Industria e Comercio SA	Morgan Stanley	25.385	(89.800)	Cielo SA	Goldman Sachs	26.878
(87.500)	Atacadao Distribuicao Comercio e Industria Ltda	Goldman Sachs	(3.177)	247.100	Construtora Tenda SA	Goldman Sachs	(43.932)
(190.800)	Atacadao Distribuicao Comercio e Industria Ltda	Morgan Stanley	(17.019)	136.139	Construtora Tenda SA	Morgan Stanley	(49.261)
(15.500)	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	Goldman Sachs	5.306	(272.585)	Cosan Logistica SA	Morgan Stanley	78.990
(296.200)	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	Morgan Stanley	311.486	(234.546)	Cosan Logistica SA	Goldman Sachs	42.938
27.800	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	Morgan Stanley	(53.782)	(121.479)	Cosan SA Industria e Comercio	Morgan Stanley	76.692
70.413	Banco ABC Brasil SA (Pref)	Morgan Stanley	(13.178)	12.100	CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA	Goldman Sachs	183
110.961	Banco ABC Brasil SA (Pref)	Goldman Sachs	(22.884)	90.035	CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA	Morgan Stanley	(82.502)
(199.900)	Banco Bradesco SA (Pref)	Goldman Sachs	192.101	(94.200)	Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	Morgan Stanley	49.553
(6.000)	Banco Bradesco SA (Pref)	Morgan Stanley	5.481	(312.400)	Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	Goldman Sachs	92.014
56.100	Banco BTG Pactual SA (Unit)	Goldman Sachs	(28.798)	(826.693)	Direcional Engenharia SA	Goldman Sachs	(22.278)
135.000	Banco BTG Pactual SA (Unit)	Morgan Stanley	(62.250)	(1.081.873)	Direcional Engenharia SA	Morgan Stanley	75.441
221.500	Banco do Brasil SA	Goldman Sachs	(159.487)	(243.100)	Duratex SA	Morgan Stanley	24.783
35.700	Banco do Brasil SA	Goldman Sachs	(40.657)	422.500	EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	Morgan Stanley	(66.628)
143.800	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA 'B' (Pref)	Goldman Sachs	(49.722)	344.300	EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	Goldman Sachs	(107.042)
165.699	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA 'B' (Pref)	Morgan Stanley	(25.120)	4.300	Eletropaulo Metropolitana Eletricidade de Sao Paulo SA	Goldman Sachs	202
(781.200)	BB Seguridade Participacoes SA	Morgan Stanley	460.855	134.500	Energisa SA (Unit)	Goldman Sachs	(55.956)
(168.500)	BB Seguridade Participacoes SA	Goldman Sachs	73.648	266.200	Energisa SA (Unit)	Morgan Stanley	(143.201)
(212.669)	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes SA	Morgan Stanley	18.945	(35.769)	Engie Brasil Energia SA	Goldman Sachs	6.510
(121.743)	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes SA	Goldman Sachs	(5.739)	(190.900)	Engie Brasil Energia SA	Morgan Stanley	102.443
(718.911)	BR Malls Participacoes SA	Goldman Sachs	70.879	(47.500)	Equatorial Energia SA	Goldman Sachs	24.339
(1.135.760)	BR Malls Participacoes SA	Morgan Stanley	112.937	(43.738)	Equatorial Energia SA	Morgan Stanley	28.972
(75.743)	BR Properties SA	Goldman Sachs	3.144	91.600	Estacio Participacoes SA	Morgan Stanley	(118.439)
(288.168)	BR Properties SA	Morgan Stanley	(36.249)	170.800	Estacio Participacoes SA	Goldman Sachs	(65.698)
(83.400)	BRF SA	Goldman Sachs	43.287	(268.800)	Even Construtora e Incorporadora SA	Goldman Sachs	35.861
(213.700)	BRF SA	Morgan Stanley	66.275	(227.090)	Even Construtora e Incorporadora SA	Morgan Stanley	36.240
69.100	Camil Alimentos SA	Goldman Sachs	2.331	(40.100)	Ez Tec Empreendimentos e Participacoes SA	Goldman Sachs	16.602
196.200	Camil Alimentos SA	Morgan Stanley	(12.689)	(65.600)	Ez Tec Empreendimentos e Participacoes SA	Morgan Stanley	50.576
(10.500)	CCR SA	Goldman Sachs	5.030	(10.200)	Fibria Celulose SA	Morgan Stanley	1.914
(290.622)	CCR SA	Morgan Stanley	102.138	(36.100)	Fibria Celulose SA	Goldman Sachs	13.708
(4.000)	Centrais Eletricas Brasileiras SA	Goldman Sachs	1.972				
(255.700)	Centrais Eletricas Brasileiras SA	Morgan Stanley	259.041				
8.700	Cia Brasileira de Distribuicao (Pref)	Morgan Stanley	(7.976)				
13.209	Cia de Gas de Sao Paulo - COMGAS 'A' (Pref)	Goldman Sachs	(8.247)				
5.600	Cia de Gas de Sao Paulo - COMGAS 'A' (Pref)	Morgan Stanley	(3.988)				

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Brésil suite				Brésil suite			
264.500	Fleury SA	Morgan Stanley	(101.757)	582.000	MRV Engenharia e Participacoes SA	Goldman Sachs	(135.272)
(21.700)	Gerdau SA (Pref)	Goldman Sachs	13.184	444.613	MRV Engenharia e Participacoes SA	Morgan Stanley	(157.778)
16.200	Gol Linhas Aereas			(138.480)	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	Morgan Stanley	128.076
61.257	Inteligentes SA (Pref)	Morgan Stanley	(34.472)	(40.303)	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	Goldman Sachs	37.566
236.728	Grendene SA	Goldman Sachs	(27.361)	(77.700)	Natura Cosmeticos SA	Morgan Stanley	49.902
(4.900)	Guararapes Confecoos SA	Morgan Stanley	(135.541)	(37.700)	Natura Cosmeticos SA	Goldman Sachs	35.989
(251.500)	Helbor Empreendimentos SA	Goldman Sachs	23.383	(36.800)	Odontoprev SA	Goldman Sachs	7.336
(399.600)	Helbor Empreendimentos SA	Morgan Stanley	17.633	(386.200)	Oi SA (Pref)	Morgan Stanley	101.547
270.000	Hypera SA	Goldman Sachs	(61.490)	(351.200)	Oi SA (Pref)	Goldman Sachs	40.714
105.600	Hypera SA	Morgan Stanley	(17.524)	(186.715)	Omega Geracao SA	Goldman Sachs	57.512
(82.300)	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	Goldman Sachs	32.470	(69.273)	Omega Geracao SA	Morgan Stanley	14.560
(118.600)	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	Morgan Stanley	177.629	(178.007)	Paranapanema SA	Morgan Stanley	38.295
(108.700)	Instituto Hermes Pardini SA	Goldman Sachs	52.336	(166)	Paranapanema SA	Goldman Sachs	11
(140.200)	Instituto Hermes Pardini SA	Morgan Stanley	38.836	(1.900)	Petro Rio SA	Morgan Stanley	290
186.671	International Meal Co Alimentacao SA	Goldman Sachs	(47.811)	8.700	Petrobras Distribuidora SA	Goldman Sachs	(8.062)
169.108	International Meal Co Alimentacao SA	Morgan Stanley	(24.776)	70.200	Petrobras Distribuidora SA	Morgan Stanley	(38.242)
114.587	Iochpe Maxion SA	Goldman Sachs	(89.507)	(130.200)	Petroleo Brasileiro SA (Pref)	Morgan Stanley	217.702
90.814	Iochpe Maxion SA	Morgan Stanley	(63.655)	(82.200)	Petroleo Brasileiro SA (Pref)	Goldman Sachs	183.549
199.018	IRB Brasil Resseguros S/A	Goldman Sachs	(166.079)	66.700	Porto Seguro SA	Goldman Sachs	(70.072)
70.800	IRB Brasil Resseguros S/A	Morgan Stanley	(35.498)	103.000	Porto Seguro SA	Morgan Stanley	(106.589)
60.030	Itau Unibanco Holding SA (Pref)	Goldman Sachs	(79.120)	121.500	QGEF Participacoes SA	Goldman Sachs	(24.525)
50.810	Itau Unibanco Holding SA (Pref)	Morgan Stanley	(48.534)	73.500	QGEF Participacoes SA	Morgan Stanley	(21.145)
214.200	Itausa - Investimentos Itau SA (Pref)	Morgan Stanley	(59.927)	1.600	Qualicorp SA	Goldman Sachs	(833)
377.300	Itausa - Investimentos Itau SA (Pref)	Goldman Sachs	(109.204)	107.600	Qualicorp SA	Morgan Stanley	(81.215)
1.021.200	JBS SA	Goldman Sachs	(167.463)	(153.200)	Raia Drogasil SA	Goldman Sachs	368.158
690.100	JBS SA	Morgan Stanley	(146.692)	(204.500)	Raia Drogasil SA	Morgan Stanley	311.867
122.878	JSL SA	Goldman Sachs	(49.371)	(8.700)	Randon SA Implementos e Participacoes (Pref)	Goldman Sachs	2.330
87.830	JSL SA	Morgan Stanley	(24.657)	(18.683)	Randon SA Implementos e Participacoes (Pref)	Morgan Stanley	5.047
(239.700)	Klabin SA (Unit)	Goldman Sachs	88.457	(1.000.041)	Rumo SA	Morgan Stanley	373.152
(600.512)	Klabin SA (Unit)	Morgan Stanley	176.619	(220.738)	Rumo SA	Goldman Sachs	47.959
523.600	Kroton Educacional SA	Goldman Sachs	(97.166)	(85.400)	Santos Brasil Participacoes SA	Goldman Sachs	9.134
429.000	Kroton Educacional SA	Morgan Stanley	(95.546)	(389.925)	Santos Brasil Participacoes SA	Morgan Stanley	12.198
13.700	Laep Investments Ltd BDR*	Goldman Sachs	(1.050)	40.337	Sao Martinho SA	Goldman Sachs	13.524
24.300	Laep Investments Ltd BDR*	Morgan Stanley	(1.864)	90.717	Sao Martinho SA	Morgan Stanley	6.577
(110.500)	Linx SA	Goldman Sachs	62.901	(55.200)	Ser Educacional SA '144A'	Goldman Sachs	4.988
(103.000)	Linx SA	Morgan Stanley	42.166	(169.400)	Ser Educacional SA '144A'	Morgan Stanley	66.392
17.425	Localiza Rent a Car SA	Goldman Sachs	(7.047)	30.900	SLC Agricola SA	Morgan Stanley	(5.770)
209.700	Localiza Rent a Car SA	Morgan Stanley	185.405	54.900	SLC Agricola SA	Goldman Sachs	7.522
(55.900)	Lojas Americanas SA (Pref)	Goldman Sachs	17.576	42.488	Smiles Fidelidade SA	Goldman Sachs	(34.412)
(1.162.000)	Lojas Americanas SA (Pref)	Morgan Stanley	439.330	61.100	Smiles Fidelidade SA	Morgan Stanley	(65.750)
39.800	Lojas Renner SA	Goldman Sachs	(16.112)	(92.523)	Somos Educacao SA	Goldman Sachs	13.968
250.600	Lojas Renner SA	Morgan Stanley	(180.179)	23.921	Sonae Sierra Brasil SA	Goldman Sachs	(7.332)
7.900	M Dias Branco SA	Goldman Sachs	(4.751)	5.300	Sonae Sierra Brasil SA	Morgan Stanley	(1.953)
134.286	M Dias Branco SA	Morgan Stanley	(77.534)	951.224	Sul America SA (Unit)	Morgan Stanley	(673.443)
(800)	Magazine Luiza SA	Goldman Sachs	13	81.900	Suzano Papel e Celulose SA	Goldman Sachs	(82.648)
(14.400)	Magazine Luiza SA	Morgan Stanley	30.439	210.700	Suzano Papel e Celulose SA	Morgan Stanley	(42.103)
41.243	Magnesita Refratarios SA	Morgan Stanley	(31.839)	(800.160)	Tecnisa SA	Goldman Sachs	46.826
81.300	Magnesita Refratarios SA	Goldman Sachs	(52.458)	(951.433)	Tecnisa SA	Morgan Stanley	45.719
(142.100)	Mahle-Metal Leve SA	Goldman Sachs	58.323	169.432	Tegma Gestao Logistica SA	Goldman Sachs	(54.657)
(127.100)	Mahle-Metal Leve SA	Morgan Stanley	60.307	99.200	Tegma Gestao Logistica SA	Morgan Stanley	(15.611)
(595.000)	Marcopolo SA (Pref)	Goldman Sachs	100.267	6.400	Telefonica Brasil SA (Pref)	Goldman Sachs	(4.050)
(1.332.100)	Marcopolo SA (Pref)	Morgan Stanley	186.229	42.200	Telefonica Brasil SA (Pref)	Morgan Stanley	(50.600)
(122.800)	Marisa Lojas SA	Goldman Sachs	22.760	29.200	TIM Participacoes SA	Goldman Sachs	(5.020)
(109.354)	Marisa Lojas SA	Morgan Stanley	7.280	451.900	TIM Participacoes SA	Morgan Stanley	186.499
29.800	Metalurgica Gerdau SA (Pref)	Morgan Stanley	(8.850)	(13.600)	TOTVS SA	Morgan Stanley	5.561
884.700	Metalurgica Gerdau SA (Pref)	Goldman Sachs	(303.610)	(30.800)	TOTVS SA	Goldman Sachs	15.670
(368.466)	Mills Estruturas e Servicos de Engenharia SA	Goldman Sachs	81.471	415.909	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA (Unit)	Morgan Stanley	(67.128)
(236.300)	Mills Estruturas e Servicos de Engenharia SA	Morgan Stanley	31.150	407.600	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA (Unit)	Goldman Sachs	(13.436)
166.900	Minerva SA/Brazil	Goldman Sachs	(4.162)	(29.500)	Tupy SA	Goldman Sachs	17.050
83.900	Minerva SA/Brazil	Morgan Stanley	(145.978)	(11.200)	Tupy SA	Morgan Stanley	6.454
(188.100)	Movida Participacoes SA	Goldman Sachs	52.794	(92.100)	Ultrapar Participacoes SA	Morgan Stanley	83.897
(198.900)	Movida Participacoes SA	Morgan Stanley	60.825	(33.500)	Ultrapar Participacoes SA	Goldman Sachs	39.818
				(25.100)	Unipar Carbocloro SA (Pref)	Morgan Stanley	(36.884)

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

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Brésil suite				Canada suite			
(765.800)	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA 'A' (Pref)	Goldman Sachs	461.378	191.461 (5.697)	BlackPearl Resources Inc Boardwalk Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(17.916)
(179.000)	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA 'A' (Pref)	Morgan Stanley	105.057	(11.890)	Bombardier Inc	Morgan Stanley	(5.785)
36.600	Vale SA	Goldman Sachs	(25.532)	240.475	Bonavista Energy Corp	Morgan Stanley	(17.377)
49.500	Vale SA	Morgan Stanley	(36.717)	36.677	Bonterra Energy Corp	Morgan Stanley	(21.486)
(63.560)	Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de Pagamento e Identificacao SA	Goldman Sachs	21.855	(148.494)	Boralex Inc 'A'	Morgan Stanley	(38.454)
(145.223)	Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de Pagamento e Identificacao SA	Morgan Stanley	423.467	12.614	Boyd Group Income Fund (Unit)	Morgan Stanley	(10.471)
53.500	Via Varejo SA (Unit)	Goldman Sachs	(35.167)	919	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Morgan Stanley	(852)
88.100	Via Varejo SA (Unit)	Morgan Stanley	(61.061)	3.489	Brookfield Business Partners LP	Morgan Stanley	1.065
(5.200)	WEG SA	Goldman Sachs	1.955	49.194	Brookfield Infrastructure Partners LP	Morgan Stanley	(35.695)
(465.679)	WEG SA	Morgan Stanley	(656.866)	105.311	Brookfield Property Partners LP	Morgan Stanley	91.587
(86.100)	Wiz Solucoes e Corretagem de Seguros SA	Goldman Sachs	5.672	79.585	Brookfield Renewable Partners LP	Morgan Stanley	(34.643)
(259.800)	Wiz Solucoes e Corretagem de Seguros SA	Morgan Stanley	61.188	(11.557)	BRP Inc/CA	Morgan Stanley	(45.844)
			1.801.048	167.418	CAE Inc	Morgan Stanley	273.660
				(110.063)	Calfrac Well Services Ltd	Morgan Stanley	33.355
				(3.513)	Cameco Corp	Morgan Stanley	276
				51.439	Canaccord Genuity Group Inc	Morgan Stanley	(18.011)
				(386.592)	Canacol Energy Ltd	Morgan Stanley	61.169
				(19.621)	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	(17.975)
				108.681	Canadian Apartment Properties (Reit)	Morgan Stanley	8.997
423.018	Advantage Oil & Gas Ltd	Morgan Stanley	(81.213)	463	Canadian Imperial Bank of Commerce	Morgan Stanley	(2.074)
95.808	Aecon Group Inc	Morgan Stanley	(177.019)	(2.342)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	(1.362)
(21.622)	Ag Growth International Inc	Morgan Stanley	18.502	17.774	Canadian Natural Resources Ltd	Morgan Stanley	(41.906)
(50.772)	AGF Management Ltd 'B'	Morgan Stanley	11.225	2.657	Canadian Pacific Railway Ltd	Morgan Stanley	22.190
(231.065)	Aimia Inc	Morgan Stanley	(10.589)	(1.692)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Morgan Stanley	7.716
(27.543)	Air Canada	Morgan Stanley	21.832	(90.918)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Morgan Stanley	300.338
(55.384)	AirBoss of America Corp	Morgan Stanley	29.734	(68.538)	Canadian Western Bank	Morgan Stanley	114.117
(26.899)	Alacer Gold Corp	Morgan Stanley	1.240	(52.934)	Canfor Corp	Morgan Stanley	(77.763)
163.686	Alamos Gold Inc 'A'	Morgan Stanley	(144.313)	87.615	Canfor Pulp Products Inc	Morgan Stanley	4.518
66.138	Alaris Royalty Corp	Morgan Stanley	(31.534)	(3.744)	Cantrustholdings Inc	Morgan Stanley	1.928
47.841	Alcanna Inc	Morgan Stanley	(3.620)	(3.843)	Canopy Growth Corp	Morgan Stanley	(862)
(236.514)	Algonquin Power & Utilities Corp	Morgan Stanley	(30.368)	117.125	CanWel Building Materials Group Ltd	Morgan Stanley	(2.767)
4.186	Alimentation Couche-Tard Inc 'B'	Morgan Stanley	4.607	130.009	Capital Power Corp	Morgan Stanley	(35.284)
(22.183)	Allied Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	4.226	25.112	Cardinal Energy Ltd	Morgan Stanley	(8.925)
(88.688)	AltaGas Ltd	Morgan Stanley	52.989	(5.523)	Cargojet Inc	Morgan Stanley	(2.185)
82.303	Altius Minerals Corp	Morgan Stanley	1.988	(81.444)	Cascades Inc	Morgan Stanley	(4.373)
(86.360)	Altus Group Ltd/Canada	Morgan Stanley	(21.377)	(635)	CCL Industries Inc 'B'	Morgan Stanley	500
1.525	Angico Eagle Mines Ltd	Morgan Stanley	3.201	(71.948)	Celestica Inc	Morgan Stanley	3.656
(6.939)	Aphria Inc	Morgan Stanley	7.342	(16.043)	Cenovus Energy Inc	Morgan Stanley	11.786
(2.991)	ARC Resources Ltd	Morgan Stanley	2.212	11.050	Centerra Gold Inc	Morgan Stanley	(4.366)
72.118	Argonaut Gold Inc	Morgan Stanley	(2.952)	(190.177)	CES Energy Solutions Corp	Morgan Stanley	58.531
27.928	Aritzia Inc	Morgan Stanley	(590)	2.380	CGI Group Inc 'A'	Morgan Stanley	1.111
(61.485)	Arizona Mining Inc	Morgan Stanley	(2.737)	98.460	Chartwell Retirement Residences (Unit)	Morgan Stanley	(12.595)
(95.304)	Artis Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	13.966	(84.597)	Chemtrade Logistics Income Fund (Unit)	Morgan Stanley	(8.579)
(50.935)	Atco Ltd/Canada 'I'	Morgan Stanley	13.900	(62.159)	Chesswood Group Ltd	Morgan Stanley	21.542
194.084	Atlantic Power Corp	Morgan Stanley	(2.835)	(27.464)	China Gold International Resources Corp Ltd	Morgan Stanley	539
14.632	ATS Automation Tooling Systems Inc	Morgan Stanley	36.394	120.612	Choice Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(4.777)
(31.888)	Aurora Cannabis Inc	Morgan Stanley	9.053	(33.152)	CI Financial Corp	Morgan Stanley	10.741
27.871	AutoCanada Inc	Morgan Stanley	(20.061)	(66.364)	Cineplex Inc	Morgan Stanley	253.987
(42.738)	B2Gold Corp	Morgan Stanley	(5.701)	(111.016)	Clearwater Seafoods Inc	Morgan Stanley	25.020
13.710	Badger Daylighting Ltd	Morgan Stanley	383	29.801	Cogeco Communications Inc	Morgan Stanley	(122.857)
(343)	Bank of Montreal	Morgan Stanley	882	20.114	Cogeco Inc	Morgan Stanley	(28.770)
1.546	Bank of Nova Scotia/The	Morgan Stanley	(4.522)	16.497	Colliers International Group Inc	Morgan Stanley	(61.516)
(2.795)	Barrick Gold Corp	Morgan Stanley	(310)	(250.305)	Cominar Real Estate Investment Trust (Reit) 'U'	Morgan Stanley	29.124
45.800	Baytex Energy Corp	Morgan Stanley	65.753	(112.587)	Computer Modelling Group Ltd	Morgan Stanley	75.168
7.761	BCE Inc	Morgan Stanley	(6.677)				
22.299	Bellatrix Exploration Ltd	Morgan Stanley	(1.587)				
(61.363)	Birchcliff Energy Ltd	Morgan Stanley	12.609				
(214.864)	Bird Construction Inc	Morgan Stanley	2.226				
7.416	BlackBerry Ltd	Morgan Stanley	2.126				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Canada suite				Canada suite			
Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
18	Constellation Software Inc/Canada	Morgan Stanley	285	(271.507)	Gran Tierra Energy Inc	Morgan Stanley	45.357
(30.780)	Continental Gold Inc	Morgan Stanley	(1.273)	(38.491)	Granite Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	50.738
11.140	Corby Spirit and Wine Ltd	Morgan Stanley	(4.701)	(11.755)	Great Canadian Gaming Corp	Morgan Stanley	(151.902)
(40.889)	Corus Entertainment Inc 'B'	Morgan Stanley	73.581	(63.095)	Great-West Lifeco Inc	Morgan Stanley	63.862
14.370	Cott Corp	Morgan Stanley	(613)	64.788	Guyana Goldfields Inc	Morgan Stanley	(4.465)
596	Crescent Point Energy Corp	Morgan Stanley	(300)	(157.675)	H&R Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	47.045
138.377	Crew Energy Inc	Morgan Stanley	(22.077)	48.788	High Arctic Energy Services Inc	Morgan Stanley	(5.146)
(60.042)	CRH Medical Corp	Morgan Stanley	(48.993)	(76.049)	High Liner Foods Inc	Morgan Stanley	36.567
61.278	Crius Energy Trust (Unit)	Morgan Stanley	(12.807)	9.136	Home Capital Group Inc	Morgan Stanley	2.226
348.338	Crombie Real Estate Investment Trust (Reit)**	Morgan Stanley	(19.618)	(248.931)	Horizon North Logistics Inc	Morgan Stanley	(31.629)
55.035	CT Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(10.399)	79.486	Hudbay Minerals Inc	Morgan Stanley	(55.749)
29.379	Descartes Systems Group Inc/The	Morgan Stanley	115.309	3.122	Husky Energy Inc	Morgan Stanley	(2.949)
31.935	Detour Gold Corp	Morgan Stanley	(1.479)	(155.011)	Hydro One Ltd '144A'	Morgan Stanley	20.122
(3.916)	DHX Media Ltd	Morgan Stanley	295	25.729	IAMGOLD Corp	Morgan Stanley	8.800
(68.600)	DHX Media Ltd	Morgan Stanley	8.877	40.287	IGM Financial Inc	Morgan Stanley	(44.651)
(218.965)	DIRTT Environmental Solutions	Morgan Stanley	11.986	3.028	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	(1.239)
1.035	Dollarama Inc	Morgan Stanley	(2.408)	(169.129)	Industrial Alliance Insurance & Financial Services Inc	Morgan Stanley	(42.988)
3.032	Domtar Corp	Morgan Stanley	5.575	(35.086)	Innergex Renewable Energy Inc	Morgan Stanley	(2.743)
(31.962)	Dorel Industries Inc 'B'	Morgan Stanley	14.153	2.309	Intact Financial Corp	Morgan Stanley	30.051
100.992	Dream Global Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	323	61.104	Inter Pipeline Ltd	Morgan Stanley	(899)
344.762	Dream Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	452.473	(47.616)	Interfor Corp	Morgan Stanley	(6.783)
(67.065)	Dream Office Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(161.870)	(28.209)	InterRent Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	7.846
28.872	Dundee Corp 'A'	Morgan Stanley	(1.945)	(88.476)	Intertape Polymer Group Inc	Morgan Stanley	4.360
143.145	Dundee Precious Metals Inc	Morgan Stanley	1.522	(41.704)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Morgan Stanley	14.287
(1.406)	Echelon Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	778	65.797	Jamieson Wellness Inc	Morgan Stanley	60.231
(41.388)	ECN Capital Corp	Morgan Stanley	1.319	(198.284)	Just Energy Group Inc	Morgan Stanley	8.080
(34.746)	Eldorado Gold Corp	Morgan Stanley	(1.524)	(38.379)	Kelt Exploration Ltd	Morgan Stanley	26.830
(16.791)	Emera Inc	Morgan Stanley	3.406	269.353	Keyera Corp	Morgan Stanley	(35.515)
23.880	Empire Co Ltd 'A'	Morgan Stanley	12.874	(16.176)	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	11.848
8.450	Enbridge Inc	Morgan Stanley	(5.668)	(61.891)	Kinaxis Inc	Morgan Stanley	(13.545)
124.233	Enbridge Income Fund Holdings Inc	Morgan Stanley	(39.927)	5.691	Kinder Morgan Canada Ltd '144A'	Morgan Stanley	41.170
(2.873)	Encana Corp	Morgan Stanley	1.508	(7.039)	Kinross Gold Corp	Morgan Stanley	288
(14.474)	Endeavour Mining Corp	Morgan Stanley	(7.570)	68.351	Kirkland Lake Gold Ltd	Morgan Stanley	102
(20.561)	Endeavour Silver Corp	Morgan Stanley	816	16.196	Knight Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(4.400)
(95.682)	Enercare Inc	Morgan Stanley	32.749	(41.911)	Labrador Iron Ore Royalty Corp	Morgan Stanley	30.100
52.227	Enerflex Ltd	Morgan Stanley	(30.871)	(15.358)	Laurentian Bank of Canada	Morgan Stanley	147.786
(25.651)	Enerplus Corp	Morgan Stanley	10.822	11.704	Linamar Corp	Morgan Stanley	56.805
32.962	Enghouse Systems Ltd	Morgan Stanley	7.986	2.571	Lithium Americas Corp	Morgan Stanley	(6.673)
(37.698)	Ensign Energy Services Inc	Morgan Stanley	9.536	735.404	Loblaw Cos Ltd	Morgan Stanley	495
67.346	Essential Energy Services Trust	Morgan Stanley	609	122.537	Lucara Diamond Corp	Morgan Stanley	(44.233)
(88.662)	Extendicare Inc	Morgan Stanley	25.201	(15.860)	Lundin Mining Corp	Morgan Stanley	(22.641)
1.562	Fairfax Financial Holdings Ltd	Morgan Stanley	(42.393)	3.900	MAG Silver Corp	Morgan Stanley	(2.215)
(45.896)	Fairfax India Holdings Corp '144A'	Morgan Stanley	(50.631)	(65.889)	Magna International Inc	Morgan Stanley	(9.769)
135.073	Fiera Capital Corp	Morgan Stanley	(55.559)	20.758	Major Drilling Group International Inc	Morgan Stanley	(18.432)
48.250	Finning International Inc	Morgan Stanley	(732)	136.119	Manulife Financial Corp	Morgan Stanley	(18.792)
(104.653)	First Capital Realty Inc	Morgan Stanley	7.659	37.518	Maple Leaf Foods Inc	Morgan Stanley	40.949
(18.888)	First Majestic Silver Corp	Morgan Stanley	2.938	(18.938)	Martinrea International Inc	Morgan Stanley	(46.948)
41.932	First National Financial Corp	Morgan Stanley	(43.067)	19.197	Maxar Technologies Ltd	Morgan Stanley	15.616
(1.837)	First Quantum Minerals Ltd	Morgan Stanley	3.173	(44.759)	McCoy Global Inc	Morgan Stanley	(292)
22.850	FirstService Corp	Morgan Stanley	(24.219)	(15.273)	McEwen Mining Inc	Morgan Stanley	(2.792)
6.174	Fortis Inc/Canada	Morgan Stanley	(4.267)	51.208	Medical Facilities Corp	Morgan Stanley	(851)
53.463	Fortuna Silver Mines Inc	Morgan Stanley	422	4.471	MEG Energy Corp	Morgan Stanley	(6.555)
1.700	Franco-Nevada Corp	Morgan Stanley	(990)	3.002	Methanex Corp	Morgan Stanley	53.776
(26.056)	Freehold Royalties Ltd	Morgan Stanley	25.547	(23.753)	Metro Inc	Morgan Stanley	(1.429)
(8.519)	Frontera Energy Corp	Morgan Stanley	34.904	(23.753)	Morguard Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	818
(30.312)	Genworth MI Canada Inc	Morgan Stanley	22.719	145.841	Morneau Shepell Inc	Morgan Stanley	(1.745)
80	George Weston Ltd	Morgan Stanley	5	(30.161)	MTY Food Group Inc	Morgan Stanley	28.306
(69.984)	Gibson Energy Inc	Morgan Stanley	(52.631)	(128.078)	Mullen Group Ltd	Morgan Stanley	(3.084)
4.985	Gildan Activewear Inc	Morgan Stanley	72	(8.390)	National Bank of Canada	Morgan Stanley	16.568
(46.638)	Gluskin Sheff + Associates Inc	Morgan Stanley	47.376	(51.287)	New Gold Inc	Morgan Stanley	(4.529)
22.747	goeasy Ltd	Morgan Stanley	(21.094)	(21.058)	Nexa Resources SA	Morgan Stanley	17.151
6.028	Goldcorp Inc	Morgan Stanley	4.729	5.278	NexGen Energy Ltd	Morgan Stanley	(265)

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Canada suite				Canada suite			
6.288	NFI Group Inc	Morgan Stanley	(14.590)	(136.399)	Slate Office REIT (Reit)	Morgan Stanley	7.003
170.411	Noranda Income Fund (Unit)	Morgan Stanley	(1.272)	49.531	Slate Retail REIT (Unit)	Morgan Stanley	(11.864)
21.061	Norbord Inc	Morgan Stanley	11.586	21.670	Sleep Country Canada Holdings Inc '144A'	Morgan Stanley	(9.659)
17.265	North American Construction Group Ltd	Morgan Stanley	(3.788)	(71.544)	SmartCentres Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(9.574)
(100.209)	North West Co Inc/The	Morgan Stanley	15.333	(449)	SNC-Lavalin Group Inc	Morgan Stanley	(18)
125.303	Northland Power Inc	Morgan Stanley	165.213	(24.215)	Spartan Energy Corp	Morgan Stanley	6.841
(71.303)	Northview Apartment Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(2.755)	13.352	Spin Master Corp '144A'	Morgan Stanley	(8.531)
145.350	NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(34.836)	(55.618)	Sprott Inc	Morgan Stanley	5.371
(58.493)	Novagold Resources Inc	Morgan Stanley	(16.608)	12.649	SSR Mining Inc	Morgan Stanley	928
375	Nutrien Ltd	Morgan Stanley	(179)	(99.345)	Stantec Inc	Morgan Stanley	30.583
134.693	NuVista Energy Ltd	Morgan Stanley	(52.220)	(6.128)	Stars Group Inc/The	Morgan Stanley	12.671
(16.234)	OceanaGold Corp	Morgan Stanley	744	7.159	Stelco Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.407)
10.181	Onex Corp	Morgan Stanley	(22.596)	(8.775)	Stella-Jones Inc	Morgan Stanley	963
(13.391)	Open Text Corp	Morgan Stanley	(3.557)	155.407	Summit Industrial Income (Reit)	Morgan Stanley	(2.568)
(28.367)	Osisko Gold Royalties Ltd	Morgan Stanley	(2.369)	670	Sun Life Financial Inc	Morgan Stanley	(1.569)
80.821	Osisko Mining Inc	Morgan Stanley	2.386	3.850	Suncor Energy Inc	Morgan Stanley	(5.377)
(42.038)	Painted Pony Energy Ltd	Morgan Stanley	5.788	(82.256)	SunOpta Inc	Morgan Stanley	(40.803)
22.203	Pan American Silver Corp	Morgan Stanley	(3.835)	(50.384)	Superior Plus Corp	Morgan Stanley	30.064
(55.500)	Paramount Resources Ltd 'A'	Morgan Stanley	(7.534)	25.086	Supremex Inc	Morgan Stanley	(2.362)
74.175	Parex Resources Inc	Morgan Stanley	(51.257)	(187.938)	Surge Energy Inc	Morgan Stanley	31.537
48.274	Parkland Fuel Corp	Morgan Stanley	2.888	(47.060)	Tahoe Resources Inc	Morgan Stanley	(6.608)
127.534	Pason Systems Inc	Morgan Stanley	(62.541)	(2.204)	Teck Resources Ltd 'B'	Morgan Stanley	3.359
6.136	Pattern Energy Group Inc 'A'	Morgan Stanley	3.923	315	TELUS Corp	Morgan Stanley	(158)
15.852	Pembina Pipeline Corp	Morgan Stanley	(2.624)	44.376	Teranga Gold Corp	Morgan Stanley	59.425
(2.810)	Peyto Exploration & Development Corp	Morgan Stanley	1.109	(11.029)	TFI International Inc	Morgan Stanley	(1.778)
(26.058)	Poseidon Concepts Corp**	Morgan Stanley	76	(5.658)	Theratechnologies Inc	Morgan Stanley	208
(500)	Power Corp of Canada	Morgan Stanley	335	(3.800)	Thomson Reuters Corp	Morgan Stanley	(952)
93.165	Power Financial Corp	Morgan Stanley	(91.259)	146.163	Timbercreek Financial Corp	Morgan Stanley	(17.908)
(80.780)	PrairieSky Royalty Ltd	Morgan Stanley	141.260	(12.164)	TMAC Resources Inc	Morgan Stanley	(1.338)
52.179	Premier Gold Mines Ltd	Morgan Stanley	1.303	(28.732)	TMX Group Ltd	Morgan Stanley	(86.006)
(21.349)	Premium Brands Holdings Corp	Morgan Stanley	39.352	200.771	TORC Oil & Gas Ltd	Morgan Stanley	(43.898)
(13.510)	Pretium Resources Inc	Morgan Stanley	(4.013)	(4.172)	Torex Gold Resources Inc	Morgan Stanley	1.557
(52.913)	ProMetic Life Sciences Inc	Morgan Stanley	28.363	36.509	Toromont Industries Ltd	Morgan Stanley	(11.195)
136.515	Quebecor Inc 'B'	Morgan Stanley	(15.806)	5.749	Toronto-Dominion Bank/The	Morgan Stanley	(5.840)
(80.702)	Raging River Exploration Inc	Morgan Stanley	6.047	(21.662)	Torstar Corp 'B'	Morgan Stanley	2.710
67.038	Real Matters Inc	Morgan Stanley	(59.088)	63.564	Tourmaline Oil Corp	Morgan Stanley	9.282
(4.168)	Recipe Unlimited Corp	Morgan Stanley	3.769	(103.389)	TransAlta Corp	Morgan Stanley	10.718
(46.610)	Resolute Forest Products Inc	Morgan Stanley	(11.256)	275.917	TransAlta Renewables Inc	Morgan Stanley	3.926
380	Restaurant Brands International Inc	Morgan Stanley	714	22.223	Transat AT Inc	Morgan Stanley	(2.711)
22.893	Richelieu Hardware Ltd	Morgan Stanley	(4.561)	(7.310)	TransCanada Corp	Morgan Stanley	10.519
(139.450)	RioCan Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	44.719	(22.219)	Transcontinental Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.000)
(51.955)	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Morgan Stanley	(45.698)	(192.835)	Trican Well Service Ltd	Morgan Stanley	16.621
6.195	Rogers Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	(15.421)	(311.860)	Tricon Capital Group Inc	Morgan Stanley	(64.545)
(378.162)	Rogers Sugar Inc	Morgan Stanley	(7.426)	110.562	Trinidad Drilling Ltd	Morgan Stanley	(19.456)
60.662	Roots Corp	Morgan Stanley	42.710	(4.870)	Tucows Inc 'A'	Morgan Stanley	1.326
1.128	Royal Bank of Canada	Morgan Stanley	(5.625)	(817.839)	Turquoise Hill Resources Ltd	Morgan Stanley	153.488
(46.900)	Russel Metals Inc	Morgan Stanley	53.415	27.742	Uni-Select Inc	Morgan Stanley	(24.076)
20.819	Sandstorm Gold Ltd	Morgan Stanley	(355)	(162.197)	Uranium Participation Corp	Morgan Stanley	883
(5.165)	Saputo Inc	Morgan Stanley	(6.066)	(2.341)	Valeant Pharmaceuticals International Inc	Morgan Stanley	121
(60.389)	Savaria Corp	Morgan Stanley	(13.029)	(48.815)	Valener Inc	Morgan Stanley	9.714
(10.128)	Seabridge Gold Inc	Morgan Stanley	(5.754)	6.445	Valeura Energy Inc	Morgan Stanley	479
12.100	Sears Canada Inc	Morgan Stanley	(5.839)	(31.766)	Vermilion Energy Inc	Morgan Stanley	68.483
144.320	Secure Energy Services Inc	Morgan Stanley	(61.935)	24.065	Wajax Corp	Morgan Stanley	(12.410)
(143.899)	SEMAFO Inc	Morgan Stanley	(678)	5.227	Waste Connections Inc	Morgan Stanley	6.117
49.121	Seven Generations Energy Ltd 'A'	Morgan Stanley	73.413	67.237	Wesdome Gold Mines Ltd	Morgan Stanley	10.472
(18.048)	Shaw Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	5.543	(11.974)	West Fraser Timber Co Ltd	Morgan Stanley	(17.308)
44.752	ShawCor Ltd	Morgan Stanley	(33.083)	407.777	Western Forest Products Inc	Morgan Stanley	(53.971)
(4.046)	Shopify Inc 'A'	Morgan Stanley	(71.582)	(102.079)	WestJet Airlines Ltd	Morgan Stanley	29.415
14.709	Sienna Senior Living Inc	Morgan Stanley	(7.473)	58.582	Westport Fuel Systems Inc	Morgan Stanley	(11.943)
(6.828)	Sierra Wireless Inc	Morgan Stanley	1.825	(61.471)	Westshore Terminals Investment Corp	Morgan Stanley	23.186
91.899	Silvercorp Metals Inc	Morgan Stanley	(3.769)	445	Wheaton Precious Metals Corp	Morgan Stanley	27
				211.145	Whitecap Resources Inc	Morgan Stanley	(109.314)
				(27.890)	Winpak Ltd	Morgan Stanley	25.726
				96.956	WPT Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	16.483
				40.453	WSP Global Inc	Morgan Stanley	(13.619)

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Canada suite				Mexique suite			
117.801 (68.385)	Xtreme Drilling Corp	Morgan Stanley	(7.166)	110.200	Banco Santander Mexico SA		
13.548	Yamana Gold Inc	Morgan Stanley	(6.839)		Institucion de Banca		
	ZCL Composites Inc	Morgan Stanley	(6.158)		Multiple Grupo Financiero		
			923.725		Santand 'B'	Morgan Stanley	(24.169)
Chili				9.200	Banco Santander Mexico SA		
1.125.081	AES Gener SA	Morgan Stanley	(13.985)		Institucion de Banca		
446.367	Aguas Andinas SA 'A'	Morgan Stanley	(13.491)		Multiple Grupo Financiero		
9.006.416	Banco de Chile	Morgan Stanley	404.447		Santand 'B'	Goldman Sachs	(842)
4.766	Banco de Credito			43.500	Banco Santander Mexico SA		
	e Inversiones SA	Morgan Stanley	143.243		Institucion de Banca		
643	Bupa Chile SA**	Morgan Stanley	45		Multiple Grupo Financiero		
26.744	CAP SA	Morgan Stanley	(22.826)		Santand 'B'	Morgan Stanley	(7.539)
50.229	Cia Cerveceras Unidas SA	Morgan Stanley	(52.331)	(3.303.933)	Becle SAB de CV	Morgan Stanley	420.866
1.001.331	Colbun SA	Morgan Stanley	(12.856)	(56.551)	Becle SAB de CV	Goldman Sachs	(1.439)
298.091	Embotelladora Andina			(459.842)	Bolsa Mexicana de Valores		
	SA 'B' (Pref)	Morgan Stanley	(78.615)		SAB de CV	Goldman Sachs	39.611
607.761	Empresas CMPC SA	Morgan Stanley	435.033	(22.907)	Bolsa Mexicana de Valores		
3.190	Empresas COPEC SA	Morgan Stanley	(970)		SAB de CV	Morgan Stanley	561
8.408.515	Enel Chile SA	Morgan Stanley	(44.613)	815.547	Cemex SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	2.867
94.931	Inversiones Aguas			937.949	Cemex SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(11.012)
	Metropolitanas SA	Morgan Stanley	(22.137)	(59.272)	Coca-Cola Femsa SAB		
90.764	Inversiones La Construcccion				de CV 'L'	Goldman Sachs	13.305
	SA	Morgan Stanley	(98.323)	(21.339)	Coca-Cola Femsa SAB		
1.010.678	Parque Arauco SA	Morgan Stanley	(134.282)		de CV 'L'	Morgan Stanley	8.325
2.335.816	Ripley Corp SA	Morgan Stanley	948.325	192.013	Concentradora Fibra Danhos		
788.046	Salfacorp SA	Morgan Stanley	(125.202)		SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(5.352)
463.032	Sociedad Matriz del Banco			127.089	Concentradora Fibra Danhos		
	de Chile SA 'B'	Morgan Stanley	(1.316)		SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	(17.037)
1.196.584	SONDA SA	Morgan Stanley	(110.132)	(293.252)	Concentradora Fibra		
			1.200.014		Hoteleria Mexicana		
Colombie					SA de CV (Reit) '144A'	Goldman Sachs	4.063
499.610	Avianca Holdings SA (Pref)	Morgan Stanley	(12.481)	(340.449)	Concentradora Fibra		
3.463.389	Ecopetrol SA	Morgan Stanley	(50.735)		Hoteleria Mexicana		
			(63.216)		SA de CV (Reit) '144A'	Morgan Stanley	5.962
Allemagne				(331.879)	Concentradora Hipotecaria		
(652)	Alphabet Inc 'A'	Morgan Stanley	8.931		SAPI de CV (Reit)	Morgan Stanley	25.874
(222)	Tesla Inc	Goldman Sachs	6.003	1.129.471	Consortio ARA SAB de CV	Goldman Sachs	(9.987)
(14.266)	Walt Disney Co/The	Morgan Stanley	164.204	1.050.288	Consortio ARA SAB de CV	Morgan Stanley	(35.460)
			179.138	(169.600)	Controladora Vuela Cia		
Italie					de Aviacion SAB de CV 'A'	Goldman Sachs	8.101
(1.170)	Rizzoli Corriere Della Sera	Bank of America		(603.900)	Controladora Vuela Cia		
	Mediagroup SpA	Merrill Lynch	(515)		de Aviacion SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	443.473
1.170	Rizzoli Corriere Della Sera	Bank of America		(45.928)	Corp Inmobiliaria Vesta		
	Mediagroup SpA	Merrill Lynch	342		SAB de CV	Morgan Stanley	1.571
			(173)	242.400	Credito Real SAB de CV		
Mexique					SOFOM ER	Goldman Sachs	(9.863)
1.357.047	Alfa SAB de CV 'A'	Goldman Sachs	(94.677)	490.960	Credito Real SAB de CV		
2.997.435	Alfa SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	(128.254)		SOFOM ER	Morgan Stanley	(13.028)
645.239	Alpek SAB de CV	Goldman Sachs	64.572	(27.000)	Fibra Uno Administracion SA		
1.003.033	Alpek SAB de CV	Morgan Stanley	34.348		de CV (Reit)	Morgan Stanley	516
(88.400)	Alsea SAB de CV	Goldman Sachs	21.857	(661.534)	Fibra Uno Administracion SA		
(475.652)	Alsea SAB de CV	Morgan Stanley	43.799		de CV (Reit)	Goldman Sachs	69.089
1.355.460	America Movil SAB de CV 'L'	Goldman Sachs	(101.966)	56.000	Fomento Economico Mexicano		
812.239	America Movil SAB de CV 'L'	Morgan Stanley	(65.639)		SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(6.017)
(337.137)	Arca Continental SAB de CV	Goldman Sachs	22.555	54.500	Fomento Economico Mexicano		
(557.904)	Arca Continental SAB de CV	Morgan Stanley	318.370		SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	(10.936)
(3.211.328)	Axtel SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	9.348	(295.562)	Genomma Lab Internacional		
(1.495.723)	Axtel SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	9.217		SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	(5.328)
(88.000)	Banco del Bajio SA '144A'	Goldman Sachs	7.907	(554.199)	Genomma Lab Internacional		
(335.186)	Banco del Bajio SA '144A'	Morgan Stanley	37.574		SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	(9.546)
283.700	Banco Santander Mexico SA			(244.502)	Genera SAB de CV	Goldman Sachs	(7.951)
	Institucion de Banca			(1.271.820)	Genera SAB de CV	Morgan Stanley	(34.759)
	Multiple Grupo Financiero			(81.700)	GMexico Transportes SAB		
	Santand 'B'	Goldman Sachs	(64.856)		de CV '144A'	Goldman Sachs	988
				(743.991)	GMexico Transportes SAB		
					de CV '144A'	Morgan Stanley	229.653
				124.434	Gruma SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	(74.846)
				138.402	Gruma SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	(36.682)
				172.203	Grupo Aeromexico SAB de CV	Goldman Sachs	1.590
				194.395	Grupo Aeromexico SAB de CV	Morgan Stanley	618

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Mexique suite				Mexique suite			
194.315	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	Goldman Sachs	(49.121)	927.095	Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	31.111
173.115	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	Morgan Stanley	(21.358)	303.356	Megacable Holdings SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	(35.202)
148.134	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	(164.346)	457.817	Megacable Holdings SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(73.804)
66.833	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	(56.593)	(294.454)	Mexichem SAB de CV	Goldman Sachs	32.427
(8.435)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	10.233	(835.548)	Nemak SAB de CV '144A'	Morgan Stanley	177.939
(44.060)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	93.782	(57.600)	Nemak SAB de CV '144A'	Goldman Sachs	1.161
(1.537.265)	Grupo Bimbo SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	701.200	228.300	PLA Administradora Industrial S de RL de CV (Reit)	Goldman Sachs	(16.304)
(290.796)	Grupo Bimbo SAB de CV 'A'	Goldman Sachs	43.718	861.016	PLA Administradora Industrial S de RL de CV (Reit)	Morgan Stanley	(27.638)
207.568	Grupo Carso SAB de CV 'A1'	Goldman Sachs	(15.096)	1.086.740	Prologis Property Mexico SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	147.642
87.445	Grupo Carso SAB de CV 'A1'	Morgan Stanley	1.222	797.257	Prologis Property Mexico SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(19.601)
(3.100)	Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	Goldman Sachs	1	89.892	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	Goldman Sachs	(37.759)
(15.300)	Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	Morgan Stanley	69	209.447	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	Morgan Stanley	(27.469)
417.710	Grupo Comercial Chedraui SA de CV	Goldman Sachs	(14.874)	(100.075)	Qualitas Controladora SAB de CV	Goldman Sachs	146
692.873	Grupo Comercial Chedraui SA de CV	Morgan Stanley	(20.845)	(322.668)	Qualitas Controladora SAB de CV	Morgan Stanley	19.287
(9.432)	Grupo Elektra SAB DE CV	Goldman Sachs	4.536	101.945	Rassini SAB de CV	Goldman Sachs	(12.172)
(53.347)	Grupo Elektra SAB DE CV	Morgan Stanley	20.064	23.693	Rassini SAB de CV	Morgan Stanley	(2.423)
74.900	Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	Goldman Sachs	(20.692)	(666.783)	Regional SAB de CV	Morgan Stanley	321.059
758.517	Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	Morgan Stanley	(64.680)	(268.301)	Regional SAB de CV	Goldman Sachs	58.564
(2.035.836)	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV 'O'	Goldman Sachs	230.626	(1.375.258)	Telesites SAB de CV	Goldman Sachs	12.687
(842.892)	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV 'O'	Morgan Stanley	52.500	(3.458.831)	Telesites SAB de CV	Morgan Stanley	(114.233)
460.378	Grupo Financiero Interacciones SA de CV 'O'	Goldman Sachs	(53.755)	(984.519)	TV Azteca SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	10.835
489.314	Grupo Financiero Interacciones SA de CV 'O'	Morgan Stanley	(18.984)	(2.968.077)	TV Azteca SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	302.924
(124.157)	Grupo GICSA SA de CV	Goldman Sachs	4.096	(55.688)	Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR	Morgan Stanley	8.904
(330.808)	Grupo GICSA SA de CV	Morgan Stanley	2.521	513.500	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Goldman Sachs	(2.363)
(869.370)	Grupo Herdez SAB de CV	Goldman Sachs	103.848	2.378.414	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Morgan Stanley	49.057
(4.098)	Grupo Herdez SAB de CV	Morgan Stanley	233				4.035.139
(1.995.312)	Grupo Lala SAB de CV	Goldman Sachs	(199.433)	Pérou			
(809.842)	Grupo Lala SAB de CV	Morgan Stanley	(75.634)	447	Credicorp Ltd	Morgan Stanley	(939)
(74.800)	Grupo Mexico SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	20.193	(238)	Credicorp Ltd	Goldman Sachs	(25.734)
(319.500)	Grupo Mexico SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	198.534	7.452	Tahoe Resources Inc**	Morgan Stanley	(149)
(282.192)	Grupo Rotoplas SAB de CV	Morgan Stanley	15.714	537.685	Volcan Cia Minera SAA	Morgan Stanley	(18.352)
(259.136)	Grupo Rotoplas SAB de CV	Goldman Sachs	13.846				(45.174)
66.317	Grupo Simec SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	(27.537)	Royaume-Uni			
(497.182)	Grupo Televisa SAB (Unit)	Morgan Stanley	319.664	51.691	Rhythmone Plc	Bank of America	
(10.400)	Grupo Televisa SAB (Unit)	Goldman Sachs	2.648			Merrill Lynch	(159.751)
(180.465)	Hoteles City Express SAB de CV	Goldman Sachs	4.874	23.480	Rhythmone Plc	Goldman Sachs	(10.387)
(1.415.871)	Hoteles City Express SAB de CV	Morgan Stanley	114.769	19.978	Rhythmone Plc	Morgan Stanley	(68.605)
219.579	Industrias Bachoco SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	(45.223)	(23.480)	Rhythmone Plc	Goldman Sachs	4.150
463.503	Industrias Bachoco SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	8.312	(19.978)	Rhythmone Plc	Morgan Stanley	(9.815)
34.983	Industrias Penoles SAB de CV	Morgan Stanley	(32.376)				(244.408)
48.533	Industrias Penoles SAB de CV	Goldman Sachs	(51.059)	Etats-Unis			
(29.400)	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	Goldman Sachs	5.790	(125.944)	1-800-Flowers.com Inc 'A'	Bank of America	
(1.617.084)	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	Morgan Stanley	1.154.342	(9.854)	2U Inc	Merrill Lynch	(56.675)
(890.400)	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	48.223	593	2U Inc	Goldman Sachs	(13.401)
(226.407)	La Comer SAB de CV	Goldman Sachs	(9.859)	(46.242)	2U Inc	Morgan Stanley	1.228
(1.653.140)	La Comer SAB de CV	Morgan Stanley	(31.922)	(25.163)	3D Systems Corp	Bank of America	(62.889)
2.152.022	Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(41.202)	8.559	3M Co	Bank of America	
				66.814	8x8 Inc	Merrill Lynch	(37.403)
						Morgan Stanley	(240.530)

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(20.293)	8x8 Inc	Bank of America		(2.765)	ACI Worldwide Inc	Morgan Stanley	(1.714)
(71.717)	A Schulman Inc	Merrill Lynch	58.850	(2.442)	Aclaris Therapeutics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch				Merrill Lynch	3.614
(4.058)	A-Mark Precious Metals Inc	Bank of America	(3.091)	(15.565)	Aclaris Therapeutics Inc	Morgan Stanley	15.876
		Merrill Lynch		(1.389)	ACM Research Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.861)
433.499	A10 Networks Inc	Bank of America	(1.583)	19.278	Acorda Therapeutics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch				Merrill Lynch	30.845
218.946	A10 Networks Inc	Goldman Sachs	169.065	7.862	Acorda Therapeutics Inc	Goldman Sachs	12.579
84.382	A10 Networks Inc	Morgan Stanley	85.389	4.360	Acorda Therapeutics Inc	Morgan Stanley	12.862
(143.915)	AAON Inc	Bank of America	20.252	23.431	Activision Blizzard Inc	Morgan Stanley	3.749
		Merrill Lynch		19.364	Activision Blizzard Inc	Bank of America	
(10.205)	AAR Corp	Merrill Lynch	(158.307)			Merrill Lynch	25.948
		Bank of America		1.323	Actua Corp	Bank of America	
(56.730)	AAR Corp	Merrill Lynch	12.756			Merrill Lynch	—
16.929	Aaron's Inc	Morgan Stanley	(72.047)	(232.463)	Actuant Corp 'A'	Bank of America	
22.506	Aaron's Inc	Morgan Stanley	5.687			Merrill Lynch	168.768
		Bank of America		(128.511)	Actuant Corp 'A'	Morgan Stanley	(47.669)
		Merrill Lynch	1.223	1.305	Acuity Brands Inc	Bank of America	
69.611	Abbott Laboratories	Bank of America				Merrill Lynch	6.838
		Merrill Lynch	105.809	20.646	Acuity Brands Inc	Morgan Stanley	132.275
202	Abbott Laboratories	Morgan Stanley	135	(1.801)	Acuity Brands Inc	Bank of America	
12.932	AbbVie Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(9.437)
		Merrill Lynch	(42.805)	20.565	Acushnet Holdings Corp	Bank of America	
551	AbbVie Inc	Goldman Sachs	(1.824)			Merrill Lynch	17.480
(28.145)	Abeona Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(56.994)	1.844	Acushnet Holdings Corp	Morgan Stanley	92
(1.506)	Abeona Therapeutics Inc	Goldman Sachs	2.937	1.427	Axiom Corp	Bank of America	
(1.653)	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Morgan Stanley	1.636			Merrill Lynch	3.168
(3.285)	Abiomed Inc	Bank of America		20.150	Axiom Corp	Morgan Stanley	25.196
		Merrill Lynch	(25.163)	2.059	Adamas Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
926	Abiomed Inc	Morgan Stanley	4.109			Merrill Lynch	(264)
89.280	ABM Industries Inc	Morgan Stanley	(81.481)	1.136	Adamas Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(2.851)
(10.673)	ABM Industries Inc	Bank of America		2.819	Adamas Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.006)
		Merrill Lynch	15.796	(1.187)	Adams Resources	Bank of America	
7.404	Abraxas Petroleum Corp	Goldman Sachs	(444)		& Energy Inc	Merrill Lynch	154
(7.913)	Acacia Communications Inc	Bank of America		(2.275)	Adams Resources	& Energy Inc	
		Merrill Lynch	2.356			Goldman Sachs	296
(26.664)	Acacia Communications Inc	Morgan Stanley	(38.365)	360	Addus HomeCare Corp	Bank of America	
(11.877)	Acacia Communications Inc	Goldman Sachs	2.850			Merrill Lynch	1.638
(37.756)	Acacia Research Corp	Bank of America		88.674	Adecoagro SA	Morgan Stanley	(13.301)
		Merrill Lynch	(1.888)	(49.948)	Adient Plc	Goldman Sachs	164.329
(2.401)	Acacia Research Corp	Goldman Sachs	(120)	(1.066)	Adient Plc	Morgan Stanley	3.646
(9.042)	Acacia Research Corp	Morgan Stanley	452	13.322	Adobe Systems Inc	Bank of America	
1.336	Acadia Healthcare Co Inc	Bank of America				Merrill Lynch	159.198
		Merrill Lynch	(1.714)	(165.530)	Adtalem Global Education Inc	Bank of America	
6.155	Acadia Healthcare Co Inc	Morgan Stanley	(7.275)			Merrill Lynch	(309.242)
(8.081)	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs	6.788	(78.298)	Adtalem Global Education Inc	Morgan Stanley	(100.127)
(4.279)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1.498	3.133	ADTRAN Inc	Bank of America	
19.373	Acadia Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	20.729			Merrill Lynch	(940)
1.636	Accelerate Diagnostics Inc	Morgan Stanley	8	(15.972)	Advance Auto Parts Inc	Bank of America	
(37.290)	Acceleron Pharma Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(102.221)
		Merrill Lynch	(43.629)	13.601	Advanced Drainage		
26.940	Accenture Plc 'A'	Bank of America			Systems Inc	Morgan Stanley	73.527
		Merrill Lynch	61.962	7.906	Advanced Drainage	Bank of America	
57.511	Accenture Plc 'A'	Morgan Stanley	91.097		Systems Inc	Merrill Lynch	37.203
988	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	2.272	(213.168)	Advanced Emissions	Bank of America	
(52.391)	Access National Corp	Bank of America			Solutions Inc	Merrill Lynch	85.267
		Merrill Lynch	(72.633)	2.711	Advanced Energy	Bank of America	
(11.311)	Access National Corp	Goldman Sachs	(15.949)		Industries Inc	Merrill Lynch	4.988
(15.247)	Access National Corp	Morgan Stanley	(3.812)	2.790	Advanced Energy		
117.467	ACCO Brands Corp	Morgan Stanley	52.860		Industries Inc	Goldman Sachs	5.134
86.097	ACCO Brands Corp	Bank of America		(19.448)	Advanced Micro Devices Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	99.012			Merrill Lynch	(27.811)
34.448	ACCO Brands Corp	Goldman Sachs	39.615	(10.233)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	(14.633)
200.195	Accuray Inc	Bank of America		18.272	AdvanSix Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(35.034)			Merrill Lynch	1.644
219.266	Accuray Inc	Goldman Sachs	(38.372)	1.915	AdvanSix Inc	Morgan Stanley	(2.470)
76.958	Accuray Inc	Morgan Stanley	(28.859)	(48.912)	Adverum Biotechnologies Inc	Morgan Stanley	(22.010)
(71.625)	Aceto Corp	Bank of America		(6.313)	Adverum Biotechnologies Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	8.871			Merrill Lynch	(2.525)
(3.717)	ACI Worldwide Inc	Bank of America		65.689	AECOM	Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.211)			Merrill Lynch	(4.986)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
10.691	AECOM	Morgan Stanley	353	(9.711)	Akamai Technologies Inc	Bank of America	
25.717	Aegon NV Reg	Bank of America				Merrill Lynch	6.798
		Merrill Lynch	1.330	(11.804)	Akcea Therapeutics Inc	Bank of America	
94.515	Aegon NV Reg	Morgan Stanley	(40.779)			Merrill Lynch	(12.108)
(102.295)	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	(169.102)	(1.675)	Akcea Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(3.819)
(16.782)	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs	8.450	92.095	Akebia Therapeutics Inc	Bank of America	
(26.039)	Aerie Pharmaceuticals Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(29.757)
		Merrill Lynch	(10.416)	23.314	Akebia Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(8.036)
873	Aerie Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	609	35.238	Akebia Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(24.314)
1.164	Aerie Pharmaceuticals Inc	Bank of America		6.147	Alamo Group Inc	Goldman Sachs	(5.471)
		Merrill Lynch	622	42.636	Alamo Group Inc	Bank of America	
286.061	Aerohive Networks Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(37.946)
		Merrill Lynch	11.442	6.140	Alamo Group Inc	Morgan Stanley	(24.621)
34.795	Aerohive Networks Inc	Goldman Sachs	1.392	(111.122)	Alamos Gold Inc 'A'	Morgan Stanley	307.792
63.621	Aerohive Networks Inc	Morgan Stanley	(7.635)	(20.643)	Alarm.com Holdings Inc	Bank of America	
(32.484)	Aerovironment Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(77.927)
		Merrill Lynch	(121.576)	(17.849)	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(67.380)
(24.724)	Aerovironment Inc	Morgan Stanley	(47.223)	(22.106)	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(48.191)
(811.267)	AES Corp/VA	Morgan Stanley	(385.352)	28.349	Alaska Air Group Inc	Bank of America	
(94.140)	AES Corp/VA	Bank of America				Merrill Lynch	45.642
		Merrill Lynch	(35.303)	(114.235)	Albany International Corp 'A'	Bank of America	
13.795	Affiliated Managers Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(194.200)
		Merrill Lynch	(97.117)	(27.742)	Albany International Corp 'A'	Morgan Stanley	24.968
3.176	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	(25.122)	2.138	Albemarle Corp	Bank of America	
398	Affiliated Managers Group Inc	Goldman Sachs	(2.802)			Merrill Lynch	(15.094)
(51.162)	Aflac Inc	Bank of America		2.781	Albemarle Corp	Goldman Sachs	(19.634)
		Merrill Lynch	14.570	(29.016)	Alcoa Corp	Morgan Stanley	12.767
(68.416)	Aflac Inc	Morgan Stanley	25.774	(233)	Alcoa Corp	Bank of America	
(44.475)	AGCO Corp	Morgan Stanley	108.074			Merrill Lynch	301
55.134	AGCO Corp	Bank of America		(266)	Alcoa Corp	Goldman Sachs	343
		Merrill Lynch	25.362	24.710	Alder Biopharmaceuticals Inc	Bank of America	
591	AGCO Corp	Goldman Sachs	272			Merrill Lynch	45.096
54.977	Agenus Inc	Bank of America		(6.950)	Aldeyra Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1.738
		Merrill Lynch	6.215	2.469	Alexander & Baldwin Inc	Bank of America	
16.853	Agenus Inc	Goldman Sachs	2.107			Merrill Lynch	1.543
27.470	Agenus Inc	Morgan Stanley	(1.236)	38.522	Alexander & Baldwin Inc	Morgan Stanley	27.736
28.787	Agilent Technologies Inc	Bank of America		50.917	Alexandria Real Estate	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.182		Equities Inc (Reit)	Merrill Lynch	48.257
(53.546)	Agilysys Inc	Bank of America		64.159	Alexandria Real Estate		
		Merrill Lynch	(128.510)		Equities Inc (Reit)	Morgan Stanley	54.061
(37.575)	Agilysys Inc	Morgan Stanley	(69.138)	4.765	Alexandria Real Estate		
(1.100)	Agilysys Inc	Goldman Sachs	(2.640)		Equities Inc (Reit)	Goldman Sachs	4.384
(13.900)	Agios Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(88.543)	1.265	Alexion Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(3.150)
(11.602)	Agios Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(72.380)	4.100	Alexion Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
(190.894)	AGNC Investment Corp (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(20.623)
		Merrill Lynch	(45.324)	(17.898)	Alico Inc	Bank of America	
(16.957)	AGNC Investment Corp (Reit)	Morgan Stanley	(85)			Merrill Lynch	2.685
9.752	AH Belo Corp 'A'	Bank of America		(2.495)	Alico Inc	Goldman Sachs	374
		Merrill Lynch	975	(25.760)	Alico Inc	Morgan Stanley	(25.760)
1.507	AH Belo Corp 'A'	Morgan Stanley	75	(1.330)	Align Technology Inc	Bank of America	
18.691	Aimmune Therapeutics Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(71.022)
		Merrill Lynch	57.755	(4.469)	Align Technology Inc	Morgan Stanley	(175.810)
1.121	Aimmune Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(146)	(21.553)	Alkermes Plc	Goldman Sachs	(26.726)
32.825	Air Lease Corp	Bank of America		(291)	Alleghany Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(10.504)			Merrill Lynch	4.173
(64.604)	Air Lease Corp	Morgan Stanley	(15.506)	(24.059)	Allegheny Technologies Inc	Goldman Sachs	(5.774)
2.579	Air Lease Corp	Goldman Sachs	(825)	(25.776)	Allegheny Technologies Inc	Morgan Stanley	(3.093)
44.889	Air Products & Chemicals Inc	Bank of America		(16.330)	Allegiance Bancshares Inc	Morgan Stanley	(11.431)
		Merrill Lynch	(148.583)	(1.500)	Allegiance Bancshares Inc	Goldman Sachs	(2.250)
1.541	Air Products & Chemicals Inc	Goldman Sachs	(5.101)	(54.022)	Allegiance Bancshares Inc	Bank of America	
44.006	Air Products & Chemicals Inc	Morgan Stanley	(215.376)			Merrill Lynch	(71.719)
80.748	Air Transport Services	Bank of America		(24.212)	Allegiant Travel Co	Bank of America	
	Group Inc	Merrill Lynch	(13.770)			Merrill Lynch	90.795
112.160	Air Transport Services			(3.576)	Allegiant Travel Co	Morgan Stanley	(1.788)
	Group Inc	Morgan Stanley	48.229	14.265	Allegion Plc	Morgan Stanley	(2.425)
(15.334)	Aircastle Ltd	Goldman Sachs	23.154	21.666	Allegion Plc	Bank of America	
(1.459)	AK Steel Holding Corp	Goldman Sachs	(452)			Merrill Lynch	44.199
(55.099)	AK Steel Holding Corp	Morgan Stanley	(10.469)	(7.060)	Allergan Plc	Goldman Sachs	6.636
(94.251)	AK Steel Holding Corp	Bank of America		3.440	ALLETE Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(29.218)			Merrill Lynch	10.086
(36.619)	Akamai Technologies Inc	Morgan Stanley	(35.708)				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
647	Alliance Data Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.879	1.656	AMC Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2.252
(2.630)	Alliance Data Systems Corp	Morgan Stanley	1.131	(29.430)	Amdocs Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(67.100)
(1.360)	Alliance One International Inc	Goldman Sachs	(4.080)	(1.244)	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	(2.961)
(3.721)	Alliance One International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.163)	(11.140)	Amedisys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39.213)
54.934	Alliant Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	37.410	(4.919)	AMERCO	Bank of America Merrill Lynch	117.367
1.873	Alliant Energy Corp	Goldman Sachs	1.506	(3.865)	AMERCO	Morgan Stanley	56.025
(10.278)	Allied Motion Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19.323)	77.598	Ameren Corp	Morgan Stanley	128.718
(7.668)	Allied Motion Technologies Inc	Morgan Stanley	(13.956)	19.774	Ameresco Inc 'A'	Goldman Sachs	18.431
(1.010)	Allied Motion Technologies Inc	Goldman Sachs	(1.899)	10.752	Ameresco Inc 'A'	Morgan Stanley	9.139
(77.731)	Allison Transmission Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	88.613	40.491	Ameresco Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	34.480
(46.444)	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	109.143	30.136	America Movil SAB de CV ADR 'L'	Goldman Sachs	(40.265)
2.572	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Morgan Stanley	3.620	80.719	America Movil SAB de CV ADR 'L'	Morgan Stanley	(71.033)
(14.780)	Allstate Corp/The	Morgan Stanley	38.633	22.096	America's Car-Mart Inc/TX	Bank of America Merrill Lynch	206.598
12.385	Allstate Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(29.972)	2.053	America's Car-Mart Inc/TX	Goldman Sachs	19.196
870	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	(1.305)	(39.156)	American Airlines Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.175
29.295	Ally Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17.415)	1.991	American Airlines Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(725)
3.264	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	(2.089)	661	American Assets Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1.144
(10.438)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	939	46.964	American Assets Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	61.992
129.200	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Bank of America Merrill Lynch	153.748	(9.394)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Morgan Stanley	4.885
(447)	Alphabet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4.488)	4.578	American Campus Communities Inc (Reit)	Goldman Sachs	8.195
236	Alphabet Inc 'A'	Morgan Stanley	4.049	67.862	American Campus Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	120.853
27.106	Alta Mesa Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.584)	987	American Campus Communities Inc (Reit)	Morgan Stanley	2.458
23.328	Alta Mesa Resources Inc	Morgan Stanley	(12.364)	10.166	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs	9.251
1.203	Altair Engineering Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	596	113.589	American Eagle Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	51.651
5.259	Altair Engineering Inc 'A'	Morgan Stanley	2.093	(3.224)	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	620
(4.125)	Alteryx Inc 'A'	Morgan Stanley	(8.333)	5.600	American Equity Investment Life Holding Co	Morgan Stanley	2.060
23.188	Altice USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(31.903)	38.466	American Express Co	Bank of America Merrill Lynch	(11.816)
1.355	Altice USA Inc 'A'	Goldman Sachs	(718)	25.146	American Financial Group Inc/OH	Bank of America Merrill Lynch	2.989
48.621	Altice USA Inc 'A'	Morgan Stanley	(1.945)	1.090	American Financial Group Inc/OH	Morgan Stanley	458
(7.672)	Altisource Portfolio Solutions SA	Morgan Stanley	(2.378)	(74.227)	American International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	192.248
(19.872)	Altisource Portfolio Solutions SA	Bank of America Merrill Lynch	4.430	(98.976)	American International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	75.751
10.429	Altra Industrial Motion Corp	Morgan Stanley	(11.424)	(2.948)	American National Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.717)
21.804	Altra Industrial Motion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17.443)	12.378	American National Insurance Co	Bank of America Merrill Lynch	(7.951)
10.806	Altra Industrial Motion Corp	Goldman Sachs	(8.645)	2.445	American National Insurance Co	Goldman Sachs	(1.171)
(123.959)	Altria Group Inc	Morgan Stanley	(64.088)	460	American National Insurance Co	Morgan Stanley	(1.058)
(3.266)	Altria Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.344)	(13.226)	American Public Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52.243)
16.531	AMAG Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	20.250	(90.361)	American Railcar Industries Inc	Morgan Stanley	7.229
1.070	AMAG Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1.311	(84.919)	American Railcar Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72.181)
(71.631)	Ambac Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	30.085				
16.032	Ambarella Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.168)				
(6.801)	Ambarella Inc	Morgan Stanley	(21.055)				
2.239	Ambarella Inc	Goldman Sachs	(582)				
320	Ambarella Inc	Morgan Stanley	(122)				
124.851	Ambev SA ADR	Goldman Sachs	(55.658)				
201.491	Ambev SA ADR	Morgan Stanley	(52.388)				
13.819	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(11.746)				
8.913	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(11.807)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
27.755	American Renal Associates Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15.543)	(235.675)	Antares Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35.351)
7.913	American Renal Associates Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.165)	(131.838)	Antares Pharma Inc	Goldman Sachs	(19.776)
2.320	American Renal Associates Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.299)	97.043	Antero Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	970
85.795	American Software Inc/GA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	47.187	10.182	Antero Resources Corp	Goldman Sachs	102
56.763	American Software Inc/GA 'A'	Goldman Sachs	31.220	4.220	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	(422)
38.542	American Software Inc/GA 'A'	Morgan Stanley	18.500	83.869	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	23.483
(63.947)	American States Water Co	Bank of America Merrill Lynch	(166.262)	37.455	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Goldman Sachs	10.487
(70.163)	American States Water Co	Morgan Stanley	(161.375)	49.260	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Morgan Stanley	8.867
(12.270)	American Tower Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(9.571)	(44.929)	Aon Plc	Morgan Stanley	83.452
(2.141)	American Tower Corp (Reit)	Goldman Sachs	(1.670)	(11.647)	Aon Plc	Goldman Sachs	12.695
37.052	American Water Works Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	101.937	(12.552)	Apache Corp	Bank of America Merrill Lynch	29.623
15.229	American Water Works Co Inc	Morgan Stanley	51.131	4.136	Apache Corp	Morgan Stanley	(1.670)
611	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs	2.134	2.867	Apartment Investment & Management Co 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	2.638
(50.910)	American Woodmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.122.566)	(10.842)	Apellis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(13.444)
10.169	American Woodmark Corp	Morgan Stanley	209.622	1.692	Apergy Corp	Goldman Sachs	(738)
810	American Woodmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.161	37.330	Apergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	63.939
(149.785)	Americold Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(62.940)	44.667	Apogee Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	90.335
(90.964)	Americold Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	(10.006)	4.567	Apogee Enterprises Inc	Goldman Sachs	11.829
(1.218)	AmeriGas Partners LP	Morgan Stanley	390	5.044	Apogee Enterprises Inc	Morgan Stanley	4.457
76.070	Ameriprise Financial Inc	Morgan Stanley	(430.556)	(459.335)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(156.174)
(48.150)	Ameris Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(13.104)	(58.573)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (Reit)	Morgan Stanley	(5.121)
(14.473)	Ameris Bancorp	Morgan Stanley	10.211	(5.332)	Appian Corp	Bank of America Merrill Lynch	(861)
(3.258)	AMERISAFE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.258)	(2.530)	Appian Corp	Morgan Stanley	(4.073)
18.565	AmerisourceBergen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(42.885)	175.897	Apple Hospitality Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	167.102
404	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs	(933)	(13.422)	Apple Hospitality Inc (Reit)	Morgan Stanley	(7.382)
5.224	AMETEK Inc	Goldman Sachs	811	20.340	Apple Hospitality Inc (Reit)	Goldman Sachs	19.323
87.697	AMETEK Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.124	(8.294)	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.543)
42.236	AMETEK Inc	Morgan Stanley	1.015	(6.792)	Apple Inc	Morgan Stanley	2.536
1.686	Amgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.134	45.096	Applied Genetic Technologies Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	(45.096)
(16.267)	Amicus Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38.553)	39.078	Applied Genetic Technologies Corp/DE	Morgan Stanley	(37.124)
13.876	Amkor Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.464	10.444	Applied Industrial Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	—
(724)	AMN Healthcare Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11)	80.922	Applied Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(201.137)
(120.354)	Anneal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(541.759)	154.488	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	(212.324)
(37.945)	Ampco-Pittsburgh Corp	Morgan Stanley	(1.897)	4.785	Applied Optoelectronics Inc	Goldman Sachs	46.319
(28.274)	Ampco-Pittsburgh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19.792)	709	Applied Optoelectronics Inc	Morgan Stanley	6.253
94.650	Amphenol Corp 'A'	Morgan Stanley	(89.292)	10.279	Applied Optoelectronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	99.501
6.969	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	(2.021)	150.507	Approach Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	57.945
31.686	Anadarko Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	21.863	42.631	Approach Resources Inc	Goldman Sachs	16.413
24.366	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	41.383	100.532	Approach Resources Inc	Morgan Stanley	5.529
(15.284)	AnaptysBio Inc	Bank of America Merrill Lynch	180.963	(13.646)	Apptio Inc 'A'	Morgan Stanley	(17.194)
(16.909)	AnaptysBio Inc	Morgan Stanley	147.446	(9.464)	AptarGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12.065)
(5.484)	Anika Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.312)	(54.611)	AptarGroup Inc	Morgan Stanley	(14.366)
(4.610)	Anixter International Inc	Morgan Stanley	(4.759)	8.774	Aptiv Plc	Morgan Stanley	809
(131.221)	Annaly Capital Management Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(18.063)	(705)	Aptiv Plc	Goldman Sachs	(804)
(28.318)	Ansys Inc	Bank of America Merrill Lynch	44.229	46.795	Aqua America Inc	Morgan Stanley	80.487
(5.096)	Ansys Inc	Morgan Stanley	7.492	(50.949)	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	(43.307)
				(106.818)	Aramark	Morgan Stanley	(5.341)
				(22.961)	Aratana Therapeutics Inc	Morgan Stanley	6.659
				(2.713)	Aratana Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1.085

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
385.464	Arbor Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	11.949	196	ASML Holding NV	Bank of America	
460.281	Arbor Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(724)
		Merrill Lynch	79.172	4.373	ASML Holding NV	Morgan Stanley	(9.704)
4.899	Arbor Realty Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	740	5.442	Aspen Aerogels Inc	Bank of America	
347.516	ARC Document Solutions Inc	Bank of America				Merrill Lynch	218
		Merrill Lynch	(104.255)	98.517	Aspen Aerogels Inc	Morgan Stanley	7.881
72.287	ARC Document Solutions Inc	Goldman Sachs	(21.686)	(39.970)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Morgan Stanley	(35.907)
158.139	ARC Document Solutions Inc	Morgan Stanley	—	(17.133)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Bank of America	
(21.216)	ArcBest Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(5.997)
		Merrill Lynch	6.640	(59.420)	Aspen Technology Inc	Bank of America	
(50.259)	Arch Capital Group Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(77.712)
		Merrill Lynch	(8.841)	(26.176)	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	(26.618)
(13.897)	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	17.927	(2.419)	Assembly Biosciences Inc	Bank of America	
7.358	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	(5.663)			Merrill Lynch	(847)
53.714	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America		(2.347)	Assembly Biosciences Inc	Goldman Sachs	(821)
		Merrill Lynch	(19.874)	(56.478)	Associated Banc-Corp	Morgan Stanley	11.398
(83.661)	Arconic Inc	Bank of America		3.725	Associated Banc-Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	9.203			Merrill Lynch	2.049
(21.742)	Arconic Inc	Morgan Stanley	15.219	(23.124)	Associated Capital Group	Bank of America	
(12.877)	Ardagh Group SA	Goldman Sachs	5.923		Inc 'A'	Merrill Lynch	(42.779)
(9.785)	Ardagh Group SA	Morgan Stanley	1.370	(934)	Associated Capital Group		
83.282	Ardelyx Inc	Morgan Stanley	(34.252)		Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.728)
82.944	Ardelyx Inc	Bank of America		(8.678)	Assurant Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(134.784)			Merrill Lynch	(42.296)
91.548	Ardelyx Inc	Goldman Sachs	(148.766)	(22.329)	Assurant Inc	Morgan Stanley	(95.272)
(21.643)	Arena Pharmaceuticals Inc	Bank of America		24.439	Assured Guaranty Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	28.785			Merrill Lynch	(5.132)
133.075	Ares Commercial Real Estate	Bank of America		(22.368)	Astec Industries Inc	Bank of America	
	Corp (Reit)	Merrill Lynch	37.261			Merrill Lynch	(67.328)
31.276	Argan Inc	Bank of America		(18.267)	Astec Industries Inc	Morgan Stanley	(11.143)
		Merrill Lynch	(1.564)	(5.842)	Astronics Corp	Bank of America	
15.208	Argo Group International	Bank of America				Merrill Lynch	35.870
	Holdings Ltd	Merrill Lynch	7.604	(1.839)	Astronics Corp 'B'	Morgan Stanley	166
581	Arista Networks Inc	Bank of America		(3.169)	Astronics Corp 'B'	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.812	(98.064)	Asure Software Inc	Bank of America	
(39.182)	Armstrong World Industries Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(39.226)
		Merrill Lynch	(105.791)	9.717	At Home Group Inc	Goldman Sachs	(4.081)
66.099	Array BioPharma Inc	Bank of America		16.434	At Home Group Inc	Morgan Stanley	(12.024)
		Merrill Lynch	70.065	9.129	At Home Group Inc	Bank of America	
20.408	Array BioPharma Inc	Goldman Sachs	21.632			Merrill Lynch	(4.242)
16.255	Array BioPharma Inc	Morgan Stanley	12.029	(24.713)	AT&T Inc	Bank of America	
(13.925)	ARRIS International PLC	Morgan Stanley	3.735			Merrill Lynch	(4.819)
(63.898)	ARRIS International PLC	Goldman Sachs	52.396	13.406	AT&T Inc	Morgan Stanley	(1.944)
33.172	Arrow Electronics Inc	Bank of America		6.888	Atara Biotherapeutics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(17.913)			Merrill Lynch	31.168
1.893	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	379	5.889	athenahealth Inc	Bank of America	
(132.190)	Arrow Financial Corp	Bank of America				Merrill Lynch	15.482
		Merrill Lynch	(152.019)	1.412	athenahealth Inc	Goldman Sachs	3.728
(1.864)	Arrow Financial Corp	Morgan Stanley	280	3.921	athenahealth Inc	Morgan Stanley	5.267
79.202	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America		13.364	Athene Holding Ltd 'A'	Goldman Sachs	(23.654)
		Merrill Lynch	(53.065)	(14.075)	Athene Holding Ltd 'A'	Morgan Stanley	17.296
30.130	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	(93.103)	32.909	Athene Holding Ltd 'A'	Bank of America	
(123.840)	Artisan Partners Asset	Bank of America				Merrill Lynch	(58.249)
	Management Inc 'A'	Merrill Lynch	43.344	799	Athene Holding Ltd 'A'	Morgan Stanley	(1.694)
(4.262)	Artisan Partners Asset			170.962	Atkore International Group Inc	Bank of America	
	Management Inc 'A'	Morgan Stanley	2.958			Merrill Lynch	163.496
50.595	Asbury Automotive Group Inc	Bank of America		7.947	Atkore International Group Inc	Goldman Sachs	10.570
		Merrill Lynch	(11.443)	34.904	Atkore International Group Inc	Morgan Stanley	48.168
(251.380)	Ascena Retail Group Inc	Goldman Sachs	(90.853)	84.187	Atlantic Power Corp	Morgan Stanley	—
(1.525)	Ascent Capital Group Inc 'A'	Bank of America		65.920	Atlantic Power Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	656			Merrill Lynch	(6.592)
(4.255)	Ascent Capital Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1.830	68.306	Atlantic Power Corp	Goldman Sachs	(6.831)
40.809	ASGN Inc	Bank of America		6.125	Atlantica Yield Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(195.067)			Merrill Lynch	(2.882)
3.369	ASGN Inc	Goldman Sachs	(16.104)	52.875	Atlantica Yield Plc	Morgan Stanley	(112.805)
(132.043)	Ashford Hospitality Trust	Bank of America		2.346	Atlas Air Worldwide		
	Inc (Reit)	Merrill Lynch	(77.905)		Holdings Inc	Morgan Stanley	1.414
(43.091)	Ashland Global Holdings Inc	Bank of America		755	Atlas Air Worldwide		
		Merrill Lynch	(115.903)		Holdings Inc	Goldman Sachs	1.050
(941)	Ashland Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(536)				
(2.013)	Ashland Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(6.019)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
14.196	Atlassian Corp Plc 'A'	Bank of America		(339.722)	Babcock & Wilcox	Goldman Sachs	98.519
(26.842)	Atlassian Corp Plc 'A'	Merrill Lynch	29.244	(49.397)	Enterprises Inc	Bank of America	
30.410	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	(58.553)		Badger Meter Inc	Merrill Lynch	(71.626)
(54.847)	ATN International Inc	Bank of America	99.370	9.171	Baker Hughes a GE Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	(106.403)	(6.504)	Balchem Corp	Merrill Lynch	(10.638)
74.281	AtriCure Inc	Bank of America		79.189	Baldwin & Lyons Inc 'B'	Morgan Stanley	(8.267)
		Merrill Lynch	97.308			Bank of America	
39.930	aTyr Pharma Inc	Bank of America		25.069	Baldwin & Lyons Inc 'B'	Merrill Lynch	(3.844)
		Merrill Lynch	(18.663)	15.293	Baldwin & Lyons Inc 'B'	Morgan Stanley	4.191
(14.158)	Autodesk Inc	Bank of America		(185.706)	Ball Corp	Goldman Sachs	(765)
(2.545)	Autodesk Inc	Merrill Lynch	73.055	(78.019)	Banc of California Inc	Morgan Stanley	430.709
(14.653)	Autoliv Inc	Morgan Stanley	(3.475)			Bank of America	
		Bank of America		(30.996)	Banc of California Inc	Merrill Lynch	(66.316)
(13.800)	Autoliv Inc	Merrill Lynch	(28.427)	(2.262)	Banc of California Inc	Goldman Sachs	(26.347)
10.741	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	14.628	539	BancFirst Corp	Morgan Stanley	(234)
		Bank of America		1.555	BancFirst Corp	Morgan Stanley	270
45.806	Automatic Data Processing Inc	Merrill Lynch	36.842	(57.104)	Banco Bradesco SA ADR	Goldman Sachs	2.799
(6.835)	AutoNation Inc	Morgan Stanley	318.397	(149.501)	Banco Bradesco SA ADR	Goldman Sachs	49.515
24.036	AutoNation Inc	Morgan Stanley	9.865	1.579	Banco de Chile ADR	Morgan Stanley	128.571
		Bank of America		4.512	Banco de Chile ADR	Goldman Sachs	(1.358)
		Merrill Lynch	(1.442)	22.493	Banco Santander Brasil	Morgan Stanley	(9.114)
345	AutoNation Inc	Morgan Stanley	90		SA ADR		
1.445	AutoNation Inc	Goldman Sachs	(87)	163.815	Banco Santander Brasil	Goldman Sachs	(17.320)
685	AutoZone Inc	Bank of America			SA ADR		
		Merrill Lynch	(4.062)	(6.297)	Banco Santander Chile ADR	Morgan Stanley	(275.725)
(32.762)	AV Homes Inc	Goldman Sachs	(54.057)	(47.772)	Banco Santander Chile ADR	Goldman Sachs	(630)
(31.265)	AV Homes Inc	Bank of America		(20.300)	Banco Santander SA ADR	Morgan Stanley	955
		Merrill Lynch	(51.587)	(1.023)	Bancolumbia SA ADR	Morgan Stanley	16.139
(143.245)	Avangrid Inc	Bank of America		(38.193)	Bancolumbia SA ADR	Morgan Stanley	(644)
		Merrill Lynch	(167.597)	(45.025)	BancorpSouth Bank	Goldman Sachs	47.531
(12.617)	Avangrid Inc	Goldman Sachs	(14.762)	(36.047)	Bank of America Corp	Morgan Stanley	(6.434)
(38.903)	AVEO Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2.140	14.100	Bank of Commerce Holdings	Goldman Sachs	82.728
16.537	Avery Dennison Corp	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	8.765	6.042	Bank of Commerce Holdings	Merrill Lynch	6.017
39.411	Avery Dennison Corp	Morgan Stanley	(131.633)	4.802	Bank of Commerce Holdings	Goldman Sachs	3.977
(6.943)	Avid Bioservices Inc	Goldman Sachs	1.805	68.051	Bank of Hawaii Corp	Morgan Stanley	1.609
(34.740)	Avid Bioservices Inc	Morgan Stanley	8.685			Bank of America	
(11.226)	Avis Budget Group Inc	Bank of America		21.972	Bank of Hawaii Corp	Merrill Lynch	28.792
		Merrill Lynch	41.985	303	Bank of Hawaii Corp	Morgan Stanley	(22.631)
(165.137)	Avnet Inc	Morgan Stanley	52.844	1.211	Bank of Marin Bancorp	Goldman Sachs	133
(33.074)	Avnet Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	47.957	1.000	Bank of Marin Bancorp	Merrill Lynch	182
69.265	Avon Products Inc	Bank of America		1.030	Bank of Marin Bancorp	Morgan Stanley	750
		Merrill Lynch	(5.922)	(53.616)	Bank of New York Mellon	Goldman Sachs	155
175.818	Avon Products Inc	Morgan Stanley	(12.974)		Corp/The	Bank of America	
1.374	Avon Products Inc	Goldman Sachs	(131)	24.523	BankFinancial Corp	Merrill Lynch	123.317
48.703	AVX Corp	Goldman Sachs	(5.357)			Bank of America	
28.933	AVX Corp	Morgan Stanley	(4.629)	6.522	BankFinancial Corp	Merrill Lynch	13.242
101.086	AVX Corp	Bank of America		27.410	BankFinancial Corp	Goldman Sachs	3.522
		Merrill Lynch	(11.119)	(22.688)	BankUnited Inc	Morgan Stanley	2.741
446	Axalta Coating Systems Ltd	Goldman Sachs	(58)	2.935	BankUnited Inc	Morgan Stanley	(18.810)
(36.667)	Axcelis Technologies Inc	Bank of America		133.024	Banner Corp	Morgan Stanley	(2.084)
		Merrill Lynch	14.667			Bank of America	
(15.133)	Axis Capital Holdings Ltd	Bank of America		(3.476)	Banner Corp	Merrill Lynch	189.847
		Merrill Lynch	13.771	(43.675)	Barnes & Noble Education Inc	Morgan Stanley	(1.371)
(18.557)	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	10.577			Bank of America	
(2.773)	AxoGen Inc	Bank of America		(16.628)	Barnes Group Inc	Merrill Lynch	(10.482)
		Merrill Lynch	(12.201)	5.513	Bassett Furniture Industries Inc	Bank of America	
(10.643)	AxoGen Inc	Morgan Stanley	(50.554)			Merrill Lynch	(13.469)
(177.652)	AZZ Inc	Bank of America		3.183	Bassett Furniture Industries Inc	Merrill Lynch	1.654
		Merrill Lynch	(648.642)	17.967	Baxter International Inc	Morgan Stanley	(1.910)
(6.325)	B&G Foods Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(5.142)	46.659	Baxter International Inc	Merrill Lynch	29.134
(327.506)	B. Riley Financial Inc	Bank of America		5.036	BB&T Corp	Morgan Stanley	21.547
		Merrill Lynch	(180.128)			Bank of America	
(12.785)	B. Riley Financial Inc	Morgan Stanley	(4.475)	(8.367)	BB+T Corp	Merrill Lynch	(14.554)
(2.022)	B. Riley Financial Inc	Goldman Sachs	(1.112)	(3.119)	BCB Bancorp Inc	Morgan Stanley	3.984
(95.425)	Babcock & Wilcox	Bank of America				Bank of America	
	Enterprises Inc	Merrill Lynch	(47.352)			Merrill Lynch	(1.560)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(16.498)	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29.917)	(8.681)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.095)
24.266	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	40.646	(107.251)	BioScrip Inc	Morgan Stanley	(15.015)
6.572	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs	11.008	(7.614)	BioSpecifics Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.208)
8.663	Beacon Roofing Supply Inc	Morgan Stanley	16.416	(27.763)	BioTelemetry Inc	Goldman Sachs	(63.855)
(66.827)	Beasley Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(53.462)	(5.545)	BioTelemetry Inc	Morgan Stanley	(9.149)
59.423	Beazer Homes USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	50.510	(19.946)	BioTime Inc	Bank of America Merrill Lynch	—
(36.502)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	5.110	3.793	BJ's Restaurants Inc	Morgan Stanley	14.413
(38.634)	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	218.037	130.009	BJ's Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	514.107
(29.677)	Bed Bath & Beyond Inc	Morgan Stanley	(24.280)	5.342	BJ's Restaurants Inc	Goldman Sachs	21.298
(60.735)	Bed Bath & Beyond Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35.226)	46.676	Black Hills Corp	Bank of America Merrill Lynch	63.634
2.238	Belden Inc	Morgan Stanley	(4.026)	35.690	Black Hills Corp	Morgan Stanley	45.950
(54.092)	Belden Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.900	15.239	Black Hills Corp	Goldman Sachs	16.471
6.500	Bellicum Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.365)	1.006	Blackbaud Inc	Bank of America Merrill Lynch	396
5.031	Bellicum Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1.057)	11.702	Blackbaud Inc	Morgan Stanley	1.148
(87.385)	Belmond Ltd 'A'	Goldman Sachs	(18.373)	(65.314)	Blackbaud Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.207
(53.333)	Belmond Ltd 'A'	Morgan Stanley	8.000	(11.302)	Blackline Inc	Morgan Stanley	(1.017)
35.853	Bemis Co Inc	Morgan Stanley	(8.824)	(41.978)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(20.989)
40.141	Bemis Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	26.493	159.360	Bloomin' Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.402
(4.193)	Benchmark Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.774)	11.366	Bloomin' Brands Inc	Goldman Sachs	(1.932)
(72.944)	Beneficial Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28.419)	83.941	Bloomin' Brands Inc	Morgan Stanley	45.328
(16.965)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	74.816	(47.527)	Blucora Inc	Morgan Stanley	(83.172)
(1.982)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.535)	(50.595)	Blucora Inc	Bank of America Merrill Lynch	(263.094)
(53.165)	Berry Global Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(73.368)	(16.185)	Bluebird Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(131.515)
(13.489)	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	74.247	(1.950)	Bluebird Bio Inc	Goldman Sachs	(18.135)
(2.683)	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	27.062	(15.592)	BlueLinx Holdings Inc	Goldman Sachs	(7.640)
(34.107)	BG Staffing Inc	Bank of America Merrill Lynch	64.462	(649)	BlueLinx Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.629)
(903)	BG Staffing Inc	Goldman Sachs	1.707	(27.251)	Blueprint Medicines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(115.846)
6.375	BGC Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.964)	(38.898)	Bluerock Residential Growth REIT Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(1.556)
168.632	BGC Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(78.414)	(1.481)	Bluerock Residential Growth REIT Inc (Reit)	Goldman Sachs	(59)
16.346	BGC Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	(7.601)	12.517	BMC Stock Holdings Inc	Morgan Stanley	7.510
28.533	Big Lots Inc	Morgan Stanley	16.834	(155)	Boeing Co/The	Bank of America Merrill Lynch	613
1.107	Biglari Holdings Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	14.616	(7.549)	Boeing Co/The	Morgan Stanley	41.835
302	Biglari Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	4.053	(66.965)	Bofi Holding Inc	Morgan Stanley	(24.107)
203	Biglari Holdings Inc 'B'	Morgan Stanley	1.330	(735)	Bofi Holding Inc	Goldman Sachs	(243)
1.369	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	8.228	38.446	Boingo Wireless Inc	Bank of America Merrill Lynch	66.127
791	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	546	2.191	Boingo Wireless Inc	Goldman Sachs	3.769
809	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Goldman Sachs	3.681	4.867	BOK Financial Corp	Morgan Stanley	(13.725)
769	Bio-Techne Corp	Bank of America Merrill Lynch	562	(23.973)	BOK Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	64.727
805	Bio-Techne Corp	Morgan Stanley	(240)	(11.230)	BOK Financial Corp	Goldman Sachs	30.321
(14.766)	Bio-Techne Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.363)	(703)	Booking Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27.776)
(14.291)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.516)	(1.740)	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	(52.382)
(76.714)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(44.208)	(19.556)	Boot Barn Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31.297)
5.161	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	117.000	(25.503)	Boot Barn Holdings Inc	Goldman Sachs	(51.516)
441	Biogen Inc	Goldman Sachs	9.997	41.791	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	173.851
189	Biogen Inc	Morgan Stanley	3.599	1.797	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Goldman Sachs	7.476
(16.080)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(28.301)	11.268	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Morgan Stanley	36.876
				104.960	BorgWarner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(181.517)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
11.886	BorgWarner Inc	Goldman Sachs	(22.528)	(11.101)	Bristow Group Inc	Bank of America	
134.425	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(487.040)			Merrill Lynch	70.380
(813)	Boston Beer Co Inc/The 'A'	Morgan Stanley	(13.333)	(33.761)	Bristow Group Inc	Goldman Sachs	214.045
45.872	Boston Private Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.734)	134.002	Brixmor Property Group Inc (Reit)	Bank of America	
194.187	Boston Private Financial Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	197.491
40.180	Boston Properties Inc (Reit)	Merrill Lynch	53.401	(21.082)	Brixmor Property Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	(19.141)
37.760	Boston Properties Inc (Reit)	Bank of America		19.301	Broadcom Inc	Morgan Stanley	241.476
3.429	Boston Properties Inc (Reit)	Merrill Lynch	106.075	3.482	Broadcom Inc	Bank of America	
47.629	Bottomline Technologies de Inc	Goldman Sachs	65.020			Merrill Lynch	34.437
13.954	Box Inc 'A'	Merrill Lynch	9.053	33.587	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America	
34.375	Box Inc 'A'	Goldman Sachs	178.132	14.227	Brookdale Senior Living Inc	Merrill Lynch	37.617
		Bank of America	(33.350)	19.575	Brookdale Senior Living Inc	Goldman Sachs	6.616
		Merrill Lynch	(82.156)	92.996	Brookdale Senior Living Inc	Morgan Stanley	7.536
(3.773)	Boyd Gaming Corp	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.282)	(105.292)	Brookline Bancorp Inc	Merrill Lynch	43.243
5.236	Boyd Gaming Corp	Bank of America				Bank of America	(115.821)
		Merrill Lynch	7.470	(45.747)	Brooks Automation Inc	Bank of America	
23.269	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	33.408			Merrill Lynch	(88.712)
52.396	Brady Corp 'A'	Bank of America		(32.309)	Brooks Automation Inc	Morgan Stanley	(97.399)
		Merrill Lynch	115.271	1.146	Brown & Brown Inc	Bank of America	
(97.156)	Braemar Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	516
		Merrill Lynch	(86.469)	(5.825)	Brown & Brown Inc	Bank of America	
9.038	Brandywine Realty Trust (Reit)	Goldman Sachs	4.598			Merrill Lynch	(2.621)
105.623	Brandywine Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	46.474	140.387	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	(14.263)
176.649	Brandywine Realty Trust (Reit)	Bank of America		12.312	Brown-Forman Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	85.940			Merrill Lynch	12.222
(774)	Braskem SAADR	Morgan Stanley	759	7.616	Brown-Forman Corp	Goldman Sachs	7.921
(1.748)	Braskem SAADR	Goldman Sachs	2.657	18.545	Brown-Forman Corp 'B'	Bank of America	
(68.682)	BRF SAADR	Morgan Stanley	27.473			Merrill Lynch	(19.287)
(175.073)	BRF SAADR	Goldman Sachs	152.314	38.030	Brown-Forman Corp 'B'	Morgan Stanley	33.645
(64.258)	Bridge Bancorp Inc	Bank of America		10.280	Brown-Forman Corp 'B'	Goldman Sachs	(10.691)
		Merrill Lynch	(19.277)	8.259	Bruker Corp	Bank of America	
34.094	Bridgepoint Education Inc	Bank of America				Merrill Lynch	6.503
		Merrill Lynch	37.503	51.015	Bruker Corp	Morgan Stanley	(98.771)
44.105	Bridgepoint Education Inc	Goldman Sachs	48.516	2.610	Bruker Corp	Goldman Sachs	2.558
33.368	Bridgepoint Education Inc	Morgan Stanley	7.007	938	Brunswick Corp/DE	Goldman Sachs	982
13.422	Bridgewater Bancshares Inc	Morgan Stanley	(2.684)	7.092	Brunswick Corp/DE	Bank of America	
20.155	Bridgewater Bancshares Inc	Goldman Sachs	(3.873)			Merrill Lynch	20.070
68.226	Bridgewater Bancshares Inc	Bank of America		28.281	Brunswick Corp/DE	Morgan Stanley	28.402
		Merrill Lynch	(12.982)	(87.944)	Buckle Inc/The	Bank of America	
100.593	Briggs & Stratton Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(6.545)
		Merrill Lynch	15.089	(156.189)	Buckle Inc/The	Morgan Stanley	(39.047)
29.859	Briggs & Stratton Corp	Goldman Sachs	4.479	(6.586)	Build-A-Bear Workshop Inc	Bank of America	
43.647	Briggs & Stratton Corp	Morgan Stanley	(20.078)			Merrill Lynch	4.572
2.955	Bright Horizons Family Solutions Inc	Bank of America		40.881	Bunge Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	9.633			Merrill Lynch	(51.156)
3.029	Bright Horizons Family Solutions Inc	Goldman Sachs	9.875	5.868	Bunge Ltd	Morgan Stanley	(7.796)
2.404	Brightcove Inc	Bank of America		4.176	Bunge Ltd	Goldman Sachs	(3.931)
		Merrill Lynch	721	12.078	Burlington Stores Inc	Bank of America	
3.737	Brightcove Inc	Goldman Sachs	1.121			Merrill Lynch	102.658
2.700	Brightcove Inc	Morgan Stanley	1.080	1.243	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	10.491
(16.597)	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	80.750	34.661	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	411.913
(42.213)	Brighthouse Financial Inc	Bank of America		(33.789)	BWX Technologies Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	59.520			Merrill Lynch	22.196
118.708	BrightSphere Investment Group Plc	Bank of America		(28.972)	C&J Energy Services Inc	Morgan Stanley	60.262
		Merrill Lynch	(5.935)	(131.565)	CA Inc	Bank of America	
(75.289)	Brink's Co/The	Bank of America				Merrill Lynch	(23.335)
		Merrill Lynch	(361.827)	(1.317)	Cable One Inc	Bank of America	
2.315	Brinker International Inc	Bank of America				Merrill Lynch	23.021
		Merrill Lynch	787	857	Cabot Corp	Goldman Sachs	(643)
(2.470)	Brinker International Inc	Goldman Sachs	(840)	33.797	Cabot Corp	Morgan Stanley	31.093
3.442	Brinker International Inc	Morgan Stanley	1.471	19.609	Cabot Corp	Bank of America	
11.804	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs	8.145			Merrill Lynch	(14.707)
50.271	Bristol-Myers Squibb Co	Bank of America		28.770	Cabot Microelectronics Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	34.557			Merrill Lynch	75.953
1.215	Bristol-Myers Squibb Co	Morgan Stanley	790	10.197	Cabot Oil & Gas Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(2.855)
				2.681	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs	(751)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie	USD	Nombre	Description	Contrepartie	USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
651	CACI International Inc 'A'	Morgan Stanley	2.702	2.017	Cannae Holdings Inc	Bank of America	
2.944	CACI International Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	81
		Merrill Lynch	14.426	25.550	Cantel Medical Corp	Bank of America	
(1.530)	CACI International Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.817)			Merrill Lynch	(89.775)
(19.195)	CACI International Inc 'A'	Bank of America		5.327	Cantel Medical Corp	Morgan Stanley	(25.061)
		Merrill Lynch	(94.056)	8.335	Cantel Medical Corp	Goldman Sachs	(30.429)
1.959	CACI International Inc 'A'	Goldman Sachs	9.599	4.121	Capella Education Co	Goldman Sachs	29.259
30.417	Cactus Inc 'A'	Bank of America		770	Capella Education Co	Morgan Stanley	3.889
		Merrill Lynch	(33.155)	13.514	Capella Education Co	Bank of America	
25.214	Cactus Inc 'A'	Goldman Sachs	(28.867)			Merrill Lynch	95.949
8.939	Cactus Inc 'A'	Morgan Stanley	(26.370)	15.638	Capital City Bank Group Inc	Bank of America	
172.007	Cadence BanCorp	Bank of America				Merrill Lynch	(10.634)
		Merrill Lynch	(8.600)	1.888	Capital City Bank Group Inc	Goldman Sachs	(1.284)
3.914	Cadence BanCorp	Goldman Sachs	(196)	6.199	Capital City Bank Group Inc	Morgan Stanley	(5.703)
18.711	Cadence BanCorp	Morgan Stanley	3.368	32.682	Capital One Financial Corp	Bank of America	
(2.343)	Cadence BanCorp	Morgan Stanley	(426)			Merrill Lynch	(69.281)
35.903	Cadence Design Systems Inc	Bank of America		118.732	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	(62.466)
		Merrill Lynch	46.431	5.485	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs	(8.611)
10.105	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs	15.032	(53.039)	Capital Senior Living Corp	Bank of America	
(67.523)	Caesars Entertainment Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(15.381)
		Merrill Lynch	23.633	(8.278)	Capital Senior Living Corp	Goldman Sachs	(2.401)
(5.395)	CAI International Inc	Bank of America		(1.113)	Capstar Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.191)
		Merrill Lynch	2.874	(24.025)	Capstar Financial Holdings Inc	Bank of America	
(3.717)	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	(2.974)			Merrill Lynch	(25.707)
(1.162)	Cal-Maine Foods Inc	Morgan Stanley	(1.046)	(4.305)	Capstar Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.205)
21.827	Cal-Maine Foods Inc	Bank of America		(201.708)	Capstead Mortgage Corp (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	17.462			Merrill Lynch	(74.632)
7.863	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	6.290	(4.063)	Capstead Mortgage Corp (Reit)	Morgan Stanley	(366)
(106.697)	CalAmp Corp	Bank of America		(14.721)	Carbonite Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(76.822)			Merrill Lynch	(61.092)
233	Calavo Growers Inc	Bank of America		12.535	Cardinal Health Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(243)			Merrill Lynch	(19.148)
9.200	Calavo Growers Inc	Morgan Stanley	(37.542)	419	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs	(662)
18.025	Caleres Inc	Morgan Stanley	9.373	30.401	Cardinal Health Inc	Morgan Stanley	(78.416)
10.540	Caleres Inc	Bank of America		(6.205)	Cardtronics Plc 'A'	Morgan Stanley	22.867
		Merrill Lynch	6.017	(30.047)	Cardtronics Plc 'A'	Goldman Sachs	95.624
4.775	Caleres Inc	Goldman Sachs	2.499	16.095	Care.com Inc	Goldman Sachs	39.111
9.547	California Resources Corp	Morgan Stanley	(17.355)	27.791	Care.com Inc	Bank of America	
1.551	California Resources Corp	Bank of America				Merrill Lynch	67.532
		Merrill Lynch	(2.235)	8.857	Care.com Inc	Morgan Stanley	16.917
3.075	California Water Service Group	Bank of America		(97.435)	Career Education Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.836			Merrill Lynch	(136.409)
2.404	California Water Service Group	Morgan Stanley	3.956	208.407	CareTrust Inc (Reit)	Morgan Stanley	212.575
33.372	Calithera Biosciences Inc	Morgan Stanley	5.006	666.835	CareTrust Inc (Reit)	Bank of America	
53.895	Calithera Biosciences Inc	Bank of America				Merrill Lynch	1.000.252
		Merrill Lynch	(20.211)	20.346	CareTrust Inc (Reit)	Goldman Sachs	30.519
50.441	Calithera Biosciences Inc	Goldman Sachs	(18.915)	523	Carlisle Cos Inc	Goldman Sachs	1.757
(176.860)	Calix Inc	Bank of America		2.227	Carlisle Cos Inc	Morgan Stanley	1.743
		Merrill Lynch	(88.430)	(16.527)	CarMax Inc	Bank of America	
(9.953)	Calix Inc	Goldman Sachs	(4.977)			Merrill Lynch	(62.968)
17.360	Callaway Golf Co	Bank of America		(3.367)	CarMax Inc	Morgan Stanley	(20.487)
		Merrill Lynch	18.914	114.797	Carnival Corp	Bank of America	
(351.331)	Callon Petroleum Co	Bank of America				Merrill Lynch	(254.849)
		Merrill Lynch	600.776	594	Carnival Corp	Goldman Sachs	(1.319)
(543)	Cambrex Corp	Morgan Stanley	(61)	201.556	Carnival Corp	Morgan Stanley	(414.830)
(35.953)	Cambrex Corp	Bank of America		42.074	Carolina Financial Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	46.677			Merrill Lynch	136.587
57.962	Camden Property Trust (Reit)	Morgan Stanley	122.151	9.683	Carolina Financial Corp	Goldman Sachs	30.693
(75.350)	Campbell Soup Co	Bank of America		3.100	Carolina Financial Corp	Morgan Stanley	1.705
		Merrill Lynch	302.977	4.154	Carpenter Technology Corp	Bank of America	
(62.377)	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	251.482			Merrill Lynch	8.848
(13.131)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	69.857	7.785	Carpenter Technology Corp	Goldman Sachs	16.582
6.935	Camping World Holdings Inc 'A'	Bank of America		116.837	Carriage Services Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(19.973)			Merrill Lynch	(1.168)
5.393	Camping World Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(15.532)	14.792	Carriage Services Inc	Goldman Sachs	(148)
21.735	Camping World Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(61.293)	5.451	Carrizo Oil & Gas Inc	Bank of America	
				(3.575)	Carrizo Oil & Gas Inc	Merrill Lynch	(6.868)
819	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	1.228	58.613	Carrols Restaurant Group Inc	Morgan Stanley	4.969
						Bank of America	
						Merrill Lynch	48.356

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
13.755	Carrols Restaurant Group Inc	Goldman Sachs	11.348	15.161	Celldex Therapeutics Inc	Bank of America	
9.451	Carrols Restaurant Group Inc	Morgan Stanley	10.632			Merrill Lynch	(1.286)
2.991	Cars.com Inc	Bank of America		43.571	Celldex Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3.695)
		Merrill Lynch	4.277	32.922	Celldex Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1.452)
25.143	Cars.com Inc	Morgan Stanley	53.296	(4.125)	Cellular Biomedicine Group Inc	Bank of America	
(4.308)	Carter's Inc	Morgan Stanley	5.444			Merrill Lynch	3.713
(5.064)	Carter's Inc	Bank of America		221.167	Cemex SAB de CV ADR	Morgan Stanley	(250.397)
		Merrill Lynch	5.215	73.036	Cemex SAB de CV ADR	Goldman Sachs	6.938
(13.678)	Casa Systems Inc	Bank of America		(5.821)	Centene Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	20.654			Merrill Lynch	(30.502)
(6.796)	Casa Systems Inc	Morgan Stanley	6.456	(1.136)	Centene Corp	Morgan Stanley	(1.763)
(6.394)	Casella Waste Systems Inc 'A'	Bank of America		(1.946)	Centennial Resource Development Inc/DE 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.645			Merrill Lynch	2.666
(3.823)	Casey's General Stores Inc	Bank of America		(39.740)	Centennial Resource Development Inc/DE 'A'	Goldman Sachs	54.444
		Merrill Lynch	9.634			Goldman Sachs	—
(13.470)	Casey's General Stores Inc	Goldman Sachs	33.944	4.615	CenterPoint Energy Inc	Bank of America	
41.295	Casey's General Stores Inc	Morgan Stanley	(27.444)	130.733	CenterPoint Energy Inc	Bank of America	
(19.615)	Catalent Inc	Bank of America				Merrill Lynch	—
		Merrill Lynch	(3.903)	111.634	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	98.486
214.622	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America		70.959	Central European Media Enterprises Ltd 'A'	Morgan Stanley	(60.695)
		Merrill Lynch	(12.877)			Bank of America	
100.285	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(6.017)	195.694	Central European Media Enterprises Ltd 'A'	Merrill Lynch	(19.050)
83.276	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (Reit)			72.450	Central European Media Enterprises Ltd 'A'	Goldman Sachs	(7.245)
(24.073)	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	(15.822)	(1.302)	Central European Media Enterprises Ltd		
		Bank of America	(6.971)		(Wts 2/5/2018)*		—
(46.588)	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	(139.236)	732	Central Garden & Pet Co 'A'	Morgan Stanley	
95.085	Cathay General Bancorp	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	69.412			Merrill Lynch	666
13.755	Cathay General Bancorp	Morgan Stanley	(5.089)	740	Central Garden & Pet Co 'A'	Goldman Sachs	673
22.392	Cathay General Bancorp	Goldman Sachs	16.346	21.389	Central Garden & Pet Co 'A'	Morgan Stanley	1.073
91.957	Cato Corp/The 'A'	Bank of America		156.086	Central Pacific Financial Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	513.120			Merrill Lynch	6.243
(1.631)	Cavco Industries Inc	Morgan Stanley	(49.722)	118.937	Central Pacific Financial Corp	Morgan Stanley	(59.469)
1.042	Cavium Inc	Bank of America		(6.696)	Century Aluminum Co	Morgan Stanley	(8.058)
		Merrill Lynch	6.836	92.516	Century Casinos Inc	Bank of America	
(128.338)	CBIZ Inc	Bank of America				Merrill Lynch	21.279
		Merrill Lynch	(160.423)	32.781	Century Casinos Inc	Goldman Sachs	7.540
(494.729)	CBL & Associates Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	(499.676)	123.786	Century Casinos Inc	Morgan Stanley	59.417
(31.012)	Cboe Global Markets Inc	Bank of America		123.000	Century Communities Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	294.614			Merrill Lynch	79.950
(58.665)	Cboe Global Markets Inc	Morgan Stanley	301.517	4.127	Century Communities Inc	Morgan Stanley	(1.651)
(7.872)	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America		(113.699)	CenturyLink Inc	Morgan Stanley	115.973
		Merrill Lynch	(236)	(86.309)	CenturyLink Inc	Bank of America	
(28.555)	CBRE Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(533)			Merrill Lynch	93.565
2.393	CBS Corp 'B non-voting share'	Morgan Stanley	194	13.484	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	2.427
5.064	CBS Corp 'B non-voting share'	Goldman Sachs	(20.560)	52.661	Cerus Corp	Bank of America	
20.833	CBS Corp 'B non-voting share'	Bank of America				Merrill Lynch	17.905
		Merrill Lynch	(84.582)	51.826	Cerus Corp	Goldman Sachs	17.621
6.885	CDK Global Inc	Bank of America		11.617	Cerus Corp	Morgan Stanley	4.182
		Merrill Lynch	5.301	(13.424)	CEVA Inc	Bank of America	
633	CDK Global Inc	Morgan Stanley	872			Merrill Lynch	(847)
11.179	CDK Global Inc	Goldman Sachs	8.608	(23.322)	CF Industries Holdings Inc	Bank of America	
24.054	CDW Corp/DE	Bank of America				Merrill Lynch	10.728
		Merrill Lynch	59.491	(63.918)	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America	
43.463	CDW Corp/DE	Morgan Stanley	90.403			Merrill Lynch	(208.373)
198.938	CECO Environmental Corp	Bank of America		(19.856)	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	87.044
		Merrill Lynch	(55.703)	278	ChannelAdvisor Corp	Goldman Sachs	70
58.746	CECO Environmental Corp	Goldman Sachs	(16.449)	6.874	ChannelAdvisor Corp	Bank of America	
80.576	CECO Environmental Corp	Morgan Stanley	(23.367)			Merrill Lynch	1.719
15.941	Celanese Corp 'A'	Morgan Stanley	210.918	(3.928)	Charles River Laboratories International Inc	Bank of America	
24.333	Celanese Corp 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	(12.255)
		Merrill Lynch	164.004	3.875	Charles Schwab Corp/The	Bank of America	
360	Celanese Corp 'A'	Goldman Sachs	2.426			Merrill Lynch	(13.400)
641	Celgene Corp	Goldman Sachs	(2.493)	95.614	Charles Schwab Corp/The	Morgan Stanley	(258.070)
40.625	Celgene Corp	Bank of America		(12.774)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(110.861)			Merrill Lynch	60.293
625	Celgene Corp	Morgan Stanley	925	24.671	Charter Financial Corp/MD	Bank of America	
						Merrill Lynch	(1.727)

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

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
9.061	Charter Financial Corp/MD	Goldman Sachs	(634)	13.084	Chubb Ltd	Morgan Stanley	1.719
19.921	Charter Financial Corp/MD	Morgan Stanley	(13.347)	(18.227)	Chubb Ltd	Goldman Sachs	69.809
(8.687)	Chase Corp	Bank of America		148.613	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	25.217
		Merrill Lynch	(70.365)	53.312	Church & Dwight Co Inc	Bank of America	
49.863	Chatham Lodging Trust (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	30.452
		Merrill Lynch	76.290	8.923	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	4.997
1.989	Chatham Lodging Trust (Reit)	Goldman Sachs	3.043	(861)	Churchill Downs Inc	Bank of America	
13.792	Chatham Lodging Trust (Reit)	Morgan Stanley	8.275			Merrill Lynch	(1.450)
2.498	CHC Group Ltd*	Morgan Stanley	(1.124)	(2.247)	Churchill Downs Inc	Morgan Stanley	10.112
(4.887)	Check Point Software	Bank of America		13.900	Cia Brasileira de Distribuicao		
	Technologies Ltd	Merrill Lynch	(3.274)		ADR	Goldman Sachs	(2.224)
(51.262)	Check Point Software			34.974	Cia Cervecerias Unidas		
	Technologies Ltd	Morgan Stanley	(60.489)		SAADR	Goldman Sachs	(37.422)
6.096	Cheesecake Factory Inc/The	Goldman Sachs	1.402	32.426	Cia Cervecerias Unidas		
96.910	Cheesecake Factory Inc/The	Bank of America			SAADR	Morgan Stanley	(73.411)
		Merrill Lynch	23.555	(114.025)	Cia de Minas Buenaventura		
51.229	Cheesecake Factory Inc/The	Morgan Stanley	136.625		SAAADR	Goldman Sachs	11.693
(43.229)	Chegg Inc	Morgan Stanley	(96.833)	(332.919)	Cia Siderurgica Nacional		
13.389	Chemed Corp	Bank of America			SAADR	Morgan Stanley	153.143
		Merrill Lynch	(20.422)	(192.652)	Cia Siderurgica Nacional		
193	CHEMED Corp	Morgan Stanley	106		SAADR	Goldman Sachs	98.253
667	CHEMED Corp	Goldman Sachs	(342)	40.414	Cidara Therapeutics Inc	Bank of America	
15.842	Chemical Financial Corp	Morgan Stanley	(24.397)			Merrill Lynch	46.476
(112.508)	Chemical Financial Corp	Bank of America		94.811	Cidara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	109.033
		Merrill Lynch	(42.753)	3.054	Cidara Therapeutics Inc	Morgan Stanley	2.291
1.892	ChemoCentryx Inc	Goldman Sachs	1.183	49.138	Ciena Corp	Bank of America	
89.602	ChemoCentryx Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(53.045)
		Merrill Lynch	122.755	64.099	Ciena Corp	Morgan Stanley	(36.536)
16.635	ChemoCentryx Inc	Morgan Stanley	55.126	9.858	Ciena Corp	Goldman Sachs	(11.534)
15.022	Chemours Co/The	Morgan Stanley	(32.761)	342	Cigna Corp	Bank of America	
399	Chemours Co/The	Goldman Sachs	(76)			Merrill Lynch	(1.272)
5.510	Chemours Co/The	Bank of America		19.126	Cimarex Energy Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.075)			Merrill Lynch	(80.903)
(7.189)	Chemung Financial Corp	Morgan Stanley	(23.436)	8.169	Cimarex Energy Co	Goldman Sachs	(34.555)
(3.330)	Chemung Financial Corp	Bank of America		243	Cimarex Energy Co	Morgan Stanley	(1.256)
		Merrill Lynch	(16.028)	(6.634)	Cimpress NV	Bank of America	
(300)	Chemung Financial Corp	Goldman Sachs	(1.557)			Merrill Lynch	(4.445)
671	Cheniere Energy Inc	Morgan Stanley	3.402	(10.738)	Cimpress NV	Morgan Stanley	(44.500)
(18.029)	Cheniere Energy Partners			18.985	Cimpress NV	Bank of America	
	LP Holdings LLC	Morgan Stanley	(41.106)			Merrill Lynch	12.720
(71.749)	Cheniere Energy Partners			4.882	Cimpress NV	Goldman Sachs	3.271
	LP Holdings LLC	Goldman Sachs	(180.090)	1.247	Cimpress NV	Morgan Stanley	5.175
(15.541)	Chesapeake Energy Corp	Goldman Sachs	(11.733)	(103.401)	Cincinnati Bell Inc	Bank of America	
(114.783)	Chesapeake Energy Corp	Bank of America				Merrill Lynch	511.835
		Merrill Lynch	(9.757)	(10.623)	Cincinnati Financial Corp	Bank of America	
1.295	Chesapeake Utilities Corp	Bank of America				Merrill Lynch	20.396
		Merrill Lynch	3.216	12.615	Cinemark Holdings Inc	Bank of America	
1.059	Chesapeake Utilities Corp	Goldman Sachs	1.523			Merrill Lynch	(34.061)
337	Chesapeake Utilities Corp	Morgan Stanley	314	8.005	Cinemark Holdings Inc	Goldman Sachs	(21.614)
(14.243)	Chevron Corp	Bank of America		833	Cintas Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	82.467			Merrill Lynch	2.120
(9.154)	Chevron Corp	Morgan Stanley	(7.938)	3.751	Cintas Corp	Morgan Stanley	5.024
28.213	Chico's FAS Inc	Morgan Stanley	(46.834)	(9.326)	Cintas Corp	Bank of America	
80.622	Chico's FAS Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(3.917)
		Merrill Lynch	(169.306)	(283)	Cintas Corp	Goldman Sachs	(119)
63.490	Chico's FAS Inc	Goldman Sachs	(133.329)	15.650	CIRCOR International Inc	Bank of America	
(109.472)	Chimera Investment					Merrill Lynch	12.833
	Corp (Reit)	Morgan Stanley	(10.947)	7.955	CIRCOR International Inc	Goldman Sachs	6.523
(8.443)	China Biologic Products			5.065	CIRCOR International Inc	Morgan Stanley	(9.320)
	Holdings Inc	Morgan Stanley	(53.800)	133.650	Cirrus Logic Inc	Bank of America	
(1.066)	Chipotle Mexican Grill Inc	Morgan Stanley	(8.291)			Merrill Lynch	(72.171)
738	Chipotle Mexican Grill Inc	Bank of America		28.654	Cirrus Logic Inc	Goldman Sachs	(15.473)
		Merrill Lynch	7.653	15.585	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	(6.234)
76	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs	788	(5.312)	Cision Ltd	Goldman Sachs	(5.843)
(44.409)	Choice Hotels International Inc	Bank of America		(19.051)	Cision Ltd	Morgan Stanley	(11.812)
		Merrill Lynch	(77.716)	(12.348)	CIT Group Inc	Bank of America	
(85.064)	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	(106.371)			Merrill Lynch	44.453
(4.352)	Chubb Ltd	Bank of America		29.798	Citi Trends Inc	Morgan Stanley	(12.515)
		Merrill Lynch	16.668	31.224	Citi Trends Inc	Bank of America	
(2.569)	Chubb Ltd	Morgan Stanley	11.740			Merrill Lynch	9.367

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

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
9.573	Citi Trends Inc	Goldman Sachs	2.872	11.961	CoBiz Financial Inc	Morgan Stanley	4.784
64.826	Citigroup Inc	Bank of America		(12.796)	Coca-Cola Bottling Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	(433.038)		Consolidated	Merrill Lynch	(27.639)
103.521	Citigroup Inc	Morgan Stanley	(438.607)	5.537	Coca-Cola Bottling Co		
(70.923)	Citizens & Northern Corp	Bank of America			Consolidated	Morgan Stanley	4.097
		Merrill Lynch	(75.888)	(114.016)	Coca-Cola Co/The	Bank of America	
(79.059)	Citizens & Northern Corp	Morgan Stanley	(432.666)			Merrill Lynch	(89.467)
134.346	Citizens Financial Group Inc	Bank of America		(26.090)	Coca-Cola Co/The	Morgan Stanley	(12.001)
		Merrill Lynch	(267.532)	59.090	Coca-Cola European	Bank of America	
30.711	Citizens Financial Group Inc	Morgan Stanley	(52.209)		Partners Plc	Merrill Lynch	(10.045)
7.249	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs	(13.471)	9.267	Coca-Cola European		
(14.249)	Citrix Systems Inc	Bank of America			Partners Plc	Goldman Sachs	(1.575)
		Merrill Lynch	(5.767)	(1.397)	Coca-Cola Femsa SAB		
(23.051)	Citrix Systems Inc	Morgan Stanley	(43.520)		de CV ADR	Goldman Sachs	3.395
(22.750)	City Holding Co	Bank of America		(4.987)	Coca-Cola Femsa SAB		
		Merrill Lynch	(53.235)		de CV ADR	Morgan Stanley	6.591
(24.450)	Civeo Corp	Bank of America		109.059	Cogent Communications	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.095)		Holdings Inc	Merrill Lynch	109.059
10.587	Civista Bancshares Inc	Bank of America		14.624	Cogent Communications		
		Merrill Lynch	7.004		Holdings Inc	Goldman Sachs	14.624
1.104	Civista Bancshares Inc	Goldman Sachs	201	(15.342)	Cognex Corp	Bank of America	
5.114	Civista Bancshares Inc	Morgan Stanley	126			Merrill Lynch	18.104
3.514	Civitas Solutions Inc	Morgan Stanley	1.406	(6.694)	Cognex Corp	Morgan Stanley	16.005
31.111	Clarus Corp	Bank of America		(12.639)	Cognizant Technology	Bank of America	
		Merrill Lynch	6.222		Solutions Corp 'A'	Merrill Lynch	(7.331)
32.643	Clarus Corp	Goldman Sachs	6.529	(19.928)	Cohbar Inc	Morgan Stanley	(2.391)
33.329	Clarus Corp	Morgan Stanley	(1.666)	(1.925)	Cohen & Steers Inc	Bank of America	
(6.057)	Clean Harbors Inc	Bank of America				Merrill Lynch	96
		Merrill Lynch	(10.600)	(6.635)	Coherent Inc	Morgan Stanley	15.120
(22.750)	Clean Harbors Inc	Morgan Stanley	(27.755)	(7.611)	Coherent Inc	Bank of America	
23.620	Clear Channel Outdoor	Bank of America				Merrill Lynch	35.380
	Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	(9.448)	41.967	Cohu Inc	Bank of America	
(73.973)	Clear Channel Outdoor	Bank of America				Merrill Lynch	53.298
	Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	29.589	3.779	Cohu Inc	Morgan Stanley	1.096
(20.147)	Clear Channel Outdoor			2.211	Cohu Inc	Goldman Sachs	2.808
	Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	4.029	(11.271)	Colfax Corp	Morgan Stanley	9.130
(23.202)	Clearfield Inc	Bank of America		(24.051)	Colfax Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	16.241			Merrill Lynch	6.975
(51.663)	Clearfield Inc	Morgan Stanley	12.916	11.011	Colgate-Palmolive Co	Bank of America	
(3.566)	Clearfield Inc	Goldman Sachs	2.496			Merrill Lynch	21.141
(7.346)	Clearwater Paper Corp	Bank of America		(59.882)	Collectors Universe Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	8.448			Merrill Lynch	49.702
36.101	Clorox Co/The	Morgan Stanley	187.899	(10.378)	Collegium Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	23.247
3.160	Clorox Co/The	Bank of America		(6.791)	Colony NorthStar Inc 'A' (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	13.322			Merrill Lynch	645
11.028	Cloudera Inc	Bank of America		(54.496)	Colony NorthStar Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	15.898
		Merrill Lynch	6.617	(192.116)	Columbia Banking System Inc	Bank of America	
1.979	Cloudera Inc	Goldman Sachs	1.187			Merrill Lynch	(39.719)
11.722	Clovis Oncology Inc	Bank of America		(26.339)	Columbia Banking System Inc	Morgan Stanley	9.409
		Merrill Lynch	(33.642)	(18.803)	Columbia Property Trust	Bank of America	
16.669	Clovis Oncology Inc	Goldman Sachs	(44.132)		Inc (Reit)	Merrill Lynch	(2.498)
5.786	Clovis Oncology Inc	Morgan Stanley	(10.263)	(2.178)	Columbia Property Trust		
135.090	CMS Energy Corp	Bank of America			Inc (Reit)	Morgan Stanley	(784)
		Merrill Lynch	189.126	(658)	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	129
9.927	CNA Financial Corp	Bank of America		19.244	Comcast Corp 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(15.530)			Merrill Lynch	(18.859)
3.246	CNA Financial Corp	Goldman Sachs	(6.395)	23.456	Comcast Corp 'A'	Morgan Stanley	(19.110)
58.107	CNA Financial Corp	Morgan Stanley	(111.903)	69.645	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	(68.252)
(38.421)	CNB Financial Corp/PA	Bank of America		24.422	Comerica Inc	Morgan Stanley	(147.509)
		Merrill Lynch	(44.376)	(1.065)	Comerica Inc	Bank of America	
(14.685)	CNB Financial Corp/PA	Morgan Stanley	1.395			Merrill Lynch	4.398
(309.349)	CNH Industrial NV	Morgan Stanley	355.751	54.044	Comfort Systems USA Inc	Bank of America	
13.604	CNO Financial Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	147.125
		Merrill Lynch	(1.632)	13.403	Comfort Systems USA Inc	Goldman Sachs	35.539
(42.912)	CNX Resources Corp	Bank of America		58.766	Comfort Systems USA Inc	Morgan Stanley	94.026
		Merrill Lynch	(2.369)	(34.938)	Commerce Bancshares Inc/MO	Bank of America	
(46.900)	CNX Resources Corp	Morgan Stanley	235			Merrill Lynch	13.276
134.306	CoBiz Financial Inc	Bank of America		(50.504)	Commercial Metals Co	Morgan Stanley	(18.686)
		Merrill Lynch	146.394				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(142.476)	Commercial Metals Co	Bank of America Merrill Lynch	(150.597)	41.521	Constellation Brands Inc 'A'	Morgan Stanley	(70.989)
(116.761)	CommScope Holding Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.348	491	Constellation Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	2.343
(189.623)	CommScope Holding Co Inc	Morgan Stanley	56.887	5.775	Constellium NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3.465
(4.878)	Community Bank System Inc	Morgan Stanley	38	184.644	Constellium NV 'A'	Morgan Stanley	—
(9.088)	Community Health Systems Inc (Right)	Goldman Sachs	20	32.183	Consumer Portfolio Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.218
(133.364)	Community Healthcare Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(241.088)	7.210	Consumer Portfolio Services Inc	Goldman Sachs	721
(47.924)	CommVault Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.566)	211.273	Consumer Portfolio Services Inc	Morgan Stanley	2.113
(1.354)	CommVault Systems Inc	Morgan Stanley	(1.219)	39.645	Continental Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	39.645
(17.117)	Compass Minerals International Inc	Goldman Sachs	55.630	14.636	Continental Resources Inc/OK	Bank of America Merrill Lynch	(3.768)
(14.939)	Compass Minerals International Inc	Morgan Stanley	14.192	19.140	Continental Resources Inc/OK	Morgan Stanley	33.818
288	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs	(92)	(17.560)	Convergys Corp	Bank of America Merrill Lynch	15.728
11.696	Conagra Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.743)	(4.535)	Cooper Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	10.570
57.990	Conagra Brands Inc	Morgan Stanley	4.336	(38.445)	Cooper Tire & Rubber Co	Bank of America Merrill Lynch	(11.534)
112.866	Conatus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	27.484	(674)	Cooper Tire & Rubber Co	Goldman Sachs	(202)
105.157	Conatus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	26.735	(17.362)	Cooper-Standard Holdings Inc	Morgan Stanley	113.584
41.380	Conatus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	8.795	(1.648)	Copa Holdings SA 'A'	Goldman Sachs	5.933
(13.322)	Concert Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.528)	(2.278)	Copa Holdings SA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	8.201
464	Concho Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.535)	(963)	Copa Holdings SA 'A'	Morgan Stanley	3.293
17.187	Concho Resources Inc	Morgan Stanley	(146.759)	(48.228)	Copart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26.525)
(32.852)	Conduent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.197)	6.531	Copart Inc	Morgan Stanley	19.201
(45.847)	Conduent Inc	Morgan Stanley	7.565	52.216	Corcept Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	43.339
15.612	CONMED Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.270	30.800	Corcept Therapeutics Inc	Goldman Sachs	25.564
5.483	CONMED Corp	Goldman Sachs	4.661	(7.433)	Corcept Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1.086)
2.181	CONMED Corp	Morgan Stanley	632	(1.682)	Core Laboratories NV	Morgan Stanley	3.835
(12.581)	CONMED Corp	Morgan Stanley	(3.648)	(7.241)	Core Laboratories NV	Bank of America Merrill Lynch	(5.358)
(67.989)	Conn's Inc	Goldman Sachs	98.584	26.788	Core-Mark Holding Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	15.228
(908)	Conn's Inc	Morgan Stanley	(45)	8.530	Core-Mark Holding Co Inc	Goldman Sachs	3.311
(23.104)	Conn's Inc	Bank of America Merrill Lynch	33.501	55.961	Core-Mark Holding Co Inc	Morgan Stanley	39.173
(392)	Connecticut Water Service Inc	Morgan Stanley	(721)	2.602	CoreCivic Inc (Reit)	Morgan Stanley	1.691
(101.183)	Connecticut Water Service Inc	Bank of America Merrill Lynch	(94.100)	15.427	CoreCivic Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	16.353
(252.586)	ConnectOne Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(126.293)	(65.589)	CoreLogic Inc/United States	Bank of America Merrill Lynch	(101.663)
(34.533)	ConnectOne Bancorp Inc	Morgan Stanley	17.267	(27.160)	CoreLogic Inc/United States	Morgan Stanley	(196.942)
46.729	ConocoPhillips	Bank of America Merrill Lynch	(122.430)	13.487	CoreSite Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	22.928
5.012	Consol Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.002	41.151	CoreSite Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	201.640
4.017	Consolidated Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	522	2.362	CoreSite Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	4.015
77.756	Consolidated Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.906	(40.955)	Corindus Vascular Robotics Inc	Morgan Stanley	950
51.068	Consolidated Communications Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.228)	(1.385)	Corium International Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.981
15.341	Consolidated Edison Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.870)	(6.166)	Corium International Inc	Goldman Sachs	8.817
9.551	Consolidated Edison Inc	Morgan Stanley	(563)	33.307	Cornerstone OnDemand Inc	Bank of America Merrill Lynch	111.578
10.236	Consolidated Water Co Ltd	Morgan Stanley	2.032	6.767	Cornerstone OnDemand Inc	Morgan Stanley	21.200
8.262	Consolidated Water Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.002	(162.563)	Corning Inc	Morgan Stanley	50.395
9.227	Consolidated Water Co Ltd	Goldman Sachs	1.074	2.252	Corporate Office Properties Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	2.139
(7.625)	Consolidated-Tomoka Land Co	Bank of America Merrill Lynch	12.731	50.843	Corvus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	181.510
(13.263)	Consolidated-Tomoka Land Co	Morgan Stanley	16.711	19.456	Corvus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	69.458
(19.885)	Consolidated-Tomoka Land Co	Goldman Sachs	34.401	9.862	Corvus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	20.118
7.811	Constellation Brands Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4.690	134.581	Cosan Ltd 'A'	Goldman Sachs	(123.815)
				493.587	Cosan Ltd 'A'	Morgan Stanley	(567.625)
				(583)	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.953

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
77	CoStar Group Inc	Bank of America		(82.296)	CTI BioPharma Corp	Goldman Sachs	(32.095)
		Merrill Lynch	626	(42.866)	CTI BioPharma Corp	Morgan Stanley	9.859
1.146	CoStar Group Inc	Morgan Stanley	8.194	(103.736)	CTS Corp	Bank of America	
988	Costco Wholesale Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(191.912)
		Merrill Lynch	3.310	6.594	CubeSmart (Reit)	Morgan Stanley	6.066
1.997	Cotiviti Holdings Inc	Bank of America		44.459	CubeSmart (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.118			Merrill Lynch	28.813
2.099	Cotiviti Holdings Inc	Morgan Stanley	2.470	432	CubeSmart (Reit)	Goldman Sachs	276
831	Cotiviti Holdings Inc	Goldman Sachs	952	(13.350)	Cubic Corp	Morgan Stanley	7.343
(66.743)	Coty Inc 'A'	Bank of America		(23.978)	Cubic Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	50.166			Merrill Lynch	(12.942)
(410)	County Bancorp Inc	Goldman Sachs	45	18.527	Cullen/Frost Bankers Inc	Morgan Stanley	(78.369)
(20.505)	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	(45.316)	3.216	Cullen/Frost Bankers Inc	Bank of America	
109.281	Cousins Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	56.280			Merrill Lynch	(10.561)
76.569	Cousins Properties Inc (Reit)	Bank of America		19.963	Culp Inc	Morgan Stanley	11.978
		Merrill Lynch	37.136	13.894	Culp Inc	Bank of America	
		Goldman Sachs	3.972			Merrill Lynch	20.146
8.189	Cousins Properties Inc (Reit)	Bank of America		17.950	Cumberland		
(217.709)	Covanta Holding Corp	Merrill Lynch	(201.381)		Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(696)
(26.139)	Covanta Holding Corp	Morgan Stanley	(24.179)	12.033	Cummins Inc	Bank of America	
(153.953)	Covanta Holding Corp	Goldman Sachs	(142.407)			Merrill Lynch	(20.817)
7.112	Covenant Transportation	Bank of America		1.093	Cummins Inc	Goldman Sachs	(1.891)
	Group Inc 'A'	Merrill Lynch	569	15.930	Curis Inc	Bank of America	
1.678	Covenant Transportation					Merrill Lynch	(5.791)
	Group Inc 'A'	Goldman Sachs	134	14.577	Curis Inc	Goldman Sachs	(5.298)
1.602	Covenant Transportation			19.594	Curis Inc	Morgan Stanley	(4.084)
	Group Inc 'A'	Morgan Stanley	336	24.130	Curo Group Holdings Corp	Bank of America	
(50.869)	Cowen Inc	Goldman Sachs	39.423			Merrill Lynch	685
(66.136)	Cowen Inc	Morgan Stanley	44.642	7.248	Curo Group Holdings Corp	Goldman Sachs	161
55.479	CRA International Inc	Bank of America		65.522	Curtiss-Wright Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(18.308)			Merrill Lynch	(66.177)
6.456	CRA International Inc	Goldman Sachs	(2.130)	1.428	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	(1.015)
1.827	CRA International Inc	Morgan Stanley	201	2.649	Curtiss-Wright Corp	Goldman Sachs	(2.215)
(611)	Cracker Barrel Old Country			(6.506)	Customers Bancorp Inc	Bank of America	
	Store Inc	Goldman Sachs	(2.059)			Merrill Lynch	(7.026)
(35.420)	Cracker Barrel Old Country			(25.337)	Customers Bancorp Inc	Morgan Stanley	(16.976)
	Store Inc	Morgan Stanley	(79.341)	4.575	CVB Financial Corp	Morgan Stanley	(760)
(45.073)	Craft Brew Alliance Inc	Bank of America		(23.969)	CVR Energy Inc	Morgan Stanley	77.002
		Merrill Lynch	(49.580)	(12.884)	CVS Health Corp	Morgan Stanley	11.219
812	Crane Co	Goldman Sachs	(690)	(8.478)	CVS Health Corp	Goldman Sachs	8.817
24.548	Crane Co	Bank of America		(2.603)	CyberArk Software Ltd	Morgan Stanley	(4.921)
		Merrill Lynch	(21.475)	(10.288)	CyberOptics Corp	Bank of America	
30.136	Crane Co	Morgan Stanley	(21.134)			Merrill Lynch	1.029
(8.531)	Cray Inc	Morgan Stanley	4.596	(23.899)	CyberOptics Corp	Morgan Stanley	-
978	Credicorp Ltd	Goldman Sachs	(4.661)	(3.794)	CyberOptics Corp	Goldman Sachs	379
6.819	Credicorp Ltd	Morgan Stanley	(3.205)	(52.875)	Cymabay Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(78.255)
(3.103)	Credit Acceptance Corp	Bank of America		(65.561)	Cypress Semiconductor Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(21.628)			Merrill Lynch	(25.241)
(13.919)	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs	(97.015)	(2.167)	Cypress Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(704)
(22.708)	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	(492.851)	13.178	CyrusOne Inc (Reit)	Bank of America	
(72.974)	Cree Inc	Bank of America				Merrill Lynch	22.016
		Merrill Lynch	(275.842)	636	CyrusOne Inc (Reit)	Morgan Stanley	(245)
(58.239)	Cree Inc	Morgan Stanley	(125.214)	30.964	Dana Inc	Goldman Sachs	(42.111)
11.486	Crocs Inc	Bank of America		136.033	Dana Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	25.958			Merrill Lynch	(185.456)
(57.827)	Cross Country Healthcare Inc	Bank of America		87.529	Dana Inc	Morgan Stanley	(138.296)
		Merrill Lynch	(24.287)	20.071	Danaher Corp	Morgan Stanley	(5.988)
(45.576)	Crown Castle International	Bank of America		61.557	Danaher Corp	Bank of America	
	Corp (Reit)	Merrill Lynch	(18.230)			Merrill Lynch	36.816
27.283	Crown Holdings Inc	Bank of America		669	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs	749
		Merrill Lynch	1.364	20.588	Darden Restaurants Inc	Bank of America	
(174.148)	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	874.659			Merrill Lynch	23.059
(67.660)	CryoLife Inc	Bank of America		54.011	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	20.821
		Merrill Lynch	(118.405)	(45.761)	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	(13.986)
(5.210)	CryoLife Inc	Morgan Stanley	(4.689)	(8.148)	Darling Ingredients Inc	Bank of America	
(12.444)	CSW Industrials Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(5.530)
		Merrill Lynch	(44.176)	(4.353)	DaVita Inc	Morgan Stanley	(974)
(26.502)	CSX Corp	Bank of America		1.264	DaVita Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(73.146)			Merrill Lynch	2.124
(39.168)	CTI BioPharma Corp	Bank of America		1.858	DaVita Inc	Goldman Sachs	3.121
		Merrill Lynch	(15.276)	534	DaVita Inc	Morgan Stanley	27

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
179.654	Dawson Geophysical Co	Morgan Stanley	274.785	(187.181)	Diebold Nixdorf Inc	Bank of America	
32.613	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	107.629
		Merrill Lynch	21.851	(115.810)	Diebold Nixdorf Inc	Goldman Sachs	66.591
20.264	DDR Corp	Morgan Stanley	3.327	(424)	Digimarc Corp	Bank of America	
22.289	Dean Foods Co	Bank of America				Merrill Lynch	(191)
		Merrill Lynch	(9.138)	(32.437)	Digimarc Corp	Goldman Sachs	(22.527)
(2.842)	Dean Foods Co	Morgan Stanley	625	(24.136)	Digimarc Corp	Morgan Stanley	(20.516)
(821)	Deckers Outdoor Corp	Bank of America		3.735	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.956)			Merrill Lynch	523
4.598	Deckers Outdoor Corp	Morgan Stanley	40.348	214	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	220
31.027	Deckers Outdoor Corp	Bank of America		18.915	Dillard's Inc 'A'	Goldman Sachs	171.937
		Merrill Lynch	382.253	13.235	Dillard's Inc 'A'	Morgan Stanley	98.865
(9.634)	Deere & Co	Bank of America		51.543	Dillard's Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(60.502)			Merrill Lynch	416.715
(16.758)	Deere & Co	Morgan Stanley	64.777	(90.946)	Dime Community Bancshares Inc	Bank of America	
182.664	Del Taco Restaurants Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(90.946)
		Merrill Lynch	115.078	(2.350)	Dine Brands Global Inc	Morgan Stanley	7.802
20.116	Del Taco Restaurants Inc	Morgan Stanley	14.282	994	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs	(3.471)
73.395	Del Taco Restaurants Inc	Goldman Sachs	46.239	1.827	Dine Brands Global Inc	Bank of America	
(17.307)	Delek US Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(10.974)
		Merrill Lynch	(128.245)	1.911	Dine Brands Global Inc	Morgan Stanley	(5.631)
1.218	Dell Technologies Inc 'V'	Morgan Stanley	200	23.948	Diodes Inc	Bank of America	
11.874	Delphi Technologies Plc	Bank of America				Merrill Lynch	29.935
		Merrill Lynch	(7.124)	19.525	Diodes Inc	Goldman Sachs	24.406
1.872	Delphi Technologies Plc	Goldman Sachs	(1.123)	44.451	Diodes Inc	Morgan Stanley	32.005
350	Delphi Technologies Plc	Morgan Stanley	(1.085)	(9.444)	Diplomat Pharmacy Inc	Morgan Stanley	2.246
(17.620)	Delphi Technologies Plc	Morgan Stanley	25.573	1.902	Diplomat Pharmacy Inc	Bank of America	
(103.847)	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	(28.977)			Merrill Lynch	(1.132)
6.627	Delta Air Lines Inc	Bank of America		1.028	Discover Financial Services	Bank of America	
		Merrill Lynch	11.995			Merrill Lynch	(2.457)
2.618	Deluxe Corp	Goldman Sachs	(11.912)	335	Discover Financial Services	Morgan Stanley	(1.441)
68.070	Deluxe Corp	Bank of America		(5.366)	Discovery Inc 'A'	Goldman Sachs	10.893
		Merrill Lynch	(201.602)	(36.093)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America	
14.035	Deluxe Corp	Morgan Stanley	(27.901)			Merrill Lynch	108.556
(7.344)	DENTSPLY SIRONA Inc	Morgan Stanley	(805)	(37.337)	DISH Network Corp 'A'	Morgan Stanley	113.131
(22.587)	Depomed Inc	Bank of America		(33.190)	DMC Global Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	20.780			Merrill Lynch	(104.549)
236.420	Dermira Inc	Bank of America		(40.174)	DMC Global Inc	Morgan Stanley	(50.218)
		Merrill Lynch	(527.217)	(529)	DocuSign Inc	Bank of America	
9.606	Dermira Inc	Morgan Stanley	(11.527)			Merrill Lynch	(2.185)
29.900	Dermira Inc	Goldman Sachs	(66.677)	(1.488)	DocuSign Inc	Morgan Stanley	(5.668)
1.619	Despegar.com Corp	Bank of America		28.327	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.768)			Merrill Lynch	(1.416)
43.333	Despegar.com Corp	Morgan Stanley	(40.079)	14.705	Dollar General Corp	Bank of America	
(11.634)	Deutsche Bank AG	Bank of America				Merrill Lynch	(84.683)
		Merrill Lynch	29.318	12.492	Dollar General Corp	Morgan Stanley	(82.811)
(173.799)	Deutsche Bank AG	Morgan Stanley	372.525	2.028	Dollar General Corp	Goldman Sachs	(10.383)
893	Devon Energy Corp	Morgan Stanley	(63)	(27.392)	Dollar Tree Inc	Bank of America	
28.618	Devon Energy Corp	Bank of America				Merrill Lynch	301.860
		Merrill Lynch	12.878	(26.515)	Dollar Tree Inc	Morgan Stanley	270.958
10.106	Devon Energy Corp	Goldman Sachs	4.548	13.977	Dominion Energy Inc	Bank of America	
(4.193)	DexCom Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(14.117)
		Merrill Lynch	(3.816)	8.505	Domino's Pizza Inc	Bank of America	
(252)	DexCom Inc	Morgan Stanley	(474)			Merrill Lynch	26.280
25.737	DHI Group Inc	Bank of America		3.130	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	6.197
		Merrill Lynch	18.016	770	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs	2.379
12.266	DHI Group Inc	Goldman Sachs	8.586	(21.889)	Domtar Corp	Morgan Stanley	(82.237)
8.243	DHI Group Inc	Morgan Stanley	4.946	5.764	Domtar Corp	Bank of America	
(26.059)	Diamondback Energy Inc	Bank of America				Merrill Lynch	5.556
		Merrill Lynch	182.413	2.580	Domtar Corp	Goldman Sachs	6.373
67.805	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Morgan Stanley	37.632	38.669	Donegal Group Inc 'A'	Bank of America	
46.375	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Goldman Sachs	57.273			Merrill Lynch	4.640
416.336	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Bank of America		9.331	Donegal Group Inc 'A'	Morgan Stanley	933
		Merrill Lynch	514.175	4.903	Donnelley Financial Solutions Inc	Goldman Sachs	(5.687)
(33.331)	Dicerna Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(30.331)	(19.377)	Dorman Products Inc	Morgan Stanley	70.303
5.809	Dick's Sporting Goods Inc	Bank of America		(49.027)	Dorman Products Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	41.373			Merrill Lynch	18.630
14.148	Dick's Sporting Goods Inc	Morgan Stanley	93.449	(6.995)	Dorman Products Inc	Goldman Sachs	2.658

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
572	Douglas Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	687	(10.649)	Eastern Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(9.584)
412	Douglas Dynamics Inc	Morgan Stanley	433	(874)	Eastern Co/The	Goldman Sachs	(787)
8.922	Douglas Emmett Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	9.011	109.332	EastGroup Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	318.307
(130.197)	DowDuPont Inc	Morgan Stanley	403.611	2.943	EastGroup Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	10.065
(170.792)	DowDuPont Inc	Bank of America Merrill Lynch	474.802	11.372	EastGroup Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	32.638
5.432	DR Horton Inc	Goldman Sachs	9.995	6.072	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs	(16.334)
121.537	DR Horton Inc	Bank of America Merrill Lynch	221.695	33.295	Eastman Chemical Co	Bank of America Merrill Lynch	(89.564)
17.676	DR Horton Inc	Morgan Stanley	(6.867)	14.496	Eaton Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	11.887
(2.920)	Dream Office Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	19.507	(14.894)	Eaton Vance Corp	Bank of America Merrill Lynch	35.746
(7.482)	Dril-Quip Inc	Morgan Stanley	(6.403)	12.458	eBay Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.852)
4.094	Dril-Quip Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.165	(1.064)	Ebix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.286)
(8.014)	DSP Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(585)	(53.458)	Ebix Inc	Morgan Stanley	32.402
(51.538)	DSW Inc 'A'	Morgan Stanley	87.615	2.957	EBIX Inc	Morgan Stanley	2.311
(116.172)	DSW Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	83.644	10.905	Echo Global Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.382
47.295	DTE Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	27.431	6.589	Echo Global Logistics Inc	Goldman Sachs	446
2.469	DTE Energy Co	Goldman Sachs	1.432	2.966	Echo Global Logistics Inc	Morgan Stanley	37
702	Ducommun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(729)	(28.036)	EchoStar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	104.855
755	Ducommun Inc	Goldman Sachs	(364)	(16.536)	EchoStar Corp 'A'	Morgan Stanley	113.029
(62.287)	Duke Energy Corp	Morgan Stanley	73.129	123.234	Eclipse Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.243
8.881	Duke Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1.332	90.527	Eclipse Resources Corp	Morgan Stanley	(1.358)
57.388	Duke Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	35.581	64.367	Eclipse Resources Corp	Goldman Sachs	4.828
(40.541)	Duluth Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	(12.162)	2.339	Ecolab Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.298)
(41.897)	Duluth Holdings Inc 'B'	Morgan Stanley	(12.150)	7.712	Ecolab Inc	Morgan Stanley	(11.713)
5.338	Dun & Bradstreet Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	2.829	(16.635)	Edgewell Personal Care Co	Bank of America Merrill Lynch	(579)
1.530	Dun & Bradstreet Corp/The	Goldman Sachs	811	(78.919)	Edgewell Personal Care Co	Morgan Stanley	(6.871)
13.416	Dun & Bradstreet Corp/The	Morgan Stanley	98.514	(88.953)	Edison International	Bank of America Merrill Lynch	(30.273)
(10.489)	Dunkin' Brands Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.028	(74.090)	Edison International	Morgan Stanley	102.902
(1.565)	Dunkin' Brands Group Inc	Goldman Sachs	(20)	(206.083)	Education Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(548.181)
199.160	Durect Corp	Bank of America Merrill Lynch	21.908	(17.666)	Education Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(54.588)
154.580	Durect Corp	Goldman Sachs	17.004	14.839	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	39.620
125.351	Durect Corp	Morgan Stanley	10.028	16.165	eGain Corp	Bank of America Merrill Lynch	36.371
(10.926)	DXC Technology Co	Bank of America Merrill Lynch	91.014	1.743	eGain Corp	Morgan Stanley	4.488
(17.558)	Dycom Industries Inc	Morgan Stanley	(43.544)	(66.767)	eHealth Inc	Bank of America Merrill Lynch	(149.558)
(96.063)	Dycom Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.585.487	(7.414)	eHealth Inc	Morgan Stanley	(3.410)
(34.058)	Dynavax Technologies Corp	Morgan Stanley	23.841	13.103	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(655)
(972)	Dynavax Technologies Corp	Goldman Sachs	2.916	15.903	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	42.938
(44.162)	E*TRADE Financial Corp	Morgan Stanley	90.532	4.762	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	12.857
(30.384)	E*TRADE Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	17.533	(16.772)	El Paso Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(16.339)
19.225	Eagle Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	16.341	3.712	El Paso Electric Co	Morgan Stanley	9.094
(12.172)	Eagle Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.290)	91.934	El Pollo Loco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	50.564
(20.773)	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	Bank of America Merrill Lynch	(17.242)	36.602	El Pollo Loco Holdings Inc	Goldman Sachs	20.131
(2.480)	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	Morgan Stanley	(744)	29.148	El Pollo Loco Holdings Inc	Morgan Stanley	7.287
(64.293)	East West Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	45.950	897	Eldorado Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.797
330.681	Easterly Government Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	52.909	3.262	Eldorado Resorts Inc	Morgan Stanley	1.020
57.302	Easterly Government Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	9.168	(7.421)	Eldorado Resorts Inc	Goldman Sachs	(20.435)
22.641	Easterly Government Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	7.245	13.265	Electronic Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.848
				324	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	(159)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
1.468	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs	2.319	5.396	EnerSys	Bank of America	
739	Electronics For Imaging Inc	Bank of America				Merrill Lynch	36.315
		Merrill Lynch	429	(14.971)	EnerSys	Bank of America	
2.958	Electronics For Imaging Inc	Goldman Sachs	1.716			Merrill Lynch	(100.755)
(33.090)	Electronics For Imaging Inc	Morgan Stanley	7.942	111.817	Enova International Inc	Bank of America	
3.195	Elevate Credit Inc	Goldman Sachs	(3.131)			Merrill Lynch	(128.590)
(15.296)	elf Beauty Inc	Bank of America		19.959	Enova International Inc	Goldman Sachs	(22.953)
		Merrill Lynch	15.143	34.392	Enova International Inc	Morgan Stanley	(46.429)
2.790	elf Beauty Inc	Morgan Stanley	(2.874)	2.990	EnPro Industries Inc	Morgan Stanley	1.475
1.176	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs	2.564	(38.492)	Ensco Plc 'A'	Morgan Stanley	30.409
1.354	Eli Lilly & Co	Bank of America		(42.479)	Ensco Plc 'A'	Goldman Sachs	20.815
		Merrill Lynch	2.952	6.189	Ensign Group Inc/The	Morgan Stanley	10.893
(54.783)	Ellie Mae Inc	Bank of America		12.075	Ensign Group Inc/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	(342.394)			Merrill Lynch	39.168
(17.241)	Ellie Mae Inc	Morgan Stanley	(201.773)	4.563	Ensign Group Inc/The	Goldman Sachs	16.199
(40.004)	Ellington Residential			(14.269)	Enstar Group Ltd	Morgan Stanley	116.115
	Mortgage (Reit)	Morgan Stanley	(12.401)	(18.092)	Enstar Group Ltd	Goldman Sachs	91.365
(189.537)	Ellington Residential	Bank of America		120.547	Entegris Inc	Bank of America	
	Mortgage (Reit)	Merrill Lynch	(77.710)			Merrill Lynch	(18.082)
(1.500)	Ellington Residential			(26.310)	Entegris Inc	Bank of America	
	Mortgage (Reit)	Goldman Sachs	(615)			Merrill Lynch	3.947
(12.367)	Embraer SA ADR	Goldman Sachs	11.920	(57.858)	Entergy Corp	Bank of America	
2.054	EMCOR Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(97.834)
		Merrill Lynch	4.108	(47.498)	Enterprise Financial Services	Bank of America	
(334)	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	239		Corp	Merrill Lynch	(54.623)
(6.347)	EMCORE Corp	Bank of America		6.516	Entravision Communications		
		Merrill Lynch	(3.174)		Corp 'A'	Goldman Sachs	–
(29.421)	Emergent BioSolutions Inc	Bank of America		491.662	Entravision Communications	Bank of America	
		Merrill Lynch	(55.505)		Corp 'A'	Merrill Lynch	–
150.483	Emergent Capital Inc	Morgan Stanley	(9.330)	4.215	Envestnet Inc	Bank of America	
74.445	Emergent Capital Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.464)
		Merrill Lynch	(5.360)	1.325	Envestnet Inc	Goldman Sachs	(227)
(54.928)	Emerson Electric Co	Bank of America		(7.725)	Envision Healthcare Corp	Morgan Stanley	(1.777)
		Merrill Lynch	22.294	951	Envision Healthcare Corp	Bank of America	
(9.542)	Emerson Electric Co	Morgan Stanley	180			Merrill Lynch	1.255
2.501	Empire State Realty Trust Inc			1.054	Envision Healthcare Corp	Morgan Stanley	242
	'A' (Reit)	Morgan Stanley	371	17.953	Enzo Biochem Inc	Bank of America	
(98.276)	Empire State Realty Trust Inc					Merrill Lynch	(3.052)
	'A' (Reit)	Morgan Stanley	(80.095)	(18.291)	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	79.200
72.223	Employers Holdings Inc	Bank of America		84.971	EP Energy Corp 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	32.500			Merrill Lynch	(5.098)
5.912	Employers Holdings Inc	Goldman Sachs	1.892	(620)	EPAM Systems Inc	Bank of America	
5.702	Employers Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.261)			Merrill Lynch	298
(125.125)	Empresas ICA SAB de CV			11.657	EPAM Systems Inc	Bank of America	
	ADR	Morgan Stanley	1.251			Merrill Lynch	(5.595)
13.739	Enanta Pharmaceuticals Inc	Bank of America		3.782	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs	(1.815)
		Merrill Lynch	(53.033)	(6.719)	Epizyme Inc	Goldman Sachs	(13.774)
699	Enanta Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(2.698)	(11.950)	ePlus Inc	Morgan Stanley	(20.315)
(2.382)	Enbridge Inc	Bank of America		(44.785)	EPR Properties (Reit)	Morgan Stanley	(44.259)
		Merrill Lynch	4.812	2.573	EQT Corp	Bank of America	
887	Encompass Health Corp	Goldman Sachs	1.567			Merrill Lynch	(2.058)
887	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	1.286	733	EQT Corp	Goldman Sachs	(586)
3.947	Endo International Plc	Bank of America		332	EQT Corp	Morgan Stanley	(365)
		Merrill Lynch	579	(17.162)	EQT Corp	Morgan Stanley	5.008
(50.302)	Endo International Plc	Goldman Sachs	(9.306)	(19.205)	Equifax Inc	Bank of America	
(26.174)	Endocyte Inc	Morgan Stanley	3.141			Merrill Lynch	(31.496)
(115.867)	Endocyte Inc	Bank of America		(2.302)	Equinix Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(251.431)			Merrill Lynch	(24.862)
(3.191)	Enel Americas SA ADR	Morgan Stanley	1.693	(2.950)	Equinix Inc (Reit)	Morgan Stanley	(38.391)
(24.556)	Enel Americas SA ADR	Goldman Sachs	15.716	(461.246)	Equity Commonwealth (Reit)	Bank of America	
(6.587)	Energen Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(199.501)
		Merrill Lynch	(10.869)	(186.691)	Equity Commonwealth (Reit)	Morgan Stanley	(231.390)
(13.246)	Energizer Holdings Inc	Bank of America		24.535	Equity LifeStyle Properties	Bank of America	
		Merrill Lynch	(67.785)		Inc (Reit)	Merrill Lynch	58.148
(47.589)	Energizer Holdings Inc	Morgan Stanley	(109.931)	3.532	Equity LifeStyle Properties		
(124.743)	Energy Recovery Inc	Morgan Stanley	98.547		Inc (Reit)	Goldman Sachs	8.371
4.598	Energy XXI Gulf Coast Inc	Bank of America		728	Equity Residential (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.839)			Merrill Lynch	1.561
4.532	Energy XXI Gulf Coast Inc	Goldman Sachs	(1.813)	18.071	Equity Residential (Reit)	Morgan Stanley	52.732
(38.455)	EnerSys	Morgan Stanley	(21.919)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
4.286	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America		14.790	Expeditors International of Washington Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.329)			Merrill Lynch	51.321
2.670	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	(828)	907	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	1.986
1.950	Erie Indemnity Co 'A'	Morgan Stanley	(3.413)	(47.579)	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	(102.950)
13.471	Eros International Plc	Bank of America		(5.130)	Exponent Inc	Morgan Stanley	(12.262)
		Merrill Lynch	18.859	111.031	Extended Stay America Inc (Unit)	Bank of America	
76.056	ESCO Technologies Inc	Bank of America			Extended Stay America Inc (Unit)	Merrill Lynch	146.561
		Merrill Lynch	87.464	23.024	Exterrre Corp	Morgan Stanley	24.866
(6.115)	Esperion Therapeutics Inc	Bank of America		30.622	Exterrre Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	19.996		Exterrre Corp	Merrill Lynch	(29.091)
(11.389)	Esperion Therapeutics Inc	Morgan Stanley	22.892	24.562	Exterrre Corp	Goldman Sachs	(23.334)
63.070	Essendant Inc	Bank of America		25.423	Exterrre Corp	Morgan Stanley	(15.762)
		Merrill Lynch	208.762	(17.288)	Extra Space Storage Inc (Reit)	Bank of America	
183.703	Essent Group Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(60.685)
		Merrill Lynch	(141.451)	38.239	Extraction Oil & Gas Inc	Bank of America	
19.072	Essent Group Ltd	Morgan Stanley	(6.855)			Merrill Lynch	104.775
4.732	Essex Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	31.285	6.305	Extraction Oil & Gas Inc	Morgan Stanley	4.414
(3.462)	Essex Property Trust Inc (Reit)	Bank of America		12.268	Extraction Oil & Gas Inc	Goldman Sachs	33.614
		Merrill Lynch	(19.076)	(35.986)	Exxon Mobil Corp	Bank of America	
10.499	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	37.425
		Merrill Lynch	86.407	(129.860)	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	(197.176)
29.605	Etsy Inc	Bank of America		34.935	EZCORP Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	79.601			Merrill Lynch	(20.961)
2.725	Etsy Inc	Morgan Stanley	7.685	4.580	EZCORP Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.748)
(1.177)	Etsy Inc	Morgan Stanley	(213)	19.016	EZCORP Inc 'A'	Morgan Stanley	(14.262)
5.832	Etsy Inc	Goldman Sachs	13.792	(544)	F5 Networks Inc	Bank of America	
(16.173)	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	(4.043)			Merrill Lynch	(1.295)
12.864	Euronet Worldwide Inc	Bank of America		(9.432)	F5 Networks Inc	Morgan Stanley	(1.814)
		Merrill Lynch	(1.672)	(9.360)	Fabrinet	Morgan Stanley	1.706
(35.323)	Everbridge Inc	Bank of America		4.792	Facebook Inc 'A'	Goldman Sachs	23.241
		Merrill Lynch	(141.645)	2.878	Facebook Inc 'A'	Bank of America	
(29.530)	Evercore Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	13.958
		Merrill Lynch	92.304	(18.848)	Facebook Inc 'A'	Morgan Stanley	(101.214)
(36.977)	Evercore Inc 'A'	Morgan Stanley	221.862	7.220	FactSet Research Systems Inc	Bank of America	
1.265	Evercore Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	41.443
		Merrill Lynch	(3.542)	3.066	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	25.207
3.460	Everest Re Group Ltd	Morgan Stanley	(13.030)	379	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs	2.175
(2.693)	Everest Re Group Ltd	Bank of America		396	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs	3.057
		Merrill Lynch	8.618	6.218	Fair Isaac Corp	Bank of America	
651	Everest Re Group Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	48.003
		Merrill Lynch	(549)	2.528	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	38.901
9.940	Eversource Energy	Bank of America		(142.349)	Fairmount Santrol Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.851			Merrill Lynch	74.021
9.727	EVERTEC Inc	Bank of America		(18.978)	Fairmount Santrol Holdings Inc	Morgan Stanley	7.212
		Merrill Lynch	4.345	(78.087)	Farmer Brothers Co	Bank of America	
14.175	EVERTEC Inc	Morgan Stanley	4.825			Merrill Lynch	(429.479)
19.382	Evolution Petroleum Corp	Bank of America		(61.013)	Fastenal Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	7.753			Merrill Lynch	8.542
19.504	Evolution Petroleum Corp	Goldman Sachs	6.789	(73.624)	Fastenal Co	Morgan Stanley	25.032
97.019	Evolution Petroleum Corp	Morgan Stanley	14.553	5.583	FBL Financial Group Inc 'A'	Bank of America	
10.412	EW Scripps Co/The 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	16.749
		Merrill Lynch	(1.562)	1.544	FBL Financial Group Inc 'A'	Goldman Sachs	4.632
2.394	EW Scripps Co/The 'A'	Goldman Sachs	(359)	17	FBL Financial Group Inc 'A'	Morgan Stanley	22
79.403	EW Scripps Co/The 'A'	Morgan Stanley	(60.346)	49.156	FCB Financial Holdings Inc 'A'	Bank of America	
(12.082)	Exact Sciences Corp	Bank of America				Merrill Lynch	25.649
		Merrill Lynch	(128.069)	2.910	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Morgan Stanley	728
984	Exact Sciences Corp	Bank of America		3.787	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Goldman Sachs	11.134
		Merrill Lynch	9.048	9.372	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Bank of America	
(34.123)	Exantas Capital Corp	Bank of America				Merrill Lynch	27.554
		Merrill Lynch	(14.673)	2.617	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Bank of America	
(3.544)	Exantas Capital Corp	Goldman Sachs	(1.524)			Merrill Lynch	9.096
(57.369)	Exantas Capital Corp	Morgan Stanley	(18.932)	20.622	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	44.750
6.486	Exelixis Inc	Goldman Sachs	1.394	(17.941)	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Bank of America	
31.886	Exelixis Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(65.843)
		Merrill Lynch	1.228				
(91.046)	Exelon Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	(83.307)				
(77.784)	Exelon Corp	Morgan Stanley	(48.197)				
(1.611)	Expedia Group Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(8.571)				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(14.644)	Federal Signal Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.226)	92.509	First Financial Northwest Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.697)
289	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.541	24.596	First Financial Northwest Inc	Goldman Sachs	(3.443)
16.235	FedEx Corp	Morgan Stanley	42.330	30.279	First Financial Northwest Inc	Morgan Stanley	(1.211)
(1.852)	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.908)	(169)	First Guaranty Bancshares Inc	Morgan Stanley	30
(1.154)	Fennec Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.419)	166.438	First Hawaiian Inc	Bank of America Merrill Lynch	137.805
8.404	Ferrari NV	Morgan Stanley	(20.674)	5.590	First Hawaiian Inc	Morgan Stanley	2.571
4.720	Ferro Corp	Morgan Stanley	(2.320)	3.475	First Hawaiian Inc	Goldman Sachs	3.301
11.885	Ferroglobe Plc	Morgan Stanley	(15.926)	141.468	First Horizon National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(87.710)
3.289	Ferroglobe Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.749)	9.484	First Horizon National Corp	Morgan Stanley	(9.294)
(38.788)	Fiat Chrysler Automobiles NV	Morgan Stanley	-	13.748	First Horizon National Corp	Goldman Sachs	(8.524)
(69.438)	Fibria Celulose SA ADR	Goldman Sachs	32.736	5.837	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	6.888
(24.493)	Fibria Celulose SA ADR	Morgan Stanley	8.083	90.679	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	124.230
(8.328)	FibroGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.265)	9.824	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	13.459
75.784	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(112.496)	(1.684)	First Internet Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(4.968)
120.457	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	(63.479)	119.635	First Majestic Silver Corp	Morgan Stanley	(13.911)
679	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs	(1.202)	16.393	First Majestic Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.951
(113.693)	Fiesta Restaurant Group Inc	Goldman Sachs	(68.216)	(30.327)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23.130)
(107.392)	Fiesta Restaurant Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64.435)	(967)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Goldman Sachs	(754)
(62.860)	Fifth Third Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	237.611	(3.696)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Morgan Stanley	(2.513)
(66.938)	Finisar Corp	Morgan Stanley	(31.631)	(55.718)	First Midwest Bancorp Inc/IL	Bank of America Merrill Lynch	(56.832)
(790)	FireEye Inc	Bank of America Merrill Lynch	837	(73.580)	First Midwest Bancorp Inc/IL	Morgan Stanley	9.565
(2.847)	FireEye Inc	Goldman Sachs	3.018	47.907	First Republic Bank/CA	Bank of America Merrill Lynch	74.735
17.954	First American Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(180)	(562)	First Republic Bank/CA	Morgan Stanley	312
390	First American Financial Corp	Goldman Sachs	(115)	(12.947)	First Solar Inc	Bank of America Merrill Lynch	53.860
51.328	First American Financial Corp	Morgan Stanley	(36.358)	20.486	FirstCash Inc	Morgan Stanley	(33.547)
(38.551)	First BanCorp/Puerto Rico	Morgan Stanley	6.034	(201.317)	FirstEnergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(128.843)
3.308	First Bancorp/Southern Pines NC	Bank of America Merrill Lynch	4.300	(28.089)	FirstEnergy Corp	Morgan Stanley	(19.943)
904	First Bancorp/Southern Pines NC	Morgan Stanley	271	(32.266)	Fiserv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16.778)
3.177	First Bank/Hamilton NJ	Bank of America Merrill Lynch	489	299.533	Fitbit Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	68.893
3.119	First Bank/Hamilton NJ	Morgan Stanley	281	176.816	Fitbit Inc 'A'	Goldman Sachs	40.668
(1.834)	First Business Financial Services Inc	Goldman Sachs	(459)	30.668	Fitbit Inc 'A'	Morgan Stanley	7.974
(16.622)	First Business Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.156)	(5.431)	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	15.370
(12.554)	First Business Financial Services Inc	Morgan Stanley	628	3.476	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.962)
(2.715)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Bank of America Merrill Lynch	26.390	(1.648)	Five Below Inc	Morgan Stanley	(147.960)
(1.679)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Morgan Stanley	7.135	(5.248)	Five Point Holdings LLC 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2.159
129.120	First Connecticut Bancorp Inc/Farmington CT	Bank of America Merrill Lynch	38.736	(1.235)	Five Point Holdings LLC 'A'	Morgan Stanley	3.201
6.645	First Connecticut Bancorp Inc/Farmington CT	Goldman Sachs	1.994	31.456	Five Prime Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.582
27.341	First Connecticut Bancorp Inc/Farmington CT	Morgan Stanley	(8.202)	1.743	Five9 Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.443
145.783	First Data Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(86.012)	17.111	Five9 Inc	Morgan Stanley	30.629
142.694	First Defiance Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	319.635	(9.155)	FleetCor Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.320)
7.642	First Defiance Financial Corp	Morgan Stanley	1.146	(21.984)	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	(23.812)
3.882	First Financial Corp/IN	Bank of America Merrill Lynch	2.954	5.656	Flex Ltd	Bank of America Merrill Lynch	152
1.431	First Financial Corp/IN	Morgan Stanley	356	(5.914)	FLIR Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.909
474	First Financial Corp/IN	Goldman Sachs	(126)	6.286	FLIR Systems Inc	Morgan Stanley	417

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
25.047 (109.386)	Flowers Foods Inc Flowsolve Corp	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	20.495 205.646	48.035	Fox Factory Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	146.507
(119.818)	Flowsolve Corp	Morgan Stanley	353.463	4.379	Fox Factory Holding Corp	Goldman Sachs	13.356
(109.573)	FNB Corp/PA	Bank of America Merrill Lynch	 31.776	48.127 (61.140)	Fox Factory Holding Corp Francesca's Holdings Corp	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	62.565 (6.588)
(29.417)	FNF Group	Morgan Stanley	16.179	(32.951)	Frank's International NV	Morgan Stanley	(989)
3.329	FNF Group	Goldman Sachs	(1.565)	(7.722)	Franklin Electric Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (15.830)
5.871	FNF Group	Morgan Stanley	(3.229)	1.427	Franklin Resources Inc	Morgan Stanley	(1.456)
18.552	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	Morgan Stanley	(52.472)	80.301	Franklin Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (8.833)
995	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	Goldman Sachs	(1.831)	(53.519)	Fred's Inc 'A'	Morgan Stanley	4.817
(15.393)	FONAR Corp	Bank of America Merrill Lynch	 (5.388)	(17.751)	Fred's Inc 'A'	Goldman Sachs	3.461
(8.401)	FONAR Corp	Goldman Sachs	(2.940)	(38.869)	Freeport-McMoRan Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (50.918)
(11.665)	Foot Locker Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (119.995)	(54.114)	FreightCar America Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (99.029)
(23.911)	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	(1.999)	2.650	Fresh Del Monte Produce Inc	Morgan Stanley	(722)
(88.980)	Ford Motor Co	Bank of America Merrill Lynch	 (32.923)	(2.641)	Fresh Del Monte Produce Inc	Bank of America Merrill Lynch	 4.912
(236.605)	Ford Motor Co	Morgan Stanley	(16.562)	10.188	Freshpet Inc	Bank of America Merrill Lynch	 23.432
1.007	ForeScout Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (342)	912	Freshpet Inc	Goldman Sachs	2.098
863	ForeScout Technologies Inc	Morgan Stanley	78	(87.876)	Front Yard Residential Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	 (75.573)
89.622	Forest City Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	 53.773	5.333	Frontier Communications Corp	Bank of America Merrill Lynch	 (9.333)
8.384	Forest City Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(1.408)	(736)	FRP Holdings Inc	Goldman Sachs	(478)
(89.237)	FormFactor Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (66.928)	(25.468)	FRP Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (16.554)
(12.676)	FormFactor Inc	Morgan Stanley	(2.903)	10.074	FS Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (2.687)
25.746	Forrester Research Inc	Bank of America Merrill Lynch	 28.321	1.866	FS Bancorp Inc	Goldman Sachs	455
2.911	Forrester Research Inc	Morgan Stanley	2.474	515	FS Bancorp Inc	Morgan Stanley	(283)
(19.725)	Forterra Inc	Bank of America Merrill Lynch	 3.156	(9.281)	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	(16.978)
(5.257)	Fortinet Inc	Morgan Stanley	(15.666)	44.379	FTS International Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (6.213)
2.937	Fortive Corp	Bank of America Merrill Lynch	 (7.754)	22.652	FTS International Inc	Goldman Sachs	(3.171)
6.020	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	Morgan Stanley	4.515	21.491	Fulton Financial Corp	Morgan Stanley	(5.373)
14.090	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	Bank of America Merrill Lynch	 4.509	(109.176)	Fulton Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	 (26.706)
1.945	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	Goldman Sachs	622	2.106	Funko Inc	Bank of America Merrill Lynch	 779
125.041	Fortune Brands Home & Security Inc	Bank of America Merrill Lynch	 134.820	(44.115)	Fusion Connect Inc	Morgan Stanley	17.205
8.236	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldman Sachs	9.142	5.529	G-III Apparel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	 23.266
94.367	Fortune Brands Home & Security Inc	Morgan Stanley	14.155	12.621 (19.137)	G-III Apparel Group Ltd G-III Apparel Group Ltd	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	49.348 (83.437)
(4.951)	Forum Energy Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	 5.416	(3.368)	Gafisa SA ADR	Goldman Sachs	674
(23.463)	Forum Energy Technologies Inc	Morgan Stanley	21.117	(11.535)	Gafisa SA ADR	Morgan Stanley	9.805
(4.072)	Forward Air Corp	Morgan Stanley	(56)	(71.910)	GAIN Capital Holdings Inc	Morgan Stanley	2.784
(5.330)	Fossil Group Inc	Morgan Stanley	(2.654)	(11.670)	GAMCO Investors Inc	Bank of America Merrill Lynch	 3.734
1.122	Foundation Building Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	 1.380	12.071	GameStop Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	 (3.863)
3.570	Foundation Building Materials Inc	Goldman Sachs	4.391	10.662	GameStop Corp 'A'	Goldman Sachs	(3.412)
(920)	Foundation Medicine Inc	Morgan Stanley	(12.972)	(54.569)	GameStop Corp 'A'	Morgan Stanley	(28.376)
(945)	Foundation Medicine Inc	Goldman Sachs	(20.365)	26.979	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	16.633
(4.036)	Foundation Medicine Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (60.545)	(3.849)	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	 (3.233)
94.812	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	 74.901	(39.157)	Gannett Co Inc	Morgan Stanley	9.789
13.594	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	10.739	(51.967)	Gap Inc/The	Morgan Stanley	116.573
3.638	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	1.928	(76.318)	Gap Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	 106.003
				6.019	Gardner Denver Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (3.551)
				488	Gardner Denver Holdings Inc	Goldman Sachs	(587)
				471	Garmin Ltd	Morgan Stanley	24

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
48.801	Garmin Ltd	Bank of America		(87.425)	Gerdau SA ADR	Morgan Stanley	9.097
		Merrill Lynch	62.953	(20.186)	Gibraltar Industries Inc	Morgan Stanley	(33.307)
4.269	Garmin Ltd	Goldman Sachs	5.507	61.247	Gilead Sciences Inc	Bank of America	
(29.017)	Gartner Inc	Bank of America				Merrill Lynch	46.152
		Merrill Lynch	39.825	810	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs	536
(14.530)	Gartner Inc	Morgan Stanley	(19.439)	552	Gilead Sciences Inc	Morgan Stanley	316
10.325	GasLog Ltd	Bank of America		109.847	Glacier Bancorp Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	762			Merrill Lynch	29.659
(143.745)	GasLog Ltd	Morgan Stanley	7.187	60.088	Gladstone Land Corp (Reit)	Bank of America	
22.089	GasLog Ltd	Morgan Stanley	(5.511)			Merrill Lynch	(8.412)
147.146	Gates Industrial Corp Plc	Bank of America		22.959	Gladstone Land Corp (Reit)	Morgan Stanley	6.199
		Merrill Lynch	5.886	14.163	Gladstone Land Corp (Reit)	Goldman Sachs	(1.983)
7.668	Gates Industrial Corp Plc	Goldman Sachs	307	(3.802)	Global Blood Therapeutics Inc	Bank of America	
2.833	Gates Industrial Corp Plc	Morgan Stanley	(1.983)			Merrill Lynch	4.182
29.069	GATX Corp	Morgan Stanley	(26.113)	(7.662)	Global Eagle Entertainment Inc	Goldman Sachs	(10.493)
(4.670)	GATX Corp	Goldman Sachs	8.325	(287.539)	Global Eagle Entertainment Inc	Morgan Stanley	(77.636)
5.073	GATX Corp	Bank of America		(99)	Global Indemnity Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.486)			Merrill Lynch	222
1.621	Gatx Corp	Goldman Sachs	(794)	(63.407)	Global Indemnity Ltd	Morgan Stanley	159.152
(14.968)	GCI Liberty Inc 'A'	Bank of America		(40.340)	Global Medical REIT Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	22.602			Merrill Lynch	(10.085)
3.264	GCI Liberty Inc 'A'	Morgan Stanley	(2.028)	(700)	Global Medical REIT Inc (Reit)	Goldman Sachs	(175)
(22.374)	Genco Shipping & Trading Ltd	Goldman Sachs	(14.767)	(37.155)	Global Payments Inc	Bank of America	
22.293	Gencor Industries Inc	Bank of America				Merrill Lynch	87.783
		Merrill Lynch	4.476	3.086	Global Water Resources Inc	Goldman Sachs	432
7.798	Gencor Industries Inc	Goldman Sachs	1.950	6.226	Global Water Resources Inc	Morgan Stanley	249
10.604	Gencor Industries Inc	Morgan Stanley	1.260	14.405	Global Water Resources Inc	Bank of America	
4.842	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	1.876			Merrill Lynch	2.017
18.106	Generac Holdings Inc	Goldman Sachs	34.220	151	Globant SA	Bank of America	
99.816	Generac Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	261
		Merrill Lynch	186.643	50.164	Globant SA	Morgan Stanley	109.859
(100.934)	General Electric Co	Bank of America		3.888	Globus Medical Inc 'A'	Goldman Sachs	24.144
		Merrill Lynch	66.112	2.305	Globus Medical Inc 'A'	Morgan Stanley	7.699
(91.953)	General Electric Co	Morgan Stanley	113.562	818	Globus Medical Inc 'A'	Bank of America	
(3.397)	General Mills Inc	Goldman Sachs	611			Merrill Lynch	5.080
(50.355)	General Mills Inc	Bank of America		38.833	GNC Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(11.262)
		Merrill Lynch	9.064	4.422	GNC Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(619)
(4.438)	General Motors Co	Bank of America		37.485	GNC Holdings Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(22.767)			Merrill Lynch	(10.871)
5.216	General Motors Co	Morgan Stanley	19.769	8.915	GoDaddy Inc 'A'	Morgan Stanley	17.384
(57.776)	Genesco Inc	Bank of America		5.523	GoDaddy Inc 'A'	Goldman Sachs	19.054
		Merrill Lynch	(6.158)	60.057	GoDaddy Inc 'A'	Bank of America	
(43.521)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	207.060
		Merrill Lynch	(71.810)	2.713	Golar LNG Ltd	Bank of America	
(82.497)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Morgan Stanley	(660.667)			Merrill Lynch	(11.774)
(107.316)	Genie Energy Ltd 'B'	Bank of America		80.241	Golar LNG Ltd	Morgan Stanley	(414.044)
		Merrill Lynch	(66.536)	15.256	Gold Resource Corp	Morgan Stanley	9.611
(16.163)	Genie Energy Ltd 'B'	Morgan Stanley	(8.243)	5.592	Gold Resource Corp	Bank of America	
1.586	Genomic Health Inc	Morgan Stanley	2.783			Merrill Lynch	5.089
37.322	Genomic Health Inc	Bank of America		3.354	Gold Resource Corp	Goldman Sachs	3.052
		Merrill Lynch	59.398	(17.249)	Golden Entertainment Inc	Bank of America	
1.459	Genomic Health Inc	Goldman Sachs	3.071			Merrill Lynch	(6.037)
(65.835)	Genpact Ltd	Bank of America		(2.021)	Golden Entertainment Inc	Goldman Sachs	(707)
		Merrill Lynch	9.875	12.553	Goldman Sachs Group Inc/The	Morgan Stanley	(151.967)
(233.871)	Gentex Corp	Bank of America		(791)	Goldman Sachs Group Inc/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	(54.438)			Merrill Lynch	12.094
(290.550)	Gentex Corp	Morgan Stanley	(131.619)	(21.908)	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Bank of America	
(129.483)	Gentherm Inc	Bank of ANmerica		(64.082)	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Merrill Lynch	28.480
		Merrill Lynch	(79.973)			Morgan Stanley	80.743
(63.754)	Gentherm Inc	Morgan Stanley	(74.526)	6.573	GoPro Inc 'A'	Morgan Stanley	2.103
4.947	Genuine Parts Co	Bank of America		200.234	GoPro Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.947)			Merrill Lynch	(14.016)
(2.952)	Genuine Parts Co	Morgan Stanley	1.477	58.451	GoPro Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.092)
(40.459)	GEO Group Inc/The (Reit)	Morgan Stanley	(36.653)	(41.059)	Government Properties Income Trust (Reit)	Morgan Stanley	(20.998)
36.016	GEO Group Inc/The (Reit)	Bank of America		(10.447)	GP Strategies Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	66.990			Merrill Lynch	(4.179)
2.317	GEO Group Inc/The (Reit)	Morgan Stanley	2.294	24.722	Graco Inc	Bank of America	
10.763	GEO Group Inc/The (Reit)	Goldman Sachs	20.019			Merrill Lynch	11.619
1.818	Geospace Technologies Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	(131)				
(21.185)	Gerdau SA ADR	Goldman Sachs	17.584				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(18.349)	GrafTech International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12.929	(39.257) (51.803)	Grupo Televisa SAB ADR GTT Communications Inc	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	51.427 183.901
(62.437)	Graham Corp	Bank of America Merrill Lynch	(139.274)	737	GTT Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(198)
241	Graham Holdings Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(2.440)	3.795	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.423)
543	Graham Holdings Co 'B'	Morgan Stanley	(3.102)	603	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs	1.556
20.859	Grana y Montero SAA ADR	Goldman Sachs	(7.926)	(105.992)	Gulf Island Fabrication Inc	Goldman Sachs	(47.696)
(11.521)	Grand Canyon Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28.342)	(11.154)	Gulf Island Fabrication Inc	Morgan Stanley	–
9.677	Grand Canyon Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	2	11.880	Gulfport Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.208
(210.858)	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	61.149	11.622	H&E Equipment Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30.217)
(160.579)	Graphic Packaging Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(110.800)	9.686	H&E Equipment Services Inc	Morgan Stanley	(27.896)
24.809	Gray Television Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22.634)	773	H&E Equipment Services Inc	Goldman Sachs	(2.010)
51.190	Gray Television Inc	Morgan Stanley	(57.589)	3.950	H&R Block Inc	Goldman Sachs	553
(470.915)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Bank of America Merrill Lynch	–	73.991	H&R Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.020
(107.753)	Great Plains Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(162.707)	137.406	H&R Block Inc	Morgan Stanley	36.275
1.305	Great Plains Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.357	94.603	Hackett Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	17.975
41.619	Great Plains Energy Inc	Morgan Stanley	72.105	(4.200)	Haemonetics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15.708)
2.140	Great Western Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.397	29.849	Hain Celestial Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(21.491)
53.269	Great Western Bancorp Inc	Morgan Stanley	1.065	106.761	Hain Celestial Group Inc/The	Morgan Stanley	5.338
(33.770)	Great Western Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.538)	(85.194)	Halcon Resources Corp	Morgan Stanley	33.226
(14.004)	Green Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	14.004	15.470	Halliburton Co	Bank of America Merrill Lynch	(40.569)
(17.124)	Green Brick Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.715)	56.185	Halliburton Co	Morgan Stanley	(131.263)
80.426	Green Dot Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	23.324	121.040	Hallmark Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.052)
9.526	Green Dot Corp 'A'	Morgan Stanley	17.433	30.306	Hallmark Financial Services Inc	Morgan Stanley	–
16.618	Green Dot Corp 'A'	Goldman Sachs	4.819	25.842	Halozyne Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.449)
(161.748)	Green Plains Inc	Bank of America Merrill Lynch	(258.563)	(60.569)	Halyard Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119.321)
5.207	Green Plains Partners LP	Morgan Stanley	1.041	(9.650)	Halyard Health Inc	Morgan Stanley	(9.361)
57.877	Green Plains Partners LP	Bank of America Merrill Lynch	46.302	(35.757)	Hamilton Beach Brands Holding Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(54.552)
32.393	Greenbrier Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	85.841	(31.383)	Hamilton Lane Inc 'A'	Morgan Stanley	(3.307)
47.250	Greenbrier Cos Inc/The	Morgan Stanley	(28.350)	(246.792)	Hancock Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	184.196
(69.003)	Greenhill & Co Inc	Morgan Stanley	(65.300)	(24.513)	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	(5.148)
197.169	Greenlight Capital Re Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(195.347)	(71.317)	Hanesbrands Inc	Goldman Sachs	(83.441)
15.041	Greenlight Capital Re Ltd 'A'	Morgan Stanley	(16.545)	53.205	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	11.173
(5.017)	Greif Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.025)	1.062	Hanmi Financial Corp	Goldman Sachs	2.177
(784)	Griffon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(627)	19.348	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	–
8.736	Group 1 Automotive Inc	Morgan Stanley	(3.900)	25.590	Hanover Insurance Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	54.605
(54.401)	Groupon Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.168	26.582	Hanover Insurance Group Inc/The	Morgan Stanley	48.820
(53.275)	Groupon Inc	Morgan Stanley	(8.258)	5.503	Hanover Insurance Group Inc/The	Goldman Sachs	14.473
(69.968)	Groupon Inc	Goldman Sachs	6.647	(16.149)	Harley-Davidson Inc	Goldman Sachs	(3.391)
5.178	GrubHub Inc	Bank of America Merrill Lynch	29.349	4.067	Harris Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14.194)
256	GrubHub Inc	Goldman Sachs	1.188	10.022	Harris Corp	Morgan Stanley	6.615
29.692	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ADR	Goldman Sachs	(64.432)	1.379	Harris Corp	Goldman Sachs	(4.813)
16.034	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ADR	Morgan Stanley	(29.558)	(34.677)	Harsco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10.780)
(10.812)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ADR	Goldman Sachs	96.033	17.373	Harte-Hanks Inc	Morgan Stanley	(3.127)
(107)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ADR	Morgan Stanley	397	56.436	Hartford Financial Services Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(5.644)
(62.242)	Grupo Televisa SAB ADR	Morgan Stanley	272.341	18.915	Hartford Financial Services Group Inc/The	Morgan Stanley	(21.185)
				8.451	Hartford Financial Services Group Inc/The	Goldman Sachs	(845)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
141.393	Harvard Bioscience Inc	Bank of America		1.336	Hennessy Advisors Inc	Morgan Stanley	(788)
		Merrill Lynch	(70.697)	24.078	Hennessy Advisors Inc	Bank of America	
21.049	Harvard Bioscience Inc	Goldman Sachs	(10.525)			Merrill Lynch	(12.521)
27.728	Harvard Bioscience Inc	Morgan Stanley	(4.159)	(45.894)	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	23.884
(52.252)	Hasbro Inc	Morgan Stanley	20.283	(38.634)	Henry Schein Inc	Bank of America	
(7.011)	Hasbro Inc	Bank of America				Merrill Lynch	29.047
		Merrill Lynch	3.006	5.324	Herbalife Nutrition Ltd	Morgan Stanley	2.468
(50.610)	Hawaiian Electric Industries Inc	Morgan Stanley	19.447	4.096	Herc Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.322)
(221.763)	Hawaiian Electric Industries Inc	Bank of America		13.642	Heritage Commerce Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(139.711)			Merrill Lynch	2.183
12.402	Hawaiian Holdings Inc	Bank of America		242.108	Heritage Commerce Corp	Morgan Stanley	(58.106)
		Merrill Lynch	3.721	(13.873)	Heritage-Crystal Clean Inc	Bank of America	
6.472	Hawaiian Holdings Inc	Morgan Stanley	7.564			Merrill Lynch	(4.939)
(39.744)	Haynes International Inc	Bank of America		(28.604)	Herman Miller Inc	Morgan Stanley	39.450
		Merrill Lynch	(124.399)	(12.635)	Herman Miller Inc	Bank of America	
34.264	HB Fuller Co	Bank of America				Merrill Lynch	(5.563)
		Merrill Lynch	29.124	47.188	Hersha Hospitality Trust (Reit)	Bank of America	
17.967	HB Fuller Co	Morgan Stanley	20.268			Merrill Lynch	86.826
(16.041)	HCA Healthcare Inc	Bank of America		9.334	Hersha Hospitality Trust (Reit)	Goldman Sachs	17.175
		Merrill Lynch	(54.058)	11.981	Hersha Hospitality Trust (Reit)	Morgan Stanley	9.106
(40.646)	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	(236.765)	16.338	Hershey Co/The	Bank of America	
(112.707)	HCP Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(28.592)
		Merrill Lynch	(51.845)	58.104	Hershey Co/The	Morgan Stanley	(89.751)
300.735	HD Supply Holdings Inc	Morgan Stanley	362.376	6.806	Hertz Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(10.209)
39.543	HD Supply Holdings Inc	Bank of America		(12.197)	Heska Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	4.523			Merrill Lynch	(140.509)
7.476	HD Supply Holdings Inc	Goldman Sachs	1.518	(45.690)	Hess Corp	Bank of America	
(1.575)	Health Insurance	Bank of America				Merrill Lynch	135.242
	Innovations Inc 'A'	Merrill Lynch	(4.489)	(28.804)	Hess Corp	Morgan Stanley	95.629
(20.062)	Health Insurance			17.214	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America	
	Innovations Inc 'A'	Morgan Stanley	14.043			Merrill Lynch	(26.160)
(12.911)	Health Insurance			758	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs	(1.433)
	Innovations Inc 'A'	Goldman Sachs	(26.375)	48.411	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	(91.981)
(112.373)	Healthcare Realty Trust	Bank of America		6.994	Hexcel Corp	Morgan Stanley	43.879
	Inc (Reit)	Merrill Lynch	(80.909)	(726)	Hexcel Corp	Bank of America	
3.216	Healthcare Services Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(506)
		Merrill Lynch	116	(59.962)	HFF Inc 'A'	Bank of America	
13.170	Healthcare Services Group Inc	Morgan Stanley	2.847			Merrill Lynch	(98.234)
(157.685)	Healthcare Services Group Inc	Bank of America		(11.607)	HFF Inc 'A'	Morgan Stanley	(7.857)
		Merrill Lynch	96.255	8.038	Hibbett Sports Inc	Goldman Sachs	(10.248)
(19.273)	Healthcare Trust of America	Bank of America		20.068	Hibbett Sports Inc	Morgan Stanley	(18.061)
	Inc 'A' (Reit)	Merrill Lynch	(5.011)	28.581	Hibbett Sports Inc	Bank of America	
(22.312)	HealthEquity Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(30.630)
		Merrill Lynch	(129.543)	127.003	HighPoint Resources Corp	Bank of America	
496	HealthEquity Inc	Morgan Stanley	(340)			Merrill Lynch	114.207
(959)	Heartland Express Inc	Morgan Stanley	(249)	29.250	HighPoint Resources Corp	Goldman Sachs	26.910
(12.046)	Heartland Express Inc	Goldman Sachs	(12.528)	13.975	HighPoint Resources Corp	Morgan Stanley	(559)
(65.158)	Heartland Express Inc	Bank of America		19.846	Highwoods Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	51.203
		Merrill Lynch	(67.764)	1.092	Highwoods Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	1.627
401.041	Hecla Mining Co	Morgan Stanley	(20.052)	183.571	Highwoods Properties Inc (Reit)	Bank of America	
59.022	Hecla Mining Co	Bank of America				Merrill Lynch	477.095
		Merrill Lynch	(1.771)	(171.759)	Hill International Inc	Bank of America	
9.872	HEICO Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(8.588)
		Merrill Lynch	15.438	(41.500)	Hill International Inc	Morgan Stanley	(2.075)
49.277	HEICO Corp	Morgan Stanley	144.342	46.863	Hill-Rom Holdings Inc	Bank of America	
475	HEICO Corp	Goldman Sachs	1.259			Merrill Lynch	235.721
2.352	HEICO Corp 'A'	Goldman Sachs	1.627	49.860	Hill-Rom Holdings Inc	Morgan Stanley	402.145
67.441	HEICO Corp 'A'	Bank of America		3.254	Hill-Rom Holdings Inc	Goldman Sachs	16.368
		Merrill Lynch	53.383	3.328	Hilltop Holdings Inc	Morgan Stanley	732
(45.421)	Heidrick & Struggles	Bank of America		7.367	Hilton Grand Vacations Inc	Bank of America	
	International Inc	Merrill Lynch	(9.308)			Merrill Lynch	9.430
(109.925)	Helix Energy Solutions	Bank of America		593	Hilton Grand Vacations Inc	Goldman Sachs	759
	Group Inc	Merrill Lynch	45.069	1.140	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	(34)
(301)	Helmerich & Payne Inc	Bank of America		(49.520)	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	181.567
		Merrill Lynch	1.418	(2.820)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Bank of America	
(3.119)	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	14.690			Merrill Lynch	4.568
27.728	Helmerich & Payne Inc	Morgan Stanley	(110.080)	(179.274)	HMS Holdings Corp	Bank of America	
(23.341)	Hemisphere Media Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(168.518)
		Merrill Lynch	(7.002)	2.041	HNI Corp	Morgan Stanley	2.713
(1.469)	Hemisphere Media Group Inc	Goldman Sachs	(441)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(14.500)	HollyFrontier Corp	Bank of America Merrill Lynch	(154.570)	37.043	Hudson Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.482
1.249	Hollysys Automation Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(837)	7.503	Hudson Ltd 'A'	Goldman Sachs	300
35.723	Hollysys Automation Technologies Ltd	Morgan Stanley	(38.224)	(4.646)	Hudson Ltd 'A'	Morgan Stanley	1.239
(46.799)	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.524)	(18.893)	Hudson Pacific Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(24.493)
(62.926)	Hologic Inc	Morgan Stanley	(63.894)	(8.510)	Hudson Technologies Inc	Goldman Sachs	2.213
59.366	Home BancShares Inc/AR	Bank of America Merrill Lynch	(21.965)	18.774	Humana Inc	Bank of America Merrill Lynch	79.414
(5.921)	Home BancShares Inc/AR	Bank of America Merrill Lynch	2.191	(21.113)	Huntington Bancshares Inc/OH	Bank of America Merrill Lynch	8.023
5.373	Home BancShares Inc/AR	Goldman Sachs	(1.988)	(48.972)	Huntington Bancshares Inc/OH	Morgan Stanley	6.116
(12.097)	Home Depot Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	16.573	(6.160)	Huntington Ingalls Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29.014)
(54.888)	Home Depot Inc/The	Morgan Stanley	(98.551)	42.369	Huntsman Corp	Bank of America Merrill Lynch	8.050
(22.507)	HomeStreet Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.326	(59.139)	Huntsman Corp	Morgan Stanley	(26.146)
(22.021)	Homology Medicines Inc	Morgan Stanley	(2.643)	1.864	Hurco Cos Inc	Morgan Stanley	4.846
5.490	Honeywell International Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.858	4.891	Hurco Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	16.385
4.960	Hope Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	694	(59.351)	Hurco Cos Inc	Goldman Sachs	14.013
4.124	Hope Bancorp Inc	Goldman Sachs	577	(15.060)	Huttig Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(234.436)
(2.174)	Horizon Bancorp Inc/IN	Bank of America Merrill Lynch	(3.413)	(227.574)	Huttig Building Products Inc	Goldman Sachs	(452)
(2.351)	Horizon Bancorp Inc/IN	Morgan Stanley	(611)	26.011	Hyatt Hotels Corp 'A'	Morgan Stanley	(20.482)
(150)	Horizon Bancorp Inc/IN	Goldman Sachs	(236)	(9.077)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Merrill Lynch	41.357
(14.005)	Horizon Global Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.804)	(18.594)	IAC/InterActiveCorp	Morgan Stanley	(5.778)
(2.765)	Horizon Pharma Plc	Morgan Stanley	(3.622)	(4.644)	IAC/InterActiveCorp	Bank of America Merrill Lynch	(190.031)
18.187	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	5.232	532	IBERIABANK Corp	Morgan Stanley	(18.091)
1.597	Hormel Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.278	30.990	IBERIABANK Corp	Morgan Stanley	(399)
(42.464)	Hormel Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	(33.971)	(4.279)	IBERIABANK Corp	Bank of America Merrill Lynch	61.980
57.165	Hortonworks Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.764	(60.985)	Ichor Holdings Ltd	Morgan Stanley	1.371
42.626	Hortonworks Inc	Morgan Stanley	2.558	(19.506)	Ichor Holdings Ltd	Goldman Sachs	28.850
11.149	Hortonworks Inc	Goldman Sachs	3.679	2.780	Icon Plc	Morgan Stanley	(21.262)
(2.148)	Hospitality Properties Trust (Reit)	Morgan Stanley	(1.761)	(17.636)	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	(83)
43.289	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	36.109	92.447	IDACORP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(450.600)
4.649	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Goldman Sachs	1.466	239.368	IDACORP Inc	Morgan Stanley	285.230
3.077	Hostess Brands Inc	Morgan Stanley	(157)	(7.215)	Idera Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	754.009
19.660	Houghton Mifflin Harcourt Co	Bank of America Merrill Lynch	4.424	(191.576)	Idera Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.587)
56.561	Houghton Mifflin Harcourt Co	Morgan Stanley	35.351	18.376	IDEX Corp	Morgan Stanley	(42.147)
(43.605)	Houlihan Lokey Inc	Bank of America Merrill Lynch	23.767	173	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	4.046
(10)	Houston Wire & Cable Co	Bank of America Merrill Lynch	(2)	17.572	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	1.388
(777.150)	Hovnanian Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(89.372)	13.381	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	189.075
(22.414)	Howard Hughes Corp/The	Morgan Stanley	104.001	(139.961)	IES Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	24.487
9.882	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.223	(27.971)	IHS Markit Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(34.990)
28.337	HP Inc	Morgan Stanley	5.526	(99.302)	II-VI Inc	Goldman Sachs	64.333
(50.866)	HRG Group Inc	Morgan Stanley	(3.737)	(38.951)	II-VI Inc	Bank of America Merrill Lynch	26.131
(38.710)	HRG Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27.017)	(18.117)	ILG Inc	Morgan Stanley	33.108
(8.597)	Hub Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(23.322)	(22.700)	ILG Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.494)
14.869	Hubbell Inc	Bank of America Merrill Lynch	58.138	23.754	Illinois Tool Works Inc	Morgan Stanley	(11.123)
1.161	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.597	754	Illinois Tool Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.789)
19.532	Hudson Ltd 'A'	Morgan Stanley	1.563	17.444	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs	(279)
				(4.811)	Illumina Inc	Morgan Stanley	(29.131)
				29.208	IMAX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41.711)
				12.856	IMAX Corp	Goldman Sachs	(80.322)
						Morgan Stanley	(17.998)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
39.151	IMAX Corp	Bank of America		(35.031)	Inovalon Holdings Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(107.665)			Merrill Lynch	(21.019)
(23.098)	IMAX Corp	Morgan Stanley	48.585	(33.745)	Inphi Corp	Bank of America	
(18.935)	Immersion Corp	Morgan Stanley	(44.876)			Merrill Lynch	(51.336)
(27.538)	ImmunoGen Inc	Bank of America		(17.647)	Insight Enterprises Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(15.972)			Merrill Lynch	(43.235)
(15.603)	ImmunoGen Inc	Goldman Sachs	(9.050)	16.385	Insight Enterprises Inc	Morgan Stanley	224.311
(84.829)	Immunomedics Inc	Goldman Sachs	(225.595)	(41.475)	Insmmed Inc	Bank of America	
(872)	Immunomedics Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(45.208)
		Merrill Lynch	(2.965)	75.104	Insperty Inc	Bank of America	
(7.972)	Impac Mortgage Holdings Inc	Morgan Stanley	—			Merrill Lynch	292.906
7.814	Imperva Inc	Morgan Stanley	12.893	23.465	Insperty Inc	Morgan Stanley	77.435
9.288	Incyte Corp	Bank of America		1.038	Insperty Inc	Goldman Sachs	4.048
		Merrill Lynch	13.549	(121.160)	Installed Building Products Inc	Bank of America	
3.853	Incyte Corp	Goldman Sachs	5.165			Merrill Lynch	(489.666)
617	Incyte Corp	Morgan Stanley	684	(587)	Installed Building Products Inc	Morgan Stanley	(37)
10.896	Independence Contract	Bank of America		(32.325)	Insteel Industries Inc	Bank of America	
	Drilling Inc	Merrill Lynch	(6.756)			Merrill Lynch	(56.005)
5.620	Independence Contract			668	Instructure Inc	Morgan Stanley	1.536
	Drilling Inc	Goldman Sachs	(3.484)	2.094	Insulet Corp	Bank of America	
24.377	Independence Contract					Merrill Lynch	16.459
	Drilling Inc	Morgan Stanley	(12.540)	(13.326)	Insulet Corp	Bank of America	
(14.176)	Independence Holding Co	Morgan Stanley	9.923			Merrill Lynch	(104.742)
(22.461)	Independence Holding Co	Bank of America		15.954	Integer Holdings Corp	Morgan Stanley	2.742
		Merrill Lynch	(55.029)	710	Integer Holdings Corp	Goldman Sachs	426
61.972	Independent Bank Corp/MI	Bank of America		4.943	Integer Holdings Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	74.366			Merrill Lynch	2.966
13.578	Independent Bank Corp/MI	Goldman Sachs	16.294	(98.838)	Integra LifeSciences	Bank of America	
18.226	Independent Bank Corp/MI	Morgan Stanley	4.557		Holdings Corp	Merrill Lynch	(145.292)
(22.583)	Independent Bank	Bank of America		(47.073)	Integrated Device	Bank of America	
	Corp/Rockland MA	Merrill Lynch	(65.523)		Technology Inc	Merrill Lynch	(128.980)
(14.482)	Independent Bank			(26.130)	Integrated Device		
	Corp/Rockland MA	Morgan Stanley	(57.277)		Technology Inc	Morgan Stanley	(35.164)
(5.823)	Independent Bank Group Inc	Bank of America		(17.979)	Intel Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	8.456			Merrill Lynch	(30.744)
16.721	Infinera Corp	Morgan Stanley	(11.577)	(20.474)	Intellia Therapeutics Inc	Bank of America	
147.945	Infinera Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(32.554)
		Merrill Lynch	(149.468)	(105.810)	Intelsat SA	Morgan Stanley	(938.570)
(45.047)	Infinera Corp	Morgan Stanley	16.310	102.702	Inter Parfums Inc	Bank of America	
(23.217)	Information Services Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	477.564
		Merrill Lynch	770	3.024	Inter Parfums Inc	Goldman Sachs	14.062
6.920	Infrastructure and Energy	Bank of America		47	Inter Parfums Inc	Morgan Stanley	85
	Alternatives Inc	Merrill Lynch	(1.548)	(10.991)	Interactive Brokers	Bank of America	
3.368	Infrastructure and Energy				Group Inc 'A'	Merrill Lynch	48.470
	Alternatives Inc	Goldman Sachs	(432)	(8.517)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
4.594	Infrastructure and Energy					Merrill Lynch	9.624
	Alternatives Inc	Morgan Stanley	(1.194)	66.873	Intercontinental Exchange Inc	Bank of America	
46.759	Ingersoll-Rand Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(24.074)
		Merrill Lynch	(19.171)	49.515	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	(10.398)
622	Ingersoll-Rand Plc	Goldman Sachs	(255)	5.207	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs	(1.875)
21.248	Ingersoll-Rand Plc	Morgan Stanley	(35.469)	15.912	InterDigital Inc/PA	Bank of America	
(5.732)	Ingevity Corp	Bank of America				Merrill Lynch	17.503
		Merrill Lynch	9.916	34.839	Interface Inc	Goldman Sachs	5.226
2.021	Ingles Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	1.617	135.036	Interface Inc	Bank of America	
48.341	Ingles Markets Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	20.255
		Merrill Lynch	3.232	12.032	Interface Inc	Morgan Stanley	(2.406)
155.556	InnerWorkings Inc	Bank of America		(2.773)	Internap Corp	Morgan Stanley	22.194
		Merrill Lynch	18.667	(6.949)	Internap Corp	Bank of America	
(1.029)	Innophos Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	5.283
		Merrill Lynch	(1.406)	(892)	International Business	Bank of America	
91.407	Innospec Inc	Bank of America			Machines Corp	Merrill Lynch	1.383
		Merrill Lynch	297.073	(46.308)	International Business		
6.034	Innospec Inc	Goldman Sachs	19.611		Machines Corp	Morgan Stanley	92.290
11.555	Innospec Inc	Morgan Stanley	26.660	897	International Flavors		
26.308	Innoviva Inc	Goldman Sachs	4.272		& Fragrances Inc	Goldman Sachs	63
15.656	Innoviva Inc	Morgan Stanley	(7.012)	15.439	International Flavors	Bank of America	
103.615	Innoviva Inc	Bank of America			& Fragrances Inc	Merrill Lynch	(2.089)
		Merrill Lynch	15.972	13.983	International Flavors		
(1.974)	Inogen Inc	Morgan Stanley	(10.556)		& Fragrances Inc	Morgan Stanley	(12.504)
17.808	Inovalon Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	3.562				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
16.192	International Game Technology Plc	Bank of America		(1.044)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(66.630)			Merrill Lynch	(1.984)
10.446	International Game Technology Plc	Goldman Sachs	(42.985)	(85.438)	Iovance Biotherapeutics Inc	Bank of America	
133.728	International Game Technology Plc					Merrill Lynch	21.360
(20.129)	International Paper Co	Morgan Stanley	(328.302)	(5.464)	Iovance Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	1.366
		Bank of America		(1.834)	IQVIA Holdings Inc	Morgan Stanley	3.467
		Merrill Lynch	8.308	(14.741)	IQVIA Holdings Inc	Bank of America	
(116.828)	International Seaways Inc	Goldman Sachs	(155.196)			Merrill Lynch	31.841
(16.595)	International Speedway Corp 'A'	Bank of America		3.172	iRadimed Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.298)			Merrill Lynch	481
78.164	Interpublic Group of Cos Inc/The	Bank of America		3.340	iRadimed Corp	Goldman Sachs	424
		Merrill Lynch	(132.879)	2.762	iRadimed Corp	Morgan Stanley	312
11.997	Interpublic Group of Cos Inc/The			(6.817)	iRhythm Technologies Inc	Morgan Stanley	(49.628)
18.154	Intersect ENT Inc	Goldman Sachs	(20.395)	14.683	Iridium Communications Inc	Goldman Sachs	51.391
		Bank of America		15.174	Iridium Communications Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	13.470			Merrill Lynch	53.109
12.042	Intersect ENT Inc	Morgan Stanley	7.903	64.823	Iridium Communications Inc	Morgan Stanley	218.656
5.123	Intersect ENT Inc	Goldman Sachs	5.733	6.002	iRobot Corp	Morgan Stanley	10.624
431	INTL. FCStone Inc	Bank of America		39.459	iRobot Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.336			Merrill Lynch	144.815
939	INTL. FCStone Inc	Goldman Sachs	2.911	18.524	Iron Mountain Inc (Reit)	Bank of America	
(13.256)	Intra-Cellular Therapies Inc	Bank of America				Merrill Lynch	12.011
		Merrill Lynch	(31.019)	26.366	Iron Mountain Inc (Reit)	Morgan Stanley	22.411
(21.290)	Intra-Cellular Therapies Inc	Morgan Stanley	(33.638)	5.342	Iron Mountain Inc (Reit)	Goldman Sachs	3.896
(5.078)	Intrexon Corp	Bank of America		28.881	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.219)			Merrill Lynch	5.776
(24.045)	Intrexon Corp	Morgan Stanley	(22.362)	82.391	Itau Unibanco Holding SA ADR	Goldman Sachs	(116.171)
(10.718)	IntriCon Corp	Goldman Sachs	(17.115)	61.830	Itau Unibanco Holding SA ADR	Morgan Stanley	(140.201)
(1.722)	IntriCon Corp	Morgan Stanley	(3.530)	(76.549)	Iteris Inc	Goldman Sachs	36.744
(6.338)	IntriCon Corp	Bank of America		(27.991)	Iteris Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(11.092)			Merrill Lynch	13.436
(3.632)	Intuit Inc	Bank of America		(56.677)	Iteris Inc	Morgan Stanley	15.846
		Merrill Lynch	(43.003)	(4.195)	Itron Inc	Morgan Stanley	49.482
177	Intuitive Surgical Inc	Bank of America		(4.183)	Itron Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	810			Merrill Lynch	17.046
3.534	Intuitive Surgical Inc	Morgan Stanley	9.948	37.779	ITT Inc	Bank of America	
(5.019)	Intuitive Surgical Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(28.327)
		Merrill Lynch	(30.164)	42.791	ITT Inc	Morgan Stanley	(54.927)
(111.844)	Invacare Corp	Bank of America		74.218	J Alexander's Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	39.145			Merrill Lynch	(7.422)
38.056	Invesco Ltd	Bank of America		10.600	J. Jill Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(40.720)			Merrill Lynch	21.942
122.198	Invesco Ltd	Morgan Stanley	(178.409)	41.413	J. Jill Inc	Goldman Sachs	85.725
2.919	Invesco Ltd	Goldman Sachs	(3.123)	3.440	J. Jill Inc	Morgan Stanley	5.401
348.629	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Bank of America		(4.881)	j2 Global Inc	Morgan Stanley	(1.866)
		Merrill Lynch	94.982	(92.568)	j2 Global Inc	Bank of America	
208.436	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)					Merrill Lynch	(70.375)
30.163	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	40.645	2.007	Jabil Inc	Bank of America	
(10.890)	Investment Technology Group Inc	Goldman Sachs	8.596			Merrill Lynch	1.967
33.334	Investors Bancorp Inc	Bank of America		135.826	Jabil Inc	Morgan Stanley	63.920
(218.669)	Investors Bancorp Inc	Merrill Lynch	1.856	(28.173)	Jack Henry & Associates Inc	Bank of America	
		Morgan Stanley	(2.623)			Merrill Lynch	(81.138)
(378.516)	Investors Real Estate Trust (Reit)	Bank of America		(43.948)	Jack in the Box Inc	Bank of America	
(253.928)	Investors Real Estate Trust (Reit)	Merrill Lynch	(75.753)			Merrill Lynch	381.469
86.612	Invitae Corp	Bank of America		2.138	Jacobs Engineering Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	46.337			Merrill Lynch	4.233
14.654	Invitae Corp	Morgan Stanley	513	1.952	Jacobs Engineering Group Inc	Goldman Sachs	3.865
109.990	Invitae Corp	Goldman Sachs	58.845	1.619	Jacobs Engineering Group Inc	Morgan Stanley	1.570
(73.764)	Invitation Homes Inc (Reit)	Bank of America		135.931	Jagged Peak Energy Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	24.342			Merrill Lynch	(108.282)
(32.950)	Invitation Homes Inc (Reit)	Morgan Stanley	(7.249)	36.569	Jagged Peak Energy Inc	Goldman Sachs	(39.845)
(12.482)	ION Geophysical Corp	Goldman Sachs	39.318	8.293	Jagged Peak Energy Inc	Morgan Stanley	(7.878)
(12.951)	ION Geophysical Corp	Morgan Stanley	19.427	(86.773)	Jamba Inc	Morgan Stanley	(19.958)
				(3.610)	Jamba Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	939
				43.069	James River Group Holdings Ltd	Bank of America	
						Merrill Lynch	28.856
				13.678	James River Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	9.164

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(168.908)	Janus Henderson Group Plc	Goldman Sachs	380.043	(130.643)	KBR Inc	Bank of America	
12.859	Jason Industries Inc	Morgan Stanley	(2.186)			Merrill Lynch	(198.719)
774	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America		15.902	Keane Group Inc	Morgan Stanley	(21.627)
		Merrill Lynch	3.480	7.511	Keane Group Inc	Bank of America	
8.193	Jazz Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	18.813			Merrill Lynch	(12.193)
(11.544)	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	(52.525)	(123.736)	Kearny Financial Corp/MD	Bank of America	
4.246	JBG SMITH Properties (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(55.681)
		Merrill Lynch	9.638	(348.672)	Kearny Financial Corp/MD	Morgan Stanley	(34.867)
1.728	JBG SMITH Properties (Reit)	Goldman Sachs	3.923	12.419	Kearny Financial Corp/MD	Bank of America	
1.210	JBG SMITH Properties (Reit)	Morgan Stanley	1.234			Merrill Lynch	5.589
(88.692)	JC Penney Co Inc	Morgan Stanley	(8.426)	59.602	Kearny Financial Corp/MD	Morgan Stanley	5.960
76.500	Jefferies Financial Group Inc	Bank of America		(3.543)	Kellogg Co	Morgan Stanley	(130)
		Merrill Lynch	(131.580)	80.719	Kellogg Co	Bank of America	
14.562	Jefferies Financial Group Inc	Goldman Sachs	(25.047)			Merrill Lynch	259.915
(53.346)	JELD-WEN Holding Inc	Bank of America		2.207	Kellogg Co	Goldman Sachs	7.107
		Merrill Lynch	(6.616)	1.237	Kellogg Co	Morgan Stanley	3.649
(111.203)	JELD-WEN Holding Inc	Morgan Stanley	45.593	(26.219)	Kemet Corp	Morgan Stanley	(30.414)
(242)	Jernigan Capital Inc (Reit)	Bank of America		(7.638)	Kemet Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(290)			Merrill Lynch	(2.798)
(26.790)	Jernigan Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	(24.111)	(11.011)	Kemper Corp	Morgan Stanley	(235.745)
2.648	JM Smucker Co/The	Bank of America		(2.771)	Kemper Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.350)			Merrill Lynch	(13.994)
30.465	JM Smucker Co/The	Morgan Stanley	(159.338)	4.288	Kennametal Inc	Bank of America	
71.554	JMP Group LLC	Morgan Stanley	2.147			Merrill Lynch	(4.288)
2.541	John B Sanfilippo & Son Inc	Bank of America		(50.835)	Kennametal Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.529			Merrill Lynch	62.213
379	John B Sanfilippo & Son Inc	Morgan Stanley	370	31.729	Kennametal Inc	Morgan Stanley	(55.208)
2.829	John B Sanfilippo & Son Inc	Goldman Sachs	5.470	(33.949)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs	(10.390)
(67.700)	John Bean Technologies Corp	Bank of America		17.310	Key Energy Services Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(209.102)			Merrill Lynch	(2.250)
(23.862)	John Bean Technologies Corp	Morgan Stanley	(34.504)	9.972	Key Energy Services Inc	Morgan Stanley	(9.773)
31.174	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America		64.497	Key Tronic Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	60.789			Merrill Lynch	16.769
7.918	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldman Sachs	15.440	11.081	Key Tronic Corp	Morgan Stanley	3.657
69.799	John Wiley & Sons Inc 'A'	Morgan Stanley	92.190	(66.037)	KeyCorp	Bank of America	
231	Johnson & Johnson	Goldman Sachs	(954)			Merrill Lynch	62.951
72.510	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	(376.459)	87.836	KeyCorp	Morgan Stanley	(99.779)
20.429	Johnson & Johnson	Bank of America		60	Keysight Technologies Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(84.372)			Merrill Lynch	419
(157.547)	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	163.282	(8.115)	Keysight Technologies Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(52.666)
(66.411)	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs	154.108	6.692	Keysight Technologies Inc	Morgan Stanley	49.126
11.692	Jones Lang LaSalle Inc	Bank of America		(198.002)	KeyW Holding Corp/The	Morgan Stanley	(239.582)
		Merrill Lynch	(30.867)	(20.431)	KeyW Holding Corp/The	Bank of America	
2.030	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	(5.359)			Merrill Lynch	(23.700)
2.781	Jounce Therapeutics Inc	Bank of America		2.022	Kforce Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.143)			Merrill Lynch	(279)
7.880	Jounce Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(27.918)	1.121	Kforce Inc	Morgan Stanley	827
6.804	Jounce Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(282)	(2.208)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Bank of America	
10.772	Juniper Networks Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(7.772)
		Merrill Lynch	1.831	(24.850)	Kimball Electronics Inc	Bank of America	
(46.910)	Juniper Networks Inc	Morgan Stanley	(34.390)			Merrill Lynch	(27.335)
2.564	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs	436	45.502	Kimball International Inc 'B'	Bank of America	
4.209	Juniper Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(421)			Merrill Lynch	28.666
8.631	Kadant Inc	Goldman Sachs	28.482	23.094	Kimball International Inc 'B'	Morgan Stanley	11.316
14.361	Kadant Inc	Morgan Stanley	(17.951)	6.118	Kimball International Inc 'B'	Goldman Sachs	3.854
21.128	Kadant Inc	Bank of America		338	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs	(463)
		Merrill Lynch	69.722	12.581	Kimberly-Clark Corp	Bank of America	
2.675	Kaiser Aluminum Corp	Morgan Stanley	6.331			Merrill Lynch	(17.236)
728	Kaiser Aluminum Corp	Bank of America		74.635	Kimco Realty Corp (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	4.899			Merrill Lynch	99.234
(27.218)	Kaman Corp	Bank of America		115.239	Kimco Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	24.200
		Merrill Lynch	(55.797)	25.763	Kimco Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	34.265
(35.906)	Kaman Corp	Morgan Stanley	6.104	194.943	Kinder Morgan Inc/DE	Morgan Stanley	115.016
(266)	Kansas City Southern	Bank of America		11.435	Kinsale Capital Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(106)			Merrill Lynch	29.274
(25.518)	KAR Auction Services Inc	Bank of America		4.265	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	1.493
		Merrill Lynch	596	2.800	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs	7.168
(3.776)	KAR Auction Services Inc	Morgan Stanley	2.667	(9.311)	Kirby Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(33.985)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie	USD	Nombre	Description	Contrepartie	USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
11.403	Kirkland's Inc	Bank of America		320.249	Ladder Capital Corp (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	27.367			Merrill Lynch	173.539
10.674	Kirkland's Inc	Goldman Sachs	25.618	38.061	Ladder Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	21.695
85.125	Kite Realty Group Trust (Reit)	Bank of America		101.506	Ladder Capital Corp (Reit)	Morgan Stanley	17.194
		Merrill Lynch	97.042	89.814	Ladenburg Thalmann	Bank of America	
5.498	Kite Realty Group Trust (Reit)	Morgan Stanley	3.079		Financial Services Inc	Merrill Lynch	(5.389)
83.351	KKR Real Estate Finance	Bank of America		64.380	Ladenburg Thalmann		
	Trust Inc	Merrill Lynch	(2.131)		Financial Services Inc	Goldman Sachs	(3.863)
1.286	KKR Real Estate Finance	Goldman Sachs	(309)	29.974	Ladenburg Thalmann		
	Trust Inc				Financial Services Inc	Morgan Stanley	(1.798)
6.440	KKR Real Estate Finance			(4.737)	Lakeland Bancorp Inc	Bank of America	
	Trust Inc	Morgan Stanley	(44)			Merrill Lynch	(1.895)
(20.747)	KLA-Tencor Corp	Bank of America		75.591	Lakeland Financial Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(70.955)			Merrill Lynch	37.796
(35.591)	KLA-Tencor Corp	Morgan Stanley	(40.218)	25.525	Lakeland Financial Corp	Goldman Sachs	12.763
5.569	Knight-Swift Transportation			15.742	Lakeland Financial Corp	Morgan Stanley	(6.454)
	Holdings Inc	Morgan Stanley	3.694	(5.142)	Lam Research Corp	Bank of America	
(72.533)	Knight-Swift Transportation	Bank of America				Merrill Lynch	2.160
	Holdings Inc	Merrill Lynch	(90.666)	3.677	Lam Research Corp	Morgan Stanley	2.120
(30.971)	Knoll Inc	Bank of America		1.001	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(14.556)			Merrill Lynch	1.832
(30.975)	Knowles Corp	Morgan Stanley	(4.956)	1.180	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Morgan Stanley	1.215
6.252	Knowles Corp	Bank of America		1.059	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Goldman Sachs	1.938
		Merrill Lynch	3.251	7.331	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	(4.487)
2.629	Knowles Corp	Goldman Sachs	1.367	(2.658)	Lancaster Colony Corp	Morgan Stanley	(17.913)
40.353	Kohl's Corp	Bank of America		(5.231)	Lancaster Colony Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	174.728			Merrill Lynch	(9.363)
2.362	Kohl's Corp	Goldman Sachs	10.227	32.299	Landstar System Inc	Bank of America	
49.334	Kohl's Corp	Morgan Stanley	323.151			Merrill Lynch	171.185
104.400	Koninklijke Philips NV	Morgan Stanley	(153.311)	1.143	Landstar System Inc	Goldman Sachs	6.058
4.539	Kopin Corp	Morgan Stanley	999	(45.083)	Lannett Co Inc	Morgan Stanley	(23.891)
12.665	Kopin Corp	Bank of America		(29.840)	Lantheus Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.800			Merrill Lynch	(12.213)
59.907	Kopin Corp	Goldman Sachs	17.972	(15.334)	Laredo Petroleum Inc	Bank of America	
6.301	Koppers Holdings Inc	Goldman Sachs	8.611			Merrill Lynch	10.044
3.048	Koppers Holdings Inc	Morgan Stanley	(650)	46.940	Las Vegas Sands Corp	Bank of America	
13.671	Koppers Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	97.454
		Merrill Lynch	21.190	553	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	818
3.477	Korn/Ferry International	Goldman Sachs	4.937	289	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	751
87.208	Korn/Ferry International	Bank of America		(76.662)	Latam Airlines Group SA ADR	Morgan Stanley	85.861
		Merrill Lynch	123.835	(3.722)	Latam Airlines Group SA ADR	Goldman Sachs	3.601
894	Korn/Ferry International	Morgan Stanley	948	(79.098)	Laureate Education Inc 'A'	Bank of America	
(84.607)	Kosmos Energy Ltd	Morgan Stanley	(32.302)			Merrill Lynch	(144.749)
(116.569)	Kosmos Energy Ltd	Goldman Sachs	(51.107)	(11.644)	Laureate Education Inc 'A'	Morgan Stanley	(12.925)
(40.576)	Kraft Heinz Co/The	Bank of America		(7.643)	Layne Christensen Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	43.416			Merrill Lynch	1.452
(78.577)	Kraft Heinz Co/The	Morgan Stanley	(36.709)	(89.511)	Layne Christensen Co	Morgan Stanley	27.748
(41.666)	Kratos Defense & Security			399	LCI Industries	Bank of America	
	Solutions Inc	Goldman Sachs	(5.417)			Merrill Lynch	1.057
(146.257)	Kratos Defense & Security	Bank of America		11.408	LCI Industries	Morgan Stanley	(37.076)
	Solutions Inc	Merrill Lynch	(19.013)	(13.128)	LCI Industries	Bank of America	
49.783	Kroger Co/The	Bank of America				Merrill Lynch	(34.789)
		Merrill Lynch	10.454	16.045	LCNB Corp	Bank of America	
96.670	Kroger Co/The	Morgan Stanley	32.098			Merrill Lynch	14.477
(3.713)	Kronos Worldwide Inc	Bank of America		5.505	LCNB Corp	Morgan Stanley	4.256
		Merrill Lynch	692	900	LCNB Corp	Goldman Sachs	855
(11.098)	Kronos Worldwide Inc	Morgan Stanley	1.657	21.143	Leaf Group Ltd	Bank of America	
(14.741)	Kulicke & Soffa Industries Inc	Morgan Stanley	(33.260)			Merrill Lynch	3.171
(38.651)	KVH Industries Inc	Bank of America		2.376	Leaf Group Ltd	Goldman Sachs	356
		Merrill Lynch	1.933	511	Lear Corp	Bank of America	
(5.428)	KVH Industries Inc	Goldman Sachs	271			Merrill Lynch	669
(17.865)	L Brands Inc	Bank of America		(288.443)	LegacyTexas Financial	Bank of America	
		Merrill Lynch	(23.046)		Group Inc	Merrill Lynch	349.016
(10.411)	L3 Technologies Inc	Bank of America		(19.986)	LegacyTexas Financial		
		Merrill Lynch	(73.085)		Group Inc	Morgan Stanley	32.577
6.484	La Quinta Holdings Inc	Morgan Stanley	5.641	22.856	Legg Mason Inc	Bank of America	
3.528	La-Z-Boy Inc	Morgan Stanley	9.095			Merrill Lynch	(36.570)
7.150	Laboratory Corp of America			10.968	Legg Mason Inc	Goldman Sachs	(17.549)
	Holdings	Morgan Stanley	39.969	63.585	Leggett & Platt Inc	Morgan Stanley	36.879
(15.396)	Laboratory Corp of America	Bank of America		(9.564)	Leidos Holdings Inc	Bank of America	
	Holdings	Merrill Lynch	(98.377)			Merrill Lynch	(302)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(1.767)	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.396)	37.886	Lincoln National Corp	Bank of America	
31.578	LeMaitre Vascular Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(67.423)
		Merrill Lynch	9.473	95.998	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	(376.029)
525	LendingTree Inc	Morgan Stanley	832	323	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	(123)
678	LendingTree Inc	Bank of America		28.911	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.311			Merrill Lynch	(5.782)
(96.752)	Lennar Corp 'A'	Bank of America		28.973	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Goldman Sachs	(5.795)
		Merrill Lynch	(94.817)				
(22.762)	Lennar Corp 'A'	Morgan Stanley	84.605	391	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Morgan Stanley	20
(14.531)	Lennar Corp 'B'	Bank of America		58.254	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(14.676)			Merrill Lynch	16.341
2.531	Lennox International Inc	Morgan Stanley	5.340	24.375	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Goldman Sachs	7.800
3.800	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Bank of America		67.024	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Morgan Stanley	7.373
		Merrill Lynch	6.329	44.111	Lithia Motors Inc 'A'	Bank of America	
3.947	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	4.717			Merrill Lynch	5.293
7.656	Lexington Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	2.450	5.178	Lithia Motors Inc 'A'	Goldman Sachs	621
(4.823)	LGI Homes Inc	Morgan Stanley	49.466	89.398	Lithia Motors Inc 'A'	Morgan Stanley	(41.920)
28.420	LHC Group Inc	Bank of America		(10.123)	Littelfuse Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	74.176			Merrill Lynch	(61.447)
10.378	LHC Group Inc	Morgan Stanley	31.757	(2.689)	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	(22.507)
2.388	LHC Group Inc	Goldman Sachs	6.233	23.575	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America	
(29.443)	Liberty Broadband Corp 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	(21.453)
		Merrill Lynch	60.538	(39.189)	Live Oak Bancshares Inc	Bank of America	
(513)	Liberty Broadband Corp 'A'	Morgan Stanley	194			Merrill Lynch	(45.067)
(15.184)	Liberty Broadband Corp 'C'	Bank of America		30.877	LivePerson Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	35.682			Merrill Lynch	44.000
(13.590)	Liberty Expedia Holdings 'A'	Morgan Stanley	(20.929)	7.606	LivePerson Inc	Goldman Sachs	10.839
1.928	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	4.434	4.397	LivePerson Inc	Morgan Stanley	4.067
2.861	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	4.406	(84.204)	LKQ Corp	Bank of America	
21.436	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	(70.083)
		Merrill Lynch	49.303	(23.723)	LKQ Corp	Morgan Stanley	(23.486)
7.771	Liberty Global Plc 'A'	Bank of America		2.576	Loews Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(10.646)			Merrill Lynch	(7.857)
12.052	Liberty Global Plc 'A'	Morgan Stanley	(7.713)	(27.087)	Loews Corp	Bank of America	
(2.263)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Goldman Sachs	(2.648)			Merrill Lynch	82.615
(9.262)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Morgan Stanley	3.705	160.490	Loews Corp	Morgan Stanley	(481.470)
(8.646)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America		246	LogMeIn Inc	Bank of America	
(1.496)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Merrill Lynch	(5.214)			Merrill Lynch	(357)
		Goldman Sachs	(1.825)	1.499	LogMeIn Inc	Morgan Stanley	(4.450)
2.513	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Goldman Sachs	3.493	(5.514)	Loral Space & Communications Inc	Bank of America	
8.845	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	1.930
		Merrill Lynch	12.295	(55.937)	Louisiana-Pacific Corp	Bank of America	
20.578	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Bank of America				Merrill Lynch	(128.096)
		Merrill Lynch	28.192	(30.014)	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	(30.014)
40.468	Liberty Oilfield Services 'A'	Bank of America		(33.291)	Lowe's Cos Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	40.525			Merrill Lynch	(390.171)
9.577	Liberty Oilfield Services 'A'	Goldman Sachs	5.020	(1.610)	Lowe's Cos Inc	Morgan Stanley	173
16.577	Liberty Oilfield Services 'A'	Morgan Stanley	(7.522)	(430)	Loxo Oncology Inc	Bank of America	
(5.585)	Liberty Property Trust (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(18.426)
		Merrill Lynch	(5.791)	(144)	Loxo Oncology Inc	Goldman Sachs	(6.170)
(9.581)	Liberty Tax Inc	Bank of America		(23.712)	LPL Financial Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(958)			Merrill Lynch	37.228
(12.703)	Liberty Tax Inc	Goldman Sachs	(1.270)	(2.127)	LPL Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	6.306
27.245	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Bank of America		(11.231)	LSB Industries Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	55.852			Merrill Lynch	3.032
4.323	Life Storage Inc (Reit)	Morgan Stanley	13.099	(15.653)	LSB Industries Inc	Goldman Sachs	4.226
(11.350)	LifePoint Health Inc	Bank of America		(37.483)	LSB Industries Inc	Morgan Stanley	15.368
		Merrill Lynch	18.401	18.877	LSC Communications Inc	Bank of America	
(20.487)	LifePoint Health Inc	Morgan Stanley	(31.328)			Merrill Lynch	21.520
(6.680)	Ligand Pharmaceuticals Inc	Bank of America		1.971	LSC Communications Inc	Goldman Sachs	2.247
		Merrill Lynch	(64.328)	3.195	LSI Industries Inc	Goldman Sachs	(64)
(3.195)	Ligand Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(30.768)	(8.285)	LTC Properties Inc (Reit)	Bank of America	
(10.169)	Lilis Energy Inc	Morgan Stanley	(9.966)			Merrill Lynch	(17.813)
289	Limelight Networks Inc	Morgan Stanley	(14)	14.904	Lululemon Athletica Inc	Bank of America	
(421)	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	50.682
		Merrill Lynch	(1.082)	45.899	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	183.809
(33.214)	Lincoln Electric Holdings Inc	Morgan Stanley	(113.368)	584	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs	3.194
				(2.337)	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	6.163

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(14.917)	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs	45.732	3.192	Marin Software Inc	Bank of America	
16.369	Luminex Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(479)
		Merrill Lynch	39.286	4.734	Marin Software Inc	Goldman Sachs	(710)
1.327	Luminex Corp	Goldman Sachs	3.185	2.918	Marin Software Inc	Morgan Stanley	(584)
(3.330)	Luxoft Holding Inc	Morgan Stanley	16.613	30.460	Marine Products Corp	Morgan Stanley	20.408
14.035	Lydall Inc	Bank of America		5.801	Marine Products Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	21.053			Merrill Lynch	2.726
1.070	Lydall Inc	Goldman Sachs	1.605	(14.670)	Marinus Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
825	Lydall Inc	Morgan Stanley	(165)			Merrill Lynch	(20.685)
(25.726)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Morgan Stanley	(227.840)	(8.340)	Marinus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(10.425)
14.051	M&T Bank Corp	Morgan Stanley	(116.730)	583	Markel Corp	Bank of America	
(79.758)	M&T Bank Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(10.885)
		Merrill Lynch	999.368	(4.292)	Markel Corp	Morgan Stanley	135.671
24.135	M/I Homes Inc	Bank of America		(212)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	11.102			Merrill Lynch	(3.235)
9.632	M/I Homes Inc	Goldman Sachs	4.431	(1.382)	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	(11.547)
66.942	Macatawa Bank Corp	Bank of America		(5.677)	Marlin Business Services Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	87.694			Merrill Lynch	(5.677)
32.528	Macatawa Bank Corp	Goldman Sachs	42.612	25.768	Marriott International Inc/MD 'A'	Morgan Stanley	(44.836)
46.302	Macatawa Bank Corp	Morgan Stanley	40.746	638	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs	2.001
(3.514)	Macerich Co/The (Reit)	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(5.060)	(9.722)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Merrill Lynch	(40.467)
6.598	Macerich Co/The (Reit)	Morgan Stanley	3.365	(6.059)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	(17.663)
(54.624)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Bank of America				Bank of America	
(39.451)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Merrill Lynch	(13.656)	4.645	Marriott Vacations Worldwide Corp	Merrill Lynch	12.892
(1.552)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs	(9.863)	8.008	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America	
3.416	Macquarie Infrastructure Corp	Morgan Stanley	(1.614)			Merrill Lynch	(4.565)
		Bank of America		165.499	Marten Transport Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.518			Merrill Lynch	372.373
(33.695)	Macquarie Infrastructure Corp	Morgan Stanley	(25.945)	24.801	Marten Transport Ltd	Goldman Sachs	55.802
1.090	MacroGenics Inc	Morgan Stanley	1.657	(24.186)	Marvell Technology Group Ltd	Bank of America	
(5.853)	Macy's Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.451)
		Merrill Lynch	(32.074)	81.914	Marvell Technology Group Ltd	Morgan Stanley	(34.908)
1.085	Madison Square Garden Co/The 'A'	Bank of America		2.420	Masco Corp	Bank of America	
120	Madison Square Garden Co/The 'A'	Merrill Lynch	(2.420)			Merrill Lynch	1.936
(1.682)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(268)	5.502	Masimo Corp	Goldman Sachs	21.358
(4.059)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(171.362)	101.392	Masimo Corp	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	408.182
		Merrill Lynch	(386.904)	4.059	Masimo Corp	Morgan Stanley	9.457
(758)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(72.253)	824	Masonite International Corp	Bank of America	
(2.711)	Magellan Health Inc	Morgan Stanley	(5.286)			Merrill Lynch	2.060
(12.669)	MakeMyTrip Ltd	Bank of America		3.875	Masonite International Corp	Morgan Stanley	4.263
		Merrill Lynch	(15.203)	(23.578)	MasTec Inc	Morgan Stanley	24.757
(6.219)	MakeMyTrip Ltd	Morgan Stanley	(2.799)	(7.052)	MasTec Inc	Bank of America	
(8.956)	Mallinckrodt Plc	Goldman Sachs	(13.255)			Merrill Lynch	(648)
(41.134)	Mallinckrodt Plc	Morgan Stanley	(41.134)	42.265	MasTec Inc	Bank of America	
(14.388)	Mammoth Energy Services Inc	Morgan Stanley	(40.544)			Merrill Lynch	(54.945)
(1.302)	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	690	24.530	Mastercard Inc 'A'	Goldman Sachs	4.661
(23.010)	Manhattan Associates Inc	Bank of America		8.370	Mastercard Inc 'A'	Morgan Stanley	4.771
		Merrill Lynch	21.325	33.354	Matador Resources Co	Bank of America	
32.051	Manitowoc Co Inc/The	Bank of America				Merrill Lynch	(128.661)
		Merrill Lynch	(23.864)	52.920	Matador Resources Co	Morgan Stanley	(137.374)
4.863	Manitowoc Co Inc/The	Goldman Sachs	(2.918)	(6.359)	Match Group Inc	Bank of America	
19.092	Manitowoc Co Inc/The	Morgan Stanley	(35.950)			Merrill Lynch	(17.360)
20.836	ManpowerGroup Inc	Bank of America		2.278	Materion Corp	Morgan Stanley	(2.506)
		Merrill Lynch	(51.419)	1.843	Materion Corp	Bank of America	
84.571	Marathon Oil Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(737)
		Merrill Lynch	15.223	3.009	Materion Corp	Goldman Sachs	(1.204)
134.457	Marathon Oil Corp	Morgan Stanley	591.836	(12.678)	Matrix Service Co	Bank of America	
5.408	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs	21.416			Merrill Lynch	(23.452)
41.058	Marcus & Millichap Inc	Bank of America		(1.217)	Mattel Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(9.337)			Merrill Lynch	(499)
2.564	Marcus & Millichap Inc	Goldman Sachs	(333)	(56.001)	Mattel Inc	Goldman Sachs	(22.960)
79.430	Marcus Corp/The	Bank of America		5.875	Matthews International Corp 'A'	Goldman Sachs	17.625
		Merrill Lynch	(19.858)	46.838	Matthews International Corp 'A'	Bank of America	
4.033	Marcus Corp/The	Goldman Sachs	(1.008)			Merrill Lynch	140.514
5.209	Marcus Corp/The	Morgan Stanley	(2.605)	(4.826)	Maui Land & Pineapple Co Inc	Goldman Sachs	(8.446)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(27.940)	Maui Land & Pineapple Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42.016)	20.674	Medpace Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.395
62.615	Maxim Integrated Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	76.539	350	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	(60)
(117.112)	MAXIMUS Inc	Bank of America Merrill Lynch	32.428	18.297	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs	15.004
(49.873)	MaxLinear Inc	Morgan Stanley	3.990	42.504	Medtronic Plc	Bank of America Merrill Lynch	76.720
2.403	MaxLinear Inc	Goldman Sachs	60	7.811	Medtronic Plc	Morgan Stanley	6.609
2.124	MaxLinear Inc	Bank of America Merrill Lynch	(408)	927	Medtronic Plc	Goldman Sachs	1.673
(112.431)	Maxwell Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.249	(14.322)	Meet Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(5.729)
(19.306)	Maxwell Technologies Inc	Goldman Sachs	386	(21.527)	Melinta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(6.026)
(24.417)	Maxwell Technologies Inc	Morgan Stanley	488	(4.178)	Melinta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.342
(10.928)	MBIA Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.192	17.596	MellanoX Technologies Ltd	Morgan Stanley	28.154
(100.532)	MBIA Inc	Morgan Stanley	40.185	(2.250)	MercadoLibre Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24.087)
(20.756)	MBIA Inc	Goldman Sachs	9.133	(4.024)	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	8.607
69.608	MBT Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	31.324	37.921	Mercantile Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	33.721
1.804	MBT Financial Corp	Morgan Stanley	(90)	11.834	Mercantile Bank Corp	Goldman Sachs	9.414
85.311	MCBC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	91.283	14.267	Mercantile Bank Corp	Morgan Stanley	(3.187)
2.218	MCBC Holdings Inc	Morgan Stanley	(466)	6.757	Merchants Bancorp/IN	Bank of America Merrill Lynch	16.487
2.404	McCormick & Co Inc/MD 'non-voting share'	Morgan Stanley	(3.928)	6.374	Merchants Bancorp/IN	Goldman Sachs	15.553
30.866	McCormick & Co Inc/MD 'non-voting share'	Bank of America Merrill Lynch	(113.587)	16.560	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	14.699
4.630	McCormick & Co Inc/MD 'non-voting share'	Goldman Sachs	(17.038)	76.334	Merck & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	42.747
(40.720)	McDermott International Inc	Goldman Sachs	666	(20.052)	Mercury General Corp	Morgan Stanley	12.432
(118.985)	McDermott International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(437.068)	13.681	Mercury General Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.407
(73.166)	McDermott International Inc	Morgan Stanley	(13.288)	315	Mercury General Corp	Goldman Sachs	309
30.680	McDonald's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(63.201)	(104.608)	Mercury Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(309.640)
3.020	McDonald's Corp	Goldman Sachs	(6.221)	(7.359)	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	(15.895)
106.144	McGrath RentCorp	Bank of America Merrill Lynch	72.419	26.647	Meredith Corp	Bank of America Merrill Lynch	30.607
10.096	McGrath RentCorp	Goldman Sachs	8.380	43.729	Meredith Corp	Morgan Stanley	12.368
2.511	McGrath RentCorp	Morgan Stanley	1.758	2.941	Meredith Corp	Goldman Sachs	690
11.974	McKesson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(82.381)	(9.128)	Meredith Corp	Goldman Sachs	(8.672)
205	McKesson Corp	Morgan Stanley	(381)	131.470	Meridian Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	46.015
365	McKesson Corp	Goldman Sachs	(2.511)	58.820	Meridian Bancorp Inc	Goldman Sachs	20.587
159.042	MDC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	405.817	12.060	Meridian Bancorp Inc	Morgan Stanley	603
17.777	MDC Holdings Inc	Goldman Sachs	49.598	3.215	Merit Medical Systems Inc	Morgan Stanley	(8.841)
16.535	MDC Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	827	27.790	Meritage Homes Corp	Bank of America Merrill Lynch	93.925
(18.983)	MDU Resources Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.519	97.747	Meritage Homes Corp	Morgan Stanley	180.832
3.046	MDU Resources Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	388	2.081	Meritage Homes Corp	Goldman Sachs	1.643
23.407	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	2.215	7.524	Meritor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.213)
1.432	MedCath Corp***	Morgan Stanley	(11.112)	29.324	Meritor Inc	Morgan Stanley	(35.189)
1.716	Media General Inc-CVR***	Bank of America Merrill Lynch	232	(7.586)	Merrimack Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	303
1.127	Media General Inc-CVR***	Morgan Stanley	152	(7.287)	Mesa Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	83.582
28.270	Medical Properties Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	12.156	(2.013)	Mesa Laboratories Inc	Morgan Stanley	12.239
(10.810)	Medicines Co/The	Morgan Stanley	(25.295)	(1.050)	Mesa Laboratories Inc	Goldman Sachs	1.677
(3.474)	Medidata Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.705)	(36.465)	Meta Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(224.097)
5.344	Medifast Inc	Morgan Stanley	45.078	(15.946)	Methode Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.144
(20.809)	Medifast Inc	Bank of America Merrill Lynch	(343.140)	(8.815)	Methode Electronics Inc	Morgan Stanley	18.512
(5.216)	MEDNAX Inc	Morgan Stanley	5.425	(127.446)	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	235.775
2.107	MEDNAX Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.339)	(2.198)	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.407
				(2.044)	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	42.985
				(40.532)	MFA Financial Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(5.067)

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

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(91.068)	MGE Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(282.311)	(16.240)	Mistras Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.761)
21.253	MGIC Investment Corp	Goldman Sachs	(1.807)	(9.116)	Mitek Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.646)
60.840	MGIC Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.171)	665	MKS Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.245
1.299	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	(305)	1.194	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	3.350
(105.004)	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	23.122	4.515	Mobile Mini Inc	Goldman Sachs	6.058
89.640	MGM Growth Properties LLC 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	129.978	5.735	Mobile Mini Inc	Morgan Stanley	7.417
(183.058)	MGM Growth Properties LLC 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(303.123)	(3.763)	Mobile Mini Inc	Morgan Stanley	(2.666)
(73.356)	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	(8.803)	41.547	Mobile Mini Inc	Bank of America Merrill Lynch	62.397
(53.782)	MGM Resorts International	Morgan Stanley	114.783	51.012	MobileIron Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.652
(4.361)	MGP Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.105)	55.468	MobileIron Inc	Goldman Sachs	8.320
57.674	Michael Kors Holdings Ltd	Morgan Stanley	(401.349)	43.437	MobileIron Inc	Morgan Stanley	10.859
25.070	Michael Kors Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(159.660)	56.040	Model N Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.611
6.914	Michaels Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	559	1.095	Model N Inc	Goldman Sachs	493
(36.645)	Michaels Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(5.497)	3.057	Model N Inc	Morgan Stanley	459
21.706	Michaels Cos Inc/The	Morgan Stanley	4.341	164.269	Modine Manufacturing Co	Bank of America Merrill Lynch	(14.732)
(52.867)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(243.188)	29.433	Modine Manufacturing Co	Morgan Stanley	(37.131)
(17.320)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	(79.672)	21.241	Modine Manufacturing Co	Goldman Sachs	(2.124)
(39.391)	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(228.517)	5.549	Moelis & Co 'A'	Goldman Sachs	9.184
(29.360)	Micron Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(149.807)	813	Moelis & Co 'A'	Morgan Stanley	244
(3.297)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	11.424	199.493	Moelis & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	403.900
(22.630)	Microsoft Corp	Morgan Stanley	(61.865)	(8.314)	Mohawk Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	24.194
6.253	MicroStrategy Inc 'A'	Goldman Sachs	29.889	(49.971)	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(92.446)
4.086	MicroStrategy Inc 'A'	Morgan Stanley	10.174	2.498	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	(2.644)
62.267	MicroStrategy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	297.636	(31.318)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Morgan Stanley	5.775
(4.435)	MicroStrategy Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.768)	34.134	Molson Coors Brewing Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	48.129
(4.167)	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(16.668)	6.211	Molson Coors Brewing Co 'B'	Goldman Sachs	8.758
(38.778)	Middleby Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	160.541	(4.383)	Momenta Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(775)
(22.411)	Middleby Corp/The	Morgan Stanley	565.318	(19.080)	Mondelez International Inc 'A'	Morgan Stanley	7.404
(97.076)	Middlesex Water Co	Bank of America Merrill Lynch	(286.374)	(14.643)	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2.196
(49.466)	Midland States Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33.637)	19.336	MoneyGram International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.061)
(22.682)	MidSouth Bancorp Inc	Morgan Stanley	3.402	(9.585)	MongoDB Inc	Morgan Stanley	(64.313)
(27.685)	MidSouth Bancorp Inc	Goldman Sachs	1.384	(63.897)	Monmouth Real Estate Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(10.765)
25.363	Milacron Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	254	5.618	Monolithic Power Systems Inc	Goldman Sachs	42.247
7.470	Milacron Holdings Corp	Goldman Sachs	75	2.080	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	8.757
23.731	Milacron Holdings Corp	Morgan Stanley	(14.314)	41.465	Monolithic Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	311.817
59.486	Miller Industries Inc/TN	Bank of America Merrill Lynch	47.589	(2.484)	Monotype Imaging Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.221)
6.186	Miller Industries Inc/TN	Goldman Sachs	4.949	(40.015)	Monro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38.014)
24.865	Miller Industries Inc/TN	Morgan Stanley	6.216	(66.702)	Monro Inc	Goldman Sachs	(63.367)
941	MINDBODY Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.529	(5.904)	Monsanto Co	Bank of America Merrill Lynch	(13.402)
(4.326)	MINDBODY Inc 'A'	Morgan Stanley	(6.165)	(2.568)	Monsanto Co	Goldman Sachs	(5.829)
(1.126)	Minerals Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.048)	(48.025)	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	(83.512)
(3.967)	Minerals Technologies Inc	Morgan Stanley	(4.583)	(48.979)	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(159.427)
(70.589)	Minerva Neurosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63.331)	(1.883)	Moody's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.126)
(12.193)	Minerva Neurosciences Inc	Goldman Sachs	(23.509)	(573)	Moody's Corp	Morgan Stanley	1.037
16.950	Miragen Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.051)	(27.076)	Moog Inc 'A'	Morgan Stanley	28.159
25.231	Miragen Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(4.542)	509	Morgan Stanley	Goldman Sachs	(1.775)
6.048	Miragen Therapeutics Inc	Morgan Stanley	423	167.973	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	(659.589)
(30.648)	Mirati Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(205.342)				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
7.795	Morningstar Inc	Bank of America Merrill Lynch	55.422	3.170	Natera Inc	Bank of America Merrill Lynch	507
254	Morningstar Inc	Morgan Stanley	1.077	3.229	National Bank Holdings Corp 'A'	Goldman Sachs	6.329
3.427	Morningstar Inc	Goldman Sachs	24.366	6.078	National Bank Holdings Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	11.913
(102.258)	Mosaic Co/The	Morgan Stanley	(188.453)	491	National Bank Holdings Corp 'A'	Morgan Stanley	241
(60.486)	Motorcar Parts of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.234)	(50.420)	National Bankshares Inc	Morgan Stanley	5.042
3.876	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs	5.000	886	National Beverage Corp	Morgan Stanley	5.219
18.412	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	23.751	(1.027)	National Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.696)
29.512	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	(1.180)	(4.220)	National Beverage Corp	Goldman Sachs	(27.514)
(11.142)	Movado Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(103.281)	(1.119)	National Commerce Corp	Morgan Stanley	(364)
11.166	MRC Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.434)	(31.584)	National Fuel Gas Co	Bank of America Merrill Lynch	(41.691)
54.889	MRC Global Inc	Morgan Stanley	(5.308)	3.872	National General Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.022
2.626	MRC Global Inc	Goldman Sachs	(1.156)	21.658	National General Holdings Corp	Morgan Stanley	8.952
36.906	MSA Safety Inc	Bank of America Merrill Lynch	148.731	(17.972)	National Health Investors Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(76.201)
1.503	MSA Safety Inc	Morgan Stanley	5.155	3.060	National HealthCare Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.547
11.268	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(20.733)	1.105	National HealthCare Corp	Goldman Sachs	3.448
705	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Morgan Stanley	(2.045)	395	National HealthCare Corp	Morgan Stanley	589
(265)	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(292)	13.122	National Instruments Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.604
(42.490)	MSCI Inc	Morgan Stanley	(221.857)	978	National Instruments Corp	Morgan Stanley	116
(757)	MTS Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	(409)	5.657	National Instruments Corp	Goldman Sachs	3.200
(2.089)	Mueller Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(230)	(55.090)	National Oilwell Varco Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.371
10.000	Mueller Industries Inc	Goldman Sachs	9.875	(64.919)	National Oilwell Varco Inc	Morgan Stanley	(143.735)
(16.086)	Mueller Water Products Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3.217)	3.527	National Research Corp	Goldman Sachs	1.411
(82.364)	Multi-Color Corp	Bank of America Merrill Lynch	(420.056)	10.434	National Research Corp	Morgan Stanley	8.347
87.847	Murphy Oil Corp	Morgan Stanley	(95.753)	1.847	National Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	739
3.091	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs	(835)	19.655	National Retail Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	44.224
2.657	Murphy USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.809)	88.113	National Retail Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	198.254
705	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	1.036	6.399	National Retail Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	9.215
(1.656)	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	(975)	292.994	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	533.249
2.257	Murphy USA Inc	Goldman Sachs	(4.085)	8.755	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Goldman Sachs	15.934
4.150	MutualFirst Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.413	8.482	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Morgan Stanley	16.116
2.138	MutualFirst Financial Inc	Goldman Sachs	5.880	(4.912)	National Vision Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19.844)
1.664	MutualFirst Financial Inc	Morgan Stanley	1.498	(34.179)	National Vision Holdings Inc	Morgan Stanley	(99.183)
(31.919)	Mylan NV	Morgan Stanley	11.390	83.339	Nationstar Mortgage Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.501)
(8.650)	MyoKardia Inc	Morgan Stanley	23.355	(7.171)	Natural Gas Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.434
(3.647)	MyoKardia Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.553)	20.284	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Morgan Stanley	(2.434)
979	Myriad Genetics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.839	18.055	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Bank of America Merrill Lynch	—
1.828	Myriad Genetics Inc	Goldman Sachs	5.301	17.753	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Goldman Sachs	—
1.902	Myriad Genetics Inc	Morgan Stanley	2.530	6.581	Natural Health Trends Corp	Bank of America Merrill Lynch	11.912
9.661	Nabors Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.314)	11.560	Natural Health Trends Corp	Goldman Sachs	20.924
(4.135)	NACCO Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8.890)	2.829	Natural Health Trends Corp	Morgan Stanley	4.272
35.546	Nanometrics Inc	Bank of America Merrill Lynch	75.825	(75.480)	Nature's Sunshine Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.774)
626	Nanometrics Inc	Goldman Sachs	1.670	(9.741)	Nature's Sunshine Products Inc	Morgan Stanley	3.409
40.673	NanoString Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	79.719				
14.993	NanoString Technologies Inc	Morgan Stanley	(2.999)				
73.315	NanoString Technologies Inc	Goldman Sachs	143.697				
(9.813)	Napco Security Technologies Inc	Goldman Sachs	(1.472)				
(56.419)	Napco Security Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.463)				
(59.523)	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	(158.666)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(1.266)	Natus Medical Inc	Bank of America		(83.400)	New York Inc (Reit)	Goldman Sachs	(46.704)
		Merrill Lynch	(275)	(135.629)	New York Inc (Reit)	Morgan Stanley	(39.332)
(15.100)	Natus Medical Inc	Morgan Stanley	(16.853)	(365.848)	New York Mortgage	Bank of America	
(133.581)	Navient Corp	Bank of America			Trust Inc (Reit)	Merrill Lynch	(20.122)
		Merrill Lynch	8.015	(57.990)	New York Mortgage		
(330.551)	Navigant Consulting Inc	Bank of America			Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(3.189)
		Merrill Lynch	(343.773)	(103.275)	New York Mortgage		
(26.612)	Navios Maritime				Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	4.647
	Acquisition Corp	Morgan Stanley	(40)	(347.899)	New York Times Co/The 'A'	Bank of America	
17.157	Navistar International Corp	Morgan Stanley	(27.623)			Merrill Lynch	34.874
(5.392)	Navistar International Corp	Bank of America		(9.425)	New York Times Co/The 'A'	Morgan Stanley	1.908
		Merrill Lynch	1.887	(54.124)	Newell Brands Inc	Bank of America	
7.760	Navistar International Corp	Bank of America				Merrill Lynch	120.711
		Merrill Lynch	(4.407)	1.656	Newfield Exploration Co	Bank of America	
(1.016)	NBT Bancorp Inc	Bank of America				Merrill Lynch	397
		Merrill Lynch	102	69.777	Newmark Group Inc 'A'	Bank of America	
(19.439)	NCR Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(52.333)
		Merrill Lynch	10.108	1.320	Newmark Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(990)
(6.625)	NCR Corp	Morgan Stanley	5.267	2.875	Newmark Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(633)
(30.278)	Nektar Therapeutics	Bank of America		1.627	NewMarket Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.923			Merrill Lynch	36.786
4.553	Nektar Therapeutics	Morgan Stanley	5.915	(5.693)	NewMarket Corp	Morgan Stanley	(73.116)
(51.035)	Nelnet Inc 'A'	Bank of America		20.191	Newmont Mining Corp	Goldman Sachs	(9.288)
		Merrill Lynch	(58.305)	196.261	Newmont Mining Corp	Morgan Stanley	176.855
(10.396)	Neogen Corp	Bank of America		137.918	Newmont Mining Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(36.386)			Merrill Lynch	(63.379)
(23.989)	NeoGenomics Inc	Bank of America		(53.368)	Newpark Resources Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(10.795)			Merrill Lynch	(10.674)
(28.688)	Neos Therapeutics Inc	Bank of America		(7.145)	News Corp 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	15.778			Merrill Lynch	3.715
(21.409)	Neos Therapeutics Inc	Morgan Stanley	5.352	(143.818)	News Corp 'A'	Morgan Stanley	88.905
1.932	NetApp Inc	Bank of America		(121.167)	News Corp 'A'	Goldman Sachs	63.189
		Merrill Lynch	(2.297)	(110.451)	News Corp 'B'	Bank of America	
67.616	NetApp Inc	Morgan Stanley	451			Merrill Lynch	55.226
(16.674)	NetApp Inc	Bank of America		(35.138)	Newtek Business	Bank of America	
		Merrill Lynch	9.715		Services Corp	Merrill Lynch	(46.031)
(7.806)	Nefflix Inc	Morgan Stanley	(180.475)	108.368	Nexa Resources SA	Goldman Sachs	(110.269)
28.683	NETGEAR Inc	Bank of America		46.622	Nexa Resources SA	Morgan Stanley	(38.230)
		Merrill Lynch	94.654	118.679	Nexeo Solutions Inc	Bank of America	
882	NETGEAR Inc	Goldman Sachs	2.911			Merrill Lynch	32.043
2.167	NETGEAR Inc	Morgan Stanley	(2.492)	17.410	Nexeo Solutions Inc	Goldman Sachs	4.701
(37.635)	NetScout Systems Inc	Bank of America		14.142	Nexeo Solutions Inc	Morgan Stanley	(2.828)
		Merrill Lynch	4.999	4.761	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America	
(10.879)	NetScout Systems Inc	Morgan Stanley	3.828			Merrill Lynch	(3.095)
(1.931)	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America		14.726	Nexstar Media Group Inc 'A'	Morgan Stanley	55.514
		Merrill Lynch	(7.917)	(5.041)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America	
4.392	Nevro Corp	Bank of America				Merrill Lynch	3.277
		Merrill Lynch	19.717	1.691	Nexstar Media Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.099)
(4.309)	Nevro Corp	Bank of America		(15.500)	NextEra Energy Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.395)			Merrill Lynch	(91.140)
(8.238)	Nevro Corp	Morgan Stanley	(56.760)	66.824	NIC Inc	Bank of America	
630	Nevro Corp	Morgan Stanley	4.341			Merrill Lynch	(13.365)
(33.554)	New Jersey Resources Corp	Morgan Stanley	(18.129)	49.332	NIC Inc	Goldman Sachs	(9.866)
10.321	New Jersey Resources Corp	Bank of America		30.304	Nicholas Financial Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	15.482			Merrill Lynch	(3.636)
48.013	New Media Investment	Bank of America		(13.191)	Nicolet Bankshares Inc	Bank of America	
	Group Inc	Merrill Lynch	11.523			Merrill Lynch	(27.437)
4.981	New Media Investment			10.059	Nielsen Holdings Plc	Bank of America	
	Group Inc	Goldman Sachs	1.195			Merrill Lynch	(7.242)
1.809	New Media Investment			(73.931)	Nielsen Holdings Plc	Morgan Stanley	84.281
	Group Inc	Morgan Stanley	109	(84.916)	NIKE Inc 'B'	Morgan Stanley	(407.776)
49.132	New Relic Inc	Bank of America		5.134	Nine Energy Service Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	742.876			Merrill Lynch	(4.414)
11.306	New Relic Inc	Morgan Stanley	316.388	635	Nine Energy Service Inc	Morgan Stanley	(940)
5.373	New Relic Inc	Goldman Sachs	81.240	1.863	Nine Energy Service Inc	Goldman Sachs	(1.397)
(118.533)	New Senior Investment	Bank of America		(13.521)	NiSource Inc	Bank of America	
	Group Inc (Reit)	Merrill Lynch	(16.180)			Merrill Lynch	(2.858)
(77.941)	New York Community	Bank of America		(74.284)	NiSource Inc	Morgan Stanley	(54.970)
	Bancorp Inc	Merrill Lynch	29.618	(25.535)	NL Industries Inc	Bank of America	
(105.108)	New York Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(33.719)
		Merrill Lynch	(58.860)	(8.386)	NL Industries Inc	Goldman Sachs	(17.611)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
1.700	nLight Inc	Bank of America		31.481	NRG Yield Inc 'A'	Goldman Sachs	2.204
(14.511)	NMI Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	13.107	23.913	NRG Yield Inc 'A'	Morgan Stanley	3.826
(99.611)	NN Inc	Morgan Stanley	1.746	24.427	NRG Yield Inc 'C'	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	(2.123)
		Merrill Lynch	79.689	23.375	NRG Yield Inc 'C'	Morgan Stanley	(1.169)
85.428	Noble Corp Plc	Bank of America		2.332	NRG Yield Inc 'C'	Goldman Sachs	(181)
		Merrill Lynch	8.543	1.863	Nuance Communications Inc	Bank of America	
84.379	Noble Corp Plc	Morgan Stanley	(16.876)			Merrill Lynch	1.621
2.772	Noble Corp Plc	Goldman Sachs	277	(18.604)	Nucor Corp	Morgan Stanley	(80.317)
1.964	Nomad Foods Ltd	Bank of America		(43.634)	Nucor Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	118			Merrill Lynch	(96.867)
4.531	Nomad Foods Ltd	Morgan Stanley	362	5.260	Nutanix Inc 'A'	Bank of America	
246.268	Nordic American Tankers Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(12.045)
		Merrill Lynch	107.127	(13.008)	Nutanix Inc 'A'	Morgan Stanley	(23.705)
95.100	Nordic American Tankers Ltd	Goldman Sachs	41.369	1.340	Nutanix Inc 'A'	Goldman Sachs	(3.069)
34.970	Nordic American Tankers Ltd	Morgan Stanley	8.917	14.649	Nutrisystem Inc	Bank of America	
(18.454)	Nordson Corp	Bank of America				Merrill Lynch	55.343
		Merrill Lynch	74.370	46.187	Nutrisystem Inc	Morgan Stanley	114.616
20.085	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	63.669	(29.783)	NuVasive Inc	Bank of America	
7.540	Nordstrom Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(64.033)
		Merrill Lynch	(6.937)	(700)	Nuverra Environmental		
2.861	Nordstrom Inc	Goldman Sachs	(2.632)		Solutions Inc	Morgan Stanley	2.247
16.692	Norfolk Southern Corp	Bank of America		(27.636)	NV5 Global Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	45.903			Merrill Lynch	(158.216)
13.990	Norfolk Southern Corp	Morgan Stanley	220.864	(12.126)	NVE Corp	Bank of America	
1.706	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	4.692			Merrill Lynch	(83.843)
(86.090)	Northeast Bancorp	Goldman Sachs	4.305	19.091	nVent Electric PLC	Bank of America	
(2.038)	Northeast Bancorp	Morgan Stanley	1.019			Merrill Lynch	26.545
(48.563)	Northeast Bancorp	Bank of America		2.578	nVent Electric PLC	Morgan Stanley	1.521
		Merrill Lynch	2.887	(6.020)	nVent Electric PLC	Morgan Stanley	446
169.224	Northern Oil and Gas Inc	Bank of America		957	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	4.614
		Merrill Lynch	98.150	(18)	NVR Inc	Bank of America	
15.108	Northern Oil and Gas Inc	Morgan Stanley	2.417			Merrill Lynch	(2.574)
17.093	Northern Trust Corp	Bank of America		(97)	NVR Inc	Morgan Stanley	(8.721)
		Merrill Lynch	(90.935)	31.176	NxStage Medical Inc	Bank of America	
22.365	Northern Trust Corp	Morgan Stanley	(125.649)			Merrill Lynch	45.582
(109.709)	Northfield Bancorp Inc	Bank of America		11.165	NxStage Medical Inc	Goldman Sachs	15.375
		Merrill Lynch	(50.466)	5.766	NxStage Medical Inc	Morgan Stanley	3.950
(16.502)	Northrim BanCorp Inc	Bank of America		3.800	Nymox Pharmaceutical Corp	Morgan Stanley	(315)
		Merrill Lynch	(27.103)	(4.361)	O'Reilly Automotive Inc	Bank of America	
17.013	Northrop Grumman Corp	Morgan Stanley	85.065			Merrill Lynch	11.469
733	Northrop Grumman Corp	Bank of America		(1.331)	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	3.698
		Merrill Lynch	6.985	11.485	Oasis Midstream Partners LP	Morgan Stanley	(3.905)
162	Northrop Grumman Corp	Goldman Sachs	1.544	54.275	Oasis Midstream Partners LP	Bank of America	
(199.787)	NorthStar Realty Europe	Bank of America				Merrill Lynch	22.796
	Corp (Reit)	Merrill Lynch	(6.794)	39.638	Oasis Midstream Partners LP	Goldman Sachs	16.648
(10.164)	Northwest Bancshares Inc	Bank of America		83.761	Oasis Petroleum Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(5.387)			Merrill Lynch	86.274
(22.418)	Northwest Pipe Co	Bank of America		28.827	Oasis Petroleum Inc	Morgan Stanley	12.972
		Merrill Lynch	(20.400)	705	Oasis Petroleum Inc	Goldman Sachs	726
70.165	NorthWestern Corp	Bank of America		8.776	Occidental Petroleum Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	79.988			Merrill Lynch	(2.457)
22.094	Norwegian Cruise Line	Bank of America		925	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs	(259)
	Holdings Ltd	Merrill Lynch	19.443	27.788	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	17.061
1.817	Norwegian Cruise Line			4.949	Oceaneering International Inc	Bank of America	
	Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.072)			Merrill Lynch	(1.373)
1.670	Norwegian Cruise Line			(15.854)	Oceaneering International Inc	Morgan Stanley	5.707
	Holdings Ltd	Goldman Sachs	1.470	7.495	Oceaneering International Inc	Goldman Sachs	(3.709)
304	Novanta Inc	Morgan Stanley	578	(449.439)	OceanFirst Financial Corp	Bank of America	
(20.328)	Novanta Inc	Morgan Stanley	(38.623)			Merrill Lynch	(925.844)
11.552	Novanta Inc	Bank of America		(6.305)	Ocular Therapeutix Inc	Goldman Sachs	504
		Merrill Lynch	(347)	(22.295)	Ocular Therapeutix Inc	Morgan Stanley	1.338
4.920	Novocure Ltd	Bank of America		(24.066)	Ocwen Financial Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	13.284			Merrill Lynch	5.656
(8.382)	NOW Inc	Bank of America		(186.624)	Ocwen Financial Corp	Morgan Stanley	41.990
		Merrill Lynch	9.440	(516.406)	Office Depot Inc	Bank of America	
4.434	NOW Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(28.402)
		Merrill Lynch	(1.862)	(138.505)	Office Depot Inc	Morgan Stanley	(9.214)
7.896	NOW Inc	Morgan Stanley	(4.896)	11.996	OFG Bancorp	Morgan Stanley	(2.444)
70.184	NRG Yield Inc 'A'	Bank of America		2.000	OFG Bancorp	Bank of America	
		Merrill Lynch	4.913			Merrill Lynch	—

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
16.388	OGE Energy Corp	Bank of America		(193.868)	Oracle Corp	Morgan Stanley	(118.259)
		Merrill Lynch	22.732	(32.999)	Oracle Corp	Bank of America	
1.766	OGE Energy Corp	Goldman Sachs	2.495			Merrill Lynch	(5.283)
(4.320)	Ohio Valley Banc Corp	Bank of America		(92.056)	OraSure Technologies Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(9.504)			Merrill Lynch	(105.819)
(2.605)	Ohio Valley Banc Corp	Goldman Sachs	(5.731)	(20.772)	OraSure Technologies Inc	Morgan Stanley	(18.695)
(1.333)	Ohio Valley Banc Corp	Morgan Stanley	(1.000)	(97.740)	ORBCOMM Inc	Bank of America	
40.531	Okta Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(28.767)
		Merrill Lynch	327.490	(2.234)	Orchid Island Capital Inc (Reit)	Goldman Sachs	(514)
10.325	Okta Inc	Goldman Sachs	83.426	47.971	Orion Engineered Carbons SA	Morgan Stanley	43.614
5.652	Okta Inc	Morgan Stanley	45.725	(42.147)	Ormat Technologies Inc	Bank of America	
(3.778)	Okta Inc	Morgan Stanley	(30.564)			Merrill Lynch	29.498
(3.974)	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America		(77.485)	Ormat Technologies Inc	Morgan Stanley	172.090
		Merrill Lynch	(52.695)	(13.915)	Orthofix International NV	Bank of America	
(1.112)	Old Line Bancshares Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(7.596)
		Merrill Lynch	678	(2.726)	Orthofix International NV	Goldman Sachs	(1.579)
(161.611)	Old Republic International Corp	Bank of America		27.264	Oshkosh Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(63.028)			Merrill Lynch	(27.809)
(9.470)	Old Republic International Corp	Morgan Stanley	1.799	19.851	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	(70.029)
(23.302)	Olin Corp	Bank of America		837	Oshkosh Corp	Goldman Sachs	(854)
		Merrill Lynch	699	116.875	OSI Systems Inc	Bank of America	
(8.809)	Olin Corp	Morgan Stanley	7.089			Merrill Lynch	222.062
(52.889)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Bank of America		4.184	OSI Systems Inc	Morgan Stanley	7.991
		Merrill Lynch	(70.426)	9.074	OSI Systems Inc	Goldman Sachs	17.241
(20.257)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(34.437)	21.024	Otonomy Inc	Goldman Sachs	(3.154)
(670)	Omega Flex Inc	Morgan Stanley	(771)	7.807	Otonomy Inc	Morgan Stanley	(586)
(91)	Omega Flex Inc	Goldman Sachs	(29)	(23.693)	Otter Tail Corp	Bank of America	
(20.358)	Omega Flex Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(63.971)
		Merrill Lynch	(6.515)	159.660	Outfront Media Inc (Reit)	Bank of America	
(30.837)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Morgan Stanley	(41.322)	878	Outfront Media Inc (Reit)	Merrill Lynch	(35.125)
(416)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Bank of America		85.791	Outfront Media Inc (Reit)	Goldman Sachs	(193)
		Merrill Lynch	(969)	1.553	Overstock.com Inc	Morgan Stanley	6.392
(52.058)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Goldman Sachs	(121.295)			Bank of America	
9.243	Omnicell Inc	Bank of America		11.103	Overstock.com Inc	Merrill Lynch	(9.551)
		Merrill Lynch	1.986	14.897	Owens & Minor Inc	Morgan Stanley	(35.538)
1.010	Omnicell Inc	Goldman Sachs	531			Bank of America	
1.847	Omnicell Inc	Morgan Stanley	1.900	60.881	Owens & Minor Inc	Merrill Lynch	(2.830)
(3.988)	Omnicom Group Inc	Bank of America		28.538	Owens Corning	Morgan Stanley	(15.829)
		Merrill Lynch	15.501			Bank of America	
(56.688)	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	253.395	3.049	Owens Corning	Merrill Lynch	(19.828)
13.949	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	21.678	16.432	Owens Corning	Goldman Sachs	(2.866)
62.921	ONE Gas Inc	Morgan Stanley	183.729	(25.051)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Morgan Stanley	(11.650)
19.431	One Liberty Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	19.820	(4.427)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Bank of America	
		Bank of America		(800)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Merrill Lynch	(5.003)
79.346	One Liberty Properties Inc (Reit)	Merrill Lynch	122.193			Goldman Sachs	(904)
22.035	One Liberty Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	33.934	(8.723)	Owens-Illinois Inc	Bank of America	
22.126	OneMain Holdings Inc	Morgan Stanley	(40.491)			Merrill Lynch	(5.321)
15.243	OneMain Holdings Inc	Goldman Sachs	(20.273)	(66.217)	Owens-Illinois Inc	Morgan Stanley	15.892
30.121	OneMain Holdings Inc	Bank of America		46.255	Oxford Immunotec Global Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(41.219)	6.602	Oxford Immunotec Global Plc	Merrill Lynch	66.145
(4.460)	ONEOK Inc	Morgan Stanley	(8.764)	5.178	Oxford Immunotec Global Plc	Goldman Sachs	9.441
(29.148)	Ontario Hydro Generic Resid	Bank of America		145.570	PACCAR Inc	Morgan Stanley	3.987
		Merrill Lynch	(816.144)	80.550	PACCAR Inc	Morgan Stanley	(395.950)
27.571	Ooma Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	37.221	7.052	PACCAR Inc	Merrill Lynch	(40.275)
20.157	Ooma Inc	Goldman Sachs	27.212	56.895	Pacific Biosciences of California Inc	Goldman Sachs	(3.526)
11.714	Ooma Inc	Morgan Stanley	(1.171)			Bank of America	
1.676	OP Bancorp	Bank of America		227.939	Pacific Ethanol Inc	Merrill Lynch	6.258
		Merrill Lynch	225			Bank of America	
2.184	OP Bancorp	Morgan Stanley	(262)	84.710	Pacific Ethanol Inc	Merrill Lynch	(11.397)
(59.655)	OPKO Health Inc	Bank of America		43.139	Pacific Ethanol Inc	Goldman Sachs	(4.236)
		Merrill Lynch	54.286	8.338	Pacific Mercantile Bancorp	Morgan Stanley	(4.314)
(42.399)	Oppenheimer Holdings Inc 'A'	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	8.480	10.250	Pacific Mercantile Bancorp	Merrill Lynch	2.501
(41.918)	Opus Bank	Bank of America		1.619	Pacific Mercantile Bancorp	Goldman Sachs	3.075
		Merrill Lynch	(39.822)	(30.594)	Pacific Premier Bancorp Inc	Morgan Stanley	243
						Morgan Stanley	41.302

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(53.994)	Pacira Pharmaceuticals Inc/DE	Bank of America Merrill Lynch	(78.291)	539	Paylocity Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.151
(8.976)	Pacira Pharmaceuticals Inc/DE	Morgan Stanley	(39.356)	5.774	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	12.356
27.254	Packaging Corp of America	Bank of America Merrill Lynch	(31.260)	(14.187)	PayPal Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64.409)
104.683	Packaging Corp of America	Morgan Stanley	(453.568)	(28.801)	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	(49.250)
1.381	Packaging Corp of America	Goldman Sachs	(3.655)	(6.385)	PBF Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	(22.517)
(5.980)	PacWest Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	1.615	4.347	PC Connection Inc	Morgan Stanley	(782)
20.437	Pagseguro Digital Ltd 'A'	Goldman Sachs	51.093	47.572	PC Connection Inc	Bank of America Merrill Lynch	30.446
141.736	Pagseguro Digital Ltd 'A'	Morgan Stanley	217.377	16.074	PC Connection Inc	Goldman Sachs	10.287
6.048	Palo Alto Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	51.798	91.810	PC-Tel Inc	Morgan Stanley	(19.280)
2.345	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	3.899	(2.700)	PCM Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.215)
708	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs	6.562	(3.401)	PCSB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.632)
(12.741)	Pandora Media Inc	Morgan Stanley	(2.470)	(24.603)	PDC Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50.313)
82.136	Pandora Media Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	(1.066)	PDC Energy Inc	Morgan Stanley	1.173
(2.898)	Panhandle Oil and Gas Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	580	38.514	PDL BioPharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.926
(53.744)	Papa John's International Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.855	(52.899)	PDL BioPharma Inc	Goldman Sachs	3.068
(102.300)	Papa John's International Inc	Goldman Sachs	(23.529)	(6.327)	pdvWireless Inc	Bank of America Merrill Lynch	55.544
(42.782)	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	136.787	(49.109)	pdvWireless Inc	Morgan Stanley	11.389
(22.772)	PAR Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.604	14.719	Peabody Energy Corp	Morgan Stanley	(123.264)
(3.852)	PAR Technology Corp	Goldman Sachs	1.117	1.913	Peabody Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	49.750
136.163	Paramount Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	61.273	(10.238)	Peapack Gladstone Financial Corp	Goldman Sachs	6.466
2.001	Paramount Group Inc (Reit)	Goldman Sachs	900	(11.234)	Pebblebrook Hotel Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(24.366)
(18.000)	Paratek Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	25.200	9.071	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	(15.615)
(13.919)	Paratek Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	19.487	(28.279)	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	25.852
(8)	Pareteum Corp**	Morgan Stanley	—	196	Pendrell Corp	Bank of America Merrill Lynch	(39.502)
24.474	Park Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	45.522	155	Pendrell Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.940)
1.785	Park Hotels & Resorts Inc (Reit)	Morgan Stanley	1.660	82	Pendrell Corp	Goldman Sachs	(2.325)
(13.539)	Park National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29.380)	(10.378)	Penn Virginia Corp	Morgan Stanley	(1.394)
(4.948)	Park National Corp	Morgan Stanley	(247)	(474)	Penn Virginia Corp	Morgan Stanley	(22.832)
(676)	Park National Corp	Goldman Sachs	(1.467)	(20.019)	Penns Woods Bancorp Inc	Goldman Sachs	(2.910)
(12.104)	Parker-Hannifin Corp	Bank of America Merrill Lynch	38.612	65.265	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	(11.010)
(1.615)	Parker-Hannifin Corp	Morgan Stanley	4.652	64.223	Penske Automotive Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	28.359
17.411	Parsley Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(13.354)	12.798	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	18.625
73.654	Parsley Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	(26.856)	(35.897)	Pentair Plc	Goldman Sachs	4.609
2.566	Party City Holdco Inc	Bank of America Merrill Lynch	239	(38.643)	Pentair Plc	Morgan Stanley	755.541
76.927	Party City Holdco Inc	Morgan Stanley	11.996	(2.684)	Penumbra Inc	Goldman Sachs	28.596
1.476	Patrick Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(517)	11.966	Penumbra Inc	Morgan Stanley	(14.418)
2.219	Patrick Industries Inc	Morgan Stanley	1.559	(30.370)	People's United Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	132.823
4.403	Pattern Energy Group Inc	Goldman Sachs	1.805	103.914	People's United Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.415
107.893	Pattern Energy Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	44.041	3.024	People's United Financial Inc	Morgan Stanley	(22.431)
81.147	Pattern Energy Group Inc 'A'	Morgan Stanley	57.215	6.442	People's Utah Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(1.012)
(1.347)	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	543	8.530	People's Utah Bancorp	Goldman Sachs	22.869
(7.355)	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs	2.926	545	People's Utah Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	29.773
(5.285)	Patterson-UTI Energy Inc	Morgan Stanley	1.709	7.509	Peoples Bancorp Inc/OH	Morgan Stanley	954
1.982	Patterson-UTI Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.649)	761	Peoples Bancorp Inc/OH	Bank of America Merrill Lynch	1.045
4.689	Patterson-UTI Energy Inc	Goldman Sachs	(8.392)	3.446	Peoples Bancorp Inc/OH	Goldman Sachs	20
(11.361)	Paychex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15.678)	(24.763)	Peoples Financial Services Corp	Morgan Stanley	1.472
22.440	Paychex Inc	Morgan Stanley	3.565	47.230	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	(40.364)
(219)	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	(1.198)	10.565	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	(7.557)
908	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	990			Bank of America Merrill Lynch	31.378
(14.014)	Paycom Software Inc	Goldman Sachs	(67.688)				

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

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
180.101	Performance Food Group Co	Bank of America Merrill Lynch	162.091	(26.458)	PJT Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35.983)
12.042	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	9.032	31.249	Plains GP Holdings LP 'A'	Morgan Stanley	6.434
(17.011)	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	(12.758)	42.459	Plains GP Holdings LP 'A'	Bank of America	
12.465	PerkinElmer Inc	Morgan Stanley	4.850			Merrill Lynch	(10.419)
10.553	Perrigo Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7.071)	(1.684)	Planet Fitness Inc 'A'	Morgan Stanley	984
22.102	Perrigo Co Plc	Morgan Stanley	(24.091)	2.724	Planet Fitness Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.171)
2.572	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs	(1.793)	20.059	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America	
25.703	Perry Ellis International Inc	Bank of America Merrill Lynch	40.097	(10.102)	Plantronics Inc	Merrill Lynch	(8.625)
4.989	Perry Ellis International Inc	Goldman Sachs	7.783	(21.374)	Platform Specialty Products Corp	Morgan Stanley	(30.508)
40.149	PetIQ Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.621		Platform Specialty Products Corp	Bank of America	
35.272	PetIQ Inc	Goldman Sachs	4.938	56.039	Platform Specialty Products Corp	Merrill Lynch	51.556
(59.741)	Petroleo Brasileiro SA ADR	Goldman Sachs	255.990	10.164	PlayAGS Inc	Bank of America	
(22.149)	Petroleo Brasileiro SA ADR	Morgan Stanley	72.981			Merrill Lynch	19.312
28.659	Pfenex Inc	Goldman Sachs	(71.648)	6.090	PlayAGS Inc	Goldman Sachs	11.571
96.867	Pfenex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(242.168)	1.083	Plexus Corp	Bank of America	
(280.520)	Pfizer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109.403)	(37.998)	Plexus Corp	Merrill Lynch	667
(227.442)	Pfizer Inc	Morgan Stanley	(78.891)	402	Plexus Corp	Morgan Stanley	(35.583)
(95.174)	PG&E Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.517	601	Plexus Corp	Goldman Sachs	157
186.785	PGT Innovations Inc	Bank of America Merrill Lynch	261.397	36.134	PNM Resources Inc	Bank of America	(234)
23.843	PGT Innovations Inc	Goldman Sachs	53.647			Merrill Lynch	66.848
11.885	PGT Innovations Inc	Morgan Stanley	5.411	(739)	Polaris Industries Inc	Goldman Sachs	(3.540)
8.531	PH Glatfelter Co	Bank of America Merrill Lynch	8.275	(2.478)	Polaris Industries Inc	Bank of America	
9.824	PHI Inc 'non-voting share'	Bank of America Merrill Lynch	(7.270)			Merrill Lynch	(11.870)
2.838	Phibro Animal Health Corp 'A'	Morgan Stanley	993	(36.558)	PolarityTE Inc	Morgan Stanley	(125.736)
30.967	Phibro Animal Health Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	69.676	(9.514)	PolarityTE Inc	Bank of America	
3.471	Phibro Animal Health Corp 'A'	Goldman Sachs	7.810	4.743	PolyOne Corp	Merrill Lynch	19.350
(39.854)	Philip Morris International Inc	Bank of America Merrill Lynch	26.304			Bank of America	
(21.896)	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	(36.785)	3.678	PolyOne Corp	Merrill Lynch	(2.717)
9.051	Physicians Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	3.892	1.572	PolyOne Corp	Goldman Sachs	(1.578)
8.443	Physicians Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	5.235	(8.129)	Pool Corp	Morgan Stanley	(365)
(117.315)	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(102.064)	(11.370)	Pool Corp	Morgan Stanley	33.639
(81.398)	Pier 1 Imports Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.163)			Bank of America	
64.614	Pilgrim's Pride Corp	Bank of America Merrill Lynch	(65.826)	(8.368)	Popular Inc	Merrill Lynch	35.438
24.654	Pilgrim's Pride Corp	Morgan Stanley	(20.868)			Bank of America	
4.039	Pilgrim's Pride Corp	Goldman Sachs	(4.051)	(61.634)	Popular Inc	Merrill Lynch	8.870
(4.417)	Pinnacle Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.039)	108.621	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	97.998
153.976	Pinnacle West Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	331.048	235.768	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	(165.546)
129	Pinnacle West Capital Corp	Goldman Sachs	277			Bank of America	
108.743	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	292.519	16.122	Portland General Electric Co	Merrill Lynch	425.463
179.844	Pioneer Energy Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	53.953	(20.716)	Portola Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	29.720
76.981	Pioneer Energy Services Corp	Goldman Sachs	23.094	11.330	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
58.786	Pioneer Energy Services Corp	Morgan Stanley	—			Merrill Lynch	6.629
(1.939)	Pioneer Natural Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	13.302	10.783	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
(15.168)	Piper Jaffray Cos	Morgan Stanley	23.510	3.473	Portola Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	(3.626)
(8.659)	Piper Jaffray Cos	Bank of America Merrill Lynch	9.998	(44.846)	Post Holdings Inc	Goldman Sachs	(3.451)
9.416	Pivotal Software Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3.057	(228.732)	Potbelly Corp	Morgan Stanley	278
9.678	Pivotal Software Inc 'A'	Morgan Stanley	5.344			Morgan Stanley	52.699
				(5.006)	Potbelly Corp	Bank of America	
				69.819	Potlatch Corp (Reit)	Merrill Lynch	(160.112)
				(86.562)	Potlatch Corp (Reit)	Goldman Sachs	(3.504)
						Morgan Stanley	20.946
				(10.298)	Powell Industries Inc	Bank of America	
				20.961	Power Integrations Inc	Merrill Lynch	(324.608)
						Bank of America	
				(2.284)	Power Integrations Inc	Merrill Lynch	13.698
				(13.869)	PPG Industries Inc	Morgan Stanley	106.901
				62.428	PPL Corp	Merrill Lynch	(3.122)
				110.514	PPL Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	25.103
				7.171	PPL Corp	Morgan Stanley	(8.116)
				(914)	PRA Group Inc	Bank of America	
				(5.726)	PRA Group Inc	Merrill Lynch	(5.526)
						Goldman Sachs	(359)
						Goldman Sachs	(686)
						Morgan Stanley	2.863

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(5.034)	PRA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	(5.550)	(24.742)	PTC Inc	Bank of America	(41.319)
(101.161)	Precision Drilling Corp	Morgan Stanley	43.807			Merrill Lynch	(655)
8.363	Preferred Bank/ Los Angeles CA	Bank of America		(424)	PTC Inc	Morgan Stanley	(655)
3.224	Preferred Bank/ Los Angeles CA	Merrill Lynch	4.037	(76.018)	Public Service Enterprise Group Inc	Bank of America	(151.727)
9.464	Preferred Bank/ Los Angeles CA	Goldman Sachs	3.031	(6.922)	Public Service Enterprise Group Inc	Merrill Lynch	(250)
(79.133)	Premier Inc 'A'	Morgan Stanley	(320)	(14.990)	Public Storage (Reit)	Bank of America	(91.589)
(94.930)	Presidio Inc	Bank of America	(50.645)	(77.164)	PulteGroup Inc	Merrill Lynch	(69.448)
(55.645)	Presidio Inc	Merrill Lynch	(3.797)	(3.110)	PulteGroup Inc	Goldman Sachs	(2.799)
3.580	Prestige Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.782)	4.250	Puma Biotechnology Inc	Bank of America	(3.265)
7.086	Prestige Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	3.795	2.387	Puma Biotechnology Inc	Merrill Lynch	2.387
113.683	PRGX Global Inc	Bank of America	(2.551)	844	Puma Biotechnology Inc	Goldman Sachs	(1.730)
(77.770)	PriceSmart Inc	Merrill Lynch	(2.551)	148.734	Pure Storage Inc 'A'	Bank of America	(237.974)
(38.144)	PriceSmart Inc	Morgan Stanley	(384.962)	9.062	Pure Storage Inc 'A'	Goldman Sachs	(14.499)
(20.757)	Primerica Inc	Bank of America	(129.690)	3.554	PVH Corp	Bank of America	16.064
(402)	Primerica Inc	Merrill Lynch	(77.839)	9.926	PVH Corp	Merrill Lynch	56.382
(6.984)	Primerica Inc	Goldman Sachs	(1.508)	(5.100)	Q2 Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.805)
83.717	Primo Water Corp	Morgan Stanley	2.485	1.206	QAD Inc 'A'	Bank of America	2.894
17.494	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	161.574	632	QAD Inc 'A'	Merrill Lynch	1.517
4.860	Principal Financial Group Inc	Merrill Lynch	(60.879)	417	QAD Inc 'A'	Goldman Sachs	1.376
72.252	Principal Financial Group Inc	Goldman Sachs	(16.913)	63.557	QCR Holdings Inc	Morgan Stanley	57.201
(97.728)	ProAssurance Corp	Morgan Stanley	(173.783)	12.242	QCR Holdings Inc	Goldman Sachs	11.018
(156.460)	Procter & Gamble Co/The	Merrill Lynch	111.920	9.999	QCR Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.000)
(33.773)	Procter & Gamble Co/The	Bank of America	(126.733)	(79.721)	QEP Resources Inc	Bank of America	48.630
34.153	Progress Software Corp	Merrill Lynch	9.288	(116.788)	QEP Resources Inc	Merrill Lynch	92.263
17.563	Progress Software Corp	Morgan Stanley	18.443	(19.994)	QIAGEN NV	Morgan Stanley	(58.908)
92.945	Progress Software Corp	Goldman Sachs	9.484	(29.101)	Qorvo Inc	Bank of America	(22.600)
11.326	Progressive Corp/The	Morgan Stanley	(350.696)	(24.981)	Qorvo Inc	Merrill Lynch	(129.234)
310	Progressive Corp/The	Bank of America	6.796	(7.189)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	1.457
139.528	Prologis Inc (Reit)	Merrill Lynch	186	8.092	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America	22.577
137.623	Prologis Inc (Reit)	Goldman Sachs	55.490	(2.280)	Quaker Chemical Corp	Merrill Lynch	559
8.687	Prologis Inc (Reit)	Morgan Stanley	98.915	(10.220)	Quaker Chemical Corp	Morgan Stanley	4.701
1.292	Proofpoint Inc	Goldman Sachs	3.627	(4.590)	Qualcomm Inc	Bank of America	(10.787)
(21.636)	Proofpoint Inc	Morgan Stanley	(478)	(15.663)	Qualys Inc	Merrill Lynch	(33.062)
147.729	ProPetro Holding Corp	Bank of America	101.906	(273.391)	Quanex Building Products Corp	Bank of America	(13.670)
(7.851)	ProPetro Holding Corp	Merrill Lynch	(242.276)	11.152	Quanta Services Inc	Merrill Lynch	(6.134)
(18.150)	PROS Holdings Inc	Morgan Stanley	15.928	5.043	Quanta Services Inc	Goldman Sachs	(2.675)
6.217	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America	(44.480)	38.713	Quest Diagnostics Inc	Bank of America	222.600
7.259	Prosperity Bancshares Inc	Merrill Lynch	(8.952)	30.736	Quest Diagnostics Inc	Merrill Lynch	185.645
3.923	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America	4.811	3.632	Quidel Corp	Morgan Stanley	2.445
5.248	Prosperity Bancshares Inc	Goldman Sachs	2.872	62.905	QuinStreet Inc	Morgan Stanley	50.953
(41.606)	Proteostasis Therapeutics Inc	Morgan Stanley	5.038	(5.919)	Quorum Health Corp	Bank of America	3.078
(5.275)	Proto Labs Inc	Merrill Lynch	(29.013)	(2.893)	Quotient Ltd	Goldman Sachs	4
(3.135)	Providence Service Corp/The	Bank of America	(1.129)	9.353	Quotient Technology Inc	Goldman Sachs	(701)
21.726	Prudential Financial Inc	Merrill Lynch	(1.129)	1.300	Quotient Technology Inc	Bank of America	(98)
63.870	Prudential Financial Inc	Bank of America	(83.211)	(14.981)	Quotient Technology Inc	Morgan Stanley	1.124
76.965	PS Business Parks Inc (Reit)	Merrill Lynch	(335.318)	(12.255)	Qurata Retail Inc	Morgan Stanley	17.280
(9.064)	PS Business Parks Inc (Reit)	Bank of America	404.066	(14.875)	Qurata Retail Inc	Bank of America	20.310
		Merrill Lynch	(52.220)	(104.819)	R1 RCM Inc	Merrill Lynch	31.446

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(132.322)	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	1.323	2.355	Realty Income Corp (Reit)	Bank of America	
(51.291)	R1 RCM Inc	Goldman Sachs	15.387			Merrill Lynch	3.438
17.530	Ra Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	8.590	2.355	Realty Income Corp (Reit)	Goldman Sachs	3.438
23.530	Ra Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	17.191	2.545	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Bank of America	
32.849	Ra Pharmaceuticals Inc	Bank of America				Merrill Lynch	10.689
		Merrill Lynch	16.096	2.633	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Goldman Sachs	11.059
14.171	Radian Group Inc	Bank of America		(10.614)	Red Lion Hotels Corp	Morgan Stanley	(7.961)
		Merrill Lynch	1.559	(136.612)	Red Lion Hotels Corp	Bank of America	
18.010	Radian Group Inc	Goldman Sachs	(1.228)			Merrill Lynch	(136.612)
293.076	Radiant Logistics Inc	Bank of America		(51.890)	Red Rock Resorts Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	111.369			Merrill Lynch	(16.086)
56.921	Radiant Logistics Inc	Morgan Stanley	2.277	(18.475)	Redfin Corp	Bank of America	
8.526	Radiant Logistics Inc	Goldman Sachs	3.240			Merrill Lynch	(18.622)
20.851	Radiant Logistics Inc	Bank of America		(2.924)	Redfin Corp	Morgan Stanley	(1.023)
		Merrill Lynch	3.625	(8.338)	Redfin Corp	Goldman Sachs	(4.147)
1.354	Radiant Logistics Inc	Goldman Sachs	101	6.975	Regal Beloit Corp	Bank of America	
17.533	Rafael Holdings Inc 'B'	Bank of America				Merrill Lynch	8.370
		Merrill Lynch	11.572	454	Regal Beloit Corp	Morgan Stanley	74
2.465	Rafael Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	1.627	(11.876)	Regency Centers Corp (Reit)	Bank of America	
(8.979)	Ralph Lauren Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(20.427)
		Merrill Lynch	(126.397)	59.876	Regency Centers Corp (Reit)	Morgan Stanley	65.063
(824)	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	(838)	1.259	Regency Centers Corp (Reit)	Bank of America	
5.901	Rambus Inc	Morgan Stanley	1.593			Merrill Lynch	304
(91.558)	Rambus Inc	Morgan Stanley	(24.721)	8.468	Regeneron	Bank of America	
17.843	Rambus Inc	Bank of America			Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	28.430
		Merrill Lynch	6.186	513	Regeneron		
(12.540)	Ramco-Gershenson				Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	2.125
	Properties Trust (Reit)	Morgan Stanley	(6.270)	82	Regeneron		
40.608	Range Resources Corp	Bank of America			Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	785
		Merrill Lynch	40.608	2.764	REGENXBIO Inc	Bank of America	
2.409	Range Resources Corp	Goldman Sachs	2.409			Merrill Lynch	9.536
(71.842)	Range Resources Corp	Morgan Stanley	(92.464)	2.859	REGENXBIO Inc	Goldman Sachs	9.864
21.458	Rapid7 Inc	Bank of America		596	REGENXBIO Inc	Morgan Stanley	4.470
		Merrill Lynch	31.114	34.230	Regions Financial Corp	Bank of America	
1.779	Rapid7 Inc	Goldman Sachs	2.580			Merrill Lynch	(39.365)
47.758	Raymond James Financial Inc	Morgan Stanley	204.480	(104.897)	Regis Corp	Bank of America	
16.323	Raymond James Financial Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(123.778)
		Merrill Lynch	44.235	(19.034)	Reis Inc	Bank of America	
1.149	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	3.114			Merrill Lynch	(30.454)
22.133	Rayonier Advanced	Bank of America		32.733	Reliance Steel & Aluminum Co	Bank of America	
	Materials Inc	Merrill Lynch	(26.117)			Merrill Lynch	86.511
817	Rayonier Advanced			8.900	Reliance Steel & Aluminum Co	Goldman Sachs	24.436
	Materials Inc	Goldman Sachs	(964)	38.638	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	31.297
(95.062)	Rayonier Inc (Reit)	Bank of America		(21.799)	Renasant Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(172.062)			Merrill Lynch	(28.993)
12.413	Raytheon Co	Morgan Stanley	20.625	(11.314)	Rent-A-Center Inc/TX	Bank of America	
21.783	Raytheon Co	Bank of America				Merrill Lynch	6.449
		Merrill Lynch	50.126	(35.466)	Rent-A-Center Inc/TX	Morgan Stanley	21.989
1.072	RBB Bancorp	Bank of America		(29.185)	Rent-A-Center Inc/TX	Goldman Sachs	16.635
		Merrill Lynch	751	(18.799)	Rentech Inc	Morgan Stanley	-
(22.803)	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	(74.794)	(38.242)	Repligen Corp	Bank of America	
(24.529)	RCI Hospitality Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(65.030)
		Merrill Lynch	(35.567)	88.700	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Bank of America	
(4.426)	RCI Hospitality Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.142)			Merrill Lynch	49.294
(28.293)	Reading International Inc	Bank of America		6.886	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Goldman Sachs	3.448
		Merrill Lynch	2.208	12.153	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Morgan Stanley	(4.010)
19.603	Real Industry Inc	Bank of America		11.757	Republic First Bancorp Inc	Goldman Sachs	(4.115)
		Merrill Lynch	-	1.801	Republic Services Inc	Goldman Sachs	1.603
17.468	Real Industry Inc	Morgan Stanley	-	74.450	Republic Services Inc	Morgan Stanley	55.045
38.856	RealNetworks Inc	Bank of America		104.238	Republic Services Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.166			Merrill Lynch	92.772
13.241	RealNetworks Inc	Goldman Sachs	397	(30.022)	Research Frontiers Inc	Bank of America	
14.680	RealNetworks Inc	Morgan Stanley	147			Merrill Lynch	3.453
(24.532)	Realogy Holdings Corp	Morgan Stanley	8.965	(129.742)	Research Frontiers Inc	Morgan Stanley	5.190
(26.694)	Realogy Holdings Corp	Goldman Sachs	7.683	(5.099)	ResMed Inc	Bank of America	
(24.541)	RealPage Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(9.994)
		Merrill Lynch	(6.135)	(17.570)	ResMed Inc	Morgan Stanley	(19.327)
5.499	RealPage Inc	Morgan Stanley	(1.077)	(9.480)	Resolute Energy Corp	Bank of America	
1.595	Realty Income Corp (Reit)	Morgan Stanley	1.436			Merrill Lynch	(16.685)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(11.704)	Resolute Energy Corp	Goldman Sachs	(20.599)	1.171	Rocky Brands Inc	Bank of America	
169.975	Retail Opportunity	Bank of America				Merrill Lynch	228
	Investments Corp (Reit)	Merrill Lynch	178.687	(35.529)	Rogers Corp	Bank of America	
45.231	Retail Opportunity					Merrill Lynch	31.096
	Investments Corp (Reit)	Morgan Stanley	17.188	(7.962)	Rogers Corp	Morgan Stanley	(2.294)
(163.808)	Retail Properties of America	Bank of America		5.198	Roku Inc	Bank of America	
	Inc 'A' (Reit)	Merrill Lynch	(144.550)			Merrill Lynch	18.713
(389.061)	Retail Properties of America			3.849	Roku Inc	Morgan Stanley	14.010
	Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(198.421)	1.750	Roper Technologies Inc	Bank of America	
48.696	Retrophin Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(3.535)
		Merrill Lynch	92.522	602	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs	(1.216)
3.235	Retrophin Inc	Morgan Stanley	388	13.054	Ross Stores Inc	Bank of America	
(19.335)	REV Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(43.209)
		Merrill Lynch	7.541	(53.123)	Rowan Cos Plc 'A'	Goldman Sachs	65.873
8.733	REV Group Inc	Morgan Stanley	(2.606)	17.399	Rowan Cos Plc 'A'	Bank of America	
39.859	Revanche Therapeutics Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(21.575)
		Merrill Lynch	(68.885)	1.761	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America	
5.870	Revanche Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(11.976)			Merrill Lynch	(2.008)
16.326	Revanche Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(43.264)	84.367	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	(164.568)
(10.321)	Revlon Inc 'A'	Goldman Sachs	10.357	(2.064)	Royal Gold Inc	Bank of America	
(51.758)	Revolution Lighting	Bank of America				Merrill Lynch	(2.539)
	Technologies Inc	Merrill Lynch	(39.854)	(16.499)	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	(104.311)
6.074	REX American	Bank of America		8.638	RPC Inc	Bank of America	
	Resources Corp	Merrill Lynch	13.737			Merrill Lynch	(20.731)
402	REX American			43.317	RPC Inc	Morgan Stanley	(81.003)
	Resources Corp	Goldman Sachs	357	24.970	RPM International Inc	Bank of America	
2.250	REX American					Merrill Lynch	5.244
	Resources Corp	Morgan Stanley	704	2.166	RPM International Inc	Goldman Sachs	(687)
16.136	Rexford Industrial Realty	Bank of America		81.525	RPX Corp	Bank of America	
	Inc (Reit)	Merrill Lynch	5.246			Merrill Lynch	2.853
3.397	Rexford Industrial Realty			63.791	RR Donnelley & Sons Co	Bank of America	
	Inc (Reit)	Morgan Stanley	2.208			Merrill Lynch	2.233
1.558	Rexford Industrial Realty			27.749	RTI Surgical Inc	Bank of America	
	Inc (Reit)	Goldman Sachs	318			Merrill Lynch	2.775
16.181	Rexnord Corp	Morgan Stanley	3.398	56.789	RTI Surgical Inc	Morgan Stanley	8.518
(58.424)	Rexnord Corp	Morgan Stanley	(12.440)	11.685	Rubicon Project Inc/The	Morgan Stanley	467
249.948	Rexnord Corp	Bank of America		29.968	Rubicon Project Inc/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	124.974			Merrill Lynch	7.192
9.824	Rexnord Corp	Goldman Sachs	4.912	15.096	Rubicon Project Inc/The	Goldman Sachs	3.623
9.484	RH	Bank of America		(15.293)	Rubicon Technology Inc	Morgan Stanley	(3.517)
		Merrill Lynch	(6.849)	(7.815)	Rush Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	11.371
3.687	RH	Morgan Stanley	(4.787)	39.844	Rush Enterprises Inc 'A'	Bank of America	
(51.691)	Rhythmone Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.395)
		Merrill Lynch	5.753	17.648	Rush Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	(618)
67.061	Ribbon Communications Inc	Bank of America		14.743	Rush Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	(21.451)
		Merrill Lynch	31.519	54.059	Ruth's Hospitality Group Inc	Bank of America	
35.612	Ribbon Communications Inc	Goldman Sachs	17.219			Merrill Lynch	(8.109)
24.397	Ribbon Communications Inc	Morgan Stanley	13.697	30.703	Ryder System Inc	Bank of America	
(9.019)	RigNet Inc	Bank of America				Merrill Lynch	7.369
		Merrill Lynch	4.960	1.414	Ryder System Inc	Goldman Sachs	339
5.948	RingCentral Inc 'A'	Goldman Sachs	11.618	3.713	Ryerson Holding Corp	Morgan Stanley	2.042
25.768	RingCentral Inc 'A'	Bank of America		(3.807)	Ryman Hospitality Properties		
		Merrill Lynch	39.132		Inc (Reit)	Morgan Stanley	(16.998)
20.861	RingCentral Inc 'A'	Morgan Stanley	61.941	24.033	Ryman Hospitality Properties	Bank of America	
217.444	Riverview Bancorp Inc	Bank of America			Inc (Reit)	Merrill Lynch	69.455
		Merrill Lynch	67.635	14.402	S&P Global Inc	Bank of America	
38.996	Riverview Bancorp Inc	Goldman Sachs	13.259			Merrill Lynch	7.777
91.883	Riverview Bancorp Inc	Morgan Stanley	96.481	5.033	S&P Global Inc	Morgan Stanley	48.857
1.025	RLI Corp/DE	Bank of America		(102.606)	S&T Bancorp Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(730)			Merrill Lynch	(137.521)
30.110	RLI Corp/DE	Morgan Stanley	(36.867)	(158.920)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Morgan Stanley	(177.990)
(266.591)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Bank of America		(313.937)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(597.164)			Merrill Lynch	(266.846)
(98.589)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Morgan Stanley	(113.377)	(354)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Goldman Sachs	(301)
(58.905)	RMR Group Inc/The 'A'	Bank of America		(50.899)	Sabre Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	46.403			Merrill Lynch	(25.450)
20.363	Robert Half International Inc	Bank of America		(73.885)	Safeguard Scientifics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	24.639			Merrill Lynch	(881)
831	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	(382)	(27.799)	Saga Communications Inc 'A'	Morgan Stanley	(13.900)
8.873	Rockwell Automation Inc	Bank of America		(3.929)	Sage Therapeutics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.372)			Merrill Lynch	64.396

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(6.464)	Saia Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56.237)	(12.090)	SEACOR Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.770)
(2.201)	SailPoint Technologies Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.163)	(15.091)	Seagate Technology Plc	Goldman Sachs	(6.942)
(70.622)	Sally Beauty Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.425	(42.214)	Seagate Technology Plc	Morgan Stanley	(9.287)
(56.467)	Sally Beauty Holdings Inc	Morgan Stanley	3.309	(157.049)	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	(134.640)
(21.294)	Sanchez Energy Corp	Morgan Stanley	(219)	17.432	Sears Hometown and Outlet Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.202
(6.691)	Sanderson Farms Inc	Goldman Sachs	82.165	33.246	Sears Hometown and Outlet Stores Inc	Morgan Stanley	6.649
(1.603)	Sanderson Farms Inc	Bank of America Merrill Lynch	19.685	1.684	SeaSpine Holdings Corp	Morgan Stanley	(152)
(469)	Sanderson Farms Inc	Morgan Stanley	1.466	35.957	SeaSpine Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25.170)
68.479	Sandy Spring Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	73.957	(14.213)	SecureWorks Corp 'A'	Morgan Stanley	3.980
30.054	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs	32.458	(98.890)	Select Income (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(140.424)
12.442	Sandy Spring Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1.120)	23.444	Select Income (Reit)	Morgan Stanley	21.100
7.482	Sanmina Corp	Bank of America Merrill Lynch	(748)	4.127	Select Income REIT (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	6.091
5.844	Sanmina Corp	Goldman Sachs	(584)	538	Selective Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	407
19.605	Sanmina Corp	Morgan Stanley	1.961	3.982	Selective Insurance Group Inc	Morgan Stanley	2.484
8.175	Santander Consumer USA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.674)	(20.379)	Selective Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32.606)
(17.798)	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(79.735)	12.893	SemGroup Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6.876
(3.839)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(17.199)	47.424	SemGroup Corp 'A'	Morgan Stanley	81.177
(3.167)	Sarepta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(25.114)	(49.970)	Sempra Energy	Bank of America Merrill Lynch	(27.983)
(26.848)	SBA Communications Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(26.546)	(11.709)	Sempra Energy	Morgan Stanley	1.580
(31.082)	SBA Communications Corp (Reit)	Morgan Stanley	(39.732)	6.886	SendGrid Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.407
14.258	ScanSource Inc	Morgan Stanley	19.248	5.570	SendGrid Inc	Goldman Sachs	3.565
58.553	ScanSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	187.370	5.286	SendGrid Inc	Morgan Stanley	2.062
19.602	ScanSource Inc	Goldman Sachs	62.726	(13.352)	Senior Housing Properties Trust (Reit)	Goldman Sachs	(20.562)
5.222	Schlumberger Ltd	Morgan Stanley	(3.072)	(181.179)	Senior Housing Properties Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(279.016)
(55.940)	Schlumberger Ltd	Bank of America Merrill Lynch	168.185	(54.926)	Senior Housing Properties Trust (Reit)	Morgan Stanley	(58.222)
(9.100)	Schneider National Inc 'B'	Morgan Stanley	(8.736)	4.666	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.311)
77.438	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	7.744	11.393	Sensata Technologies Holding Plc	Morgan Stanley	(8.254)
25.269	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Goldman Sachs	2.527	(12.099)	Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs	6.412
(73.854)	Scholastic Corp	Bank of America Merrill Lynch	(179.823)	(117.152)	Sequential Brands Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52.718)
29.651	Schweitzer-Mauduit International Inc	Bank of America Merrill Lynch	34.988	11.202	Seres Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.576
5.271	Schweitzer-Mauduit International Inc	Goldman Sachs	6.220	13.162	Seres Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1.984
(41.870)	Schweitzer-Mauduit International Inc	Morgan Stanley	29.309	5.132	Seres Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(458)
(62.583)	Science Applications International Corp	Bank of America Merrill Lynch	81.984	(78.785)	Seritage Growth Properties 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(372.686)
(49.362)	Scientific Games Corp/DE 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(15.664)	(10.059)	Seritage Growth Properties 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(12.272)
(1.081)	Scientific Games Corp/DE 'A'	Morgan Stanley	973	(12.483)	Seritage Growth Properties 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(8.884)
13.315	Scorpio Bulkers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.995)	3.227	Service Corp International/US	Bank of America Merrill Lynch	(258)
3.691	Scorpio Bulkers Inc	Goldman Sachs	(1.107)	105.806	Service Corp International/US	Morgan Stanley	(40.206)
17.803	Scorpio Tankers Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.047	(36.818)	Service Corp International/US	Bank of America Merrill Lynch	2.945
(24.717)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(54.872)	13.609	ServiceMaster Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.159)
(20.868)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Morgan Stanley	10.643	17.596	ServiceMaster Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.760)
(586)	Seaboard Corp	Bank of America Merrill Lynch	(116.941)	(153)	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	(938)
(16.829)	Seachange International Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.851	17.157	ServiceSource International Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.976
21.055	Seacoast Banking Corp of Florida	Bank of America Merrill Lynch	32.635				
(68.564)	Seacoast Banking Corp of Florida	Morgan Stanley	22.810				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
15.707	ServiceSource International Inc	Morgan Stanley	785	2.206	SJW Group	Morgan Stanley	6.750
12.553	ServiceSource International Inc	Goldman Sachs	3.640	47.882	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Bank of America	
(429)	ServisFirst Bancshares Inc	Bank of America				Merrill Lynch	11.013
		Merrill Lynch	124	18.686	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Goldman Sachs	4.298
(134.460)	Shenandoah	Bank of America		(10.316)	Skyline Corp	Bank of America	
	Telecommunications Co	Merrill Lynch	(118.839)			Merrill Lynch	(25.481)
(23.853)	Shenandoah			(31.751)	Skyline Corp	Goldman Sachs	(77.528)
	Telecommunications Co	Morgan Stanley	(8.349)	(1.823)	Skyline Corp	Morgan Stanley	(3.318)
(19.906)	Sherwin-Williams Co/The	Bank of America		15.483	Skyworks Solutions Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(127.398)			Merrill Lynch	20.438
(16.944)	Sherwin-Williams Co/The	Morgan Stanley	(168.648)	6.225	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs	8.217
(68.524)	Ship Finance International Ltd	Morgan Stanley	3.426	(18.453)	SL Green Realty Corp (Reit)	Bank of America	
(2.117)	Ship Finance International Ltd	Goldman Sachs	423			Merrill Lynch	(8.304)
62.610	Ship Finance International Ltd	Morgan Stanley	(3.409)	(51.385)	Sleep Number Corp	Bank of America	
2.612	Shoe Carnival Inc	Bank of America				Merrill Lynch	14.902
		Merrill Lynch	8.440	(1.564)	Sleep Number Corp	Morgan Stanley	657
1.041	Shoe Carnival Inc	Morgan Stanley	(200)	(249.760)	SLM Corp	Bank of America	
(7.912)	ShotSpotter Inc	Morgan Stanley	(6.883)			Merrill Lynch	23.727
1.593	Shutterstock Inc	Morgan Stanley	(906)	12.111	SM Energy Co	Bank of America	
12.955	Shutterstock Inc	Bank of America				Merrill Lynch	14.291
		Merrill Lynch	25.133	2.896	SM Energy Co	Goldman Sachs	3.312
(6.027)	Shutterstock Inc	Morgan Stanley	(4.339)	8.758	SM Energy Co	Morgan Stanley	(2.190)
2.620	SI Financial Group Inc	Bank of America		379.815	Smart & Final Stores Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.441			Merrill Lynch	(25.261)
932	SI Financial Group Inc	Goldman Sachs	513	58.611	Smart & Final Stores Inc	Goldman Sachs	(4.396)
107	SI Financial Group Inc	Morgan Stanley	11	46.680	Smart & Final Stores Inc	Morgan Stanley	1.167
(52.091)	Sientra Inc	Bank of America		(33.406)	SMART Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(21.120)
		Merrill Lynch	(76.053)	(17.823)	SMART Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(11.407)
51.029	Sierra Bancorp	Bank of America		33.721	SmartFinancial Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	16.840			Merrill Lynch	5.725
71.247	Sierra Bancorp	Morgan Stanley	(25.649)	20.197	SmartFinancial Inc	Goldman Sachs	3.837
(85)	Signature Bank/New York NY	Bank of America		19.938	SmartFinancial Inc	Morgan Stanley	(18.742)
		Merrill Lynch	337	145.362	Snap Inc 'A'	Morgan Stanley	93.032
(27.741)	Signet Jewelers Ltd	Bank of America		43.726	Snap Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(105.384)			Merrill Lynch	31.438
(19.713)	Signet Jewelers Ltd	Morgan Stanley	(66.039)	15.561	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	11.360
(389)	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs	(1.953)	43.645	Snap-on Inc	Morgan Stanley	(192.474)
(33.154)	Silgan Holdings Inc	Bank of America		3.476	Snap-on Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(13.925)			Merrill Lynch	(6.870)
(66.374)	Silgan Holdings Inc	Morgan Stanley	5.974	415	Snap-on Inc	Goldman Sachs	(2.166)
(5.188)	Silicon Laboratories Inc	Bank of America		(18.064)	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	Goldman Sachs	103.145
		Merrill Lynch	(22.308)	(14.125)	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	Morgan Stanley	35.415
(27.347)	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	(272.233)	10.557	Sohu.com Inc	Morgan Stanley	3.378
3.254	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Bank of America		704	Sohu.com Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.374			Merrill Lynch	(592)
2.843	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1.457	1.386	Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	Goldman Sachs	(292)
5.394	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'		4.025	93.834	Sonic Automotive Inc 'A'	Bank of America	
(224.823)	Simmons First National Corp 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	115.672
		Merrill Lynch	(281.029)	39.966	Sonic Automotive Inc 'A'	Goldman Sachs	48.140
(100.776)	Simmons First National Corp 'A'	Morgan Stanley	(84.561)	23.158	Sonic Automotive Inc 'A'	Morgan Stanley	10.421
25.292	Simon Property Group Inc (Reit)	Bank of America		(31.134)	Sonic Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	153.775			Merrill Lynch	7.472
4.507	SINA Corp/China	Morgan Stanley	(6.763)	(260.601)	Sonic Corp	Goldman Sachs	62.544
(18.565)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	45.484	7.999	Sonoco Products Co	Bank of America	
67.322	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(164.939)			Merrill Lynch	5.519
(308.762)	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	(58.665)	7.226	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	4.986
(156.259)	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs	(40.627)	52.549	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	4.255
(67.424)	SiteOne Landscape Supply Inc	Bank of America		15.133	Sotheby's	Bank of America	
		Merrill Lynch	188.264			Merrill Lynch	(19.219)
(26.434)	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	64.235	27.673	Sotheby's	Morgan Stanley	(3.874)
(14.402)	SITO Mobile Ltd	Bank of America		1.496	Sotheby's	Goldman Sachs	(1.900)
		Merrill Lynch	1.872	(118.588)	South Jersey Industries Inc	Bank of America	
(66.470)	SITO Mobile Ltd	Goldman Sachs	8.641			Merrill Lynch	(83.012)
(3.478)	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America		(55.692)	South Jersey Industries Inc	Morgan Stanley	(186.903)
		Merrill Lynch	(6.678)	(11.778)	South Jersey Industries Inc	Goldman Sachs	(8.245)
(54.608)	Six Flags Entertainment Corp	Morgan Stanley	(61.204)	58.283	South State Corp	Bank of America	
30.162	SJW Group	Bank of America				Merrill Lynch	96.167
		Merrill Lynch	141.158	(112.995)	Southern Co/The	Bank of America	
1.129	SJW Group	Goldman Sachs	5.284			Merrill Lynch	(46.328)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(135.047)	Southern Co/The	Morgan Stanley	91.609	15.180	STAG Industrial Inc (Reit)	Goldman Sachs	15.028
(35.634)	Southern Copper Corp	Bank of America		(2.658)	Stamps.com Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	70.199			Merrill Lynch	(22.726)
(58.556)	Southern Copper Corp	Goldman Sachs	114.084	552	Stamps.com Inc	Bank of America	
(33.821)	Southern Copper Corp	Morgan Stanley	66.992			Merrill Lynch	2.135
414	Southern First Bancshares Inc	Bank of America		1.828	Stamps.com Inc	Morgan Stanley	6.722
		Merrill Lynch	(123)	(58.664)	Standard Motor Products Inc	Bank of America	
(6.029)	Southern National Bancorp of Virginia Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(100.315)
(2.675)	Southern National Bancorp of Virginia Inc	Merrill Lynch	(5.667)	808	Standex International Corp	Morgan Stanley	1.293
29.256	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	(2.515)	13.705	Standex International Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(17.953)	2.022	Standex International Corp	Merrill Lynch	70.631
111.101	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	(129.669)	1.574	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	9.240
5.806	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	(3.600)			Bank of America	
549	Southwest Gas Holdings Inc	Morgan Stanley	15	59.918	Stanley Black & Decker Inc	Merrill Lynch	(8.623)
12.621	Southwest Gas Holdings Inc	Bank of America		(86.352)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	(144.228)
		Merrill Lynch	42.154			Bank of America	
(27.758)	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	298	(172.382)	Starbucks Corp	Merrill Lynch	(38.705)
77.751	Southwestern Energy Co	Bank of America		(115.248)	StarTek Inc	Morgan Stanley	54.096
		Merrill Lynch	13.995			Bank of America	
(801)	Spark Therapeutics Inc	Bank of America		(82.202)	StarTek Inc	Merrill Lynch	(41.397)
		Merrill Lynch	(3.316)	(476.732)	Starwood Property Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(32.059)
1.979	SpartanNash Co	Bank of America				Morgan Stanley	(536.420)
		Merrill Lynch	9.931	(160.137)	Starwood Property Trust Inc (Reit)	Bank of America	
200	SpartanNash Co	Morgan Stanley	681	(336.031)	State Auto Financial Corp	Merrill Lynch	(49.482)
(56.367)	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs	(274.962)			Bank of America	
3.927	Spectrum Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	7.304	(56.942)	State Auto Financial Corp	Merrill Lynch	(591.415)
(1.211)	Spire Inc	Goldman Sachs	(1.695)	(81.150)	State Bank Financial Corp	Morgan Stanley	(524.436)
(6.925)	Spire Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.925)	(690)	State Bank Financial Corp	Merrill Lynch	4.923
40.855	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	191.205	(1.991)	State Street Corp	Morgan Stanley	(159)
(7.098)	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Bank of America				Bank of America	
2.512	Spirit Airlines Inc	Merrill Lynch	(9.298)	17.479	State Street Corp	Merrill Lynch	9.716
(322.439)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	301	9.966	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	(33.874)
(518.685)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Bank of America	(49.978)			Bank of America	
		Merrill Lynch	(236.002)	(23.792)	Steel Dynamics Inc	Merrill Lynch	12.059
12.398	Splunk Inc	Bank of America		27.554	Steelcase Inc 'A'	Morgan Stanley	(5.710)
		Merrill Lynch	(9.918)	84.582	Steelcase Inc 'A'	Bank of America	
1.960	Splunk Inc	Goldman Sachs	(1.568)	2.602	Stepan Co	Merrill Lynch	13.777
27.567	Splunk Inc	Morgan Stanley	(57.339)			Morgan Stanley	21.146
31.722	Spotify Technology SA	Morgan Stanley	100.140	(49.707)	Stericycle Inc	Bank of America	
255.582	Sprint Corp	Bank of America				Merrill Lynch	9.940
		Merrill Lynch	5.112	(33.707)	Stericycle Inc	Morgan Stanley	(31.315)
1.086.407	Sprint Corp	Morgan Stanley	(38.442)	49.504	Steris Plc	Bank of America	(31.923)
1.680	Sprouts Farmers Market Inc	Bank of America				Merrill Lynch	181.680
		Merrill Lynch	(50)	3.264	Steris Plc	Goldman Sachs	11.979
2.478	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs	(74)	13.219	Sterling Bancorp Inc/MI	Bank of America	
66.495	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	5.985			Merrill Lynch	3.305
8.005	SPS Commerce Inc	Bank of America		4.435	Sterling Bancorp Inc/MI	Goldman Sachs	1.109
		Merrill Lynch	33.249	(2.499)	Sterling Bancorp/DE	Goldman Sachs	(1.125)
5.776	SPS Commerce Inc	Morgan Stanley	12.848	(548.429)	Sterling Bancorp/DE	Bank of America	
(13.794)	SPX Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(246.793)
		Merrill Lynch	(910)	(324.038)	Sterling Bancorp/DE	Morgan Stanley	-
(39.694)	SPX Corp	Morgan Stanley	17.068	(2.721)	Steven Madden Ltd	Morgan Stanley	(3.481)
(753)	SPX Flow Inc	Morgan Stanley	(42)	1.101	Stifel Financial Corp	Bank of America	
1.599	Square Inc 'A'	Morgan Stanley	6.604			Merrill Lynch	716
21.692	Square Inc 'A'	Bank of America		2.019	Stifel Financial Corp	Goldman Sachs	1.312
		Merrill Lynch	89.154	14.487	Stoneridge Inc	Bank of America	
783	Square Inc 'A'	Goldman Sachs	3.218			Merrill Lynch	3.477
(4.919)	Square Inc 'A'	Morgan Stanley	(16.067)	11.747	Stoneridge Inc	Goldman Sachs	2.819
(102.140)	SRC Energy Inc	Morgan Stanley	(35.749)	2.849	Stoneridge Inc	Morgan Stanley	(1.111)
43.645	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America		100.590	STORE Capital Corp (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	77.252			Merrill Lynch	137.808
25.862	STAAR Surgical Co	Bank of America		3.556	STORE Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	4.872
		Merrill Lynch	133.189	(20.984)	Stratasys Ltd	Bank of America	
1.165	STAAR Surgical Co	Goldman Sachs	6.000			Merrill Lynch	29.797
9.818	STAAR Surgical Co	Morgan Stanley	26.018	(37.196)	Stratasys Ltd	Morgan Stanley	31.989
42.130	STAG Industrial Inc (Reit)	Bank of America		(13.982)	Stratus Properties Inc	Morgan Stanley	(9.088)
		Merrill Lynch	41.709	(4.588)	Stratus Properties Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(6.423)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(15.543) (7.201)	Stratus Properties Inc Strayer Education Inc	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	(21.760) (64.881)	4.310 29.298	SYNNEX Corp SYNNEX Corp	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	3.707 4.688
(2.550) 26.997	Strayer Education Inc Stryker Corp	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(1.103) 161.948	7.965 88.883	SYNNEX Corp Synopsys Inc	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	1.274 (24.887)
11.133 1.867 2.969	Stryker Corp Stryker Corp Summit Hotel Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	76.551 14.301 2.642	61.300 (4.318) 124.547	Synopsys Inc Synovus Financial Corp Synovus Financial Corp	Morgan Stanley Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	339.284 (3.623) 2.075
54.059 5.472 23.475	Summit Hotel Properties Inc (Reit) Summit Materials Inc 'A' Summit Materials Inc 'A'	Morgan Stanley Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	26.489 (7.661) (32.865)	3.249 815 4.347	Synovus Financial Corp Syntel Inc Syntel Inc	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch Goldman Sachs	682 1.111 5.912
630 26.754	Summit Materials Inc 'A' Sun Communities Inc (Reit)	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(372) 94.675	(46.147) (64.759) 4.252	Sysco Corp Sysco Corp Systemax Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	4.138 (253.643) 11.693
1.305 (79.032)	Sun Communities Inc (Reit) Sun Hydraulics Corp	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	5.101 (118.966)	(21.624)	T Rowe Price Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(90.719)
(22.346) (101.113)	Sun Hydraulics Corp Sunrun Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	9.162 (61.449)	(65.130) (109.871)	T Rowe Price Group Inc T-Mobile US Inc	Morgan Stanley Morgan Stanley	73.854 150.523
(53.575) (26.545)	Sunrun Inc Sunrun Inc	Morgan Stanley Goldman Sachs	(37.468) (19.270)	(2.625)	T2 Biosystems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.995)
137.845 11.417	Sunstone Hotel Investors Inc (Reit) Sunstone Hotel Investors Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch Goldman Sachs	169.549 14.043	(5.518) 18.767	T2 Biosystems Inc Tableau Software Inc 'A'	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	5.352 125.402
2.312 22.678	Sunstone Hotel Investors Inc (Reit) SunTrust Banks Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	740 (45.810)	2.883 (10.457)	Tableau Software Inc 'A' Tabula Rasa HealthCare Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	11.918 (58.036)
8.050 (2.745)	SunTrust Banks Inc Super Micro Computer Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(1.066) (1.488)	(15.194) (94.572)	Tactile Systems Technology Inc Tahoe Resources Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(41.024) (31.832)
(106.988) 80.134 4.054	Super Micro Computer Inc Superior Energy Services Inc Superior Energy Services Inc	Morgan Stanley Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(269.491) (88.949) (1.986)	(35.268) (17.865)	Tailored Brands Inc Take-Two Interactive Software Inc	Bank of America Merrill Lynch Morgan Stanley	32.272 (47.996)
(53.650) (629) (66.394)	Superior Energy Services Inc Supernus Pharmaceuticals Inc SuperValu Inc	Bank of America Merrill Lynch Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	26.289 (821) (170.068)	2.602 3.332 (11.254)	Take-Two Interactive Software Inc Talend SA ADR Talos Energy Inc	Merrill Lynch Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	8.566 3.499 (12.830)
(61.028) 56.077	SuperValu Inc Surface Oncology Inc	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	(155.349) (10.214)	4.458 14.931 52.013	Talos Energy Inc Talos Energy Inc Tanger Factory Outlet Centers Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch Morgan Stanley	8.373 17.981 43.691
10.285 2.298 (4.469)	Surface Oncology Inc Surface Oncology Inc SVB Financial Group	Goldman Sachs Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(3.553) (2.183) 38.746	(8.206) (34.381) (75.098)	Tanger Factory Outlet Centers Inc (Reit) Tapestry Inc	Goldman Sachs Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(12.801) 140.650 102.133
9.811 11.254 (148.030)	SVB Financial Group Switch Inc 'A' Sykes Enterprises Inc	Morgan Stanley Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(81.152) 1.006 (249.075)	(33.557) 88.348	Targa Resources Corp Target Corp	Bank of America Merrill Lynch Bank of America Merrill Lynch	21.476 37.044 (346)
(125.789) (122.262)	Symantec Corp Symantec Corp	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	46.652 163.831	2.607 67.581 (72)	Target Corp Target Corp Taro Pharmaceutical Industries Ltd	Goldman Sachs Morgan Stanley Morgan Stanley	(78.458)
(3.149) (82.988)	Synaptics Inc Synchronoss Technologies Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(1.669) 29.876	(16.644)	Taubman Centers Inc (Reit)	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(1.327)
(78.125) 2.766	Synchronoss Technologies Inc Synchrony Financial	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(11.719) 1.189	(19.058) 101.607	Taubman Centers Inc (Reit) Taylor Morrison Home Corp 'A'	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(31.446)
6.858 21.839	Syndax Pharmaceuticals Inc Syndax Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	(15.019) (47.827)	21.487 (30.070) (30.896)	Taylor Morrison Home Corp 'A' Taylor Morrison Home Corp 'A' TCF Financial Corp	Goldman Sachs Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	69.093 14.611 11.578
(3.407) (54.273)	Syneos Health Inc Syneos Health Inc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(3.237) (149.251)	(75.319)	TCF Financial Corp	Morgan Stanley	(20.082) (6.779)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(5.517)	TD Ameritrade Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	8.110	147.056	Terreno Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	79.410
134.959	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	(600.818)	3.912	TESARO Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.232)
76.731	TE Connectivity Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(63.763)	3.219	TESARO Inc	Goldman Sachs	(7.597)
(157.753)	Team Inc	Bank of America Merrill Lynch	(118.315)	257	TESARO Inc	Morgan Stanley	(1.090)
1.316	Tech Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.715	(10.243)	Tesla Inc	Goldman Sachs	359.154
4.124	Tech Data Corp	Morgan Stanley	40.966	(8.044)	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42.163)
32.842	TechnipFMC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(22.661)	33.133	Tetra Tech Inc	Bank of America Merrill Lynch	54.921
1.393	TechnipFMC Plc	Goldman Sachs	(961)	11.302	Tetra Tech Inc	Morgan Stanley	16.953
20.329	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	(33.843)	2.046	Tetra Tech Inc	Goldman Sachs	6.240
97.084	TechTarget Inc	Bank of America Merrill Lynch	293.748	43.413	Tetraphase		
17.137	TechTarget Inc	Goldman Sachs	49.669	12.988	Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	4.341
21.935	TechTarget Inc	Morgan Stanley	51.547		Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(260)
5.621	Tegna Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.911)	33.792	Tetraphase		
(5.149)	Tegna Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.751	(32.233)	Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(676)
42.174	Tegna Inc	Morgan Stanley	(21.930)		Texas Capital Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	108.546
(43.403)	Teladoc Inc	Morgan Stanley	(71.615)	33.031	Texas Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	106.571
(3.411)	Telaria Inc	Bank of America Merrill Lynch	102	331	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs	449
4.687	Teledyne Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	32.272	2.772	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	6.698
305	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs	1.742	273.339	Texas Roadhouse Inc	Bank of America Merrill Lynch	789.663
(21.078)	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(193.074)	2.722	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs	7.879
(409)	Teleflex Inc	Morgan Stanley	(1.948)	(3.185)	Textainer Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	1.911
25.696	Telefonica Brasil SA ADR	Goldman Sachs	(12.833)	172.784	TFS Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	133.908
15.362	Telefonica Brasil SA ADR	Morgan Stanley	(6.452)	28.972	TFS Financial Corp	Morgan Stanley	13.472
100.899	Telephone & Data Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38.751)	16.969	TFS Financial Corp	Goldman Sachs	13.151
8.045	Telephone & Data Systems Inc	Goldman Sachs	(3.666)	(23.824)	TG Therapeutics Inc	Morgan Stanley	7.147
154.140	Telephone & Data Systems Inc	Morgan Stanley	(135.643)	(5.120)	TG Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	768
(32.016)	Teligent Inc/NJ	Bank of America Merrill Lynch	1.281	(5.211)	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs	782
(504.412)	Teligent Inc/NJ	Morgan Stanley	(65.574)	38.229	TherapeuticsMD Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.172)
(19.151)	Teligent Inc/NJ	Goldman Sachs	766	31.802	TherapeuticsMD Inc	Morgan Stanley	1.272
(8.022)	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	16.525	(1.870)	Theravance Biopharma Inc	Goldman Sachs	(262)
(1.204)	Tempur Sealy International Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.311	5.865	Theravance Biopharma Inc	Morgan Stanley	(1.580)
(29.004)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs	67.340	1.479	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.834
3.720	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	10.490	4.961	Thermon Group Holdings Inc	Morgan Stanley	(5.854)
14.519	Tenet Healthcare Corp	Bank of America Merrill Lynch	40.798	25.833	Thermon Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	517
(70.405)	Tennant Co	Bank of America Merrill Lynch	(415.390)	8.511	Thermon Group Holdings Inc	Goldman Sachs	170
(10.379)	Tennant Co	Morgan Stanley	(21.277)	(153.190)	Third Point Reinsurance Ltd	Morgan Stanley	30.638
24.866	Tenneco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63.906)	289	Thor Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.295)
10.883	Tenneco Inc	Goldman Sachs	(27.969)	(4.664)	TIER Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(2.009)
17.669	Tenneco Inc	Morgan Stanley	(57.778)	15.073	Tiffany & Co	Bank of America Merrill Lynch	445.558
(17.539)	Teradata Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17.446)	130.687	Tile Shop Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	62.076
802	Teradata Corp	Morgan Stanley	1.123	22.571	Tile Shop Holdings Inc	Goldman Sachs	10.721
(5.346)	Teradyne Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15.878)	4.450	Tile Shop Holdings Inc	Morgan Stanley	779
(133.351)	Teradyne Inc	Morgan Stanley	(69.343)	(34.731)	Tilly's Inc	Bank of America Merrill Lynch	(74.324)
5.030	Terex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8.149)	(6.496)	Tilly's Inc	Goldman Sachs	(13.901)
1.681	Terex Corp	Morgan Stanley	(4.236)	67.416	TIM Participacoes SA ADR	Goldman Sachs	(68.216)
(7.580)	TerraForm Power Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(379)	28.823	TIM Participacoes SA ADR	Morgan Stanley	(23.347)
(80.869)	TerraForm Power Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.043)	1.020	Timberland Bancorp Inc/WA	Morgan Stanley	612
910	TerraForm Power Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	177	3.448	Timberland Bancorp Inc/WA	Bank of America Merrill Lynch	3.290
192.071	TerraForm Power Inc 'A'	Morgan Stanley	42.868	680	Timberland Bancorp Inc/WA	Goldman Sachs	714
				1.200	Time Warner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.200)
				1.119	Time Warner Inc	Morgan Stanley	(1.130)

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(890)	Timken Co/The	Bank of America		(133.701)	Trecora Resources	Bank of America	
		Merrill Lynch	846			Merrill Lynch	(120.331)
30.415	Timken Co/The	Morgan Stanley	(54.747)	(13.445)	Trecora Resources	Morgan Stanley	(6.723)
21.350	TimkenSteel Corp	Bank of America		(38.421)	Tredegear Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.989			Merrill Lynch	(124.868)
6.752	TimkenSteel Corp	Goldman Sachs	945	(4.411)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America	
5.181	TimkenSteel Corp	Morgan Stanley	(1.347)			Merrill Lynch	(3.044)
(5.105)	Tiptree Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(1.404)	(6.200)	TreeHouse Foods Inc	Morgan Stanley	(4.787)
(37.318)	Titan International Inc	Bank of America		(37.599)	Trevena Inc	Goldman Sachs	1.967
		Merrill Lynch	(6.603)	21.795	Trex Co Inc	Bank of America	
(79.178)	Titan International Inc	Morgan Stanley	28.504			Merrill Lynch	174.013
18.005	Titan Machinery Inc	Bank of America		428	Trex Co Inc	Morgan Stanley	1.866
		Merrill Lynch	(5.402)	20.470	TRI Pointe Group Inc	Bank of America	
6.277	Titan Machinery Inc	Goldman Sachs	(1.883)			Merrill Lynch	32.752
2.825	Titan Machinery Inc	Morgan Stanley	(7.204)	2.950	TRI Pointe Group Inc	Goldman Sachs	4.720
46.351	Tivity Health Inc	Morgan Stanley	(70.998)	47.359	TriCo Bancshares	Bank of America	
(11.111)	TiVo Corp	Morgan Stanley	(1.049)			Merrill Lynch	70.565
(22.221)	TJX Cos Inc/The	Morgan Stanley	(31.872)	76.326	TriCo Bancshares	Morgan Stanley	(15.265)
(8.007)	TJX Cos Inc/The	Bank of America		(74.308)	Trimble Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(36.992)			Merrill Lynch	47.557
387	Tompkins Financial Corp	Bank of America		(40.122)	Trimble Inc	Morgan Stanley	27.684
		Merrill Lynch	1.567	(19.448)	TriNet Group Inc	Bank of America	
1.705	Tompkins Financial Corp	Goldman Sachs	6.905			Merrill Lynch	(28.394)
900	Tompkins Financial Corp	Morgan Stanley	(288)	(34.481)	Trinity Industries Inc	Bank of America	
(11.446)	TopBuild Corp	Bank of America				Merrill Lynch	21.021
		Merrill Lynch	(66.143)	(3.773)	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs	2.037
(123.659)	Torchmark Corp	Morgan Stanley	315.463	(19.342)	Trinity Place Holdings Inc	Bank of America	
1.316	Torchmark Corp	Goldman Sachs	(763)			Merrill Lynch	(5.996)
(16.659)	Toro Co/The	Bank of America		(1.221)	Trinity Place Holdings Inc	Goldman Sachs	(4)
		Merrill Lynch	(7.250)	856	Trinseo SA	Goldman Sachs	(2.054)
37.126	Total System Services Inc	Bank of America		961	Trinseo SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	8.539			Merrill Lynch	(2.306)
1.636	Total System Services Inc	Goldman Sachs	376	845	Trinseo SA	Morgan Stanley	(2.831)
1.270	Total System Services Inc	Morgan Stanley	1.448	(83.178)	Triple-S Management Corp 'B'	Bank of America	
25.387	Tower International Inc	Morgan Stanley	8.885			Merrill Lynch	(310.254)
160.809	Tower International Inc	Bank of America		155.452	TriState Capital Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	209.052			Merrill Lynch	-
34.885	Tower International Inc	Goldman Sachs	45.351	35.573	TriState Capital Holdings Inc	Goldman Sachs	-
34.725	Tower Semiconductor Ltd	Morgan Stanley	20.609	9.849	TriState Capital Holdings Inc	Morgan Stanley	(10.341)
(2.985)	Town Sports International Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.642)	(17.536)	Triton International Ltd/Bermuda	Goldman Sachs	12.741
24.382	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	3.901	(33.239)	Triton International Ltd/Bermuda	Morgan Stanley	(19.040)
15.389	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	2.462	(24.765)	Triumph Bancorp Inc	Bank of America	
124.474	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(23.527)
(4.328)	TPI Composites Inc	Merrill Lynch	19.916	4.920	Triumph Group Inc	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	(12.735)
(164.311)	TPI Composites Inc	Merrill Lynch	(995)	43.375	Triumph Group Inc	Morgan Stanley	(118.081)
9.926	Tractor Supply Co	Goldman Sachs	(37.792)	(28.100)	tronc Inc	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	7.306
(934)	Trade Desk Inc/The 'A'	Merrill Lynch	41.888	(74.330)	Tronox Ltd 'A'	Goldman Sachs	(47.908)
		Bank of America		(7.667)	TrueBlue Inc	Morgan Stanley	(7.250)
(4.397)	TransDigm Group Inc	Merrill Lynch	(2.966)	58.690	TrueCar Inc	Bank of America	
(7.329)	TransDigm Group Inc	Morgan Stanley	(38.078)			Merrill Lynch	25.144
		Bank of America		13.722	TrueCar Inc	Morgan Stanley	10.566
66.555	Transocean Ltd	Merrill Lynch	(78.132)	32.014	TrueCar Inc	Goldman Sachs	12.875
		Bank of America		(7.757)	Trupanion Inc	Bank of America	
4.740	Transocean Ltd	Merrill Lynch	(66.555)			Merrill Lynch	(32.564)
17.356	TransUnion	Goldman Sachs	(4.740)	(2.417)	TTEC Holdings Inc	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	(1.325)
6.849	TransUnion	Merrill Lynch	(4.450)	(21.111)	Tucows Inc 'A'	Bank of America	
1.522	TransUnion	Morgan Stanley	2.150			Merrill Lynch	1.056
14.074	Travelers Cos Inc/The	Goldman Sachs	(517)	(1.279)	Tucows Inc 'A'	Goldman Sachs	64
		Bank of America		(18.102)	Tupperware Brands Corp	Bank of America	
702	Travelers Cos Inc/The	Merrill Lynch	(23.785)			Merrill Lynch	8.689
54.453	Travelport Worldwide Ltd	Goldman Sachs	(1.186)	(41.445)	Tupperware Brands Corp	Morgan Stanley	64.356
		Bank of America		31.257	Tutor Perini Corp	Morgan Stanley	(1.563)
(6.631)	Travelport Worldwide Ltd	Merrill Lynch	17.425	(77.905)	Twenty-First Century Fox Inc 'A'	Bank of America	
		Morgan Stanley	303			Merrill Lynch	(49.859)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
33.515	Twilio Inc 'A'	Bank of America	46.586	37.284	United Community Banks Inc/GA	Goldman Sachs	(5.294)
(7.173)	Twilio Inc 'A'	Merrill Lynch	(4.989)	370.176	United Community Financial Corp/OH	Bank of America	103.649
7.923	Twin Disc Inc	Bank of America	(2.060)	13.228	United Community Financial Corp/OH	Goldman Sachs	3.704
3.952	Twin Disc Inc	Goldman Sachs	(1.028)	69.321	United Community Financial Corp/OH	Morgan Stanley	3.466
2.642	Twin Disc Inc	Morgan Stanley	(3.461)	(4.644)	United Continental Holdings Inc	Bank of America	(5.898)
11.443	Twitter Inc	Goldman Sachs	21.398	(3.002)	United Continental Holdings Inc	Morgan Stanley	710
46.261	Twitter Inc	Bank of America	82.500	(29.768)	United Insurance Holdings Corp	Bank of America	(4.763)
21.342	Twitter Inc	Merrill Lynch	37.562	(11.378)	United Insurance Holdings Corp	Goldman Sachs	(1.820)
(147.396)	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Bank of America	(17.826)	49.263	United Natural Foods Inc	Bank of America	30.711
(16.126)	Tyler Technologies Inc	Merrill Lynch	(63.053)	8.814	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs	5.905
13.072	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America	19.216	86.792	United Natural Foods Inc	Morgan Stanley	8.679
885	Tyson Foods Inc 'A'	Merrill Lynch	770	(11.628)	United Parcel Service Inc 'B'	Bank of America	(11.744)
(78.682)	Tyson Foods Inc 'A'	Morgan Stanley	(49.774)	(237)	United Rentals Inc	Bank of America	1.121
177	Tyson Foods Inc 'A'	Goldman Sachs	260	1.058	United States Cellular Corp	Bank of America	(1.418)
6.492	Ubiquiti Networks Inc	Bank of America	22.332	680	United States Cellular Corp	Morgan Stanley	(823)
1.042	Ubiquiti Networks Inc	Merrill Lynch	1.315	(9.731)	United States Steel Corp	Bank of America	(21.700)
3.437	UBS Group AG	Bank of America	(2.669)	(36.594)	United Technologies Corp	Merrill Lynch	(30.007)
7.064	UBS Group AG	Morgan Stanley	(5.538)	(42.504)	United Technologies Corp	Morgan Stanley	104.122
65.693	UDR Inc (Reit)	Bank of America	70.292	11.993	United Therapeutics Corp	Bank of America	1.319
47.346	UDR Inc (Reit)	Merrill Lynch	54.538	1.719	United Therapeutics Corp	Goldman Sachs	189
118.859	UGI Corp	Morgan Stanley	158.082	191	United Therapeutics Corp	Morgan Stanley	552
48.048	UGI Corp	Bank of America	53.463	6.104	UnitedHealth Group Inc	Morgan Stanley	8.918
2.780	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Merrill Lynch	(132)	(173.418)	Unifi Group Inc (Reit)	Bank of America	(145.671)
3.670	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Morgan Stanley	(8.368)	(207.995)	Unifi Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	(545.792)
2.234	Ultimate Software Group Inc/The	Morgan Stanley	11.713	(39.519)	Unifi Group Inc (Reit)	Goldman Sachs	(33.196)
7.253	Ultra Clean Holdings Inc	Bank of America	1.958	84.955	Univar Inc	Bank of America	18.416
3.477	Ultra Clean Holdings Inc	Merrill Lynch	4.520	56.804	Univar Inc	Morgan Stanley	15.292
6.772	Ultra Petroleum Corp	Bank of America	(1.625)	1.921	Univar Inc	Goldman Sachs	768
(1.287)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Merrill Lynch	(1.849)	(56.305)	Universal Corp/VA	Bank of America	(662.869)
(3.125)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	(23.875)	(14.386)	Universal Corp/VA	Morgan Stanley	(190.143)
(46.498)	Ultrapar Participacoes SA ADR	Goldman Sachs	60.447	(733)	Universal Display Corp	Goldman Sachs	1.283
(77.665)	Ultrapar Participacoes SA ADR	Morgan Stanley	511.787	(3.043)	Universal Display Corp	Bank of America	5.325
22.264	UMB Financial Corp	Morgan Stanley	110.402	(46.685)	Universal Electronics Inc	Bank of America	(9.337)
(55.211)	Umpqua Holdings Corp	Bank of America	3.679	254.421	Universal Forest Products Inc	Bank of America	811.603
(8.883)	Under Armour Inc 'A'	Merrill Lynch	(14.568)	3.437	Universal Forest Products Inc	Merrill Lynch	10.964
(64.619)	Under Armour Inc 'A'	Bank of America	(163.127)	11.134	Universal Forest Products Inc	Goldman Sachs	15.588
(11.344)	Under Armour Inc 'A'	Merrill Lynch	(29.494)	(125.248)	Universal Health Realty Income Trust (Reit)	Bank of America	(485.962)
(48.567)	Unifi Inc	Goldman Sachs	(10.639)	(7.481)	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America	8.379
(4.602)	UniFirst Corp/MA	Bank of America	(19.328)	18.094	Universal Logistics Holdings Inc	Merrill Lynch	9.471
(12.239)	UniFirst Corp/MA	Merrill Lynch	(41.001)	600	Universal Logistics Holdings Inc	Goldman Sachs	420
44.429	Union Bankshares Corp	Morgan Stanley	202.344	8.742	Universal Stainless & Alloy Products Inc	Bank of America	(10.038)
(136.162)	Union Bankshares Corp	Bank of America	(56.201)	1.226	Universal Stainless & Alloy Products Inc	Merrill Lynch	(3.907)
(1.602)	Union Pacific Corp	Merrill Lynch	(7.770)	(72.544)	Univest Corp of Pennsylvania	Bank of America	7.254
21.639	Unit Corp	Bank of America	(10.603)			Merrill Lynch	
(15.714)	United Bankshares Inc/WV	Morgan Stanley	4.437				
219.193	United Community Banks Inc/GA	Bank of America	(28.670)				
107.503	United Community Banks Inc/GA	Merrill Lynch	(56.176)				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
58.460	Unum Group	Bank of America		42.649	Vanda Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.775)			Merrill Lynch	31.987
13.597	Unum Group	Goldman Sachs	(1.360)	190	Vanda Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	143
75.111	Unum Group	Morgan Stanley	(79.014)	(46.872)	Varex Imaging Corp	Bank of America	
17.005	Unum Therapeutics Inc	Bank of America				Merrill Lynch	3.567
		Merrill Lynch	4.423	(30.915)	Varex Imaging Corp	Morgan Stanley	22.877
3.598	Unum Therapeutics Inc	Morgan Stanley	259	2.828	Varian Medical Systems Inc	Goldman Sachs	3.874
394	Urban Edge Properties (Reit)	Bank of America		14.691	Varian Medical Systems Inc	Morgan Stanley	659
		Merrill Lynch	579	7.420	Varian Medical Systems Inc	Bank of America	
16.444	Urban Edge Properties (Reit)	Morgan Stanley	17.924			Merrill Lynch	9.751
58.466	Urban One Inc	Morgan Stanley	23.386	78.460	Varonis Systems Inc	Bank of America	
10.737	Urban One Inc	Goldman Sachs	4.832			Merrill Lynch	400.146
41.810	Urban Outfitters Inc	Bank of America		(122.015)	VASCO Data Security	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.627)		International Inc	Merrill Lynch	(219.108)
4.649	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs	(379)	72.064	Vector Group Ltd	Bank of America	
93.862	Urban Outfitters Inc	Morgan Stanley	102.563			Merrill Lynch	3.199
53.687	US Auto Parts Network Inc	Morgan Stanley	(4.295)	36.198	Vector Group Ltd	Goldman Sachs	312
16.566	US Auto Parts Network Inc	Bank of America		37.669	Vector Group Ltd	Morgan Stanley	11.977
		Merrill Lynch	(497)	(148.297)	Vectren Corp	Morgan Stanley	(84.476)
22.460	US Auto Parts Network Inc	Goldman Sachs	(674)	34.448	Vectren Corp	Bank of America	
(7.715)	US Bancorp	Bank of America				Merrill Lynch	38.926
		Merrill Lynch	13.501	917	Vectrus Inc	Bank of America	
40.813	US Bancorp	Morgan Stanley	(72.774)			Merrill Lynch	451
1.396	US Concrete Inc	Bank of America		(63.359)	Veeco Instruments Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.537			Merrill Lynch	(57.023)
2.713	US Concrete Inc	Morgan Stanley	8.817	27.359	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America	
(23.789)	US Concrete Inc	Goldman Sachs	(3.568)			Merrill Lynch	49.793
(58.515)	US Ecology Inc	Bank of America		19.544	Veeva Systems Inc 'A'	Morgan Stanley	53.095
		Merrill Lynch	(146.288)	906	Veeva Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	1.649
6.042	US Foods Holding Corp	Bank of America		39.742	Venator Materials Plc	Morgan Stanley	(12.717)
		Merrill Lynch	5.921	2.757	Venator Materials Plc	Bank of America	
(129.648)	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	(66.120)			Merrill Lynch	110
2.016	US Silica Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.298)	1.097	Ventas Inc (Reit)	Goldman Sachs	2.457
(16.988)	US Silica Holdings Inc	Morgan Stanley	19.366	98.654	Ventas Inc (Reit)	Bank of America	
511	US Silica Holdings Inc	Goldman Sachs	(301)			Merrill Lynch	220.985
(31.027)	USA Technologies Inc	Bank of America		307	Ventas Inc (Reit)	Morgan Stanley	559
		Merrill Lynch	(62.054)	(85.292)	Vera Bradley Inc	Bank of America	
(154.030)	USA Technologies Inc	Morgan Stanley	(300.359)			Merrill Lynch	(91.262)
(5.716)	USA Truck Inc	Bank of America		76.689	Veracyte Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	14.747			Merrill Lynch	91.818
(6.371)	USA Truck Inc	Goldman Sachs	16.437	36.203	Veracyte Inc	Goldman Sachs	43.053
9.696	USANA Health Sciences Inc	Bank of America		25.420	Veracyte Inc	Morgan Stanley	12.964
		Merrill Lynch	30.088	(205.461)	VEREIT Inc (Reit)	Morgan Stanley	(34.928)
1.244	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	5.287	(799.408)	VEREIT Inc (Reit)	Bank of America	
9.435	USANA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	(21.229)			Merrill Lynch	(111.917)
(17.836)	USG Corp	Bank of America		(25.971)	Vericel Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.319)			Merrill Lynch	-
(13.117)	USG Corp	Morgan Stanley	(2.654)	16.312	Verint Systems Inc	Bank of America	
3.209	Utah Medical Products Inc	Bank of America				Merrill Lynch	14.681
		Merrill Lynch	17.329	(89.236)	Verint Systems Inc	Bank of America	
1.523	Utah Medical Products Inc	Goldman Sachs	8.224			Merrill Lynch	(51.618)
95.179	Vale SA ADR	Morgan Stanley	(64.722)	(14.221)	VeriSign Inc	Morgan Stanley	(117.017)
30.016	Vale SA ADR	Goldman Sachs	(16.140)	(62.840)	Verisk Analytics Inc	Bank of America	
6.605	Valeant Pharmaceuticals	Bank of America				Merrill Lynch	(115.626)
	International Inc	Merrill Lynch	(185)	(23.598)	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	(34.290)
1.008	Valeant Pharmaceuticals			(4.675)	Veritex Holdings Inc	Bank of America	
	International Inc	Goldman Sachs	(100)			Merrill Lynch	(6.639)
(85.685)	Valero Energy Corp	Morgan Stanley	(333.920)	(18.581)	Veritiv Corp	Bank of America	
(8.667)	Valero Energy Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(46.453)
		Merrill Lynch	(49.741)	(87.065)	Verizon Communications Inc	Bank of America	
(1.625)	Valero Energy Corp	Goldman Sachs	(4.576)			Merrill Lynch	(26.120)
(3.868)	Valhi Inc	Bank of America		4.861	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	(3.500)
		Merrill Lynch	2.940	19.924	Versartis Inc	Bank of America	
(321.917)	Valley National Bancorp	Bank of America				Merrill Lynch	(996)
		Merrill Lynch	28.973	36.643	Versartis Inc	Goldman Sachs	(1.832)
(22.331)	Valmont Industries Inc	Bank of America		106.572	Versartis Inc	Morgan Stanley	-
		Merrill Lynch	(69.226)	(31.257)	Verso Corp 'A'	Bank of America	
(23.309)	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	(15.151)			Merrill Lynch	(39.384)
(2.885)	Valvoline Inc	Bank of America		(12.210)	Verso Corp 'A'	Goldman Sachs	(15.385)
		Merrill Lynch	317	6.810	Versum Materials Inc	Bank of America	
(67.848)	Valvoline Inc	Morgan Stanley	22.451			Merrill Lynch	10.011

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
29.418	Versum Materials Inc	Morgan Stanley	79.617	10.957	Wabash National Corp	Bank of America	
2.879	Versum Materials Inc	Goldman Sachs	4.232			Merrill Lynch	(1.024)
3.252	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America		(2.832)	WABCO Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	4.325			Merrill Lynch	18.111
1.660	VF Corp	Goldman Sachs	5.113	(20.575)	WABCO Holdings Inc	Morgan Stanley	160.117
20.834	VF Corp	Morgan Stanley	24.777	(2.012)	Wabtec Corp/DE	Bank of America	
22.678	VF Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(9.316)
		Merrill Lynch	69.848	(22.726)	Wabtec Corp/DE	Goldman Sachs	(105.221)
31.337	Viacom Inc 'B'	Bank of America		(67.124)	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	86.408
		Merrill Lynch	(35.647)				
7.460	Viacom Inc 'B'	Goldman Sachs	(9.474)	(340.958)	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(177.298)
56.228	Viacom Inc 'B'	Morgan Stanley	(87.430)				
(1.665)	VIAD Corp	Bank of America		118.404	WageWorks Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.829)			Merrill Lynch	337.451
(27.957)	ViaSat Inc	Goldman Sachs	(33.269)	4.135	WageWorks Inc	Morgan Stanley	7.443
(3.356)	ViaSat Inc	Morgan Stanley	(5.974)	25.188	WageWorks Inc	Goldman Sachs	71.786
(429.058)	Viavi Solutions Inc	Bank of America		(13.477)	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	112.827			Merrill Lynch	21.167
(37.625)	Viavi Solutions Inc	Morgan Stanley	13.705	(117.803)	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	170.814
21.435	Vici Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	10.050	(13.271)	Walker & Dunlop Inc	Morgan Stanley	(11.811)
57.773	Vici Properties Inc (Reit)	Bank of America		26.946	Walmart Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	26.887			Merrill Lynch	(21.508)
996	Vici Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	120	58.935	Walmart Inc	Morgan Stanley	(22.934)
(30.977)	Vicor Corp	Bank of America		(19.426)	Walt Disney Co/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	(139.397)			Merrill Lynch	60.609
(9.712)	Virtu Financial Inc 'A'	Bank of America		(50.019)	Walt Disney Co/The	Morgan Stanley	116.431
		Merrill Lynch	(3.885)	(30.824)	Warrior Met Coal Inc	Morgan Stanley	(19.419)
(67.525)	Virtu Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(27.010)	(49.605)	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs	(40.348)
(34.135)	Virtu Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	(66.563)	375.518	Washington Federal Inc	Bank of America	
(16.794)	Virtus Investment Partners Inc	Goldman Sachs	(26.870)			Merrill Lynch	52.534
(3.495)	Virtus Investment Partners Inc	Bank of America		27.453	Washington Federal Inc	Goldman Sachs	3.176
		Merrill Lynch	(5.592)	41.721	Washington Federal Inc	Morgan Stanley	(14.602)
(2.623)	Virtusa Corp	Morgan Stanley	(349)	(108.436)	Washington Prime Group Inc (Reit)	Bank of America	
7.682	Visa Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.612)			Merrill Lynch	(47.882)
73.680	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America		(120.139)	Washington Prime Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	—
		Merrill Lynch	(14.736)				
24.420	Vishay Intertechnology Inc	Goldman Sachs	(4.884)	(184.298)	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America	
14.525	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	3.759			Merrill Lynch	(156.653)
3.871	Vishay Precision Group Inc	Morgan Stanley	7.936	(6.592)	Waste Connections Inc	Morgan Stanley	(6.063)
2.427	Vishay Precision Group Inc	Bank of America		(17.629)	Waste Connections Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.946			Merrill Lynch	(40.018)
(2.897)	Visteon Corp	Bank of America		(16.633)	Waste Management Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	14.167			Merrill Lynch	(34.763)
(13.148)	Visteon Corp	Morgan Stanley	62.806	3.655	Waters Corp	Bank of America	
(7.126)	Vistra Energy Corp	Bank of America				Merrill Lynch	13.560
		Merrill Lynch	(9.335)	(10.160)	Waters Corp	Morgan Stanley	(24.098)
(8.868)	Vivint Solar Inc	Bank of America		2.358	Waterstone Financial Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.660			Merrill Lynch	472
5.779	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	9.399	465	Waterstone Financial Inc	Goldman Sachs	93
447	VMware Inc 'A'	Bank of America		5.696	Waterstone Financial Inc	Morgan Stanley	1.139
		Merrill Lynch	1.289	162	Watsco Inc	Goldman Sachs	990
4.511	Vocera Communications Inc	Morgan Stanley	8.120	19.738	Watsco Inc	Bank of America	
11.635	Vocera Communications Inc	Bank of America				Merrill Lynch	120.599
		Merrill Lynch	38.046	132.066	Watts Water Technologies Inc 'A'	Bank of America	
8.072	Vocera Communications Inc	Goldman Sachs	26.395			Merrill Lynch	165.219
4.034	Vonage Holdings Corp	Morgan Stanley	101	4.654	Watts Water Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	5.818
(14.244)	Vornado Realty Trust (Reit)	Bank of America					
		Merrill Lynch	(28.488)	10.736	Watts Water Technologies Inc 'A'	Morgan Stanley	3.992
(7.886)	VOXX International Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	(3.154)	(8.070)	WaVe Life Sciences Ltd	Morgan Stanley	(36.719)
(43.044)	VOXX International Corp	Goldman Sachs	(17.218)	(19.872)	Wayfair Inc 'A'	Morgan Stanley	(208.060)
(9.138)	Voya Financial Inc	Bank of America		(11.262)	WD-40 Co	Morgan Stanley	(19.145)
		Merrill Lynch	12.336	4.316	Weatherford International Plc	Morgan Stanley	(237)
25.533	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	(2.722)	42.973	Weatherford International Plc	Goldman Sachs	(1.074)
(6.717)	VSE Corp	Bank of America		15.664	Weatherford International Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.247)			Merrill Lynch	(392)
2.560	Vulcan Materials Co	Bank of America		(1.862)	Web.com Group Inc	Morgan Stanley	(2.048)
		Merrill Lynch	2.790	135.564	WEC Energy Group Inc	Morgan Stanley	368.734
393	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	90	637	Weight Watchers International Inc	Bank of America	
660	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs	719			Merrill Lynch	(2.312)
34.864	Wabash National Corp	Morgan Stanley	(20.052)				

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(738)	Weight Watchers International Inc	Goldman Sachs	3.385	832	WEX Inc	Bank of America	(2.569)
(6.627)	Weight Watchers International Inc	Morgan Stanley	20.544	8.082	WEX Inc	Merrill Lynch	(11.252)
(5.127)	Weight Watchers International Inc	Bank of America		(589)	Weyco Group Inc	Bank of America	
170.259	Weingarten Realty Investors (Reit)	Merrill Lynch	21.458	(500)	Weyco Group Inc	Goldman Sachs	(1.791)
81.291	Weingarten Realty Investors (Reit)	Bank of America	173.664	(140.293)	Weyerhaeuser Co (Reit)	Morgan Stanley	(1.520)
(114.107)	Weis Markets Inc	Merrill Lynch	168.272	(8.568)	Weyerhaeuser Co (Reit)	Bank of America	(21.044)
(530)	Weis Markets Inc	Bank of America		11.093	Whirlpool Corp	Merrill Lynch	(11.138)
(7.953)	Welbilt Inc	Merrill Lynch	(425.619)	182	Whirlpool Corp	Bank of America	(126.571)
21.731	WellCare Health Plans Inc	Goldman Sachs	(1.977)	(2.343)	Whitestone (Reit)	Morgan Stanley	(3.358)
2.019	WellCare Health Plans Inc	Bank of America		(5.461)	Whitestone (Reit)	Goldman Sachs	(1.687)
2.357	WellCare Health Plans Inc	Merrill Lynch	(3.977)	29.449	Whiting Petroleum Corp	Morgan Stanley	(2.184)
(15.340)	Wells Fargo & Co	Bank of America		1.051	Whiting Petroleum Corp	Bank of America	
(4.319)	Wells Fargo & Co	Merrill Lynch	186.017	4.469	Whiting Petroleum Corp	Merrill Lynch	113.084
(56.282)	Welltower Inc (Reit)	Goldman Sachs	17.283	(16.065)	WideOpenWest Inc	Morgan Stanley	2.480
(32.126)	Wendy's Co/The	Morgan Stanley	17.536	(2.472)	WideOpenWest Inc	Goldman Sachs	17.161
17.478	Wendy's Co/The	Bank of America	(4.619)	(14.810)	WildHorse Resource Development Corp	Bank of America	(4.498)
3.768	Werner Enterprises Inc	Merrill Lynch	1.163	(20.203)	Wildan Group Inc	Goldman Sachs	(692)
159.865	Werner Enterprises Inc	Morgan Stanley	(95.117)	(5.848)	Wildan Group Inc	Merrill Lynch	(11.462)
114.575	Wesco Aircraft Holdings Inc	Bank of America		(2)	Wildan Group Inc	Goldman Sachs	(4)
30.126	Wesco Aircraft Holdings Inc	Merrill Lynch	143.219	78.769	William Lyon Homes 'A'	Bank of America	
31.878	Wesco Aircraft Holdings Inc	Morgan Stanley	18.076	7.053	William Lyon Homes 'A'	Merrill Lynch	(72.467)
33.382	WESCO International Inc	Goldman Sachs	39.848	23.951	William Lyon Homes 'A'	Morgan Stanley	(917)
2.116	WESCO International Inc	Bank of America		2.531	Williams Cos Inc/The	Goldman Sachs	(22.035)
65.577	West Bancorporation Inc	Merrill Lynch	2.880	98.511	Williams Cos Inc/The	Goldman Sachs	(253)
25.161	West Bancorporation Inc	Goldman Sachs	(628)	8.388	Williams Cos Inc/The	Bank of America	(9.851)
27.990	West Bancorporation Inc	Merrill Lynch	31.669	5.513	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	(4.781)
(4.882)	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	13.296	4.985	Willis Lease Finance Corp	Bank of America	19.098
(44.713)	Westar Energy Inc	Merrill Lynch	(5.598)	2.510	Willis Lease Finance Corp	Merrill Lynch	(3.290)
(4.824)	Westar Energy Inc	Bank of America	(22.806)	2.254	Willis Lease Finance Corp	Goldman Sachs	(1.657)
79.605	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	(119.346)	(24.419)	Willis Towers Watson Plc	Morgan Stanley	654
6.705	Western Alliance Bancorp	Bank of America	(9)	(54.418)	Willis Towers Watson Plc	Goldman Sachs	40.536
(21.807)	Western Alliance Bancorp	Merrill Lynch	(71.645)	7.870	Wingstop Inc	Morgan Stanley	6.408
5.956	Western Asset Mortgage Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	(6.035)	(384)	Winmark Corp	Morgan Stanley	(6.060)
44.137	Western Asset Mortgage Capital Corp (Reit)	Morgan Stanley	(6.870)	(103.152)	Winnebago Industries Inc	Bank of America	(2.726)
(987)	Western Digital Corp	Bank of America	2.740	(21.137)	Winnebago Industries Inc	Merrill Lynch	61.891
(47.377)	Western New England Bancorp Inc	Merrill Lynch	(2.675)	10.347	Winthrop Realty Trust (Reit)*	Goldman Sachs	12.682
(14.386)	Western Union Co/The	Bank of America		106.074	Wintrust Financial Corp	Bank of America	(31.041)
(97.744)	Western Union Co/The	Merrill Lynch	1.726	(294.738)	WisdomTree Investments Inc	Merrill Lynch	(20.154)
3.051	Westlake Chemical Corp	Goldman Sachs	28.346	(2.437)	WisdomTree Investments Inc	Bank of America	183.809
(9.910)	Westlake Chemical Corp	Merrill Lynch	28.049	(83.077)	WisdomTree Investments Inc	Merrill Lynch	1.633
869	WestRock Co	Bank of America	12.243	1.712	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	34.244
3.454	Westwood Holdings Group Inc	Merrill Lynch	(1.138)	4.002	Wix.com Ltd	Bank of America	8.046
5.614	Westwood Holdings Group Inc	Goldman Sachs	3.040	39.319	Wolverine World Wide Inc	Merrill Lynch	13.423
24.246	Westwood Holdings Group Inc	Bank of America	9.432	25.573	Wolverine World Wide Inc	Bank of America	70.774
(8.678)	WEX Inc	Merrill Lynch	40.733	21.473	Wolverine World Wide Inc	Morgan Stanley	93.896
		Bank of America		5.265	Woodward Inc	Goldman Sachs	38.651
		Merrill Lynch	23.517	(22.209)	Woodward Inc	Morgan Stanley	5.107
				15.646	Workday Inc 'A'	Bank of America	
				6.784	Workday Inc 'A'	Merrill Lynch	15.190
				410	Workday Inc 'A'	Morgan Stanley	16.350
						Goldman Sachs	82

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

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
35.745	Workiva Inc	Bank of America		3.235	XPO Logistics Inc	Morgan Stanley	21.711
		Merrill Lynch	10.109	8.447	XPO Logistics Inc	Bank of America	
1.026	Workiva Inc	Goldman Sachs	—			Merrill Lynch	19.742
3.452	Workiva Inc	Morgan Stanley	2.204	32.551	Xylem Inc/NY	Bank of America	
(8.641)	World Acceptance Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(29.296)
		Merrill Lynch	(18.837)	1.306	Xylem Inc/NY	Morgan Stanley	(1.215)
(3.359)	World Acceptance Corp	Goldman Sachs	(7.323)	205	Xylem Inc/NY	Goldman Sachs	(185)
1.224	World Fuel Services Corp	Bank of America		6.263	Yandex NV 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.763)			Merrill Lynch	(1.127)
6.762	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs	(9.737)	42.327	Yandex NV 'A'	Morgan Stanley	(19.629)
1.083	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Goldman Sachs	9.396	3.634	Yelp Inc	Goldman Sachs	(3.266)
(5.317)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Morgan Stanley	(4.008)	120.254	Yelp Inc	Bank of America	
1.398	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Merrill Lynch	21.180			Merrill Lynch	19.150
1.084	Worldpay Inc 'A'	Bank of America		25.048	Yelp Inc	Morgan Stanley	(5.298)
		Merrill Lynch	(1.669)	2.034	Yext Inc	Bank of America	
(14.114)	Worthington Industries Inc	Bank of America				Merrill Lynch	142
		Merrill Lynch	(20.901)	(18.679)	YRC Worldwide Inc	Bank of America	
(13.877)	WP Carey Inc (Reit)	Morgan Stanley	(25.817)			Merrill Lynch	(5.530)
(114.404)	WP Carey Inc (Reit)	Bank of America		(16.517)	Yum China Holdings Inc	Morgan Stanley	(15.044)
		Merrill Lynch	(240.429)	7.355	Yum! Brands Inc	Bank of America	
(80.435)	WPX Energy Inc	Morgan Stanley	(25.684)			Merrill Lynch	(9.047)
(82.415)	WPX Energy Inc	Bank of America		19.570	ZAGG Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(17.636)			Merrill Lynch	(1.424)
(40.738)	WR Berkley Corp	Bank of America		36.479	ZAGG Inc	Goldman Sachs	(1.824)
		Merrill Lynch	25.405	4.340	ZAGG Inc	Morgan Stanley	(1.302)
(25.866)	WR Berkley Corp	Morgan Stanley	24.831	21.926	Zayo Group Holdings Inc	Bank of America	
(4.516)	WR Grace & Co	Morgan Stanley	(520)			Merrill Lynch	26.312
44.114	WR Grace & Co	Bank of America		12.005	Zayo Group Holdings Inc	Goldman Sachs	14.807
		Merrill Lynch	(3.970)	4.476	Zebra Technologies Corp 'A'	Bank of America	
(4.598)	Wright Medical Group NV	Morgan Stanley	(5.708)			Merrill Lynch	9.332
(2.141)	WSFS Financial Corp	Bank of America		(885)	Zebra Technologies Corp 'A'	Morgan Stanley	(811)
		Merrill Lynch	(3.542)	214.409	Zendesk Inc	Bank of America	
155	WW Grainger Inc	Goldman Sachs	505			Merrill Lynch	396.657
449	WW Grainger Inc	Bank of America		12.020	Zendesk Inc	Goldman Sachs	22.237
		Merrill Lynch	1.464	9.525	Zendesk Inc	Morgan Stanley	17.145
15.730	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	(27.999)	(1.993)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America	
(6.495)	Wyndham Worldwide Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(13.174)
		Merrill Lynch	(2.962)	(25.731)	Zillow Group Inc 'C'	Goldman Sachs	(159.100)
(61.340)	Wyndham Worldwide Corp	Morgan Stanley	(61.340)	(35.918)	Zillow Group Inc 'C'	Morgan Stanley	(206.194)
(3.468)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	(12.765)	(52.316)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America	
5.190	Wynn Resorts Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	86.234
		Merrill Lynch	32.957	(33.057)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Morgan Stanley	41.598
57.457	Xcel Energy Inc	Bank of America		1.061	Zions Bancorporation	Goldman Sachs	(3.141)
		Merrill Lynch	52.286	(52.683)	Zions Bancorporation	Morgan Stanley	80.915
14.468	Xencor Inc	Bank of America		9.977	Zions Bancorporation	Bank of America	
		Merrill Lynch	83.625			Merrill Lynch	(29.532)
14.591	Xencor Inc	Goldman Sachs	84.336	(21.647)	ZIOPHARM Oncology Inc	Morgan Stanley	(7.347)
4.816	Xencor Inc	Morgan Stanley	12.762	(21.286)	Zoe's Kitchen Inc	Goldman Sachs	141.006
(372.629)	Xenia Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America		44.043	Zoetis Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(849.594)			Merrill Lynch	60.339
(45.718)	Xenia Hotels & Resorts Inc (Reit)	Morgan Stanley	(218.767)	8.076	Zoetis Inc	Morgan Stanley	(109)
56.692	Xerium Technologies Inc	Bank of America		1.891	Zoetis Inc	Goldman Sachs	2.591
		Merrill Lynch	55.558	(13.463)	Zogenix Inc	Morgan Stanley	(29.619)
(13.837)	Xerox Corp	Bank of America		15.444	Zumiez Inc	Goldman Sachs	(1.544)
		Merrill Lynch	12.877	73.834	Zumiez Inc	Bank of America	
7.144	Xerox Corp	Morgan Stanley	(3.929)			Merrill Lynch	(7.383)
50.191	Xilinx Inc	Bank of America		28.829	Zumiez Inc	Morgan Stanley	8.649
		Merrill Lynch	(131.500)	93.062	Zynga Inc 'A'	Goldman Sachs	33.037
2.424	Xilinx Inc	Goldman Sachs	(6.351)	33.673	Zynga Inc 'A'	Morgan Stanley	11.617
49.169	Xilinx Inc	Morgan Stanley	98.427	316.469	Zynga Inc 'A'	Bank of America	
(2.397)	XOMA Corp	Morgan Stanley	4.040			Merrill Lynch	112.346
9.423	Xperi Corp	Morgan Stanley	(9.894)				(5.272.224)
6.918	Xperi Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	(9.452)				
				Total (exposition brute sous-jacente – 6.495.077.524 USD)			

BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values latentes USD	Valeur de marché USD
TRS	USD 11.793.222	Fund receives 3 Month LIBOR and pays MSCI Daily TR Net Emerging Markets Chile USD Index	Morgan Stanley	15/12/2018	717.517	717.517
TRS	USD 4.396.348	Fund receives 3 Month LIBOR and pays MSCI Daily TR Net Emerging Markets Chile USD Index	Morgan Stanley	13/3/2019	328.606	328.606
Total (exposition brute sous-jacente – 14.989.845 USD)					1.046.123	1.046.123

TRS (total return swaps) : swaps sur rendement total

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
JPY	11.709.763.662	USD	106.966.359	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	1.020.972
USD	417.193	JPY	45.701.781	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(4.268)
						1.016.704

Catégorie d'Actions couverte en francs suisses

CHF	4.719.232	USD	4.722.841	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	68.281
USD	216.177	CHF	216.308	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(3.426)
						64.855

Catégorie d'Actions couverte en euros

EUR	430.722.642	USD	512.089.084	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(9.926.453)
USD	25.918.225	EUR	21.733.910	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	579.512
						(9.346.941)

Catégorie d'Actions couverte en livres sterling

GBP	202.470	USD	274.947	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(5.700)
USD	11.591	GBP	8.520	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	261
						(5.439)

Catégorie d'Actions couverte en couronnes suédoises

SEK	1.291.043.307	USD	148.012.367	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1.548.477)
USD	30.733	SEK	272.438	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(174)
						(1.548.651)
Total (exposition brute sous-jacente – 787.696.237 USD)						(9.819.472)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	78,06
Gouvernement	15,46
Biens de consommation non cyclique	5,18
Biens de consommation cyclique	1,91
Titres adossés à des actifs	0,07
Technologie	0,05
Portefeuille de titres à la valeur de marché	100,73
Autres éléments du passif net	(0,73)
	100,00

BlackRock Asia Extension Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS				Etats-Unis suite			
USD 2.130.000	Etats-Unis Federal Home Loan Bank Discount Notes 18/6/2018 (Zero Coupon)	2.128.230	1,27	USD 5.000.000	Coca-Cola Company/The 8/6/2018 (Zero Coupon)	4.998.192	2,99
USD 2.700.000	United States Treasury Bill 28/6/2018 (Zero Coupon)	2.696.464	1,62	USD 1.000.000	CRC Funding LLC 4/6/2018 (Zero Coupon)	999.821	0,60
USD 18.450.000	United States Treasury Bill 5/7/2018 (Zero Coupon)	18.419.737	11,03	USD 4.000.000	CRC Funding LLC 5/11/2018 (Zero Coupon)	3.957.435	2,37
USD 4.000.000	United States Treasury Bill 29/11/2018 (Zero Coupon)	3.959.225	2,37	USD 3.200.000	Danske Corp 2/8/2018 (Zero Coupon)	3.187.572	1,91
		27.203.656	16,29	USD 700.000	Federation des Caisses Desjardins 14/6/2018 (Zero Coupon)	699.550	0,42
Total des obligations		27.203.656	16,29	USD 1.200.000	Glaxosmithkline LLC 25/6/2018 (Zero Coupon)	1.198.456	0,72
CERTIFICATS DE DÉPÔT				USD 1.500.000	JP Morgan Securities 22/2/2019 (Zero Coupon)	1.472.513	0,88
USD 2.000.000	Etats-Unis Bank of Nova Scotia/Houston 21/9/2018 (Zero Coupon)	2.000.000	1,20	USD 1.750.000	JP Morgan Securities LLC 7/8/2018 (Zero Coupon)	1.744.398	1,04
USD 3.000.000	HSBC Bank USA NA 2,30% 4/9/2018	3.000.000	1,80	USD 500.000	Kells Funding LLC 23/7/2018 (Zero Coupon)	498.375	0,30
USD 1.000.000	Natixis SA 5/6/2018 (Zero Coupon)	1.000.000	0,60	USD 3.600.000	Liberty Street Funding LLC 6/9/2018 (Zero Coupon)	3.577.399	2,14
USD 6.000.000	Royal Bank of Canada/New York 6/11/2018 (Zero Coupon)	6.000.000	3,59	USD 4.500.000	LMA SA Via LMA Americas LLC 6/8/2018 (Zero Coupon)	4.480.447	2,68
USD 6.000.000	The Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ 22/6/2018 (Zero Coupon)	6.000.000	3,59	USD 7.000.000	Macquarie Bank Ltd 14/6/2018 (Zero Coupon)	6.994.818	4,19
USD 500.000	Wells Fargo Bank NA 15/11/2018 (Zero Coupon)	500.000	0,30	USD 1.000.000	Macquarie Bank Ltd 12/7/2018 (Zero Coupon)	997.392	0,60
USD 6.000.000	Wells Fargo Bank NA 19/11/2018 (Zero Coupon)	6.000.000	3,59	USD 7.000.000	Mizuho Corporate Bank 11/6/2018 (Zero Coupon)	6.996.053	4,19
		24.500.000	14,67	USD 2.200.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 7/6/2018 (Zero Coupon)	2.199.251	1,32
Total des certificats de dépôt		24.500.000	14,67	USD 750.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 13/6/2018 (Zero Coupon)	749.500	0,45
BILLET DE TRÉSORERIE				USD 3.500.000	NRW. Bank 16/7/2018 (Zero Coupon)	3.491.031	2,09
USD 3.200.000	France BPCE SA 1/10/2018 (Zero Coupon)	3.173.648	1,90	USD 1.300.000	Old Line Funding LLC 30/7/2018 (Zero Coupon)	1.295.185	0,78
USD 1.200.000	Societe Generale SA 3/7/2018 (Zero Coupon)	1.197.579	0,72	USD 2.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 8/6/2018 (Zero Coupon)	1.999.156	1,20
		4.371.227	2,62	USD 3.000.000	Prudential Plc 18/6/2018 (Zero Coupon)	2.997.167	1,80
USD 1.000.000	Japon Mizuho Bank Ltd/New York 30/11/2018 (Zero Coupon)	987.892	0,59	USD 4.200.000	Prudential Plc 27/6/2018 (Zero Coupon)	4.193.509	2,51
		987.892	0,59	USD 500.000	Standard Chartered Bank 20/6/2018 (Zero Coupon)	499.388	0,30
USD 6.000.000	Etats-Unis American Honda Motor Co 7/6/2018 (Zero Coupon)	5.998.020	3,59	USD 2.000.000	Starbird Funding Corp 24/9/2018 (Zero Coupon)	1.983.836	1,19
USD 1.400.000	Antalis SA 12/7/2018 (Zero Coupon)	1.396.317	0,84	USD 3.920.000	United Overseas Bank Ltd 14/6/2018 (Zero Coupon)	3.917.353	2,35
USD 5.000.000	ASB Finance Ltd/London 21/9/2018 (Zero Coupon)	5.000.000	2,99	USD 1.600.000	United Overseas Bank Ltd 21/11/2018 (Zero Coupon)	1.581.201	0,95
USD 5.000.000	Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 10/7/2018 (Zero Coupon)	4.990.142	2,99	USD 5.700.000	Versailles Cds LLC 31/8/2018 (Zero Coupon)	5.667.581	3,39
USD 650.000	Barton Capital Corp 12/6/2018 (Zero Coupon)	649.553	0,39	USD 5.000.000	Victory Receivables Corp 5/6/2018 (Zero Coupon)	4.998.789	2,99
USD 500.000	Bennington Stark Capital Co 23/7/2018 (Zero Coupon)	498.303	0,30	USD 2.250.000	Victory Receivables Corp 30/7/2018 (Zero Coupon)	2.241.666	1,34
USD 1.000.000	Calco LLC 24/9/2018 (Zero Coupon)	992.621	0,59			107.253.247	64,24
USD 4.000.000	Chariot Funding LLC 3/7/2018 (Zero Coupon)	3.991.787	2,39	Total des billets de trésorerie		112.612.366	67,45
USD 500.000	Charta LLC 5/7/2018 (Zero Coupon)	498.904	0,30	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		164.316.022	98,41
USD 750.000	Charta LLC 16/7/2018 (Zero Coupon)	747.825	0,45	Portefeuille de titres à la valeur de marché		164.316.022	98,41
USD 2.900.000	Ciesco LLC 16/10/2018 (Zero Coupon)	2.872.741	1,72	Autres éléments de l'actif net		2.648.035	1,59
				Total de l'actif net (USD)		166.964.057	100,00

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Chine				Hong Kong suite			
53.000	Sinotrans Shipping Ltd	Bank of America		15.500	BYD Co Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	204			Merrill Lynch	(7.125)
121.500	Sinotrans Shipping Ltd	Morgan Stanley	314	7.500	BYD Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(2.191)
			518	(5.000)	BYD Electronic International Co Ltd		
Hong Kong				18.000	CAR Inc	Morgan Stanley	432
(64.000)	361 Degrees International Ltd	Bank of America	242	74.000	Cathay Pacific Airways Ltd	Morgan Stanley	553
		Merrill Lynch	854			Bank of America	
(48.000)	361 Degrees International Ltd	Morgan Stanley		7.000	Cathay Pacific Airways Ltd	Merrill Lynch	(4.696)
(18.000)	AAC Technologies Holdings Inc	Bank of America	(6.399)	(210.000)	Central China Real Estate Ltd	Morgan Stanley	(106)
		Merrill Lynch				Bank of America	
262.000	Agile Group Holdings Ltd	Bank of America		(33.000)	Central China Real Estate Ltd	Merrill Lynch	(12.590)
		Merrill Lynch	(51.994)	6.000	China Agri-Industries Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.600)
62.000	Agile Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(9.463)			Bank of America	
194.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H'	Bank of America		41.000	China Agri-Industries Holdings Ltd	Merrill Lynch	(45)
		Merrill Lynch	(12.095)			Morgan Stanley	(886)
82.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H'		(1.562)	3.000	China Aoyuan Property Group Ltd	Bank of America	
		Morgan Stanley				Merrill Lynch	(110)
261.200	AIA Group Ltd	Bank of America		212.000	China Cinda Asset Management Co Ltd	Morgan Stanley	(1.071)
		Merrill Lynch	(36.251)			Bank of America	
68.600	AIA Group Ltd	Morgan Stanley	(19.146)	12.000	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	1
(396.000)	Air China Ltd 'H'	Bank of America		4.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	53.911			Merrill Lynch	(234)
(108.000)	Air China Ltd 'H'	Morgan Stanley	4.387	232.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	Morgan Stanley	(10.915)
(22.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	Bank of America		4.000	China Coal Energy Co Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.990)			Merrill Lynch	(33)
(846.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd		(135.895)	42.000	China Coal Energy Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(961)
(3.130.000)	Alibaba Pictures Group Ltd	Morgan Stanley	(43.914)	55.000	China Communications Construction Co Ltd 'H'		
2.000	Angang Steel Co Ltd 'H'	Bank of America				Morgan Stanley	(1.464)
		Merrill Lynch	(107)	344.000	China Communications Construction Co Ltd 'H'	Bank of America	
18.000	Angang Steel Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(502)			Merrill Lynch	(11.340)
500	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	Bank of America		1.402.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(35)			Merrill Lynch	(3.439)
62.000	Anhui Expressway Co Ltd 'H'	Bank of America		1.314.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'		
		Merrill Lynch	(2.837)			Morgan Stanley	(1.566)
46.000	Anhui Expressway Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(1.695)	2.411.000	China Construction Bank Corp 'H'	Bank of America	
54.000	ANTA Sports Products Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(107.143)
		Merrill Lynch	(4.426)	21.000	China Construction Bank Corp 'H'		
150.000	ANTA Sports Products Ltd	Morgan Stanley	5.843			Morgan Stanley	(693)
19.000	Ausnutria Dairy Corp Ltd	Bank of America		4.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(35)			Merrill Lynch	(43)
5.500	BAIC Motor Corp Ltd 'H' '144A'	Bank of America		22.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H'		
		Merrill Lynch	(125)			Morgan Stanley	142
21.000	BAIC Motor Corp Ltd 'H' '144A'	Morgan Stanley	(158)	(5.000)	China Everbright Greentech Ltd '144A'		
3.014.000	Bank of China Ltd 'H'	Bank of America				Morgan Stanley	(134)
		Merrill Lynch	(57.361)	90.000	China Everbright Ltd	Bank of America	
96.000	Bank of China Ltd 'H'	Morgan Stanley	(1.583)			Merrill Lynch	258
23.000	Bank of East Asia Ltd/The	Bank of America		80.000	China Everbright Ltd	Morgan Stanley	1.175
		Merrill Lynch	(4.967)	29.000	China Evergrande Group	Morgan Stanley	(7.747)
71.000	Bank of East Asia Ltd/The	Morgan Stanley	(4.937)	41.000	China Evergrande Group	Bank of America	
43.000	BBMG Corp 'H'	Morgan Stanley	(929)			Merrill Lynch	(11.995)
2.000	BBMG Corp 'H'	Bank of America		(482.000)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(18)			Merrill Lynch	11.423
102.000	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	Bank of America	1.321	(66.500)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'		
		Merrill Lynch				Morgan Stanley	927
266.000	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'		(628)	(3.500)	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd		
		Morgan Stanley				Morgan Stanley	80
25.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd	Bank of America	6.355	(1.690.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	Bank of America	
		Merrill Lynch				Merrill Lynch	25.752
3.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd		(74)	(300.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'		
(276.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Bank of America				Morgan Stanley	5.720
		Merrill Lynch	(6.705)	400	China International Capital Corp Ltd 'H' '144A'	Bank of America	
400	BOC Aviation Ltd '144A'	Morgan Stanley	(23)			Merrill Lynch	(23)
2.800	BOC Aviation Ltd '144A'	Bank of America		9.200	China International Capital Corp Ltd 'H' '144A'		
		Merrill Lynch	(51)			Morgan Stanley	(537)
(486.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Bank of America	4.820	11.500	China International Marine Containers Group Co Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch				Merrill Lynch	(1.297)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
478.000	China Lesso Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(37.711)	222.000	China Resources Cement Holdings Ltd	Morgan Stanley	13.043
766.000	China Lesso Group Holdings Ltd	Bank of America		2.000	China Resources Gas Group Ltd	Morgan Stanley	(177)
197.000	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	(71.156)	14.000	China Resources Land Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(16.232)			Merrill Lynch	(2.222)
49.000	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(2.792)	48.000	China Resources Land Ltd	Morgan Stanley	(7.621)
2.200	China Literature Ltd '144A'	Bank of America		167.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd '144A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.348			Merrill Lynch	29.822
600	China Literature Ltd '144A'	Morgan Stanley	670				
156.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'			95.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd '144A'	Morgan Stanley	14.057
		Morgan Stanley	5.782			Bank of America	
426.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	Merrill Lynch	(3.198)	(20.000)	China Resources Phoenix Healthcare Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	149
(4.000)	China Machinery Engineering Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	30	(57.500)	China Resources Phoenix Healthcare Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(302)
1.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	Bank of America		29.000	China SCE Property Holdings Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	185			Merrill Lynch	187
1.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	Morgan Stanley	198	22.000	China SCE Property Holdings Ltd	Morgan Stanley	(223)
11.500	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.657)	(1.094.796)	China Shanshui Cement Group Ltd*	Merrill Lynch	421.782
69.500	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(18.114)	(105.546)	China Shanshui Cement Group Ltd*	Morgan Stanley	40.198
35.000	China Mobile Ltd	Bank of America					
		Merrill Lynch	(18.012)	22.000	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	Morgan Stanley	(386)
139.000	China Mobile Ltd	Morgan Stanley	(59.163)			Bank of America	
10.000	China National Building Material Co Ltd 'H'			16.000	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	Merrill Lynch	(647)
		Morgan Stanley	(368)	(142)	China Singyes New Materials Holdings Ltd	Morgan Stanley	–
74.000	China National Building Material Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	(3.193)	(1.134.000)	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.498)
(334.000)	China Oilfield Services Ltd 'H'	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.455)	(260.000)	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd	Merrill Lynch	(1.227)
(113.000)	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	Bank of America	3.592	14.000	China South City Holdings Ltd	Bank of America	(107)
(282.000)	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	Morgan Stanley	8.966			Merrill Lynch	8.945
28.000	China Overseas Land & Investment Ltd	Bank of America		(78.000)	China Southern Airlines Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.267)			Merrill Lynch	
4.000	China Overseas Land & Investment Ltd	Morgan Stanley	(559)	(4.000)	China State Construction International Holdings Ltd	Morgan Stanley	50
(25.000)	China Overseas Property Holdings Ltd					Bank of America	
		Morgan Stanley	(1.403)	(16.000)	China State Construction International Holdings Ltd	Merrill Lynch	160
2.600	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	Bank of America		4.000	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(826)			Merrill Lynch	(278)
2.400	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(580)	38.600	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(4.654)
108.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Bank of America		2.110.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(5.901)			Merrill Lynch	(26.736)
222.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Morgan Stanley	(14.961)	26.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	Morgan Stanley	(164)
70.000	China Power International Development Ltd			4.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	Bank of America	
		Morgan Stanley	(176)			Merrill Lynch	62
483.000	China Railway Construction Corp Ltd 'H'	Bank of America		18.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(411)
		Merrill Lynch	(14.687)	700.000	China Travel International Investment Hong Kong Ltd	Bank of America	
338.000	China Railway Construction Corp Ltd 'H'	Morgan Stanley	(4.688)			Merrill Lynch	20.556
677.000	China Railway Group Ltd 'H'	Bank of America		414.000	China Travel International Investment Hong Kong Ltd	Morgan Stanley	9.517
		Merrill Lynch	(782)	(42.000)	China Yuhua Education Corp Ltd '144A'	Bank of America	
558.000	China Railway Group Ltd 'H'	Morgan Stanley	3.611			Merrill Lynch	(3.482)
23.000	China Railway Signal & Communication Corp Ltd '144A'			(616.000)	China Yuhua Education Corp Ltd '144A'	Morgan Stanley	(40.079)
		Morgan Stanley	(760)	19.000	China ZhengTong Auto Services Holdings Ltd	Bank of America	
2.000	China Railway Signal & Communication Corp Ltd '144A'	Bank of America				Merrill Lynch	777
		Merrill Lynch	(51)	9.000	China ZhengTong Auto Services Holdings Ltd	Morgan Stanley	12
81.000	China Reinsurance Group Corp 'H'	Morgan Stanley	(101)	34.000	China Zhongwang Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.210)
9.000	China Reinsurance Group Corp 'H'	Bank of America		1.200	China Zhongwang Holdings Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	–			Merrill Lynch	(38)
30.000	China Resources Cement Holdings Ltd	Bank of America		98.000	Chinasoft International Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.674			Merrill Lynch	(1.985)

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

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
452.000	Chinasoft International Ltd	Morgan Stanley	(12.044)	(7.500)	Fullshare Holdings Ltd	Bank of America	
4.000	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(48)
5.000	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	Merrill Lynch	154	(330.000)	Fullshare Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.701)
236.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	Morgan Stanley	192	24.000	Future Land Development Holdings Ltd	Bank of America	
150.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	Bank of America	(9.594)	24.000	Future Land Development Holdings Ltd	Merrill Lynch	(1.067)
296.000	CITIC Ltd	Merrill Lynch	(7.629)	(137.200)	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd '144A'	Morgan Stanley	(1.251)
35.000	CITIC Ltd	Morgan Stanley	(9.740)	59.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Bank of America	4.807
1.000	CK Asset Holdings Ltd	Merrill Lynch	(1.153)	206.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Merrill Lynch	6.089
47.500	CK Asset Holdings Ltd	Bank of America	(311)	(1.344.000)	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	Morgan Stanley	1.543
122.000	CLP Holdings Ltd	Merrill Lynch	(10.539)			Bank of America	
105.500	CLP Holdings Ltd	Morgan Stanley	10.290	(27.000)	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	Merrill Lynch	15.388
67.000	CNOOC Ltd	Merrill Lynch	(2.547)	6.000	Genscript Biotech Corp	Morgan Stanley	412
696.000	CNOOC Ltd	Bank of America	(11.252)	40.000	Global Brands Group Holding Ltd	Morgan Stanley	270
		Merrill Lynch	(74.307)	(26.000)	GOME Retail Holdings Ltd	Bank of America	102
1.000	Colour Life Services Group Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(67)
(140.000)	Coolpad Group Ltd	Merrill Lynch	128	(4.063.000)	GOME Retail Holdings Ltd	Morgan Stanley	(10.409)
102.000	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	11.771	35.000	Goodbaby International Holdings Ltd	Bank of America	
36.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H'		(1.557)	132.500	Grand Baoxin Auto Group Ltd	Merrill Lynch	(1.334)
4.500	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(456)	55.000	Grand Baoxin Auto Group Ltd	Bank of America	(1.679)
29.000	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H'	Bank of America	121	2.500	Greentown China Holdings Ltd	Morgan Stanley	(417)
195.000	Country Garden Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(1.180)	11.000	Greentown China Holdings Ltd	Bank of America	(63)
70.000	Country Garden Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(8.722)	4.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	(390)
(3.000)	CPMC Holdings Ltd	Bank of America	84	124.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	Bank of America	(692)
(10.000)	CRRRC Corp Ltd 'H'	Merrill Lynch	190	28.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(11.347)
48.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Bank of America	4.605	14.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H'	Bank of America	12.684
100.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Merrill Lynch	20.428	800	Guangzhou R&F Properties Co Ltd	Morgan Stanley	8.481
2.000	Dah Sing Financial Holdings Ltd		(431)	926.000	Guotai Junan International Holdings Ltd	Bank of America	(91)
2.000	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Morgan Stanley	(469)	991.000	Guotai Junan International Holdings Ltd	Bank of America	(18.837)
26.000	Dali Foods Group Co Ltd '144A'	Merrill Lynch	(200)	400	Guotai Junan Securities Co Ltd '144A'	Morgan Stanley	(20.165)
56.000	Datang International Power Generation Co Ltd 'H'	Bank of America	(640)	8.000	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H' '144A'	Bank of America	(46)
4.000	Datang International Power Generation Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	(46)	148.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Morgan Stanley	(854)
320.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Bank of America	4.130	132.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Bank of America	17.989
662.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	2.626	177.000	Haitian International Holdings Ltd	Morgan Stanley	17.717
26.000	Far East Horizon Ltd		269	95.000	Haitian International Holdings Ltd	Bank of America	29.386
46.000	Far East Horizon Ltd	Morgan Stanley	827	1.298.000	Haitong International Securities Group Ltd	Merrill Lynch	10.926
(184.000)	First Pacific Co Ltd	Merrill Lynch	1.160	1.466.000	Haitong International Securities Group Ltd	Bank of America	(29.656)
52.000	FIT Hon Teng Ltd '144A'	Morgan Stanley	(1.256)	104.000	Hang Lung Properties Ltd	Morgan Stanley	(39.113)
131.000	FIT Hon Teng Ltd '144A'	Bank of America	3.013	194.000	Hang Lung Properties Ltd	Bank of America	(17.719)
566.000	Fosun International Ltd	Merrill Lynch	(17.123)	5.000	Hang Seng Bank Ltd	Morgan Stanley	(19.715)
638.500	Fosun International Ltd	Bank of America	(3.075)	300	Hang Seng Bank Ltd	Bank of America	(2.150)
434.000	Fu Shou Yuan International Group Ltd	Merrill Lynch	8.364	10.000	Henderson Land Development Co Ltd	Morgan Stanley	709
316.000	Fu Shou Yuan International Group Ltd		2.460	6.000	Henderson Land Development Co Ltd	Bank of America	
1.000	Fufeng Group Ltd	Merrill Lynch	(10)			Merrill Lynch	82

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
3.500	Hengan International Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.632	120.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.287
136.000	Hengan International Group Co Ltd	Morgan Stanley	49.543	(60.000)	Kunlun Energy Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.155)
337.500	HKBN Ltd	Morgan Stanley	(1.661)	500	KWG Property Holding Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(56)
601.500	HKBN Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.186	12.500	KWG Property Holding Ltd	Morgan Stanley	(2.195)
241.000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(3.640)	(5.000)	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20)
451.000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Morgan Stanley	(5.673)	40.700	Legend Holdings Corp 'H' '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(2.314)
557.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.500)	16.300	Legend Holdings Corp 'H' '144A'	Morgan Stanley	(1.135)
985.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Morgan Stanley	(22.316)	(12.000)	Lenovo Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(444)
2.359	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.213)	(148.000)	Li & Fung Ltd	Bank of America Merrill Lynch	25.444
2.800	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Morgan Stanley	(3.056)	9.000	Lifestyle International Holdings Ltd	Morgan Stanley	8.947
13.000	Hongkong & Shanghai Hotels Ltd/The	Bank of America Merrill Lynch	1.328	19.500	Lifestyle International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21.820
(177.000)	Hopewell Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16.998	12.000	Logan Property Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(1.557)
(17.500)	Hopewell Holdings Ltd	Morgan Stanley	1.107	2.000	Logan Property Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(178)
25.000	Hua Hong Semiconductor Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(119)	5.500	Longfor Properties Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.119)
29.000	Hua Hong Semiconductor Ltd '144A'	Morgan Stanley	4.147	500	Longfor Properties Co Ltd	Morgan Stanley	(22)
44.000	Huadian Power International Corp Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	1.387	691.000	Lonking Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12.375
(96.000)	Huaneng Power International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.471)	2.396.000	Lonking Holdings Ltd	Morgan Stanley	(66.999)
(206.000)	Huaneng Power International Inc	Morgan Stanley	(14.716)	1.000	Luk Fook Holdings International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	326
1.600	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	Morgan Stanley	(49)	154.000	Luoyang Glass Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(774)
(38.000)	Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd	Morgan Stanley	95	90.000	Luoyang Glass Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(797)
(314.000)	Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	784	18.500	Luye Pharma Group Ltd	Morgan Stanley	(2.236)
(33.000)	IGG Inc	Morgan Stanley	1.675	97.500	Luye Pharma Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11.767)
483.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(22.707)	30.000	Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(648)
1.146.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Morgan Stanley	(34.917)	58.000	Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(1.105)
4.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	174	(624.000)	Man Wah Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(34.262)
3.500	JNBY Design Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(364)	(125.200)	Man Wah Holdings Ltd	Morgan Stanley	1.262
3.500	JNBY Design Ltd	Morgan Stanley	(302)	(52.000)	Melco International Development Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.658)
131.000	Johnson Electric Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(50.840)	(15.000)	Melco International Development Ltd	Morgan Stanley	(1.631)
32.000	Johnson Electric Holdings Ltd	Morgan Stanley	(5.491)	889.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(19.213)
278.000	K Wah International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11.714	446.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H'	Morgan Stanley	(9.642)
256.000	K Wah International Holdings Ltd	Morgan Stanley	2.305	(328.800)	MGM China Holdings Ltd	Morgan Stanley	(10.594)
37.000	Kaisa Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(375)	(37.600)	MGM China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	942
4.000	Kerry Properties Ltd	Morgan Stanley	1.200	(18.000)	Mint Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.491
10.500	Kerry Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.413	(2.000)	NagaCorp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(18)
1.000	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(248)	(400)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	112
17.000	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Morgan Stanley	(2.698)	390.000	New World Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.062
13.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.654)	194.000	New World Development Co Ltd	Morgan Stanley	(1.445)
1.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(156)	(65.000)	Nexteer Automotive Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.806)
104.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	Morgan Stanley	(5.947)	(28.000)	Nexteer Automotive Group Ltd	Morgan Stanley	137

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
85.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.993)	69.000	Shui On Land Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(836)
81.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	Morgan Stanley	(4.730)	2.000	Sino Land Co Ltd	Morgan Stanley	(15)
(1.000)	NWS Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	20	2.000	Sino-Ocean Group Holding Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(92)
(500)	Orient Overseas International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(61)	340.000	Sino-Ocean Group Holding Ltd	Morgan Stanley	(13.831)
(94.500)	Orient Overseas International Ltd	Morgan Stanley	11.925	7.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	599
42.000	PC Partner Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.788	20.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	996
22.000	PC Partner Group Ltd	Morgan Stanley	1.292	4.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	240
109.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(27.615)	80.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	1.434
54.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Morgan Stanley	(10.346)	31.200	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	1.610
284.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(6.846)	17.600	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	907
847.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' '144A'	Morgan Stanley	(33.377)	837.000	Sinotrans Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(29.786)
(136.500)	Power Assets Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23.336	512.000	Sinotrans Ltd 'H'	Morgan Stanley	(20.183)
189.000	Razer Inc '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(5.770)	423.500	Sinotruk Hong Kong Ltd	Bank of America Merrill Lynch	56.196
510.000	Razer Inc '144A'	Morgan Stanley	(14.925)	152.000	Sinotruk Hong Kong Ltd	Morgan Stanley	(5.007)
6.000	Sa Sa International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16	2.000	Skyworth Digital Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5)
10.000	Sa Sa International Holdings Ltd	Morgan Stanley	256	40.000	Skyworth Digital Holdings Ltd	Morgan Stanley	(507)
125.200	Sands China Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(688)	(249.172)	SmarTone Telecommunications Holdings Ltd	Morgan Stanley	19.525
287.200	Sands China Ltd	Morgan Stanley	(36.369)	(339.500)	SOHO China Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.784)
(42.500)	Semiconductor Manufacturing International Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.158	(35.500)	SOHO China Ltd	Morgan Stanley	(771)
(259.500)	Semiconductor Manufacturing International Corp	Morgan Stanley	4.585	666.000	SSY Group Ltd	Morgan Stanley	(24.514)
(2.000)	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'H'	Morgan Stanley	310	428.000	SSY Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18.605
(224.000)	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(39.978)	57.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(17.292)
(16.000)	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(980)	92.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Morgan Stanley	(19.735)
276.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13.957)	18.000	Sunac China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.120)
528.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Morgan Stanley	(20.000)	1.000	Sunac China Holdings Ltd	Morgan Stanley	(586)
1.200	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	184	11.000	Swire Pacific Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.068
98.000	Shangri-La Asia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10.765	500	Swire Pacific Ltd 'A'	Morgan Stanley	87
142.000	Shangri-La Asia Ltd	Morgan Stanley	3.654	82.400	Swire Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10.019
2.000	Shenzhen Expressway Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	5	96.000	Swire Properties Ltd	Morgan Stanley	17.170
21.000	Shenzhen International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(903)	39.000	Techtronic Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11.393)
1.500	Shenzhen International Holdings Ltd	Morgan Stanley	127	105.000	Techtronic Industries Co Ltd	Morgan Stanley	(28.010)
4.000	Shenzhen Investment Ltd	Bank of America Merrill Lynch	36	(178.600)	Television Broadcasts Ltd	Morgan Stanley	(4.628)
44.000	Shenzhen Investment Ltd	Morgan Stanley	(54)	34.300	Tencent Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.499
1.000	Shenzhou International Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	180	158.100	Tencent Holdings Ltd	Morgan Stanley	(176.216)
98.500	Shimao Property Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13.218	(4.000)	Tianjin Capital Environmental Protection Group Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	51
78.500	Shimao Property Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.971)	702.000	Tianneng Power International Ltd	Morgan Stanley	59.162
22.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(616)	136.000	Tianneng Power International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.149
24.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	Morgan Stanley	(550)	38.000	Times China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.153)
				40.000	Times China Holdings Ltd	Morgan Stanley	(2.438)
				356.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	72.679
				170.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	Morgan Stanley	39.031
				12.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd	Morgan Stanley	(364)
				42.000	Towngas China Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.611
				88.000	Towngas China Co Ltd	Morgan Stanley	(2.231)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(1.000)	TravelSky Technology Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	172	26.000	Yuzhou Properties Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(991)
(44.000)	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(9.850)	10.000	Yuzhou Properties Co Ltd	Morgan Stanley	(420)
508.000	Uni-President China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21.436	25.500	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	Morgan Stanley	1.107
341.000	Uni-President China Holdings Ltd	Morgan Stanley	(6.904)	108.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	979
376.000	United Laboratories International Holdings Ltd/The	Bank of America Merrill Lynch	(17.180)	186.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	3.104
2.000	United Laboratories International Holdings Ltd/The	Morgan Stanley	(51)	4.800	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13
31.000	Value Partners Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(667)	2.900	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(513)
65.000	Value Partners Group Ltd	Morgan Stanley	(1.814)	200	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd '144A'	Morgan Stanley	32
4.000	Vitasoy International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	690	79.500	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	12.186
8.000	Vitasoy International Holdings Ltd	Morgan Stanley	54	17.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.040
(400)	VTech Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	58	(195.000)	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd '144A'	Morgan Stanley	(4.493)
161.000	Want Want China Holdings Ltd	Morgan Stanley	13.783	(183.000)	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	5.106
121.000	Want Want China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.849	(83.700)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	479
47.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	4.440	(192.700)	Zhuzhou CRRC Times E lectric Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	39.135
268.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	15.068	264.000	Zijin Mining Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(10.746)
888.000	West China Cement Ltd	Morgan Stanley	(9.029)	311.000	Zijin Mining Group Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(6.098)
2.596.000	West China Cement Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(23.079)		Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	4.775
192.500	WH Group Ltd '144A'	Morgan Stanley	(18.858)	203.600	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(2.063)
657.500	WH Group Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(10.790)	17.120	ZTE Corp 'H'*	Bank of America Merrill Lynch	(14.388)
500	Wuxi Biologics Cayman Inc '144A'	Bank of America Merrill Lynch	402	7.800	ZTE Corp 'H'*	Morgan Stanley	(6.556)
1.500	Wuxi Biologics Cayman Inc '144A'	Morgan Stanley	1.932				(918.692)
1.600	Wynn Macau Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1	Indonésie			
2.000	Wynn Macau Ltd	Morgan Stanley	14	189.900	Adaro Energy Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	2.560
2.000	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	709	(139.500)	AKR Corporindo Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	(2.189)
(8.000)	Xingda International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(72)	(63.400)	AKR Corporindo Tbk PT	Morgan Stanley	(1.328)
11.200	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H'	Morgan Stanley	(2.138)	176.300	Aneka Tambang Tbk	Bank of America Merrill Lynch	676
38.000	Xinyi Solar Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.644)	197.400	Aneka Tambang Tbk	Morgan Stanley	491
6.000	Xinyi Solar Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(107)	2.163.800	Astra International Tbk PT	Morgan Stanley	10.817
3.500	Xtep International Holdings Ltd	Morgan Stanley	(22)	118.000	Astra International Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	383
26.500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(5.892)	25.700	Bank Central Asia Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	1.340
20.500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' '144A'	Morgan Stanley	(4.429)	24.900	Bank Central Asia Tbk PT	Morgan Stanley	1.932
(6.200)	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd '144A'	Morgan Stanley	(1.466)	328.100	Bank Mandiri Persero Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	6.359
(8.600)	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(5.211)	440.900	Bank Mandiri Persero Tbk PT	Morgan Stanley	20.218
(33.000)	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.423)	26.500	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	Morgan Stanley	2.808
946.000	Yuexiu Property Co Ltd	Morgan Stanley	(8.409)	9.200	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	319
2.180.000	Yuexiu Property Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11.037)	106.800	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	Morgan Stanley	3.126
				414.600	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	1.225
				14.800	Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	341
				22.400	Bukit Asam Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	74

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

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Indonésie				Malaisie			
Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Indonésie suite				Malaisie suite			
41.200	Bukit Asam Tbk PT	Morgan Stanley	223	16.700	Frontken Corp Bhd	Morgan Stanley	(27)
955.900	Bumi Serpong Damai Tbk PT	Bank of America		10.000	Genting Bhd	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.953			Merrill Lynch	(58)
82.100	Bumi Serpong Damai Tbk PT	Morgan Stanley	986	46.600	Genting Bhd	Morgan Stanley	1.425
17.300	Erajaya Swasembada Tbk PT	Bank of America		50	George Kent Malaysia Bhd	Bank of America	
		Merrill Lynch	268			Merrill Lynch	(9)
63.200	Gudang Garam Tbk PT	Bank of America		(39.500)	Hartalega Holdings Bhd	Morgan Stanley	298
		Merrill Lynch	4.615	800	Hong Leong Bank Bhd	Morgan Stanley	64
63.400	Gudang Garam Tbk PT	Morgan Stanley	13.332	600	Hong Leong Financial	Bank of America	
5.000	Indah Kiat Pulp & Paper Corp Tbk PT	Bank of America			Group Bhd	Merrill Lynch	(23)
		Merrill Lynch	1.626	1.000	Hong Leong Financial		
19.600	Indah Kiat Pulp & Paper Corp Tbk PT	Morgan Stanley			Group Bhd	Morgan Stanley	(66)
		Bank of America	6.172	(711.200)	IOI Properties Group Bhd	Morgan Stanley	6.303
99.200	Indo Tambangraya Megah Tbk PT	Merrill Lynch	(1.668)	(64.200)	Kuala Lumpur Kepong Bhd	Bank of America	
						Merrill Lynch	690
12.200	Indo Tambangraya Megah Tbk PT	Morgan Stanley	66	4.500	Malayan Banking Bhd	Bank of America	
(70.500)	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT					Merrill Lynch	(1.363)
		Morgan Stanley	(4.171)	2.900	Malayan Banking Bhd	Morgan Stanley	(915)
3.500	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT			6.700	Malaysia Building Society Bhd	Bank of America	
		Morgan Stanley	186			Merrill Lynch	(39)
13.400	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	Bank of America		16.900	Malaysia Building Society Bhd	Morgan Stanley	(101)
		Merrill Lynch	694	100	Malaysian Resources Corp Bhd	Bank of America	
1.088.300	Media Nusantara Citra Tbk PT	Morgan Stanley	(309)			Merrill Lynch	(5)
1.252.100	Media Nusantara Citra Tbk PT	Bank of America		10.600	Malaysian Resources Corp Bhd		
		Merrill Lynch	(5.596)			Morgan Stanley	(366)
				1.700	Maxis Bhd	Bank of America	
19.300	Perusahaan Gas Negara Persero Tbk					Merrill Lynch	(11)
		Morgan Stanley	275	(147.000)	MISC Bhd	Morgan Stanley	30.355
11.500	PP Persero Tbk PT	Bank of America		30.900	My EG Services Bhd	Morgan Stanley	(373)
		Merrill Lynch	333	55.100	My EG Services Bhd	Bank of America	
(622.300)	Semen Indonesia Persero Tbk PT					Merrill Lynch	(2.616)
		Morgan Stanley	(7.567)	(208.600)	Pentamaster Corp Bhd	Morgan Stanley	(651)
43.400	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT			900	Petronas Dagangan Bhd	Morgan Stanley	(236)
		Morgan Stanley	342	3.100	Petronas Gas Bhd	Bank of America	
265.700	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	Bank of America				Merrill Lynch	(52)
		Merrill Lynch	3.520	2.400	Petronas Gas Bhd	Morgan Stanley	(277)
332.300	Timah Tbk PT	Morgan Stanley	(201)	58.800	PPB Group Bhd	Morgan Stanley	(1.261)
1.809.700	Timah Tbk PT	Bank of America		50.800	PPB Group Bhd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(729)			Merrill Lynch	(3.854)
				(38.800)	Press Metal Aluminium Holdings Bhd	Bank of America	
700	Unilever Indonesia Tbk PT	Morgan Stanley	10			Merrill Lynch	2.437
600	United Tractors Tbk PT	Bank of America		(154.600)	Press Metal Aluminium Holdings Bhd		
		Merrill Lynch	30			Morgan Stanley	212
111.800	United Tractors Tbk PT	Morgan Stanley	(3.836)	13.200	Public Bank Bhd	Morgan Stanley	(4.718)
272.700	Vale Indonesia Tbk PT	Bank of America		31.600	Public Bank Bhd	Bank of America	
		Merrill Lynch	7.760			Merrill Lynch	(2.268)
37.300	Vale Indonesia Tbk PT	Morgan Stanley	627			Bank of America	
27.800	Waskita Karya Persero Tbk PT	Morgan Stanley	335	2.800	RHB Bank Bhd	Merrill Lynch	(70)
16.400	Waskita Karya Persero Tbk PT	Bank of America				Morgan Stanley	(46)
		Merrill Lynch	419	2.100	RHB Bank Bhd	Morgan Stanley	858
			72.847	(188.100)	Sime Darby Plantation Bhd	Morgan Stanley	(26.042)
				397.300	Supermax Corp Bhd	Morgan Stanley	
				389.900	Supermax Corp Bhd	Bank of America	
						Merrill Lynch	(7.894)
						Bank of America	
1.700	Alliance Bank Malaysia Bhd	Merrill Lynch	(37)	35.200	Top Glove Corp Bhd	Merrill Lynch	695
		Bank of America				Morgan Stanley	(585)
114.200	Astro Malaysia Holdings Bhd	Merrill Lynch	(9.193)	69.200	Top Glove Corp Bhd	Bank of America	
			(8.993)	22.900	Velesto Energy Bhd	Merrill Lynch	(149)
265.100	Astro Malaysia Holdings Bhd	Morgan Stanley					
(160.700)	Axiata Group Bhd	Bank of America		(177.300)	YTL Corp Bhd	Bank of America	
		Merrill Lynch	33.566			Merrill Lynch	3.886
(81.800)	British American Tobacco Malaysia Bhd						47.085
		Morgan Stanley	39.707				
		Morgan Stanley	(540)				
8.900	Dialog Group Bhd						
6.500	Felda Global Ventures Holdings Bhd	Morgan Stanley	(385)	(166.710)	Aboitiz Equity Ventures Inc	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	19.683
6.700	Felda Global Ventures Holdings Bhd	Merrill Lynch	(524)	12.520	Ayala Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(11.307)
2.000	Fraser & Neave Holdings Bhd	Morgan Stanley	371			Morgan Stanley	(3.089)
200	Fraser & Neave Holdings Bhd	Bank of America		8.460	Ayala Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	70	680.900	Ayala Land Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(33.112)
23.900	Frontken Corp Bhd	Bank of America		513.600	Ayala Land Inc	Morgan Stanley	(23.248)
		Merrill Lynch	(105)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Philippines suite				Singapour suite			
(64.100)	DMCI Holdings Inc	Morgan Stanley	(714)	373.600	Manulife US Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America	(9.340)
(320.800)	DMCI Holdings Inc	Bank of America		2.000	Mapletree Commercial Trust (Reit)	Merrill Lynch	
155	Globe Telecom Inc	Bank of America	1.266	8.200	Mapletree Commercial Trust (Reit)	Bank of America	(50)
75	Globe Telecom Inc	Merrill Lynch	(98)	3.400	Mapletree North Asia Commercial Trust (Reit)	Merrill Lynch	(122)
(30.210)	International Container Terminal Services Inc	Morgan Stanley	(34)	161.700	Mapletree North Asia Commercial Trust (Reit)	Morgan Stanley	–
(20.920)	International Container Terminal Services Inc	Bank of America	(1.205)	(98.200)	NetLink NBN Trust (Unit)**	Bank of America	(299)
320	Manila Electric Co	Merrill Lynch	(338)	13.600	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	Morgan Stanley	(253)
96.600	Metro Pacific Investments Corp	Morgan Stanley	(231)	105.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	Morgan Stanley	(4.864)
88.000	Metro Pacific Investments Corp	Bank of America		(9.100)	Sembcorp Industries Ltd	Bank of America	(42.940)
8.000	SM Prime Holdings Inc	Merrill Lynch	(1.279)	(297.800)	Sembcorp Industries Ltd	Merrill Lynch	882
21.600	SM Prime Holdings Inc	Morgan Stanley	(69)	(55.600)	Sembcorp Marine Ltd	Morgan Stanley	37.039
(57.270)	Universal Robina Corp	Bank of America	(574)	(67.500)	Sembcorp Marine Ltd	Bank of America	5.805
		Merrill Lynch	9.198			Merrill Lynch	3.765
			(45.153)			Bank of America	1.704
Singapour				386.100	Sheng Siong Group Ltd	Merrill Lynch	5.808
4.600	Ascendas Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(68)	772.100	Sheng Siong Group Ltd	Morgan Stanley	
4.400	Ascendas Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America		(57.100)	Singapore Post Ltd	Bank of America	998
(41.100)	Best World International Ltd	Merrill Lynch	(52)	(174.700)	Starhill Global REIT (Reit)	Merrill Lynch	844
(15.900)	Best World International Ltd	Bank of America	(1.868)	133.300	Suntec Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America	(6.366)
6.600	CapitaLand Commercial Trust (Reit)	Merrill Lynch	(476)	399.700	Suntec Real Estate Investment Trust (Reit)	Merrill Lynch	40
200	CapitaLand Ltd	Morgan Stanley	(19)	(1.328.600)	Thai Beverage PCL	Bank of America	36.410
20.100	CapitaLand Ltd	Bank of America	(2.367)	(74.600)	UMS Holdings Ltd	Merrill Lynch	(1.118)
715.800	CapitaLand Mall Trust (Reit)	Merrill Lynch	(23.781)	14.600	United Overseas Bank Ltd	Bank of America	(15.073)
363.800	ComfortDelGro Corp Ltd	Bank of America		34.200	United Overseas Bank Ltd	Morgan Stanley	(38.500)
2.000	ComfortDelGro Corp Ltd	Merrill Lynch	25.135	52.800	Venture Corp Ltd	Bank of America	(44.439)
50.700	DBS Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	105	1.100	Wing Tai Holdings Ltd	Bank of America	(77)
13.300	DBS Group Holdings Ltd	Merrill Lynch	(21.725)	351.600	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	Merrill Lynch	(51.838)
(404.220)	Ezion Holdings Ltd	Morgan Stanley	(8.022)	91.200	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	Morgan Stanley	(5.782)
(877.600)	Frasers Commercial Trust (Reit)	Bank of America	(25.141)	22.400	Yanlord Land Group Ltd	Morgan Stanley	(667)
(3.200)	Frasers Commercial Trust (Reit)	Merrill Lynch	(120)				(364.092)
1.384.200	Genting Singapore Plc	Morgan Stanley	(63.722)	Corée du Sud			
1.323.300	Genting Singapore Plc	Bank of America	(49.302)	262	Advanced Process Systems Corp	Bank of America	(253)
(2.017.200)	Golden Agri-Resources Ltd	Merrill Lynch	(2.944)	(2.795)	AeroSpace Technology of Korea Inc	Merrill Lynch	685
(6.100)	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	Bank of America	335	(210)	AeroSpace Technology of Korea Inc	Morgan Stanley	74
(12.300)	Jardine Strategic Holdings Ltd	Merrill Lynch	16.565	8.755	AfreecaTV Co Ltd	Bank of America	65.843
200.400	Keppel Corp Ltd	Morgan Stanley	(74.718)	864	AK Holdings Inc	Bank of America	2.817
23.900	Keppel Corp Ltd	Bank of America	(9.413)	(8)	Amorepacific Corp	Merrill Lynch	(39)
5.300	Keppel DC (Reit)	Merrill Lynch	154	(3.722)	Amotech Co Ltd	Morgan Stanley	543
(21.600)	Keppel Infrastructure Trust (Unit)	Bank of America	322	(78)	Amotech Co Ltd	Bank of America	(179)
(24.900)	Keppel Infrastructure Trust (Unit)	Merrill Lynch	393	46.021	Asiana Airlines Inc	Bank of America	(15.143)
82.192	Manulife US Real Estate Investment	Bank of America	3.699	(255)	BGF Co Ltd	Merrill Lynch	181
34.958	Manulife US Real Estate Investment	Merrill Lynch	1.573	(99)	BGF retail Co Ltd	Morgan Stanley	662
163.900	Manulife US Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	–	(270)	BGF retail Co Ltd	Merrill Lynch	435

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(1.261)	BH Co Ltd	Bank of America		(18.324)	Grand Korea Leisure Co Ltd	Morgan Stanley	4.422
444	BNK Financial Group Inc	Merrill Lynch	(5.105)	33	Green Cross Corp/South Korea	Bank of America	
(5.874)	Boditech Med Inc	Morgan Stanley	(309)			Merrill Lynch	(179)
1.610	Cafe24 Corp	Bank of America	6.054	15.188	GS Engineering		
(80)	Caregen Co Ltd	Morgan Stanley	35.577	(31)	& Construction Corp	Morgan Stanley	27.102
4.013	Cell Biotech Co Ltd	Morgan Stanley	347	18.287	GS Home Shopping Inc	Morgan Stanley	158
(3.179)	Celltrion Healthcare Co Ltd	Morgan Stanley	2.173		Hana Financial Group Inc	Bank of America	
(454)	Celltrion Healthcare Co Ltd	Merrill Lynch	(23.096)	(231)	Hana Tour Service Inc	Bank of America	(71.591)
315	Celltrion Inc	Bank of America	(2.591)	(820)	Hanil Cement Co Ltd	Merrill Lynch	405
242	Celltrion Pharm Inc	Morgan Stanley	(777)	(2.083)	Hankook Tire Co Ltd	Morgan Stanley	(5.417)
38.099	Cheil Worldwide Inc	Morgan Stanley	299	(184)	Hanmi Pharm Co Ltd	Morgan Stanley	11.526
(27)	CJ CGV Co Ltd	Bank of America	8.036	(409)	Hanmi Pharm Co Ltd	Bank of America	2.320
1.041	CJ Corp	Merrill Lynch	180			Merrill Lynch	(2.745)
1.425	CJ O Shopping Co Ltd	Morgan Stanley	(15.810)	4.399	Hanmi Semiconductor Co Ltd	Bank of America	
(1.896)	Cosmax Inc	Morgan Stanley	5.552			Merrill Lynch	(3.137)
(74)	Cuckoo Homesys Co Ltd	Bank of America	(7.714)	(874)	Hanon Systems	Morgan Stanley	548
(137)	Cymechs Inc/Korea	Merrill Lynch	(1.940)	(482)	Hansae Co Ltd	Bank of America	
15.601	D.I Corp	Morgan Stanley	(56)	(39)	Hansol Chemical Co Ltd	Merrill Lynch	2.427
146	Daelim Industrial Co Ltd	Morgan Stanley	(4.292)	316	Hansol Paper Co Ltd	Morgan Stanley	(224)
(10.303)	Daemyung Corp Co Ltd	Merrill Lynch	(259)			Bank of America	83
6.654	Daewon Media Co Ltd	Merrill Lynch	2.034	33.076	Hansol Technics Co Ltd	Morgan Stanley	(29.697)
(19)	Daewoong Pharmaceutical	Bank of America	2.632	(103)	Hanssem Co Ltd	Bank of America	
(452)	Dentium Co Ltd	Merrill Lynch	(331)	(5.059)	Hanssem Co Ltd	Merrill Lynch	(248)
(2.171)	DIO Corp	Morgan Stanley	457	(3.085)	Hanwha Aerospace Co Ltd	Morgan Stanley	(8.277)
(2.199)	DIO Corp	Bank of America	4.832	138	Hanwha Chemical Corp	Morgan Stanley	(13.864)
319	DongKook Pharmaceutical	Merrill Lynch	2.614	617	Hanwha Galleria Timeworld	Morgan Stanley	(264)
164	Dongwon Industries Co Ltd	Bank of America	(872)			Morgan Stanley	(826)
5.616	Doosan Bobcat Inc	Merrill Lynch	1.315	184	HLB Inc	Morgan Stanley	4.382
32.560	Doosan Infracore Co Ltd	Morgan Stanley	5.861	1.103	Hotel Shilla Co Ltd	Morgan Stanley	6.963
(593)	DoubleUGames Co Ltd	Bank of America	(25.424)	861	Huchems Fine Chemical	Bank of America	
(4.833)	DoubleUGames Co Ltd	Merrill Lynch	1.108		Corp	Merrill Lynch	(731)
(15.822)	Duk San Neolux Co Ltd	Morgan Stanley	10.766	(13)	Hugel Inc	Bank of America	(305)
280	Easy Bio Inc	Merrill Lynch	(5.950)	(1.223)	Humedix Co Ltd	Merrill Lynch	1.905
(13.083)	Ecopro Co Ltd	Morgan Stanley	380	(1.118)	Humedix Co Ltd	Morgan Stanley	2.701
(8.170)	EM-Tech Co Ltd	Bank of America	(22.662)	120	Huons Co Ltd	Bank of America	
(2.108)	EM-Tech Co Ltd	Merrill Lynch	(8.245)	(1.120)	Hwaseung Enterprise Co Ltd	Merrill Lynch	10.657
(4.212)	Eo Technics Co Ltd	Morgan Stanley	(1.500)	(208)	Hwaseung Enterprise Co Ltd	Morgan Stanley	(2.565)
3.053	Eugene Corp	Bank of America	(2.014)	(16)	Hyundai Construction		1
(9.594)	Eugene Technology Co Ltd	Merrill Lynch	(5.978)		Equipment Co Ltd	Morgan Stanley	145
(1.041)	Eugene Technology Co Ltd	Bank of America	(273)	8.906	Hyundai Development Co-		
7.562	F&F Co Ltd	Merrill Lynch	130.003		Engineering & Construction	Morgan Stanley	2.614
(33.332)	Foosung Co Ltd	Bank of America	4.794	(2.488)	Hyundai Elevator Co Ltd	Bank of America	(27.811)
(28.733)	Foosung Co Ltd	Merrill Lynch	694			Merrill Lynch	(4.673)
(4.266)	G-Smatt Global Co Ltd	Morgan Stanley	2.545	(185)	Hyundai Elevator Co Ltd	Bank of America	
(2.221)	Gamevil Inc	Bank of America	(4.893)	(95)	Hyundai Engineering	Merrill Lynch	42
(44)	Gamevil Inc	Merrill Lynch	(62)		& Construction Co Ltd	Bank of America	(5.585)
(232)	Genexine Co Ltd	Bank of America	(17)	13.169	Hyundai Greenfood Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch		(19)	Hyundai Heavy Industries	Merrill Lynch	176
				19	Hyundai Heavy Industries	Bank of America	(786)
				1.538	Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	
				6.346	Hyundai Livart Furniture	Bank of America	(1.481)
					Co Ltd	Merrill Lynch	
				(8)	Hyundai Marine & Fire	Morgan Stanley	(15.882)
					Insurance Co Ltd	Bank of America	
				(22)	Hyundai Mobis Co Ltd	Merrill Lynch	159
				(19)	Hyundai Motor Co	Morgan Stanley	183
				(1.442)	Hyundai Motor Co (Pref)	Morgan Stanley	129
				(323)	Hyundai Rotem Co Ltd	Morgan Stanley	(3.740)
					Hyundai Rotem Co Ltd	Bank of America	
						Merrill Lynch	494

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(1.172)	i-SENS Inc	Bank of America		8.394	LG Electronics Inc	Morgan Stanley	(42.261)
477	Il Dong Pharmaceutical Co Ltd	Merrill Lynch	1.733	(2.263)	LG Hausys Ltd	Morgan Stanley	9.196
1.863	Iljin Display Co Ltd	Morgan Stanley	(480)	540	LG Household & Health	Bank of America	
60	Ilyang Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America	(214)		Care Ltd	Merrill Lynch	30.680
		Merrill Lynch	59	92	LG Household & Health		
36.862	Industrial Bank of Korea	Bank of America			Care Ltd (Pref)	Morgan Stanley	2.376
(116)	IS Dongseo Co Ltd	Merrill Lynch	(39.743)	(106)	LG Innotek Co Ltd	Morgan Stanley	(1.757)
4.343	JB Financial Group Co Ltd	Morgan Stanley	112	74.665	LG Uplus Corp	Morgan Stanley	(66.708)
		Bank of America		(2.258)	LIG Nex1 Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(940)	(170)	LIG Nex1 Co Ltd	Merrill Lynch	(16.527)
8.258	Jeju Air Co Ltd	Morgan Stanley	31.577	(369)	Lock&Lock Co Ltd	Morgan Stanley	(1.598)
75	Jin Air Co Ltd	Morgan Stanley	(89)			Bank of America	
(528)	Jungdawn Co Ltd	Morgan Stanley	(137)			Merrill Lynch	133
(1.144)	Jusung Engineering Co Ltd	Bank of America		(14)	Lotte Chemical Corp	Morgan Stanley	264
		Merrill Lynch	(14)	7	Lotte Chilsung Beverage Co		
(54)	Kakao Corp	Morgan Stanley	462		Ltd	Morgan Stanley	6
(5.117)	Kangwon Land Inc	Morgan Stanley	2.753	317	LOTTE Fine Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	605
28.934	KB Financial Group Inc	Bank of America		42	Lotte Food Co Ltd	Morgan Stanley	(702)
		Merrill Lynch	(153.358)	12.140	Lotte Himart Co Ltd	Bank of America	
		Morgan Stanley	(360)			Merrill Lynch	24.959
(130)	KC Co Ltd			10.788	LS Corp	Morgan Stanley	(2.118)
(2.173)	KEPCO Engineering			43	LS Industrial Systems Co Ltd	Morgan Stanley	(3)
	& Construction Co Inc	Morgan Stanley	6.478	(1.710)	Mando Corp	Bank of America	
(515)	KEPCO Engineering	Bank of America				Merrill Lynch	5.482
	& Construction Co Inc	Merrill Lynch	3.700	(7.595)	Mando Corp	Morgan Stanley	49.936
(3.072)	KEPCO Plant Service	Bank of America		(20)	Medipost Co Ltd	Bank of America	
	& Engineering Co Ltd	Merrill Lynch	10.100			Merrill Lynch	20
(311)	KEPCO Plant Service			50.583	Meritz Fire & Marine	Bank of America	
	& Engineering Co Ltd	Morgan Stanley	565		Insurance Co Ltd	Merrill Lynch	3.482
1.057	Kginicis Co Ltd	Bank of America		3.412	Meritz Securities Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(325)			Merrill Lynch	(572)
(112)	KMW Co Ltd	Morgan Stanley	(184)	(6.816)	Minwise Co Ltd	Morgan Stanley	4.054
(28)	Koh Young Technology Inc	Morgan Stanley	63	26.767	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	Morgan Stanley	(6.794)
(4.156)	Kolmar BNH Co Ltd	Morgan Stanley	7.131	(137)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd		
8.696	Kolon Corp	Morgan Stanley	(15.442)		'2P' (Pref)		2
(26)	Kolon Industries Inc	Bank of America		1.984	Mirae Asset Life Insurance	Bank of America	
		Merrill Lynch	(35)		Co Ltd	Merrill Lynch	200
(91)	Kolon Life Science Inc	Morgan Stanley	220	(164)	Modeltour Network Inc	Morgan Stanley	(148)
756	KoMiCo Ltd	Morgan Stanley	(262)	(53)	Nasmedia Co Ltd	Morgan Stanley	112
(10.081)	Korea Aerospace Industries Ltd	Morgan Stanley	1.839	683	NeoPharm Co Ltd	Bank of America	
4.402	Korea Gas Corp	Bank of America				Merrill Lynch	821
		Merrill Lynch	(2.800)	11.249	Neowiz	Morgan Stanley	56.121
10.993	Korea Investment Holdings	Bank of America		(2.085)	Netmarble Corp '144A'	Morgan Stanley	(31.847)
	Co Ltd	Merrill Lynch	(17.897)	4.224	NH Investment & Securities		
(849)	Korea Kolmar Co Ltd	Morgan Stanley	(258)		Co Ltd	Morgan Stanley	(2.798)
(166)	Korea Kolmar Co Ltd	Bank of America		(20)	NHN Entertainment Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	307			Merrill Lynch	6
(2.871)	Korea Line Corp	Morgan Stanley	3.510	(378)	NHN Entertainment Corp	Morgan Stanley	329
(229)	Korea Line Corp	Bank of America		318	NICE Information Service	Bank of America	
		Merrill Lynch	292		Co Ltd	Merrill Lynch	446
(12)	Korea Petrochemical Ind	Bank of America		1.956	OCI Co Ltd	Bank of America	
	Co Ltd	Merrill Lynch	33			Merrill Lynch	(51.892)
(386)	Korean Reinsurance Co	Morgan Stanley	(102)	(343)	Orion Corp/Republic of Korea	Bank of America	
255	Kortek Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(1.284)
		Merrill Lynch	92	(1.296)	Orion Corp/Republic of Korea	Morgan Stanley	(3.450)
(23)	KT&G Corp	Morgan Stanley	62	(8.374)	Orion Holdings Corp	Bank of America	
3.521	Kumho Industrial Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	6.151
		Merrill Lynch	(6.558)	(5.291)	Oscotec Inc	Morgan Stanley	(12.904)
8.832	Kumho Petrochemical Co Ltd	Morgan Stanley	(42.959)	(4.075)	Osstem Implant Co Ltd	Morgan Stanley	2.458
(72)	Kyung Dong Navien Co Ltd	Bank of America		501	Ottogi Corp	Morgan Stanley	15.030
		Merrill Lynch	724	(45.067)	Pan Ocean Co Ltd	Bank of America	
(6.427)	L&F Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	23.868
		Merrill Lynch	(49.783)	(41)	Park Systems Corp	Bank of America	
(6.654)	L&F Co Ltd	Morgan Stanley	(35.468)			Merrill Lynch	(4)
5.547	LEENO Industrial Inc	Bank of America		(1.968)	Partron Co Ltd	Morgan Stanley	(59)
		Merrill Lynch	8.616	90	Pearl Abyss Corp	Morgan Stanley	(1.086)
5.203	LF Corp	Morgan Stanley	(3.605)	(217)	Pharma Research Products	Bank of America	
210	LG Chem Ltd (Pref)	Bank of America			Co Ltd	Merrill Lynch	366
		Merrill Lynch	(1.511)	8.174	POSCO	Bank of America	
16.433	LG Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(245.534)
		Merrill Lynch	(100.567)	689	POSCO	Morgan Stanley	(12.169)

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(68)	POSCO Chemtech Co Ltd	Morgan Stanley	(336)	(35)	Tokai Carbon Korea Co Ltd	Bank of America	
28.948	Posco Daewoo Corp	Morgan Stanley	(54.485)		Merrill Lynch		(28)
293	S-1 Corp	Bank of America		33.143	Tongyang Life Insurance Co Ltd	Morgan Stanley	(12.554)
(2.627)	S-Oil Corp	Merrill Lynch	(1.726)	7.093	Union Semiconductor Equipment & Materials Co Ltd	Bank of America	
1.613	Samji Electronics Co Ltd	Morgan Stanley	9.106		Merrill Lynch		4.371
806	Samjin Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(98)	661	UniTest Inc	Bank of America	
(1.207)	Samsung Biologics Co Ltd	Morgan Stanley	2.583		Merrill Lynch		664
(1.234)	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	Bank of America	(31.123)	(86)	Value Added Technology Co Ltd	Bank of America	
842	Samsung C&T Corp	Merrill Lynch	(42.858)		Merrill Lynch		3
		Bank of America		1.612	Very Good Tour Co Ltd	Morgan Stanley	802
174	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Merrill Lynch	(2.717)	(6.024)	Vieworks Co Ltd	Morgan Stanley	23.489
174.297	Samsung Electronics Co Ltd	Bank of America	1.577	83	ViroMed Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch			Merrill Lynch		4.381
20.800	Samsung Electronics Co Ltd (Pref)	Merrill Lynch	212.674	63	WeMade Entertainment Co Ltd	Bank of America	
1.121	Samsung Engineering Co Ltd	Morgan Stanley	19.701		Merrill Lynch		59
(6.666)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Morgan Stanley	(321)	2.713	Whanin Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	2.126
2.537	Samsung SDS Co Ltd	Bank of America	1.409	4.652	WiSoL Co Ltd	Bank of America	
69	Samsung Securities Co Ltd	Merrill Lynch	(25.833)	1.876	Woori Bank	Merrill Lynch	(3.463)
1.950	Samwha Capacitor Co Ltd	Morgan Stanley	(19)	57.138	YeaRimDang Publishing Co Ltd	Bank of America	
(144)	Sangsangin Co Ltd	Morgan Stanley	(3.043)		Merrill Lynch		103.054
(6.197)	Sangsangin Co Ltd	Morgan Stanley	26	(3.022)	Yest Co Ltd	Morgan Stanley	651
		Bank of America		(458)	YG Entertainment Inc	Morgan Stanley	(717)
145	Seoul Semiconductor Co Ltd	Merrill Lynch	6.817	(7.983)	YG Entertainment Inc	Bank of America	
179	SFA Engineering Corp	Morgan Stanley	32		Merrill Lynch		(8.492)
22.011	Shinhan Financial Group Co Ltd	Morgan Stanley	(49)	(3.067)	YMT Co Ltd	Morgan Stanley	(3.623)
508	Shinsegae Food Co Ltd	Morgan Stanley	(79.086)	(2.506)	Yonwoo Co Ltd	Morgan Stanley	1.618
1.600	Shinsegae International Inc	Morgan Stanley	2.162	(2.207)	Yonwoo Co Ltd	Bank of America	
2.017	SIMMTECH Co Ltd	Morgan Stanley	19.411		Merrill Lynch		1.763
(41)	SK Chemicals Co Ltd	Morgan Stanley	(69)	631	Young Poong Corp	Morgan Stanley	(39.805)
		Bank of America					(397.310)
		Merrill Lynch	310	Taiwan			
(4.983)	SK D&D Co Ltd	Bank of America	(4.543)	(139.000)	Accton Technology Corp	Morgan Stanley	(27.846)
1.494	SK Discovery Co Ltd	Merrill Lynch	(3.612)	(302.000)	Accton Technology Corp	Bank of America	
2.519	SK Holdings Co Ltd	Bank of America	(57.091)	8.000	Advantech Co Ltd	Merrill Lynch	(144.353)
27.630	SK Hynix Inc	Merrill Lynch	217.485	1.000	Advantech Co Ltd	Bank of America	
(491)	SK Materials Co Ltd	Bank of America	(3.969)	2.000	Alchip Technologies Ltd	Merrill Lynch	(881)
(1.590)	SK Materials Co Ltd	Morgan Stanley	(4.608)	1.000	Alchip Technologies Ltd	Morgan Stanley	(192)
(19.281)	SK Networks Co Ltd	Morgan Stanley	3.899	(16.000)	All Ring Tech Co Ltd	Bank of America	
454	SK Telecom Co Ltd	Bank of America	286	(14.000)	Alpha Networks Inc	Merrill Lynch	(2.855)
(427)	SL Corp	Merrill Lynch	1.340	(131.000)	Alpha Networks Inc	Morgan Stanley	(385)
(1.244)	SM Entertainment Co Ltd	Bank of America	(2.849)	80.000	Anpec Electronics Corp	Bank of America	
(215)	SMCore Inc	Merrill Lynch	31		Merrill Lynch		17.104
(1.855)	SMCore Inc	Morgan Stanley	174	55.000	Anpec Electronics Corp	Bank of America	
5.144	Solid Inc	Bank of America	1.286	106	APAQ Technology Co Ltd	Merrill Lynch	85
(286)	Songwon Industrial Co Ltd	Morgan Stanley	(273)	1.369	APAQ Technology Co Ltd	Morgan Stanley	78
1.525	Spigen Korea Co Ltd	Bank of America	(4.368)	4.000	Arcadyan Technology Corp	Bank of America	
(5.991)	Ssangyong Cement Industrial Co Ltd	Merrill Lynch	(4.505)	1.000	Ardentec Corp	Merrill Lynch	52
(5.146)	ST Pharm Co Ltd	Bank of America	(325)	111.000	Ardentec Corp	Morgan Stanley	(23)
(1.151)	ST Pharm Co Ltd	Merrill Lynch	(1.214)	413.000	Asia Cement Corp	Bank of America	
(5.957)	Sung Kwang Bend Co Ltd	Morgan Stanley	2.213	585.000	Asia Cement Corp	Merrill Lynch	(1.801)
(1.936)	Taewoong Co Ltd	Bank of America	3.518	(321.000)	Asia Pacific Telecom Co Ltd	Morgan Stanley	(17.807)
(546)	TechWing Inc	Merrill Lynch	264	9.000	Asia Vital Components Co Ltd	Bank of America	
(7.044)	TES Co Ltd/Korea	Morgan Stanley	(15.008)	13.000	Asia Vital Components Co Ltd	Merrill Lynch	(16.317)
(950)	TES Co Ltd/Korea	Bank of America	(1.494)	1.000	AURAS Technology Co Ltd	Morgan Stanley	1.929
		Merrill Lynch					(131)
		Morgan Stanley					496
							(36)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
24.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(799)	(228.000)	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Morgan Stanley	3.757
446.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(13.267)	(19.000)	FLEXium Interconnect Inc	Bank of America Merrill Lynch	(486)
4.000	Celxpert Energy Corp	Morgan Stanley	114	39.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	Morgan Stanley	(2.137)
342.000	Chailease Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(39.124)	418.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	Bank of America Merrill Lynch	28.778
288.000	Chailease Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(6.066)	183.000	Formosa Plastics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20.947)
(1.941.000)	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(27.539)	260.000	Formosa Plastics Corp	Morgan Stanley	(18.515)
(148.000)	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	Morgan Stanley	5.220	(45.000)	Foxconn Technology Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.542
(42.000)	Chin-Poon Industrial Co Ltd	Morgan Stanley	(213)	(222.000)	Foxconn Technology Co Ltd	Morgan Stanley	2.151
(143.000)	Chin-Poon Industrial Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	976	2.000	Fubon Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	47
34.000	China Development Financial Holding Corp	Morgan Stanley	(300)	94.000	Fubon Financial Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(5.225)
16.000	China Development Financial Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	3	(26.000)	GCS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	406
(468.000)	China General Plastics Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.516	(8.000)	General Interface Solution Holding Ltd	Morgan Stanley	1.132
(39.000)	China General Plastics Corp	Morgan Stanley	2.654	1.000	Getac Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	3
1.047.000	China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	Bank of America Merrill Lynch	(2.808)	(35.000)	Giant Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	7.203
996.000	China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	Morgan Stanley	(47.872)	(2.000)	Giant Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	472
(225.000)	China Steel Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	46.002	30.000	Gigabyte Technology Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(308)
(13.000)	China Steel Chemical Corp	Morgan Stanley	2.254	64.000	Gigabyte Technology Co Ltd	Morgan Stanley	(20.951)
1.000	Chlitina Holding Ltd	Bank of America Merrill Lynch	417	(18.000)	Ginko International Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(18.068)
(171.000)	Chong Hong Construction Co Ltd	Morgan Stanley	(18.777)	4.000	Gintech Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41)
(266.000)	Chong Hong Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(46.681)	12.000	Gintech Energy Corp	Morgan Stanley	(7)
(4.000)	Chunghwa Precision Test Tech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(519)	21.000	Global Unichip Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13.712)
(138.000)	Chunghwa Telecom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(361)	19.000	Global Unichip Corp	Morgan Stanley	(4.642)
11.000	Coretronic Corp	Bank of America Merrill Lynch	862	2.000	Globalwafers Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.052
6.000	Coretronic Corp	Morgan Stanley	471	5.000	Globalwafers Co Ltd	Morgan Stanley	9.303
26.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(334)	1.000	Grape King Bio Ltd	Morgan Stanley	(43)
157.320	CTBC Financial Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(3.030)	4.000	Greatek Electronics Inc	Morgan Stanley	58
(48.000)	CTCI Corp	Morgan Stanley	(1.909)	61.000	Green Energy Technology Inc	Morgan Stanley	(2.888)
(56.700)	Cub Elecparts Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.225	16.000	Green Energy Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.315)
(1.000)	Daxin Materials Corp	Morgan Stanley	4	5.000	Hannstar Board Corp	Bank of America Merrill Lynch	958
(13.000)	Daxin Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	(328)	(29.000)	Highwealth Construction Corp	Bank of America Merrill Lynch	268
156.000	E.Sun Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.730)	(581.207)	Highwealth Construction Corp	Morgan Stanley	13.698
403.000	E.Sun Financial Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(5.056)	99.000	Hiwin Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(154.727)
1.000	Eclat Textile Co Ltd	Morgan Stanley	(382)	38.000	Hiwin Technologies Corp	Morgan Stanley	(37.483)
(7.000)	Egis Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.781)	2.000	Holtek Semiconductor Inc	Morgan Stanley	(6)
(6.000)	Egis Technology Inc	Morgan Stanley	(3.169)	2.000	Holtek Semiconductor Inc	Bank of America Merrill Lynch	14
(46.000)	Elite Material Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.565	(1.000)	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21
(7.000)	Elite Material Co Ltd	Morgan Stanley	1.333	(266.000)	HTC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.590)
3.000	Eson Precision Ind Co Ltd	Morgan Stanley	(74)	(214.000)	Innolux Corp	Bank of America Merrill Lynch	(395)
289.000	Eva Airways Corp	Bank of America Merrill Lynch	400	1.000	Integrated Service Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(140)
595.000	Eva Airways Corp	Morgan Stanley	1.621	(7.000)	King Slide Works Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.206
(464.000)	Everlight Electronics Co Ltd	Morgan Stanley	(13.192)	(2.000)	King Slide Works Co Ltd	Morgan Stanley	1.172
(179.000)	Everlight Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.660)	(56.000)	Kinsus Interconnect Technology Corp	Morgan Stanley	(1.553)
153.000	Far Eastern New Century Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.484	(12.000)	KS Terminals Inc	Morgan Stanley	(895)
93.000	Far Eastern New Century Corp	Morgan Stanley	(1.196)				

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
(2.000)	KS Terminals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(133)	(2.000)	St Shine Optical Co Ltd	Morgan Stanley	(1.138)
(3.000)	LandMark Optoelectronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(1.000)	Sunny Friend Environmental Technology Co Ltd	Morgan Stanley	42
(12.000)	LandMark Optoelectronics Corp	Morgan Stanley	1.350	(5.000)	Syncmold Enterprise Corp	Bank of America Merrill Lynch	(209)
(65.000)	Lealea Enterprise Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	96	(90.000)	Syncmold Enterprise Corp	Morgan Stanley	(2.773)
(124.000)	Lealea Enterprise Co Ltd	Morgan Stanley	1.093	196.000	Synnex Technology International Corp	Morgan Stanley	1.582
(17.000)	Long Chen Paper Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	899	530.000	Synnex Technology International Corp	Bank of America Merrill Lynch	37.474
1.000	Lotes Co Ltd	Morgan Stanley	276	(2.000)	Ta Ya Electric Wire & Cable	Morgan Stanley	(29)
(38.000)	Makalot Industrial Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.305	(987.000)	Ta Ya Electric Wire & Cable	Bank of America Merrill Lynch	6.824
7.000	Marketch International Corp	Bank of America Merrill Lynch	143	1.320.000	Taiwan Cement Corp	Bank of America Merrill Lynch	(47.798)
10.000	Marketch International Corp	Morgan Stanley	671	500.000	Taiwan Cement Corp	Morgan Stanley	(24.815)
1.000	MediaTek Inc	Morgan Stanley	(313)	(1.000)	Taiwan Chinsan Electronic Industrial Co Ltd	Morgan Stanley	(78)
(1.000)	Merida Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	268	(12.000)	Taiwan Chinsan Electronic Industrial Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.547)
(164.000)	Merry Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(25.561)	(177.000)	Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.180
23.000	Micro-Star International Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.508	(59.000)	Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	Morgan Stanley	518
139.000	Micro-Star International Co Ltd	Morgan Stanley	(10.398)	(6.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	Morgan Stanley	(274)
399.000	Nan Ya Plastics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(24.386)	(133.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11.471)
925.000	Nan Ya Plastics Corp	Morgan Stanley	(95.884)	(56.000)	Taiwan Paiho Ltd	Morgan Stanley	1.284
52.000	Nanya Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.923)	(35.000)	Taiwan Paiho Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.660
6.000	Nanya Technology Corp	Morgan Stanley	457	5.000	Taiwan Semiconductor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.184
(8.000)	Nien Made Enterprise Co Ltd	Morgan Stanley	1.147	5.000	Taiwan Semiconductor Co Ltd	Morgan Stanley	2.021
(62.000)	Nien Made Enterprise Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	29.400	601.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(148.355)
13.000	On-Bright Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.567	259.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	(45.637)
32.000	On-Bright Electronics Inc	Morgan Stanley	(4.650)	8.000	TCI Co Ltd	Morgan Stanley	(7.613)
(12.000)	Paiho Shih Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.580	22.000	TCI Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(35.767)
(1.000)	Parade Technologies Ltd	Morgan Stanley	(782)	(293.000)	Teco Electric and Machinery Co Ltd	Morgan Stanley	4.205
48.806	PChome Online Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.888	(13.000)	Tong Yang Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	216
7.186	PChome Online Inc	Morgan Stanley	1.038	77.000	Tripod Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	443
(66.000)	Pegatron Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.473	180.000	Tripod Technology Corp	Morgan Stanley	(3.629)
(7.000)	Pegatron Corp	Morgan Stanley	416	(114.000)	TSRC Corp	Morgan Stanley	5.289
88.000	Powertech Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.338	(608.000)	TSRC Corp	Bank of America Merrill Lynch	11.652
271.000	Powertech Technology Inc	Morgan Stanley	(3.703)	3.000	Ultra Chip Inc	Morgan Stanley	136
1.000	QST International Corp	Morgan Stanley	(105)	6.000	Ultra Chip Inc	Bank of America Merrill Lynch	573
(298.000)	Quanta Computer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.944)	579.000	Uni-President Enterprises Corp	Bank of America Merrill Lynch	17.709
(97.000)	Quanta Computer Inc	Morgan Stanley	6.692	25.000	Uni-President Enterprises Corp	Morgan Stanley	1.012
2.000	Rexon Industrial Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	205	5.000	United Microelectronics Corp	Morgan Stanley	72
(142.600)	Ruentex Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.959)	1.000	Userjoy Technology Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(104)
(1.192.000)	Ruentex Development Co Ltd	Morgan Stanley	(12.187)	(19.544)	VHQ Media Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14.241
(201.000)	Ruentex Industries Ltd	Morgan Stanley	4.532	(1.000)	VHQ Media Holdings Ltd	Morgan Stanley	543
(2.000)	Ruentex Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(165)	7.000	Wafer Works Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.511
(25.000)	Sercomm Corp	Morgan Stanley	481	123.000	Walsin Lihwa Corp	Morgan Stanley	(1.975)
(327.000)	Shin Zu Shing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(80.653)	559.000	Walsin Lihwa Corp	Bank of America Merrill Lynch	30.961
(3.000)	Shin Zu Shing Co Ltd	Morgan Stanley	(290)	3.000	Walsin Technology Corp	Morgan Stanley	4.715
(37.000)	Silergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(69.851)	(5.000)	Win Semiconductors Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.430
(3.000)	Silergy Corp	Morgan Stanley	(3.626)	(804)	Winbond Electronics Corp	Morgan Stanley	(6)
1.000	Sino-American Silicon Products Inc	Morgan Stanley	145				
2.000	Sino-American Silicon Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	21				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Taiwan suite				Thaïlande suite			
5.000	Winbond Electronics Corp	Bank of America		904.700	PTT PCL	Morgan Stanley	(84.958)
1.227.945	Wistron Corp	Merrill Lynch	255	277.300	PTT PCL	Bank of America	
		Merrill Lynch	(28.277)	5.400	RS PCL	Morgan Stanley	(37.066)
509.112	Wistron Corp	Morgan Stanley	(16.630)	2.600	RS PCL	Bank of America	1.582
(86.000)	Wistron NeWeb Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(394)
		Merrill Lynch	(9.863)	(125.700)	Siam City Cement PCL	Morgan Stanley	11.707
(95.000)	Wistron NeWeb Corp	Morgan Stanley	(5.755)	149.500	Sri Trang Agro-Industry PCL	Morgan Stanley	33.935
5.000	Wowprime Corp	Bank of America		177.200	Sri Trang Agro-Industry PCL	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.073)			Merrill Lynch	(91.699)
7.000	Wowprime Corp	Morgan Stanley	204	(165.900)	Thai Union Group PCL	Morgan Stanley	(48.838)
596.000	WPG Holdings Ltd	Bank of America		(844.700)	Thai Union Group PCL	Bank of America	
		Merrill Lynch	17.792			Merrill Lynch	9.240
415.000	WPG Holdings Ltd	Morgan Stanley	8.973	619.200	TTW PCL	Morgan Stanley	143.446
1.000	Yageo Corp	Morgan Stanley	1.559	918.500	TTW PCL	Bank of America	
3.490.000	Yuanta Financial Holding					Merrill Lynch	175.895
	Co Ltd	Morgan Stanley	(48.654)				
3.422.000	Yuanta Financial Holding	Bank of America					668.285
	Co Ltd	Merrill Lynch	(46.389)				
			(1.140.899)				
Thaïlande				Etats-Unis			
3.300	Airports of Thailand PCL	Morgan Stanley	(88)	14.400	21Vianet Group Inc ADR	Bank of America	
2.200	Airports of Thailand PCL	Bank of America				Merrill Lynch	33.840
		Merrill Lynch	2.040	23.487	21Vianet Group Inc ADR	Morgan Stanley	3.053
740.800	Bangkok Chain Hospital PCL	Bank of America		191	51job Inc ADR	Morgan Stanley	785
		Merrill Lynch	(714)	47	58.com Inc ADR	Bank of America	
591.800	Bangkok Chain Hospital PCL	Morgan Stanley	662			Merrill Lynch	(79)
2.450.900	Bangkok Dusit Medical	Bank of America		29.729	Alibaba Group Holding Ltd	Bank of America	
	Services PCL 'F'	Merrill Lynch	95.751	ADR	Merrill Lynch	58.167	
1.800.700	Bangkok Dusit Medical			9.871	Alibaba Group Holding Ltd		
	Services PCL 'F'	Morgan Stanley	798.045	ADR	Morgan Stanley	26.948	
(32.600)	Bangkok Expressway	Bank of America		35	Autohome Inc ADR	Bank of America	
	& Metro PCL	Merrill Lynch	(291)			Merrill Lynch	281
(808.100)	BEC World PCL	Morgan Stanley	25.945	3.207	Baidu Inc ADR	Bank of America	
1.500	Bumrungrad Hospital PCL	Morgan Stanley	172			Merrill Lynch	(88.994)
46.400	Bumrungrad Hospital PCL	Bank of America		6.378	Baidu Inc ADR	Morgan Stanley	26.788
		Merrill Lynch	3.108	102	Bitauto Holdings Ltd ADR	Bank of America	
176.300	Central Plaza Hotel PCL	Bank of America				Merrill Lynch	193
		Merrill Lynch	(26.695)	98	Bright Scholar Education		
7.800	Central Plaza Hotel PCL	Morgan Stanley	(189)		Holdings Ltd ADR	Morgan Stanley	(123)
(1.602.600)	Charoen Pokphand Foods PCL	Morgan Stanley	(272.666)	313	Cheetah Mobile Inc ADR	Morgan Stanley	260
1.423.700	Erawan Group PCL/The	Bank of America		464	China Lodging Group Ltd ADR	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.911)			Merrill Lynch	433
490.800	Erawan Group PCL/The	Morgan Stanley	66.866	3.701	Fang Holdings Ltd ADR	Bank of America	
(510.500)	GFPT PCL	Morgan Stanley	33.021			Merrill Lynch	(660)
214.300	Glow Energy PCL	Bank of America		503	GDS Holdings Ltd ADR	Morgan Stanley	548
		Merrill Lynch	7.319	23.378	Genpact Ltd	Morgan Stanley	(2.572)
93.900	Glow Energy PCL	Morgan Stanley	2.009	16.982	Genpact Ltd	Bank of America	
(60.700)	Hana Microelectronics PCL	Morgan Stanley	3.408			Merrill Lynch	(2.547)
292.900	Home Product Center PCL	Bank of America		492	Gridsum Holding Inc ADR	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.418			Merrill Lynch	251
318.800	Home Product Center PCL	Morgan Stanley	3.301	78	JD.com Inc ADR	Morgan Stanley	(41)
45.100	Indorama Ventures PCL	Bank of America		1.328	Jianpu Technology Inc ADR	Morgan Stanley	80
		Merrill Lynch	(3.685)	(17.048)	MakeMyTrip Ltd	Morgan Stanley	(7.672)
1.500	Indorama Ventures PCL	Morgan Stanley	(134)	(320)	MakeMyTrip Ltd	Bank of America	
(144.600)	KCE Electronics PCL	Morgan Stanley	18.848			Merrill Lynch	83
(43.100)	Krung Thai Bank PCL	Morgan Stanley	1.226	11.591	Melco Resorts &	Bank of America	
565.700	Land & Houses PCL	Bank of America			Entertainment Ltd ADR	Merrill Lynch	14.257
		Merrill Lynch	(2.141)	7.930	Melco Resorts &		
1.173.600	Land & Houses PCL	Morgan Stanley	888		Entertainment Ltd ADR	Morgan Stanley	6.185
(3.267.400)	LPN Development PCL	Morgan Stanley	18.219	1.120	Momo Inc ADR	Morgan Stanley	6.406
6.400	Precious Shipping PCL	Morgan Stanley	639	2.091	Momo Inc ADR	Bank of America	
34.300	PTT Exploration					Merrill Lynch	16.665
	& Production PCL	Morgan Stanley	(38.735)	326	Noah Holdings Ltd ADR	Morgan Stanley	(903)
168.800	PTT Exploration	Bank of America		338	Phoenix New Media Ltd ADR	Bank of America	
	& Production PCL	Merrill Lynch	(13.245)			Merrill Lynch	(47)
107.200	PTT Global Chemical PCL	Bank of America		1.553	Posco ADR	Bank of America	
		Merrill Lynch	(26.984)			Merrill Lynch	(4.371)
778.600	PTT Global Chemical PCL	Morgan Stanley	(140.972)	806	PPDAI Group Inc ADR	Morgan Stanley	16
				1.387	Qudian Inc ADR	Bank of America	
						Merrill Lynch	(4.896)
				3.861	Qudian Inc ADR	Morgan Stanley	(4.054)

BlackRock Asia Extension Fund suite

« *Contracts for difference* » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
465	Renren Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	9	25.050	WNS Holdings Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	58.741
99	RYB Education Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	(2)	12.742	WNS Holdings Ltd ADR	Morgan Stanley	30.071
23.522	Sea Ltd ADR	Morgan Stanley	35.048	47	YY Inc ADR	Morgan Stanley	580
17.412	Sea Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	73.479	107	YY Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	1.520
560	SINA Corp/China	Morgan Stanley	118	6.266	Zai Lab Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	22.495
173	SINA Corp/China	Bank of America Merrill Lynch	(108)				295.600
54.137	Sogou Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	448	Total (exposition brute sous-jacente – 284.735.845 USD)			
23.276	Sogou Inc ADR	Morgan Stanley	(3.957)				(1.781.811)
7.464	Sohu.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.015)				
3.650	Sohu.com Inc	Morgan Stanley	1.168				
83	Weibo Corp ADR	Morgan Stanley	63				
299	Weibo Corp ADR	Bank of America Merrill Lynch	(338)				

BlackRock Asia Extension Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
619	USD	SGX NIFTY 50	Juin 2018	13.266.408	39.434
Total				13.266.408	39.434

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
INR	579.363.258	USD	8.814.410	Bank of America Merrill Lynch	5/7/2018	(262.292)
						(262.292)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	5.394	USD	7.325	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(151)
USD	648	GBP	481	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	8
						(143)
Total (exposition brute sous-jacente – 8.559.931 USD)						(262.435)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	73,98
Gouvernement	16,29
Biens de consommation cyclique	4,43
Biens de consommation non cyclique	3,71
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,41
Autres éléments de l'actif net	1,59
	100,00

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie				Corée du Sud			
190.046	Beach Energy Ltd*	236.094	0,88	11.075	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd	278.943	1,04
77.385	Iluka Resources Ltd	656.534	2,44	15.125	Hana Financial Group Inc	583.700	2,18
75.122	Tabcorp Holdings Ltd	248.675	0,93	1.999	Korea Aerospace Industries Ltd	81.596	0,30
		1.141.303	4,25	2.445	POSCO	770.052	2,87
				8.205	SK Hynix Inc	710.930	2,65
						2.425.221	9,04
Îles Caïmans				Taiwan			
1.530.000	Anton Oilfield Services Group/Hong Kong	241.721	0,90	348.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	622.559	2,32
42.000	Health and Happiness H&H International Holdings Ltd	329.902	1,23	359.000	CTCI Corp	588.917	2,19
17.000	Parade Technologies Ltd	283.130	1,05	72.000	FLEXium Interconnect Inc	208.588	0,78
		854.753	3,18	145.000	Nanya Technology Corp	482.019	1,80
						1.902.083	7,09
Chine				Thaïlande			
1.188.000	Bank of China Ltd 'H'	620.587	2,31	133.700	Indorama Ventures PCL NVDR	243.452	0,91
572.000	Guangshen Railway Co Ltd 'H'	330.138	1,23	782.300	Land & Houses PCL Reg	273.890	1,02
370.000	PetroChina Co Ltd 'H'	305.949	1,14			517.342	1,93
		1.256.674	4,68			16.045.286	59,79
Hong Kong				BILLET DE TRÉSORERIE			
52.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	263.881	0,98	Etats-Unis			
331.000	Cathay Pacific Airways Ltd*	538.966	2,01	USD 1.212.000	Jupiter Securitization Company LLC 2/7/2018 (Zero Coupon)	1.209.913	4,51
411.000	SJM Holdings Ltd	589.634	2,20	USD 1.206.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 23/7/2018 (Zero Coupon)	1.202.429	4,48
		1.392.481	5,19	USD 1.209.000	Old Line Funding LLC 16/7/2018 (Zero Coupon)	1.205.856	4,49
Indonésie				USD 1.177.000	Victory Receivables Corp 7/6/2018 (Zero Coupon)	1.176.608	4,39
2.705.400	Cikarang Listrindo Tbk PT'144A'	211.253	0,79			4.794.806	17,87
		211.253	0,79			4.794.806	17,87
Île de Man				Total des billets de trésorerie			
374.800	Genting Singapore Plc	352.582	1,31				
		352.582	1,31	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Japon						20.840.092	77,66
31.800	Anritsu Corp	427.635	1,59	Organismes de placement collectif			
9.700	Calbee Inc	354.938	1,32	Irlande			
78.400	Chiyoda Corp	683.593	2,55	2.104.572	Institutional Cash Series Plc - Institutional US Dollar Liquidity Fund Agency Dis ¹	2.104.572	7,84
21.200	Dai-ichi Life Holdings Inc	396.761	1,48			2.104.572	7,84
39.400	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	238.154	0,89			2.104.572	7,84
119.898	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc ADR	719.388	2,68			2.104.572	7,84
900	Nintendo Co Ltd	373.289	1,39	Total des organismes de placement collectif			
19.300	Recruit Holdings Co Ltd	539.002	2,01			22.944.664	85,50
36.400	Renesas Electronics Corp	363.010	1,35	Autres éléments de l'actif net			
12.000	Seven & i Holdings Co Ltd	533.223	1,99			3.891.969	14,50
6.600	Toyota Motor Corp	421.020	1,57	Total de l'actif net (USD)			
		5.050.013	18,82			26.836.633	100,00
Philippines							
1.256.000	LT Group Inc	493.693	1,84				
69.000	Metropolitan Bank & Trust Co	104.284	0,39				
		597.977	2,23				
Singapour							
40.800	Singapore Airlines Ltd	343.604	1,28				
		343.604	1,28				

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

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Australie				Singapour			
(76.438)	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9.230	(338.500)	Raffles Medical Group Ltd	JP Morgan	20.763
(41.848)	Challenger Ltd/Australia	Bank of America Merrill Lynch	(21.560)	(100.700)	Singapore Telecommunications Ltd	Morgan Stanley	9.003
(19.018)	Perpetual Ltd	JP Morgan	22.846				29.766
			10.516	Corée du Sud			
Chine				(2.883)	Celltrion Inc	Morgan Stanley	7.112
55.207	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2.220	(5.195)	Daelim Industrial Co Ltd	Morgan Stanley	9.206
			2.220	(2.330)	Hyundai Motor Co	Bank of America Merrill Lynch	21.730
Hong Kong				(5.083)	KT&G Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.519
(41.000)	BYD Co Ltd 'H'	JP Morgan	8.593	(1.413)	NCSOFT Corp	Morgan Stanley	(1.853)
(31.000)	Hengan International Group Co Ltd	Morgan Stanley	(11.293)	(5.018)	S-Oil Corp	Morgan Stanley	17.393
(364.200)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	JP Morgan	(16.778)				67.107
(22.000)	Sun Hung Kai Properties Ltd	JP Morgan	(4.518)	Taiwan			
(1.226.000)	Xinyi Solar Holdings Ltd	Morgan Stanley	52.339	(52.000)	Elite Material Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.290
			28.343	(16.000)	Gigasolar Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	914
Indonésie				(15.000)	Gigasolar Materials Corp	JP Morgan	(3.975)
(2.846.400)	Kalbe Farma Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	(20.429)	(128.000)	Micro-Star International Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(55.823)
			(20.429)	(79.000)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	14.231
Japon				(39.000)	Win Semiconductors Corp	Bank of America Merrill Lynch	33.190
(20.300)	Brother Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	39.225	(410.000)	Wistron Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.442
(5.800)	FamilyMart UNY Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(20.531)				4.269
(35.600)	Nissan Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10.028	Thaïlande			
(11.100)	Park24 Co Ltd	JP Morgan	22.189	(183.900)	CP ALL PCL NVDR	Morgan Stanley	3.289
(12.400)	Seria Co Ltd	Morgan Stanley	(32.660)	(33.300)	Siam Cement PCL/The NVDR	JP Morgan	22.601
(167.000)	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	JP Morgan	(26.730)				25.890
			(8.479)	Etats-Unis			
Philippines				(3.874)	Weibo Corp ADR	JP Morgan	5.233
(85.810)	Jollibee Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	15.348				5.233
			15.348	Total (exposition brute sous-jacente – 14.624.660 USD)			
							159.784

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	(Moins-valeur) non réalisée USD
(20)	HKD	Mini H-Shares Index	Juin 2018	777.122	(1.019)
(34)	JPY	Mini-Topix Index	Juin 2018	546.689	(13.946)
Total				1.323.811	(14.965)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	581.637	JPY	63.034.974	Citibank	26/7/2018	(1.435)
						(1.435)
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	1.211.353	USD	1.212.076	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	17.732
USD	63.576	CHF	63.585	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(978)
						16.754
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	62.384	USD	74.233	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1.502)
USD	2.806	EUR	2.361	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	53
						(1.449)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	366.745	USD	498.082	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(10.379)
USD	28.403	GBP	20.976	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	509
						(9.870)
Total (exposition brute sous-jacente – 2.468.513 USD)						4.000

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	31,10
Biens de consommation cyclique	11,71
Valeurs industrielles	9,68
Biens de consommation non cyclique	8,39
Organismes de placement collectif	7,84
Technologie	6,85
Matériaux de base	6,22
Énergie	2,92
Services aux collectivités	0,79
Portefeuille de titres à la valeur de marché	85,50
Autres éléments de l'actif net	14,50
100,00	

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS				Etats-Unis suite			
USD 400.000	Etats-Unis Federal Home Loan Bank Discount Notes 18/6/2018 (Zero Coupon)	399.667	1,79	USD 350.000	Barton Capital Corp 12/6/2018 (Zero Coupon)	349.759	1,57
USD 2.900.000	United States Treasury Bill 5/7/2018 (Zero Coupon)	2.895.244	13,00	USD 650.000	Bedford Row Funding Corp FRN 11/6/2018	650.000	2,92
USD 500.000	United States Treasury Bill 29/11/2018 (Zero Coupon)	494.903	2,22	USD 500.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,143% 22/8/2018	500.000	2,25
		3.789.814	17,01	USD 900.000	Chariot Funding LLC 3/7/2018 (Zero Coupon)	898.152	4,03
Total des obligations		3.789.814	17,01	USD 300.000	Charta LLC 5/7/2018 (Zero Coupon)	299.343	1,34
CERTIFICATS DE DÉPÔT				USD 400.000	Coca-Cola Company/The FRN8/6/2018	399.855	1,80
USD 800.000	Norvège DNB ASA FRN 6/8/2018	800.000	3,59	USD 600.000	Coca-Cola Company/The 20/9/2018 (Zero Coupon)	595.782	2,68
		800.000	3,59	USD 500.000	CRC Funding LLC 4/6/2018 (Zero Coupon)	499.910	2,24
USD 300.000	Etats-Unis Bank of Nova Scotia/Houston 1,66% 21/9/2018	300.000	1,35	USD 500.000	CRC Funding LLC 5/11/2018 (Zero Coupon)	494.658	2,22
USD 500.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,178% 13/11/2018	500.000	2,24	USD 900.000	Crown Point Capital Co LLC 5/7/2018 (Zero Coupon)	898.045	4,03
USD 500.000	Credit Industriel et Commercial/New York 2,103% 6/8/2018	500.000	2,24	USD 500.000	Danske Corp 2/8/2018 (Zero Coupon)	498.058	2,24
USD 300.000	Royal Bank of Canada/New York 2,173% 6/11/2018	300.000	1,35	USD 250.000	HSBC Bank Plc RegS 2,337% 11/4/2019	250.000	1,12
USD 300.000	Standard Chartered Bank 2,128% 14/6/2018	300.000	1,35	USD 500.000	ING US Funding LLC 2,098% 9/7/2018	500.000	2,25
USD 600.000	Standard Chartered Bank 2,148% 9/7/2018	600.000	2,69	USD 250.000	JP Morgan Securities LLC 7/8/2018 (Zero Coupon)	249.200	1,12
USD 400.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 2,248% 21/8/2018	400.000	1,80	USD 250.000	JP Morgan Securities LLC 22/2/2019 (Zero Coupon)	245.419	1,10
USD 500.000	Sumitomo Mitsui Trust and Banking Ltd/New York 2,168% 21/6/2018	500.000	2,24	USD 300.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 4/6/2018 (Zero Coupon)	299.950	1,35
USD 750.000	UBS AG/Stamford 2,177% 1/6/2018	750.000	3,37	USD 400.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 13/6/2018 (Zero Coupon)	399.733	1,79
USD 500.000	Wells Fargo Bank NA 2,154% 15/11/2018	500.000	2,25	USD 800.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 8/6/2018 (Zero Coupon)	799.662	3,59
USD 500.000	Wells Fargo Bank NA 2,185% 19/11/2018	500.000	2,25	USD 250.000	Starbird Funding Corp 24/9/2018 (Zero Coupon)	247.980	1,11
		5.150.000	23,13	USD 500.000	Toronto-Dominion Bank/The 19/6/2018 (Zero Coupon)	499.463	2,24
Total des certificats de dépôt		5.950.000	26,72	USD 250.000	UBS AG/London 2,655% 4/4/2019	250.000	1,12
BILLET DE TRÉSORERIE				USD 500.000	Versailles Commercial Paper LLC 31/8/2018 (Zero Coupon)	497.156	2,23
USD 300.000	France BPCE SA 1/10/2018 (Zero Coupon)	297.530	1,34			12.269.050	55,09
		297.530	1,34	Total des billets de trésorerie		12.566.580	56,43
USD 750.000	Etats-Unis American Honda Motor Co 7/6/2018 (Zero Coupon)	749.753	3,37	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		22.306.394	100,16
USD 700.000	Antalis SA 12/7/2018 (Zero Coupon)	698.158	3,14	Portefeuille de titres à la valeur de marché		22.306.394	100,16
USD 500.000	Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 10/7/2018 (Zero Coupon)	499.014	2,24	Autres éléments du passif net		(36.593)	(0,16)
				Total de l'actif net (USD)		22.269.801	100,00

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Australie				Australie suite			
2.331	a2 Milk Co Ltd	HSBC	(3.001)	673	BHP Billiton Ltd	Citibank	(525)
372	a2 Milk Co Ltd	Citibank	11	530	BHP Billiton Ltd	HSBC	567
(7.969)	Adelaide Brighton Ltd	Citibank	(107)	(2.885)	BHP Billiton Ltd	HSBC	(1.500)
(3.018)	Adelaide Brighton Ltd	JP Morgan	(202)	9.808	BHP Billiton Ltd	JP Morgan	9.761
(8.769)	Afterpay Touch Group Ltd	Citibank	(4.164)	(6.604)	Bingo Industries Ltd	Citibank	294
(2.683)	Afterpay Touch Group Ltd	JP Morgan	(2.922)	(2.252)	Bingo Industries Ltd	HSBC	291
3.441	AGL Energy Ltd	Citibank	1.383	(29.234)	Bingo Industries Ltd	JP Morgan	3.976
475	AGL Energy Ltd	JP Morgan	34	216	Blackmores Ltd	HSBC	5.583
1.206	AGL Energy Ltd	HSBC	148	190	Blackmores Ltd	JP Morgan	4.857
(17.805)	Ainsworth Game Technology Ltd	HSBC	(545)	3.723	Blue Sky Alternative Investments Ltd	JP Morgan	719
(7.828)	Altium Ltd	HSBC	1.414	685	BlueScope Steel Ltd	HSBC	148
449	Altium Ltd	JP Morgan	(104)	1.443	BlueScope Steel Ltd	Citibank	191
1.005	Altium Ltd	Citibank	(319)	1.383	BlueScope Steel Ltd	JP Morgan	243
473	Altium Ltd	HSBC	(85)	(35.154)	Boral Ltd	HSBC	3.772
(17.902)	AMA Group Ltd	Citibank	179	3.535	Boral Ltd	HSBC	(379)
(6.226)	AMA Group Ltd	JP Morgan	(48)	4.287	Boral Ltd	JP Morgan	(335)
(40.546)	Amaysim Australia Ltd	JP Morgan	8.706	7.331	Brambles Ltd	JP Morgan	(683)
(32.812)	Amaysim Australia Ltd	Citibank	(60)	1.690	Bravura Solutions Ltd	JP Morgan	(123)
(1.586)	Amcor Ltd/Australia	HSBC	(715)	849	Bravura Solutions Ltd	Citibank	6
(7.543)	AMP Ltd	HSBC	(64)	4.282	Breville Group Ltd	Citibank	(220)
(265)	Ansell Ltd	HSBC	10	1.865	Breville Group Ltd	HSBC	1.073
606	APA Group	Citibank	277	2.554	Breville Group Ltd	JP Morgan	1.404
(3.593)	APA Group	HSBC	(885)	(2.862)	Brickworks Ltd	HSBC	439
(11.040)	APN Outdoor Group Ltd	JP Morgan	(4.306)	(2.051)	Brickworks Ltd	JP Morgan	392
(15.845)	APN Outdoor Group Ltd	HSBC	(6.374)	547	Brickworks Ltd	Citibank	(104)
(2.636)	APN Outdoor Group Ltd	Citibank	(1.125)	5.212	Brickworks Ltd	JP Morgan	(995)
410	Appen Ltd	Citibank	(132)	(369)	BWX Ltd	HSBC	(266)
(10.617)	Ardent Leisure Group (Unit)	JP Morgan	(567)	(16.555)	BWX Ltd	JP Morgan	(11.715)
(77.906)	Ardent Leisure Group (Unit)	HSBC	(4.515)	(10.312)	BWX Ltd	Citibank	(396)
8.822	Aristocrat Leisure Ltd	HSBC	21.910	422	carsales.com Ltd	Citibank	120
1.016	Aristocrat Leisure Ltd	Citibank	251	2.496	carsales.com Ltd	HSBC	1.141
2.258	Aristocrat Leisure Ltd	JP Morgan	5.464	(3.595)	Centuria Industrial (Reit)	JP Morgan	(208)
680	ASX Ltd	Citibank	(168)	(1.376)	Challenger Ltd/Australia	JP Morgan	(1.162)
445	ASX Ltd	JP Morgan	131	(12.821)	Challenger Ltd/Australia	HSBC	(11.185)
(7.663)	ASX Ltd	HSBC	(3.351)	3	Challenger Ltd/Australia	JP Morgan	3
(114.022)	Atlas Arteria Ltd	HSBC	(40.181)	(15.183)	Charter Hall Retail (Reit)	JP Morgan	(1.989)
(8.790)	Atlas Arteria Ltd	JP Morgan	(2.968)	(7.332)	Chorus Ltd	HSBC	358
622	Auckland International Airport Ltd	JP Morgan	16	1.295	Class Ltd	JP Morgan	189
(8.224)	Aurizon Holdings Ltd	HSBC	127	1.011	Cleanaway Waste Management Ltd	Citibank	34
5.350	Aurizon Holdings Ltd	JP Morgan	(137)	3.303	Cleanaway Waste Management Ltd	JP Morgan	(56)
(103.072)	AusNet Services	HSBC	5.268	(37.211)	Coca-Cola Amatil Ltd	HSBC	10.837
(4.216)	Austral Ltd	HSBC	(285)	471	Cochlear Ltd	Citibank	(233)
(11.959)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	HSBC	2.905	(969)	Collins Foods Ltd	Citibank	28
(50)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	JP Morgan	15	(3.602)	Collins Foods Ltd	JP Morgan	(104)
(6.398)	Australian Agricultural Co Ltd	HSBC	(465)	(3.030)	Commonwealth Bank of Australia	HSBC	7.347
(38.881)	Australian Agricultural Co Ltd	Citibank	(3.721)	(29.739)	Cooper Energy Ltd	JP Morgan	(312)
(10.394)	Australian Agricultural Co Ltd	JP Morgan	(727)	7.714	Costa Group Holdings Ltd	JP Morgan	2.669
(2.625)	Automotive Holdings Group Ltd	HSBC	1.180	4.351	Costa Group Holdings Ltd	Citibank	943
(11.183)	Aventus Retail Property Fund Ltd (Reit)	Citibank	(449)	5.223	Costa Group Holdings Ltd	HSBC	1.896
(2.688)	Aventus Retail Property Fund Ltd (Reit)	JP Morgan	(148)	(92.826)	Cromwell Property Group (Reit)	JP Morgan	591
23.736	Bank of Queensland Ltd	JP Morgan	132	(26.505)	Cromwell Property Group (Reit)	HSBC	100
9.686	Bank of Queensland Ltd	HSBC	286	(12.302)	Crown Resorts Ltd	HSBC	(1.359)
(8.801)	Bapcor Ltd	HSBC	(3.435)	4.614	Crown Resorts Ltd	HSBC	1.011
(27.782)	Beach Energy Ltd	HSBC	576	431	Crown Resorts Ltd	Citibank	(83)
2.558	Beach Energy Ltd	Citibank	(331)	231	CSL Ltd	Citibank	162
2.233	Beach Energy Ltd	HSBC	46	556	CSL Ltd	JP Morgan	6.410
26.170	Beach Energy Ltd	JP Morgan	439	2.070	CSR Ltd	HSBC	(883)
(149.932)	Beadell Resources Ltd	JP Morgan	(81)	(7.468)	CSR Ltd	HSBC	1.285
(70.648)	Beadell Resources Ltd	Citibank	(42)	(6.668)	CYBG Plc - CDI	JP Morgan	1.380
(3.193)	Bega Cheese Ltd	Citibank	81	(31.908)	CYBG Plc - CDI	HSBC	7.704
(1.082)	Bega Cheese Ltd	HSBC	(113)	(1.701)	Dacian Gold Ltd	Citibank	(91)
(6.495)	Bega Cheese Ltd	JP Morgan	(569)	(15.286)	Dacian Gold Ltd	JP Morgan	(579)
1.511	Bellamy's Australia Ltd	Citibank	1.209	2.317	Dexus (Reit)	JP Morgan	143
190	Bellamy's Australia Ltd	HSBC	(178)	(740)	Domino's Pizza Enterprises Ltd	HSBC	(4.179)
(2.837)	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	HSBC	(335)	(1.492)	Downer EDI Ltd	JP Morgan	324
				(12.652)	Downer EDI Ltd	HSBC	1.000
				4.009	DuluxGroup Ltd	Citibank	(1.139)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Australie suite				Australie suite			
6.699	DuluxGroup Ltd	JP Morgan	(643)	(8.459)	ImpediMed Ltd	JP Morgan	250
2.421	Eclixp Group Ltd	Citibank	16	(11.193)	Incitec Pivot Ltd	HSBC	2.196
3.199	Elders Ltd	JP Morgan	2.023	(21.125)	Independence Group NL	HSBC	1.947
(41.385)	EML Payments Ltd	JP Morgan	(2.428)	(2)	Independence Group NL*	JP Morgan	-
12.247	ERM Power Ltd	JP Morgan	(2.191)	(879)	Industria (Reit)	Citibank	(1)
1.825	ERM Power Ltd	Citibank	(361)	(2.238)	Industria (Reit)	JP Morgan	(45)
(3.460)	Estia Health Ltd	JP Morgan	423	42.341	Inghams Group Ltd	Citibank	2.485
(18.757)	Evolution Mining Ltd	HSBC	(629)	52.872	Inghams Group Ltd	JP Morgan	6.018
20.259	Fairfax Media Ltd	JP Morgan	(645)	1.952	Integrated Research Ltd	JP Morgan	(433)
(181.137)	FAR Ltd	Citibank	592	(31.492)	Investa Office Fund (Reit)	JP Morgan	(7.682)
(89.672)	FAR Ltd	HSBC	316	4.010	InvoCare Ltd	JP Morgan	2.694
(108.404)	FAR Ltd	JP Morgan	407	4.381	InvoCare Ltd	Citibank	2.056
(30.386)	Fletcher Building Ltd	HSBC	(12.177)	(25.416)	IPH Ltd	HSBC	(8.014)
(11.550)	FlexiGroup Ltd/Australia	HSBC	(1.472)	(375)	IPH Ltd	JP Morgan	(115)
(3.282)	FlexiGroup Ltd/Australia	Citibank	(132)	(23.009)	IPH Ltd	Citibank	(2.894)
(17.181)	FlexiGroup Ltd/Australia	JP Morgan	(2.106)	(8.499)	IRESS Ltd	HSBC	2.821
773	Flight Centre Travel Group Ltd	JP Morgan	1.700	333	Iron Mountain Inc - CDI	HSBC	(346)
89	Flight Centre Travel Group Ltd	HSBC	208	322	Iron Mountain Inc - CDI	Citibank	298
1.288	Flight Centre Travel Group Ltd	Citibank	(1.545)	151	Iron Mountain Inc - CDI	JP Morgan	(173)
(997)	Flight Centre Travel Group Ltd	HSBC	(819)	4.316	iSelect Ltd	JP Morgan	280
25.720	Folkestone Education Trust (Reit)	Citibank	(557)	(1.493)	iSentia Group Ltd	JP Morgan	(145)
10.948	Folkestone Education Trust (Reit)	JP Morgan	(1.494)	(1.002)	iSentia Group Ltd	HSBC	(99)
4.772	Folkestone Education Trust (Reit)	HSBC	(620)	(3.910)	iSentia Group Ltd	Citibank	(185)
(1.703)	Fortescue Metals Group Ltd	HSBC	109	2.587	James Hardie Industries Plc - CDI	Citibank	(1.240)
(8.157)	Freedom Foods Group Ltd	HSBC	(4.111)	5.836	James Hardie Industries Plc - CDI	JP Morgan	(4.841)
15.634	G8 Education Ltd	JP Morgan	310	10.087	James Hardie Industries Plc - CDI	HSBC	(8.379)
(9.487)	G8 Education Ltd	JP Morgan	(188)	(616)	Janus Henderson Group Plc - CDI	HSBC	(34)
(20.071)	G8 Education Ltd	HSBC	(514)	(70)	Janus Henderson Group Plc - CDI	JP Morgan	3
(7.708)	G8 Education Ltd	Citibank	398	(1.935)	Japara Healthcare Ltd	Citibank	(28)
(443)	Galaxy Resources Ltd	HSBC	(89)	(3.406)	Japara Healthcare Ltd	HSBC	75
10.095	Galaxy Resources Ltd	Citibank	2.062	(15.475)	Japara Healthcare Ltd	JP Morgan	409
(13.910)	Galaxy Resources Ltd	JP Morgan	(2.680)	(1)	LendLease Group	JP Morgan	(1)
(17.399)	Gateway Lifestyle (Unit)	JP Morgan	(1.097)	5.698	Link Administration Holdings Ltd	JP Morgan	(2.022)
(11.483)	Gateway Lifestyle (Unit)	Citibank	(822)	26.986	Link Administration Holdings Ltd	HSBC	(12.292)
(29.440)	Gateway Lifestyle (Unit)	HSBC	(1.975)	7.071	Link Administration Holdings Ltd	Citibank	(1.301)
(30.463)	Gold Road Resources Ltd	Citibank	(175)	(4.762)	Link Administration Holdings Ltd	HSBC	4.788
(1.971)	Gold Road Resources Ltd	HSBC	(15)	5.958	Lovisa Holdings Ltd	Citibank	(712)
(104.319)	Gold Road Resources Ltd	JP Morgan	(626)	1.776	Lovisa Holdings Ltd	JP Morgan	1.535
(2.452)	Goodman Group (Reit)	JP Morgan	(5)	(3.422)	Lynas Corp Ltd	JP Morgan	1.140
2	GPT Group/The (Reit)*	JP Morgan	-	(122)	Macquarie Group Ltd	HSBC	(356)
(11.582)	GrainCorp Ltd 'A'	HSBC	(2.358)	1.359	Magellan Financial Group Ltd	HSBC	(449)
1	GrainCorp Ltd 'A'	JP Morgan	-	6.610	Magellan Financial Group Ltd	JP Morgan	(2.419)
25.313	Growthpoint Properties Australia Ltd (Reit)	HSBC	2.816	(53.243)	Mayne Pharma Group Ltd	HSBC	(1.022)
40.130	GWA Group Ltd	Citibank	(351)	732	McMillan Shakespeare Ltd	JP Morgan	(285)
8.275	GWA Group Ltd	JP Morgan	(199)	1.274	McMillan Shakespeare Ltd	HSBC	(444)
19.253	GWA Group Ltd	HSBC	(299)	25.286	Medibank Pvt Ltd	HSBC	(560)
(1.540)	Hansen Technologies Ltd	HSBC	(71)	32.023	Medibank Pvt Ltd	JP Morgan	(934)
2	Harvey Norman Holdings Ltd*	JP Morgan	-	(16.889)	Melbourne IT Ltd	Citibank	(40)
(131.613)	Healthscope Ltd	HSBC	9.601	(582)	Melbourne IT Ltd	HSBC	80
3.840	Hotel Property Investments (Reit)	Citibank	320	(6.314)	Melbourne IT Ltd	JP Morgan	790
2.784	Hotel Property Investments (Reit)	JP Morgan	385	1.288	Mesoblast Ltd	JP Morgan	74
397	Hotel Property Investments (Reit)	HSBC	58	(4.252)	Metals X Ltd	HSBC	(134)
(12.770)	HT&E Ltd	HSBC	(1.170)	(1.984)	Metals X Ltd	Citibank	110
(1.559)	HUB24 Ltd	Citibank	1.249	5.191	Metcash Ltd	HSBC	(1.978)
(6.797)	HUB24 Ltd	JP Morgan	(8.285)	19.075	Metcash Ltd	JP Morgan	(9.482)
7.887	IDP Education Ltd	Citibank	4.428	36.260	Metcash Ltd	Citibank	(14.587)
3.972	IDP Education Ltd	JP Morgan	4.712	311	Mineral Resources Ltd	JP Morgan	(229)
10.455	Iluka Resources Ltd	JP Morgan	(809)	41.788	Mirvac Group (Reit)	Citibank	1.988
5.897	Iluka Resources Ltd	Citibank	(2.716)	31.569	Mirvac Group (Reit)	JP Morgan	1.051
9.347	Iluka Resources Ltd	HSBC	(110)	45.574	Mirvac Group (Reit)	HSBC	1.760
(33.761)	IMF Bentham Ltd	JP Morgan	(5.019)	1.254	Monadelphous Group Ltd	Citibank	(978)
(45.179)	IMF Bentham Ltd	HSBC	(6.981)	2.396	Monadelphous Group Ltd	HSBC	(1.170)
(4.941)	ImpediMed Ltd	Citibank	(12)				
(22.321)	ImpediMed Ltd	HSBC	629				

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Australie suite				Australie suite			
2.870	Monadelphous Group Ltd	JP Morgan	(3.326)	1.253	Ramsay Health Care Ltd	JP Morgan	(2.704)
(5.307)	Monash IVF Group Ltd	HSBC	(25)	(596)	REA Group Ltd	JP Morgan	1.921
(16.604)	Monash IVF Group Ltd	JP Morgan	(31)	41	REA Group Ltd	HSBC	118
710	Mortgage Choice Ltd	JP Morgan	(14)	(915)	Regis Healthcare Ltd	Citibank	57
(12.340)	Nanosonics Ltd	HSBC	(891)	3.456	Regis Resources Ltd	JP Morgan	(25)
(1.421)	Nanosonics Ltd	JP Morgan	(94)	18.871	Regis Resources Ltd	Citibank	1.358
432	National Australia Bank Ltd	JP Morgan	(170)	22.890	Regis Resources Ltd	HSBC	91
1.300	National Australia Bank Ltd	HSBC	(52)	5.564	Reliance Worldwide Corp Ltd	Citibank	965
427	National Australia Bank Ltd	Citibank	(122)	(16.231)	Reliance Worldwide Corp Ltd	HSBC	(19.672)
1.207	Navigator Global			(25.695)	Reliance Worldwide Corp Ltd	HSBC	(22.640)
	Investments Ltd	Citibank	537	2.405	ResMed Inc - CDI	JP Morgan	998
941	Navigator Global			(64.654)	Resolute Mining Ltd	HSBC	(2.054)
	Investments Ltd	JP Morgan	521	(15.472)	Retail Food Group Ltd	Citibank	(322)
(1.470)	Navitas Ltd	Citibank	49	(10.361)	Retail Food Group Ltd	HSBC	300
(5.836)	Navitas Ltd	HSBC	40	(5.177)	Retail Food Group Ltd	JP Morgan	160
(2.533)	Navitas Ltd	JP Morgan	44	229	Rio Tinto Ltd	Citibank	(330)
(138)	New South Resources Ltd	HSBC	(1)	1.390	Rio Tinto Ltd	JP Morgan	2.865
(17.838)	New South Resources Ltd	Citibank	(609)	403	Rio Tinto Ltd	HSBC	907
(7.089)	Newcrest Mining Ltd	HSBC	2.776	1.688	Sandfire Resources NL	HSBC	794
4.994	Newcrest Mining Ltd	Citibank	1.793	2.558	Sandfire Resources NL	Citibank	315
(25.379)	NEXTDC Ltd	HSBC	(4.318)	15.794	Sandfire Resources NL	JP Morgan	7.129
5.514	nib holdings Ltd/Australia	HSBC	(225)	4.949	Santos Ltd	JP Morgan	(1.189)
8.800	nib holdings Ltd/Australia	JP Morgan	(276)	7.022	Santos Ltd	Citibank	(1.050)
5.765	nib holdings Ltd/Australia	Citibank	843	(14.711)	Saracen Mineral Holdings Ltd	HSBC	(1.489)
13.525	Nine Entertainment Co			(12.234)	Scentre Group (Reit)	JP Morgan	(957)
	Holdings Ltd	HSBC	336	2.207	Scottish Pacific Group Ltd	Citibank	(18)
48.036	Nine Entertainment Co			6.431	Scottish Pacific Group Ltd	JP Morgan	(313)
	Holdings Ltd	JP Morgan	920	(2.326)	SeaLink Travel Group Ltd	Citibank	(842)
(57.857)	Nufarm Ltd/Australia	HSBC	(31.225)	(1.448)	SeaLink Travel Group Ltd	JP Morgan	(440)
(444)	Nufarm Ltd/Australia	JP Morgan	(40)	(8.106)	Select Harvests Ltd	Citibank	(355)
1.895	Oil Search Ltd	Citibank	(470)	(341)	Select Harvests Ltd	HSBC	(195)
1.646	Oil Search Ltd	HSBC	485	(6.104)	Select Harvests Ltd	JP Morgan	(3.403)
3.562	Oil Search Ltd	JP Morgan	982	(93.741)	Senex Energy Ltd	Citibank	4.011
(220)	Orica Ltd	JP Morgan	197	5.055	Service Stream Ltd	HSBC	(68)
(3.899)	Orica Ltd	HSBC	3.311	35.597	Service Stream Ltd	JP Morgan	(614)
(2.727)	Origin Energy Ltd	HSBC	240	11.797	Service Stream Ltd	Citibank	268
(900)	Orocobre Ltd	Citibank	327	1.142	Seven Group Holdings Ltd	Citibank	(255)
(145)	Orocobre Ltd	HSBC	(5)	100	Seven Group Holdings Ltd	JP Morgan	73
(2.528)	Orocobre Ltd	JP Morgan	(57)	30.540	Seven West Media Ltd	JP Morgan	2.030
1	Orocobre Ltd*	JP Morgan	—	2.465	SG Fleet Group Ltd	JP Morgan	(151)
9.478	Orora Ltd	HSBC	1.256	569	Shopping Centres Australasia		
9.965	Orora Ltd	JP Morgan	1.244		Property Group (Reit)	JP Morgan	28
1.241	OZ Minerals Ltd	Citibank	(530)	5.216	Shopping Centres Australasia		
1.253	OZ Minerals Ltd	JP Morgan	(52)		Property Group (Reit)	Citibank	405
444	OZ Minerals Ltd	HSBC	(8)	(65.136)	Sigma Healthcare Ltd	HSBC	(770)
(2.919)	OZ Minerals Ltd	HSBC	1.052	(1.883)	Sims Metal Management Ltd	HSBC	(184)
4.166	Pendal Group Ltd	HSBC	636	3.804	Sims Metal Management Ltd	Citibank	(1.536)
6.289	Pendal Group Ltd	JP Morgan	2.146	7.237	Sims Metal Management Ltd	HSBC	431
14.449	Pendal Group Ltd	Citibank	(5.945)	76	Sims Metal Management Ltd	JP Morgan	2
835	Perpetual Ltd	Citibank	(853)	2.053	Sirtex Medical Ltd	Citibank	(819)
4.287	Perpetual Ltd	JP Morgan	(5.150)	190	Sirtex Medical Ltd	HSBC	123
(12.297)	Perseus Mining Ltd	JP Morgan	279	862	Sirtex Medical Ltd	JP Morgan	499
(26.113)	Pilbara Minerals Ltd	Citibank	(239)	(1.966)	Sirtex Medical Ltd	HSBC	(1.271)
(1.428)	Pilbara Minerals Ltd	HSBC	(19)	(8.803)	SKY Network Television Ltd	Citibank	180
3.099	Platinum Asset			(21.421)	SKY Network Television Ltd	HSBC	(2.068)
	Management Ltd	Citibank	(164)	(6.300)	SKY Network Television Ltd	JP Morgan	(578)
10.961	Platinum Asset			4.613	SmartGroup Corp Ltd	Citibank	328
	Management Ltd	JP Morgan	255	941	SmartGroup Corp Ltd	HSBC	159
322	Premier Investments Ltd	JP Morgan	62	3.959	SmartGroup Corp Ltd	JP Morgan	563
16.446	Primary Health Care Ltd	JP Morgan	121	(27)	Sonic Healthcare Ltd	HSBC	(482)
8.307	Primary Health Care Ltd	Citibank	(455)	(33.083)	Southern Cross Media		
(13.194)	Propertylink Group (Reit)	Citibank	(66)		Group Ltd	HSBC	(2.419)
(14.600)	Propertylink Group (Reit)	JP Morgan	(361)	(1.532)	Southern Cross Media		
23.798	Qantas Airways Ltd	JP Morgan	2.628		Group Ltd	JP Morgan	(108)
(3.606)	Qantas Airways Ltd	JP Morgan	(145)	60.056	Spark Infrastructure Group	Citibank	(1.045)
6	QBE Insurance Group Ltd	JP Morgan	(3)	6.473	St Barbara Ltd	JP Morgan	974
(18.599)	QBE Insurance Group Ltd	HSBC	7.635	(15.193)	St Barbara Ltd	HSBC	(2.570)
(954)	QBE Insurance Group Ltd	JP Morgan	414	2.435	St Barbara Ltd	Citibank	545
(134.265)	Qube Holdings Ltd	Citibank	(2.412)	(1.778)	Star Entertainment		
(75.819)	Qube Holdings Ltd	HSBC	(1.260)		Group Ltd/The	HSBC	321
(33.659)	Qube Holdings Ltd	JP Morgan	(374)				

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Australie suite				Hong Kong			
11.891	Star Entertainment Group Ltd/The	Citibank	(2.946)	(10.500)	3SBio Inc '144A'	Citibank	(3.081)
5.895	Star Entertainment Group Ltd/The	HSBC	(701)	(6.000)	3SBio Inc '144A'	JP Morgan	(2.822)
14.473	Stockland (Reit)	JP Morgan	(65)	(12.000)	AAC Technologies Holdings Inc	Citibank	(4.913)
(3.524)	Suncorp Group Ltd	JP Morgan	1.526	(24.000)	Agile Group Holdings Ltd	Citibank	2.378
(10.629)	Suncorp Group Ltd	HSBC	4.249	2.000	Agile Group Holdings Ltd	Citibank	(198)
982	Super Retail Group Ltd	HSBC	717	6.000	Agile Group Holdings Ltd	HSBC	(366)
7.316	Super Retail Group Ltd	JP Morgan	5.210	16.000	Agile Group Holdings Ltd	JP Morgan	(976)
(21.262)	Superloop Ltd	Citibank	(2.948)	(84.000)	Air China Ltd 'H'	Citibank	307
(14.769)	Superloop Ltd	JP Morgan	(4.815)	(38.000)	Air China Ltd 'H'	JP Morgan	6.434
4.162	Sydney Airport (Unit)	Citibank	107	(42.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	Citibank	(1.514)
(9.569)	Syrah Resources Ltd	Citibank	2.110	(26.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	JP Morgan	(1.629)
(1.727)	Syrah Resources Ltd	JP Morgan	(43)	(34.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	HSBC	(12.478)
(12.652)	Tabcorp Holdings Ltd	HSBC	1.579	(140.000)	Alibaba Pictures Group Ltd	HSBC	(1.607)
(18.664)	Tassal Group Ltd	HSBC	(3.858)	(200.000)	Alibaba Pictures Group Ltd	JP Morgan	(2.296)
(670)	Tassal Group Ltd	JP Morgan	(132)	(240.000)	Alibaba Pictures Group Ltd	Citibank	(3.062)
28.807	Telstra Corp Ltd	JP Morgan	(8.427)	(10.000)	Aluminum Corp of China Ltd 'H'	Citibank	63
1.957	Telstra Corp Ltd	Citibank	76	(6.000)	Aluminum Corp of China Ltd 'H'	HSBC	191
(1.094)	TPG Telecom Ltd	Citibank	(243)	(48.000)	Aluminum Corp of China Ltd 'H'	JP Morgan	1.526
(16.729)	TPG Telecom Ltd	HSBC	687	26.000	Angang Steel Co Ltd 'H'	JP Morgan	(1.687)
(2.059)	TPG Telecom Ltd	JP Morgan	(13)	(28.000)	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	Citibank	(1.809)
(14.318)	Trade Me Group Ltd	HSBC	(228)	(500)	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	JP Morgan	19
(3.664)	Trade Me Group Ltd	JP Morgan	(20)	2.000	Anhui Expressway Co Ltd 'H'	HSBC	(89)
1	Transurban Group (Unit)*	JP Morgan	—	24.000	Anhui Expressway Co Ltd 'H'	JP Morgan	(1.069)
(2.619)	Treasury Wine Estates Ltd	HSBC	4.641	1.000	ANTA Sports Products Ltd	Citibank	(50)
1.784	Treasury Wine Estates Ltd	HSBC	(3.161)	5.000	ANTA Sports Products Ltd	HSBC	(1.653)
11.454	Treasury Wine Estates Ltd	JP Morgan	(9.688)	12.000	ANTA Sports Products Ltd	JP Morgan	(1.932)
(260)	Treasury Wine Estates Ltd	JP Morgan	472	2.100	ASM Pacific Technology Ltd	Citibank	(745)
5.493	Treasury Wine Estates Ltd	Citibank	2.031	4.200	ASM Pacific Technology Ltd	JP Morgan	(984)
(3.317)	Updater Inc - CDI	JP Morgan	(217)	(16.000)	AVIC International Holdings Ltd	JP Morgan	260
(8.469)	Vicinity Centres (Reit)	JP Morgan	205	(35.000)	AviChina Industry & Technology Co Ltd 'H'	Citibank	(449)
7.256	Village Roadshow Ltd	JP Morgan	358	20.000	BAIC Motor Corp Ltd 'H' '144A'	Citibank	(583)
3.013	Virtus Health Ltd	HSBC	(324)	(139.000)	Bank of Communications Co Ltd 'H'	Citibank	1.223
10.327	Virtus Health Ltd	Citibank	(1.631)	10.400	Bank of East Asia Ltd/The	HSBC	(1.585)
20.020	Virtus Health Ltd	JP Morgan	(2.421)	(5.800)	Bank of East Asia Ltd/The	HSBC	884
(4.944)	Vocus Group Ltd	JP Morgan	795	200	Bank of East Asia Ltd/The*	Citibank	—
(205)	Vocus Group Ltd	Citibank	(3)	5.800	Bank of East Asia Ltd/The	JP Morgan	(884)
(47.122)	Vocus Group Ltd	HSBC	7.281	6.000	BBMG Corp 'H'	Citibank	(91)
1.321	Washington H Soul Pattinson & Co Ltd	Citibank	(535)	4.000	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	HSBC	266
(125)	Webjet Ltd	Citibank	(44)	50.000	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	JP Morgan	3.319
(11.663)	Webjet Ltd	HSBC	(7.773)	2.000	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	Citibank	87
(290)	Webjet Ltd	JP Morgan	(185)	(92.000)	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	Citibank	(4.379)
(3.126)	Webster Ltd	Citibank	(70)	7.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	Citibank	362
(7.335)	Webster Ltd	JP Morgan	(816)	5.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	HSBC	2.678
(672)	Wesfarmers Ltd	HSBC	(1.078)	(106.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Citibank	3.637
4.649	Western Areas Ltd	JP Morgan	20	(68.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	JP Morgan	(2.170)
(4.328)	Westfield Corp (Reit)	JP Morgan	539	(238.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	HSBC	6.330
(4.677)	Westfield Corp (Reit)	HSBC	483	(40.000)	Beijing Gas Blue Sky Holdings Ltd	Citibank	(102)
(2.530)	Westgold Resources Ltd	Citibank	(336)	(1.240.000)	Beijing Gas Blue Sky Holdings Ltd	JP Morgan	(3.167)
(8.376)	Westgold Resources Ltd	JP Morgan	(979)	(64.000)	Beijing Gas Blue Sky Holdings Ltd	HSBC	(164)
4.851	Westpac Banking Corp	JP Morgan	(5.689)	4.000	Beijing Jingcheng Machinery Electric Co Ltd 'H'	JP Morgan	(36)
1.930	Whitehaven Coal Ltd	Citibank	4				
3.307	Whitehaven Coal Ltd	JP Morgan	1.675				
(753)	WiseTech Global Ltd	Citibank	(156)				
(32)	WiseTech Global Ltd	HSBC	(68)				
(2.246)	WiseTech Global Ltd	JP Morgan	(4.724)				
738	WorleyParsons Ltd	Citibank	(467)				
667	WorleyParsons Ltd	HSBC	298				
1.166	WorleyParsons Ltd	JP Morgan	477				
(2.153)	WorleyParsons Ltd	HSBC	385				
(1.356)	Xero Ltd	Citibank	(1.647)				
(171)	Xero Ltd	HSBC	(208)				
			(187.683)				
Allemagne							
309	Genpact Ltd	Citibank	(349)				
			(349)				

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(32.000)	Beijing North Star Co Ltd 'H'	Citibank	(42)	2.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(53)
8.000	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	JP Morgan	2.203	34.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H'	HSBC	(907)
7.000	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	HSBC	1.928	(37.000)	China Education Group Holdings Ltd	HSBC	(11.618)
30.000	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	Citibank	1.156	(5.000)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	Citibank	19
3.400	BOC Aviation Ltd '144A'	Citibank	(213)	(16.000)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	HSBC	(1)
500	BOC Aviation Ltd '144A'	HSBC	128	(1.000)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	JP Morgan	-
10.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	JP Morgan	(1.648)	(33.000)	China Everbright International Ltd	Citibank	(932)
(1.000)	BOC Hong Kong Holdings Ltd	HSBC	152	(10.000)	China Everbright International Ltd	HSBC	(741)
(14.000)	Bright Smart Securities & Commodities Group Ltd	Citibank	142	(30.000)	China Everbright International Ltd	JP Morgan	(2.221)
(64.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Citibank	2.591	8.000	China Everbright Ltd	Citibank	186
(6.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	JP Morgan	121	6.000	China Everbright Ltd	HSBC	322
(26.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	HSBC	525	2.000	China Everbright Ltd	JP Morgan	107
(17.500)	BYD Electronic International Co Ltd	Citibank	754	(2.000)	China Everbright Ltd	HSBC	(107)
(3.000)	BYD Electronic International Co Ltd	HSBC	(268)	(14.000)	China Everbright Ltd	JP Morgan	(752)
(3.000)	BYD Electronic International Co Ltd	JP Morgan	(268)	4.000	China First Capital Group Ltd	Citibank	189
10.000	Cafe de Coral Holdings Ltd	Citibank	997	4.000	China Foods Ltd	JP Morgan	128
(8.000)	Camsing International Holding Ltd	Citibank	(877)	40.000	China Foods Ltd	Citibank	512
(36.000)	Canvest Environmental Protection Group Co Ltd	HSBC	(552)	(97.000)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Citibank	485
(5.000)	Canvest Environmental Protection Group Co Ltd	JP Morgan	(77)	(53.500)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	HSBC	1.223
(39.000)	Canvest Environmental Protection Group Co Ltd	Citibank	196	(63.000)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	1.441
2.000	CAR Inc	JP Morgan	137	2.200	China Gas Holdings Ltd	JP Morgan	1.150
13.000	Cathay Pacific Airways Ltd	JP Morgan	466	800	China Gas Holdings Ltd	Citibank	107
(49.000)	Central China Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	2.308	5.800	China Gas Holdings Ltd	HSBC	594
(23.000)	Central China Securities Co Ltd 'H'	Citibank	468	(120.000)	China Goldjoy Group Ltd	Citibank	(230)
2.000	Champion (Reit)	Citibank	(5)	(100.000)	China Goldjoy Group Ltd	JP Morgan	127
14.000	Champion (Reit)	JP Morgan	161	(3.000)	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd	Citibank	160
5.000	Champion (Reit)	HSBC	58	(9.500)	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd	HSBC	326
3.000	China Agri-Industries Holdings Ltd	Citibank	(50)	(51.500)	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd	JP Morgan	1.769
14.000	China Agri-Industries Holdings Ltd	HSBC	90	(3.500)	China Hongqiao Group Ltd	Citibank	93
13.000	China Agri-Industries Holdings Ltd	JP Morgan	6	(193.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	3.436
34.000	China Aoyuan Property Group Ltd	JP Morgan	263	155.000	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	Citibank	(1.572)
30.000	China BlueChemical Ltd 'H'	JP Morgan	1.683	(86.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	Citibank	872
90.000	China BlueChemical Ltd 'H'	Citibank	1.495	(192.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	HSBC	3.418
2.000	China BlueChemical Ltd 'H'	HSBC	112	75.000	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	HSBC	(1.335)
120.000	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	HSBC	616	(196.000)	China Innovationpay Group Ltd	HSBC	(4.747)
16.000	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	JP Morgan	82	1.200	China International Capital Corp Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	(67)
31.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	Citibank	(1.340)	11.600	China International Capital Corp Ltd 'H' '144A'	Citibank	(262)
40.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(1.883)	1.300	China International Marine Containers Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	(149)
7.000	China Coal Energy Co Ltd 'H'	Citibank	54	(34.000)	China Jinmao Holdings Group Ltd	Citibank	702
140.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'	Citibank	(878)	(18.000)	China Jinmao Holdings Group Ltd	JP Morgan	274
16.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'	HSBC	(60)				
118.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(444)				
(7.500)	China Conch Venture Holdings Ltd	Citibank	(2.583)				
(33.000)	China Conch Venture Holdings Ltd	HSBC	(7.981)				

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
6.000	China Lesso Group Holdings Ltd	Citibank	(320)	16.000	China Resources Cement Holdings Ltd	HSBC	2.366
1.000	China Lesso Group Holdings Ltd	HSBC	(57)	4.000	China Resources Cement Holdings Ltd	JP Morgan	592
99.000	China Lesso Group Holdings Ltd	JP Morgan	(5.728)	46.000	China Resources Cement Holdings Ltd	Citibank	535
(9.000)	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Citibank	111	(4.000)	China Resources Gas Group Ltd	Citibank	278
11.000	China Lilang Ltd	Citibank	1.151	8.000	China Resources Land Ltd	Citibank	(301)
13.000	China Lilang Ltd	HSBC	2.718	17.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd '144A'	Citibank	1.996
24.000	China Lilang Ltd	JP Morgan	5.018	1.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd '144A'	HSBC	161
400	China Literature Ltd '144A'	JP Morgan	225	9.500	China Resources Pharmaceutical Group Ltd '144A'	JP Morgan	1.526
4.600	China Literature Ltd '144A'	HSBC	4.195	(26.000)	China Resources Power Holdings Co Ltd	Citibank	(670)
4.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	Citibank	16	40.000	China SCE Property Holdings Ltd	Citibank	(506)
24.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	JP Morgan	631	12.500	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	JP Morgan	353
(4.000)	China Maple Leaf Educational Systems Ltd	Citibank	(715)	1.000	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	Citibank	(25)
(2.000)	China Maple Leaf Educational Systems Ltd	JP Morgan	(800)	2.000	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	HSBC	(81)
16.000	China Maple Leaf Educational Systems Ltd	JP Morgan	6.403	11.000	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	JP Morgan	(446)
(21.000)	China Medical System Holdings Ltd	Citibank	(3.432)	(188.000)	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd	JP Morgan	(965)
(11.000)	China Medical System Holdings Ltd	HSBC	670	(10.000)	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd	Citibank	165
(31.000)	China Mengniu Dairy Co Ltd	HSBC	(5.936)	(17.000)	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd	HSBC	(87)
(96.000)	China Metal Resources Utilization Ltd '144A'	HSBC	850	2.000	China South City Holdings Ltd	HSBC	(8)
7.500	China Mobile Ltd	HSBC	(3.624)	22.000	China South City Holdings Ltd	Citibank	(139)
17.500	China Mobile Ltd	JP Morgan	(8.457)	(18.000)	China Southern Airlines Co Ltd 'H'	Citibank	112
(11.000)	China New Higher Education Group Ltd '144A'	Citibank	(842)	(10.000)	China Southern Airlines Co Ltd 'H'	HSBC	751
(26.000)	China Oilfield Services Ltd 'H'	HSBC	(2.818)	(16.000)	China Southern Airlines Co Ltd 'H'	JP Morgan	1.201
(4.000)	China Oilfield Services Ltd 'H'	JP Morgan	(434)	20.000	China State Construction International Holdings Ltd	HSBC	(224)
(4.000)	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	HSBC	76	(14.000)	China State Construction International Holdings Ltd	Citibank	87
(95.000)	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	JP Morgan	1.811	(12.000)	China State Construction International Holdings Ltd	HSBC	(170)
(101.000)	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	Citibank	1.924	(6.000)	China State Construction International Holdings Ltd	JP Morgan	(85)
(40.000)	China Overseas Property Holdings Ltd	Citibank	(2.703)	8.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	Citibank	(50)
34.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	HSBC	(1.098)	120.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	HSBC	(2.134)
78.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	JP Morgan	(3.049)	6.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(107)
32.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Citibank	(118)	34.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	HSBC	1.259
122.000	China Power International Development Ltd	Citibank	(928)	6.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	JP Morgan	222
103.000	China Power International Development Ltd	HSBC	3	62.000	China Travel International Investment Hong Kong Ltd	JP Morgan	3.476
168.000	China Power International Development Ltd	JP Morgan	4	(70.000)	China Unicom Hong Kong Ltd	HSBC	1.417
67.000	China Railway Construction Corp Ltd 'H'	Citibank	(501)	(20.000)	China Unicom Hong Kong Ltd	JP Morgan	405
37.000	China Railway Construction Corp Ltd 'H'	HSBC	(774)	(130.000)	China Unicom Hong Kong Ltd	Citibank	4.611
95.500	China Railway Construction Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(2.593)	19.500	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	HSBC	2.586
3.000	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'H' '144A'	Citibank	(118)	(80.000)	China Yuhua Education Corp Ltd '144A'	Citibank	(3.474)
10.000	China Reinsurance Group Corp 'H'	JP Morgan	64	(44.000)	China Yuhua Education Corp Ltd '144A'	HSBC	(4.656)
8.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	HSBC	2.224				
6.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	JP Morgan	1.703				

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(20.000)	China Yuhua Education Corp Ltd '144A'	JP Morgan	(2.116)	4.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H'	JP Morgan	119
4.000	China Zhongwang Holdings Ltd	JP Morgan	(30)	6.000	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H'	JP Morgan	321
(36.000)	Chinasoft International Ltd	Citibank	1.188	(10.000)	COSCO SHIPPING Ports Ltd	Citibank	(320)
4.000	Chinasoft International Ltd	Citibank	(132)	(16.000)	COSCO SHIPPING Ports Ltd	HSBC	(1.225)
30.000	Chinasoft International Ltd	HSBC	2.028	(37.000)	CRRC Corp Ltd 'H'	Citibank	89
36.000	Chinasoft International Ltd	JP Morgan	2.434	(6.500)	CSC Financial Co Ltd 'H' '144A'	HSBC	157
20.000	Chong Sing Holdings FinTech Gr	JP Morgan	51	(148.000)	CSC Financial Co Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	3.571
(102.000)	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'H'	Citibank	2.589	(16.000)	CSC Financial Co Ltd 'H' '144A'	Citibank	(308)
17.400	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	HSBC	478	12.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Citibank	1.916
8.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	JP Morgan	(50)	8.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	JP Morgan	(1.045)
10.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	Citibank	(152)	12.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	HSBC	(2.363)
2.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	HSBC	(13)	16.000	CT Environmental Group Ltd	JP Morgan	(41)
(20.000)	CIMC Enric Holdings Ltd	Citibank	226	324.000	Dah Chong Hong Holdings Ltd	Citibank	(9.880)
(4.000)	CIMC Enric Holdings Ltd	HSBC	(643)	1.000	Dah Chong Hong Holdings Ltd	HSBC	15
9.000	CITIC Ltd	JP Morgan	(182)	74.000	Dah Chong Hong Holdings Ltd	JP Morgan	1.135
(14.500)	CITIC Securities Co Ltd 'H'	HSBC	(473)	5.200	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Citibank	(1.419)
4.000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	HSBC	(41)	2.000	Dah Sing Financial Holdings Ltd	HSBC	(330)
128.000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	JP Morgan	(1.301)	19.200	Dah Sing Financial Holdings Ltd	JP Morgan	(3.168)
344.000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	Citibank	(862)	(3.600)	Dah Sing Financial Holdings Ltd	HSBC	594
6.000	Citychamp Watch & Jewellery Group Ltd	Citibank	23	31.000	Dali Foods Group Co Ltd '144A'	HSBC	653
3.000	CK Asset Holdings Ltd	Citibank	(589)	3.000	Dali Foods Group Co Ltd '144A'	JP Morgan	(21)
9.000	CK Hutchison Holdings Ltd	JP Morgan	(3.487)	10.000	Datang International Power Generation Co Ltd 'H'	HSBC	(89)
500	CK Hutchison Holdings Ltd	HSBC	(194)	(224.000)	Digital China Holdings Ltd	JP Morgan	(7.148)
2.500	CK Infrastructure Holdings Ltd	Citibank	(13)	(67.000)	Digital China Holdings Ltd	HSBC	(2.139)
12.500	CK Infrastructure Holdings Ltd	HSBC	(5.165)	(112.000)	Digital China Holdings Ltd	Citibank	(2.722)
7.000	CK Infrastructure Holdings Ltd	JP Morgan	(2.893)	32.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Citibank	(688)
(21.500)	CLP Holdings Ltd	HSBC	(1.725)	4.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	HSBC	215
1.000	CLP Holdings Ltd	Citibank	97	22.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	1.180
7.500	CLP Holdings Ltd	HSBC	725	(2.000)	Dongyue Group Ltd	HSBC	(120)
9.000	CLP Holdings Ltd	JP Morgan	869	(1.000)	Dongyue Group Ltd	JP Morgan	(60)
(640.000)	CMBC Capital Holdings Ltd	Citibank	(6)	(10.000)	Dongyue Group Ltd	Citibank	827
(270.000)	CMBC Capital Holdings Ltd	JP Morgan	1.890	(31.000)	Dynagreen Environmental Protection Group Co Ltd 'H'	Citibank	432
1.000	CNOOC Ltd	Citibank	(56)	(3.000)	ENN Energy Holdings Ltd	HSBC	(290)
1.000	CNOOC Ltd	HSBC	(2)	(13.000)	ENN Energy Holdings Ltd	Citibank	(1.262)
31.000	CNOOC Ltd	JP Morgan	(74)	(42.200)	Esprit Holdings Ltd	JP Morgan	483
5.000	Colour Life Services Group Co Ltd	Citibank	650	5.000	Esprit Holdings Ltd	JP Morgan	(57)
17.000	Colour Life Services Group Co Ltd	HSBC	3.185	9.500	Fairwood Holdings Ltd	Citibank	732
14.000	Colour Life Services Group Co Ltd	JP Morgan	2.623	3.000	Fairwood Holdings Ltd	HSBC	441
(44.000)	Comba Telecom Systems Holdings Ltd	Citibank	394	18.000	Fairwood Holdings Ltd	JP Morgan	2.644
(60.000)	Concord New Energy Group Ltd*	HSBC	—	12.000	Far East Horizon Ltd	Citibank	353
(640.000)	Concord New Energy Group Ltd	JP Morgan	369	1.000	Far East Horizon Ltd	HSBC	65
(250.000)	Concord New Energy Group Ltd	Citibank	157	5.000	Far East Horizon Ltd	JP Morgan	325
3.000	Consun Pharmaceutical Group Ltd	HSBC	(80)	(37.000)	FIH Mobile Ltd	JP Morgan	(1.085)
11.000	Consun Pharmaceutical Group Ltd	Citibank	(194)	(141.000)	FIH Mobile Ltd	Citibank	(543)
5.000	Consun Pharmaceutical Group Ltd	JP Morgan	(133)	(68.000)	First Pacific Co Ltd	Citibank	428
(60.000)	Convoy Global Holdings Ltd**	Citibank	130	(14.000)	First Tractor Co Ltd 'H'	Citibank	267
(324.000)	Convoy Global Holdings Ltd**	HSBC	701	(4.000)	Fortune Real Estate Investment Trust (Reit)	JP Morgan	(143)
(192.000)	Convoy Global Holdings Ltd**	JP Morgan	416	35.000	Fosun International Ltd	Citibank	(167)
(48.000)	Coolpad Group Ltd**	Citibank	4.036	1.500	Fosun International Ltd	HSBC	138
(224.000)	Coolpad Group Ltd**	HSBC	18.834	19.500	Fosun International Ltd	JP Morgan	1.793
(44.000)	Coolpad Group Ltd**	JP Morgan	2.355	56.000	Fu Shou Yuan International Group Ltd	Citibank	794
14.000	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H'	JP Morgan	(136)	12.000	Fu Shou Yuan International Group Ltd	HSBC	1.163
				126.000	Fu Shou Yuan International Group Ltd	JP Morgan	12.213

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

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(31.000)	Fufeng Group Ltd	Citibank	(200)	185.000	Haitong International Securities Group Ltd	HSBC	(1.403)
(13.000)	Fufeng Group Ltd	HSBC	132	18.400	Haitong Securities Co Ltd 'H'	Citibank	(360)
(7.000)	Fufeng Group Ltd	JP Morgan	71	(3.000)	Hang Lung Group Ltd	HSBC	(1)
(30.000)	Fullshare Holdings Ltd	JP Morgan	37	(10.000)	Hang Lung Properties Ltd	Citibank	328
(17.500)	Fullshare Holdings Ltd	HSBC	21	1.000	Hang Lung Properties Ltd	HSBC	(66)
(37.500)	Fullshare Holdings Ltd	Citibank	(98)	3.000	Hang Lung Properties Ltd	Citibank	(98)
6.000	Future Land Development Holdings Ltd	Citibank	(160)	4.000	Hang Lung Properties Ltd	JP Morgan	(264)
28.000	Future Land Development Holdings Ltd	JP Morgan	(569)	(15.300)	Hang Seng Bank Ltd	HSBC	2.298
(61.600)	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'H' '144A'	HSBC	(2.449)	(2.500)	Hang Seng Bank Ltd	Citibank	150
1.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	HSBC	77	1.300	Hang Seng Bank Ltd	JP Morgan	(196)
11.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	JP Morgan	850	800	Hang Seng Bank Ltd	Citibank	(48)
4.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Citibank	311	400	Hang Seng Bank Ltd	HSBC	(60)
(798.000)	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	Citibank	9.137	(19.000)	Henderson Land Development Co Ltd	HSBC	(5)
(10.000)	Gemdale Properties & Investment Corp Ltd*	Citibank	—	1.000	Hengan International Group Co Ltd	Citibank	524
(278.000)	Gemdale Properties & Investment Corp Ltd	HSBC	(1.066)	10.500	Hengan International Group Co Ltd	HSBC	7.635
8.000	Genscript Biotech Corp	Citibank	1.686	4.500	Hengan International Group Co Ltd	JP Morgan	3.272
4.000	Giordano International Ltd	HSBC	240	60.000	HengTen Networks Group Ltd	Citibank	(38)
58.000	Giordano International Ltd	JP Morgan	3.477	508.000	HengTen Networks Group Ltd	JP Morgan	(1.292)
258.000	Giordano International Ltd	Citibank	10.543	109.500	HKBN Ltd	Citibank	(1.931)
24.000	Global Brands Group Holding Ltd	HSBC	(92)	19.500	HKBN Ltd	JP Morgan	(47)
44.000	Global Brands Group Holding Ltd	JP Morgan	(168)	12.500	HKBN Ltd	HSBC	(30)
584.000	Global Brands Group Holding Ltd	Citibank	(1.112)	66.000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	HSBC	(4.027)
(304.000)	GOME Retail Holdings Ltd	Citibank	(1.167)	1.000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Citibank	(23)
(113.000)	GOME Retail Holdings Ltd	JP Morgan	(721)	68.000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	JP Morgan	(4.150)
(68.000)	GOME Retail Holdings Ltd	HSBC	(434)	184.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	JP Morgan	8.477
23.500	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Citibank	(304)	5.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	HSBC	230
(5.500)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	JP Morgan	315	81.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Citibank	26
19.000	Greentown China Holdings Ltd	Citibank	(141)	(366.000)	Honghua Group Ltd	JP Morgan	(298)
3.500	Greentown China Holdings Ltd	JP Morgan	313	7.000	Hopewell Holdings Ltd	HSBC	(100)
(8.000)	Greentown Service Group Co Ltd	HSBC	(1.550)	(20.500)	Hopewell Holdings Ltd	Citibank	1.295
(94.000)	Guangdong Investment Ltd	Citibank	2.372	(2.000)	Hopewell Holdings Ltd	HSBC	229
(74.000)	Guangshen Railway Co Ltd 'H'	JP Morgan	1.599	(5.500)	Hopewell Holdings Ltd	JP Morgan	629
10.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H'	Citibank	4.848	(8.000)	Hopson Development Holdings Ltd	HSBC	80
4.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H'	HSBC	4.028	(6.000)	Hopson Development Holdings Ltd	Citibank	102
144.000	Guotai Junan International Holdings Ltd	Citibank	(2.379)	2.000	Hua Hong Semiconductor Ltd '144A'	Citibank	362
27.000	Guotai Junan International Holdings Ltd	HSBC	(618)	11.000	Hua Hong Semiconductor Ltd '144A'	JP Morgan	843
82.000	Guotai Junan International Holdings Ltd	JP Morgan	(1.878)	(47.000)	Huabao International Holdings Ltd	Citibank	(543)
800	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H' '144A'	Citibank	(69)	(15.000)	Huabao International Holdings Ltd	HSBC	(460)
1.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Citibank	153	30.000	Huabao International Holdings Ltd	JP Morgan	919
2.000	Haier Electronics Group Co Ltd	HSBC	421	(53.000)	Huabao International Holdings Ltd	JP Morgan	(1.624)
31.000	Haier Electronics Group Co Ltd	JP Morgan	6.527	6.000	Huadian Power International Corp Ltd 'H'	HSBC	190
19.000	Haitian International Holdings Ltd	JP Morgan	2.547	(62.000)	Huaneng Power International Inc 'H'	Citibank	(1.550)
8.000	Haitian International Holdings Ltd	Citibank	615	(46.000)	Huaneng Power International Inc 'H'	HSBC	(4.399)
1.000	Haitian International Holdings Ltd	HSBC	134	(48.000)	Huaneng Power International Inc 'H'	JP Morgan	(4.590)
99.000	Haitong International Securities Group Ltd	Citibank	(1.253)	(10.000)	Huanxi Media Group Ltd	Citibank	(13)
124.000	Haitong International Securities Group Ltd	JP Morgan	(894)	(400)	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	HSBC	20
				(16.400)	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	833
				5.000	Hysan Development Co Ltd	HSBC	(297)
				5.000	Hysan Development Co Ltd	JP Morgan	640

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(22.000)	IGG Inc	JP Morgan	165	2.000	Lifestyle International Holdings Ltd	HSBC	2.258
(38.000)	IGG Inc	Citibank	(1.171)	12.500	Lifestyle International Holdings Ltd	JP Morgan	14.113
2.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	Citibank	158	(210.000)	Lifetech Scientific Corp	Citibank	(546)
8.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	JP Morgan	327	(20.000)	Lifetech Scientific Corp	HSBC	(434)
(15.000)	Jiangxi Copper Co Ltd 'H'	Citibank	(80)	4.500	Link (Reit)	HSBC	1.638
2.000	Jiayuan International Group Ltd*	JP Morgan	–	(1.500)	Link (Reit)	HSBC	(546)
40.000	Jinchuan Group International Resources Co Ltd	HSBC	(407)	29.000	Link (Reit)	JP Morgan	2.763
8.000	Jinchuan Group International Resources Co Ltd	JP Morgan	(81)	9.000	Link (Reit)	Citibank	69
5.000	Jinchuan Group International Resources Co Ltd	Citibank	(32)	20.000	Logan Property Holdings Co Ltd	HSBC	768
4.000	JNBY Design Ltd	Citibank	(335)	2.000	Logan Property Holdings Co Ltd	Citibank	(203)
1.500	JNBY Design Ltd	HSBC	16	223.000	Lonking Holdings Ltd	Citibank	(2.256)
11.500	JNBY Design Ltd	JP Morgan	120	116.000	Lonking Holdings Ltd	JP Morgan	3.700
226.000	Joy City Property Ltd	Citibank	(283)	155.000	Lonking Holdings Ltd	HSBC	4.945
2.000	Joy City Property Ltd	HSBC	3	48.000	Luoyang Glass Co Ltd 'H'	Citibank	(364)
8.000	Joy City Property Ltd	JP Morgan	10	26.000	Luoyang Glass Co Ltd 'H'	HSBC	1
15.000	K Wah International Holdings Ltd	JP Morgan	937	56.000	Luoyang Glass Co Ltd 'H'	JP Morgan	3
10.000	Kaisa Group Holdings Ltd	Citibank	(50)	28.000	Luye Pharma Group Ltd	Citibank	(3.277)
31.000	Kaisa Group Holdings Ltd	HSBC	(235)	10.000	Luye Pharma Group Ltd	HSBC	(801)
500	Kerry Logistics Network Ltd	HSBC	(22)	47.500	Luye Pharma Group Ltd	JP Morgan	(4.089)
18.000	Kerry Logistics Network Ltd	JP Morgan	(777)	6.000	Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H'	HSBC	(91)
4.000	Kerry Logistics Network Ltd	Citibank	(60)	21.200	Man Wah Holdings Ltd	JP Morgan	731
(12.000)	Kerry Properties Ltd	HSBC	(5.816)	(13.200)	Man Wah Holdings Ltd	HSBC	(1.212)
6.500	Kingboard Chemical Holdings Ltd	HSBC	375	(173.600)	Man Wah Holdings Ltd	JP Morgan	(15.938)
1.000	Kingboard Chemical Holdings Ltd	JP Morgan	58	(64.800)	Man Wah Holdings Ltd	Citibank	74
4.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Citibank	(412)	7.000	Melco International Development Ltd	HSBC	1.017
14.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	JP Morgan	(146)	(7.000)	Melco International Development Ltd	HSBC	86
18.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	Citibank	(1.281)	(44.000)	Melco International Development Ltd	Citibank	(6.189)
8.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	HSBC	612	(46.000)	Melco International Development Ltd	JP Morgan	570
38.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	JP Morgan	2.909	14.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H'	Citibank	(249)
15.000	Kingsoft Corp Ltd	Citibank	3.160	79.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H'	HSBC	(1.507)
(28.000)	Kunlun Energy Co Ltd	Citibank	1.530	36.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H'	JP Morgan	(687)
(16.000)	Kunlun Energy Co Ltd	HSBC	(980)	(9.200)	MGM China Holdings Ltd	JP Morgan	466
(4.000)	Kunlun Energy Co Ltd	JP Morgan	(245)	(28.000)	MGM China Holdings Ltd	HSBC	1.418
22.500	KWG Property Holding Ltd	JP Morgan	(169)	(11.200)	MGM China Holdings Ltd	Citibank	(1.146)
18.250	L'Occitane International SA	Citibank	(693)	(28.000)	Minth Group Ltd	Citibank	4.570
1.000	L'Occitane International SA	HSBC	(43)	32.000	MMG Ltd	JP Morgan	(1.506)
250	L'Occitane International SA	JP Morgan	(11)	(6.000)	NagaCorp Ltd	Citibank	(276)
(375.000)	Landing International Development Ltd	Citibank	2.961	(1.900)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	HSBC	640
(375.000)	Landing International Development Ltd	HSBC	4.203	(13.800)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	Citibank	1.046
(17.000)	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	Citibank	(674)	(15.000)	Nesteer Automotive Group Ltd	Citibank	(1.494)
900	Legend Holdings Corp 'H' '144A'	JP Morgan	–	(22.000)	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	Citibank	(229)
(22.000)	Lenovo Group Ltd	HSBC	(1.262)	8.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	HSBC	(162)
(28.000)	Lenovo Group Ltd	Citibank	(1.179)	5.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	JP Morgan	(101)
(55.000)	Leyou Technologies Holdings Ltd	HSBC	(3.015)	1.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	Citibank	10
(419.752)	Leyou Technologies Holdings Ltd	JP Morgan	(23.007)	(15.000)	O-Net Technologies Group Ltd	Citibank	190
(70.000)	Leyou Technologies Holdings Ltd	Citibank	(2.143)	(4.000)	O-Net Technologies Group Ltd	JP Morgan	46
(18.000)	Li & Fung Ltd	Citibank	802	(1.500)	Orient Overseas International Ltd	JP Morgan	(259)
23.500	Li Ning Co Ltd	Citibank	812	(15.500)	Orient Overseas International Ltd	HSBC	(2.681)
1.500	Li Ning Co Ltd	JP Morgan	61	(2.800)	Orient Securities Co Ltd/China '144A'	Citibank	78
35.500	Lifestyle International Holdings Ltd	Citibank	35.924				

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(120.000)	Pacific Basin Shipping Ltd	Citibank	301	(2.000)	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'H'	JP Morgan	158
(3.000)	Pacific Basin Shipping Ltd	HSBC	(34)	(24.000)	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd 'H'	Citibank	(2.265)
(10.000)	Pacific Basin Shipping Ltd	JP Morgan	(115)	(20.000)	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd 'H'	JP Morgan	(3.543)
(35.000)	Pacific Textiles Holdings Ltd	Citibank	(1.119)	(500)	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'H'	Citibank	(325)
(1.000)	Pacific Textiles Holdings Ltd	HSBC	4	4.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Citibank	2
(224.000)	Panda Green Energy Group Ltd	HSBC	(1.144)	42.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	HSBC	12
(10.000)	Panda Green Energy Group Ltd	JP Morgan	(51)	27.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	JP Morgan	7
(490.000)	Panda Green Energy Group Ltd	Citibank	(1.256)	500	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H'	Citibank	99
10.000	PC Partner Group Ltd	Citibank	511	(70.600)	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H'	Citibank	(13.972)
2.000	PC Partner Group Ltd	JP Morgan	140	2.900	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H'	HSBC	962
4.000	PCCW Ltd	Citibank	26	14.000	Shangri-La Asia Ltd	Citibank	40
129.000	PCCW Ltd	JP Morgan	(4.430)	(4.000)	Shenzhen Expressway Co Ltd 'H'	Citibank	(194)
3.000	PCCW Ltd	HSBC	(103)	1.000	Shenzhen International Holdings Ltd	Citibank	(15)
177.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	HSBC	(872)	11.500	Shenzhen International Holdings Ltd	HSBC	(935)
52.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	JP Morgan	(417)	4.500	Shenzhen International Holdings Ltd	JP Morgan	(366)
(24.000)	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	JP Morgan	(32)	8.000	Shenzhen Investment Ltd	HSBC	123
71.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	Citibank	367	6.000	Shenzhen Investment Ltd	JP Morgan	92
(108.000)	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	Citibank	(558)	2.000	Shenzhou International Group Holdings Ltd	JP Morgan	1.225
(60.000)	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	HSBC	(80)	2.000	Shimao Property Holdings Ltd	Citibank	217
(54.000)	PetroChina Co Ltd 'H'	JP Morgan	(5.439)	6.500	Shimao Property Holdings Ltd	HSBC	1.782
16.000	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	HSBC	(1.261)	7.500	Shimao Property Holdings Ltd	JP Morgan	2.056
(16.500)	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Citibank	1.612	68.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	JP Morgan	(432)
3.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Citibank	(396)	34.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	Citibank	(475)
500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	HSBC	20	14.000	Shui On Land Ltd	JP Morgan	(58)
2.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	JP Morgan	78	104.000	Shui On Land Ltd	HSBC	(1.396)
4.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' '144A'	HSBC	(95)	15.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	JP Morgan	2.541
34.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' '144A'	Citibank	(1.339)	13.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	Citibank	2.257
(113.000)	Pou Sheng International Holdings Ltd	JP Morgan	(2.737)	4.000	Sino Land Co Ltd	HSBC	133
(63.000)	Pou Sheng International Holdings Ltd	Citibank	79	4.000	Sino Land Co Ltd	Citibank	113
(9.500)	Power Assets Holdings Ltd	HSBC	4.713	18.000	Sino Land Co Ltd	JP Morgan	599
(26.000)	Power Assets Holdings Ltd	JP Morgan	12.901	48.500	Sino-Ocean Group Holding Ltd	JP Morgan	(1.171)
(9.500)	Power Assets Holdings Ltd	Citibank	172	5.500	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	Citibank	211
(2.300)	PRADA SpA	JP Morgan	717	1.500	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	HSBC	142
26.000	Razer Inc '144A'	Citibank	(694)	33.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	3.114
38.000	Razer Inc '144A'	JP Morgan	(1.095)	(26.000)	Sinopec Kantons Holdings Ltd	Citibank	197
3.300	Samsonite International SA	Citibank	(3.046)	(4.000)	Sinopec Kantons Holdings Ltd	JP Morgan	(245)
6.000	Samsonite International SA	HSBC	(6.533)	14.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	Citibank	198
1.500	Samsonite International SA	JP Morgan	(1.633)	56.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	HSBC	4.998
3.200	Sands China Ltd	Citibank	(38)	4.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	JP Morgan	357
4.400	Sands China Ltd	HSBC	367	(5.200)	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Citibank	29
15.200	Sands China Ltd	JP Morgan	1.063	400	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Citibank	21
17.500	Semiconductor Manufacturing International Corp	Citibank	137	800	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	HSBC	179
17.500	Semiconductor Manufacturing International Corp	HSBC	205	8.800	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	1.966
49.500	Semiconductor Manufacturing International Corp	JP Morgan	(777)	179.000	Sinotrans Ltd 'H'	Citibank	(6.370)
(30.000)	Semiconductor Manufacturing International Corp	JP Morgan	302	7.000	Sinotrans Ltd 'H'	HSBC	(98)
(9.000)	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'H'	Citibank	1.131	161.000	Sinotrans Ltd 'H'	JP Morgan	(2.247)
(3.500)	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'H'	HSBC	276	38.500	Sinotruk Hong Kong Ltd	HSBC	9.227

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
70.500	Sinotruk Hong Kong Ltd	JP Morgan	16.895	1.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H'	JP Morgan	163
66.000	Sinotruk Hong Kong Ltd	Citibank	518	9.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd 'H'	Citibank	(89)
(6)	Sisram Medical Ltd '144A'	JP Morgan	—	(20.000)	Tongda Group Holdings Ltd	JP Morgan	(204)
(9.000)	SJM Holdings Ltd	Citibank	(2.238)	(310.000)	Tongda Group Holdings Ltd	Citibank	(801)
20.000	SJM Holdings Ltd	HSBC	5.472	43.000	Towngas China Co Ltd	JP Morgan	3.948
2.000	SJM Holdings Ltd	JP Morgan	576	15.000	Towngas China Co Ltd	Citibank	(648)
56.000	Skyworth Digital Holdings Ltd	HSBC	1.320	(55.000)	TravelSky Technology Ltd 'H'	Citibank	2.429
6.000	Skyworth Digital Holdings Ltd	JP Morgan	(40)	(6.000)	TravelSky Technology Ltd 'H'	HSBC	(308)
(42.000)	SmarTone Telecommunications Holdings Ltd	HSBC	(3.055)	(6.000)	TravelSky Technology Ltd 'H'	JP Morgan	(307)
(64.000)	SmarTone Telecommunications Holdings Ltd	JP Morgan	(4.654)	8.000	Truly International Holdings	Citibank	(224)
(96.000)	SMI Holdings Group Ltd	Citibank	(251)	(20.000)	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H'	HSBC	(7.657)
(216.000)	SMI Holdings Group Ltd	JP Morgan	(1.110)	(4.000)	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H'	Citibank	(615)
(78.500)	SOHO China Ltd	HSBC	(1.705)	32.000	Uni-President China Holdings Ltd	Citibank	(403)
44.000	SSY Group Ltd	JP Morgan	3.592	67.000	Uni-President China Holdings Ltd	HSBC	5.726
14.000	SSY Group Ltd	Citibank	(729)	84.000	Uni-President China Holdings Ltd	JP Morgan	7.179
(4.300)	Standard Chartered Plc	Citibank	2.294	6.000	United Laboratories International Holdings Ltd/The	HSBC	(366)
(1.300)	Standard Chartered Plc	HSBC	247	6.000	United Laboratories International Holdings Ltd/The	Citibank	(83)
1.000	Sun Art Retail Group Ltd	Citibank	(20)	2.000	United Laboratories International Holdings Ltd/The	JP Morgan	(122)
(39.000)	Sun Art Retail Group Ltd	HSBC	45	38.000	Value Partners Group Ltd	Citibank	(382)
2.000	Sun Art Retail Group Ltd	HSBC	(2)	2.000	Value Partners Group Ltd	JP Morgan	(64)
(78.000)	Sun Art Retail Group Ltd	Citibank	1.576	74.000	Value Partners Group Ltd	HSBC	(2.350)
16.000	Sun Art Retail Group Ltd	JP Morgan	(19)	1.900	VTech Holdings Ltd	Citibank	(469)
(8.000)	Sun Hung Kai Properties Ltd	HSBC	332	3.900	VTech Holdings Ltd	JP Morgan	(20)
1.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Citibank	155	9.800	VTech Holdings Ltd	HSBC	(50)
(5.000)	Sunac China Holdings Ltd	JP Morgan	2.992	24.000	Want Want China Holdings Ltd	HSBC	2.601
(1.400)	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	JP Morgan	(3.284)	58.000	Want Want China Holdings Ltd	JP Morgan	6.286
(4.700)	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	Citibank	(4.924)	28.000	Want Want China Holdings Ltd	Citibank	2.430
(2.500)	Swire Pacific Ltd 'A'	Citibank	(673)	1.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	Citibank	56
1.000	Swire Properties Ltd	HSBC	262	(83.000)	Weichai Power Co Ltd 'H'	HSBC	(4.669)
11.800	Swire Properties Ltd	JP Morgan	3.086	1.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	JP Morgan	167
600	Swire Properties Ltd	Citibank	142	34.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	JP Morgan	5.679
77.000	TCL Multimedia Technology Holdings Ltd	Citibank	(1.270)	336.000	West China Cement Ltd	JP Morgan	(4.275)
19.000	TCL Multimedia Technology Holdings Ltd	HSBC	412	572.000	West China Cement Ltd	Citibank	(2.170)
30.000	TCL Multimedia Technology Holdings Ltd	JP Morgan	651	66.000	West China Cement Ltd	HSBC	(840)
7.500	Technronic Industries Co Ltd	Citibank	(1.809)	6.500	WH Group Ltd '144A'	Citibank	(529)
(4.000)	Technronic Industries Co Ltd	Citibank	965	500	WH Group Ltd '144A'	HSBC	3
(17.000)	Technronic Industries Co Ltd	HSBC	1.289	44.000	WH Group Ltd '144A'	JP Morgan	229
500	Technronic Industries Co Ltd	HSBC	109	(5.000)	Wharf Holdings Ltd/The	Citibank	61
7.000	Technronic Industries Co Ltd	JP Morgan	1.520	3.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	HSBC	(26)
(13.400)	Television Broadcasts Ltd	HSBC	(2.907)	(4.000)	Wheelock & Co Ltd	Citibank	199
(3.000)	Television Broadcasts Ltd	JP Morgan	(651)	500	Wuxi Biologics Cayman Inc '144A'	JP Morgan	809
500	Tencent Holdings Ltd	HSBC	551	3.000	Wuxi Biologics Cayman Inc '144A'	Citibank	3.330
(16.000)	Texwinca Holdings Ltd	HSBC	(184)	(6.000)	Wynn Macau Ltd	HSBC	380
(134.000)	Texwinca Holdings Ltd	JP Morgan	(1.543)	(1.000)	Xingda International Holdings Ltd	Citibank	(6)
(94.000)	Texwinca Holdings Ltd	Citibank	(845)	(5.000)	Xingda International Holdings Ltd	HSBC	(26)
(8.000)	Tianjin Capital Environmental Protection Group Co Ltd 'H'	Citibank	30	(28.000)	Xinhua Winshare Publishing and Media Co Ltd 'H'	HSBC	(15)
(10.000)	Tianjin Capital Environmental Protection Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	114	(6.000)	Xinhua Winshare Publishing and Media Co Ltd 'H'	JP Morgan	22
26.000	Tianneng Power International Ltd	HSBC	2.985	(82.000)	Xinhua Winshare Publishing and Media Co Ltd 'H'	Citibank	(1.054)
94.000	Tianneng Power International Ltd	JP Morgan	10.792	14.600	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H'	HSBC	(2.676)
72.000	Tianneng Power International Ltd	Citibank	7.354	(26.000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	HSBC	1.984
2.000	Times China Holdings Ltd	Citibank	(56)	4.000	Xinyi Solar Holdings Ltd	Citibank	(178)
2.000	Times China Holdings Ltd	HSBC	291				
2.000	Times China Holdings Ltd	JP Morgan	291				
18.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	Citibank	3.400				
30.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	HSBC	6.304				
28.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	JP Morgan	6.427				

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
56.000	Xinyi Solar Holdings Ltd	HSBC	(711)	77.200	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	Citibank	(487)
8.000	Xinyi Solar Holdings Ltd	JP Morgan	(102)				
(9.000)	Xiwang Special Steel Co Ltd	HSBC	(114)	50.800	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	JP Morgan	779
6.000	Xtep International Holdings Ltd	Citibank	62	11.400	ZTE Corp 'H'	Citibank	(9.581)
27.000	Xtep International Holdings Ltd	JP Morgan	552	14.000	ZTE Corp 'H'	HSBC	(11.768)
(10.000)	Yadea Group Holdings Ltd '144A'	Citibank	(1)				66.303
6.500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' '144A'	HSBC	(784)	Indonésie			
11.000	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' '144A'	JP Morgan	(1.327)	302.200	Ace Hardware Indonesia Tbk PT	Citibank	1.750
500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' '144A'	Citibank	(83)	10.400	Ace Hardware Indonesia Tbk PT	HSBC	1
(6.000)	Youyuan International Holdings Ltd	Citibank	(16)	326.500	Ace Hardware Indonesia Tbk PT	JP Morgan	66
(3.000)	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	HSBC	(479)	31.100	Adaro Energy Tbk PT	HSBC	614
8.000	Yuexiu Property Co Ltd	HSBC	21	510.000	Adaro Energy Tbk PT	JP Morgan	10.150
248.000	Yuexiu Property Co Ltd	JP Morgan	637	124.400	Adaro Energy Tbk PT	Citibank	(106)
328.000	Yuexiu Property Co Ltd	Citibank	(1.661)	181.800	Astra International Tbk PT	Citibank	909
7.000	Yuexiu Real Estate Investment Trust (Reit)	Citibank	99	114.200	Astra International Tbk PT	JP Morgan	171
146.000	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	Citibank	1.691	364.000	Astra International Tbk PT	HSBC	1.957
54.000	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	HSBC	1.243	(4.300)	Bank Central Asia Tbk PT	HSBC	(268)
156.000	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	JP Morgan	3.589	(38.500)	Bank Central Asia Tbk PT	JP Morgan	(2.492)
31.000	Yuzhou Properties Co Ltd	Citibank	(905)	(40.700)	Bank Mandiri Persero Tbk PT	JP Morgan	(487)
25.000	Yuzhou Properties Co Ltd	JP Morgan	(922)	(27.800)	Bank Mandiri Persero Tbk PT	HSBC	(310)
3.000	Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H'	Citibank	100	2.100	Bank Mandiri Persero Tbk PT	Citibank	96
3.500	Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H'	HSBC	188	8.700	Bank Mandiri Persero Tbk PT	HSBC	193
23.000	Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H'	JP Morgan	1.315	3.100	Bank Mandiri Persero Tbk PT	JP Morgan	71
4.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	Citibank	123	120.800	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	HSBC	319
38.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	HSBC	779	74.700	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	Citibank	2.187
10.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	JP Morgan	205	1.125.100	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	JP Morgan	5.132
2.700	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	(845)	29.300	Bukit Asam Tbk PT	HSBC	1.198
400	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd 'H' '144A'	Citibank	100	107.300	Bukit Asam Tbk PT	Citibank	580
3.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Citibank	40	50.700	Bukit Asam Tbk PT	JP Morgan	2.092
17.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd	HSBC	2.496	(393.500)	Bumi Resources Tbk PT	JP Morgan	(637)
38.500	Zhongsheng Group Holdings Ltd	JP Morgan	5.652	1.645.600	Bumi Resources Tbk PT	Citibank	1.935
(33.500)	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd '144A'	JP Morgan	595	386.400	Bumi Serpong Damai Tbk PT	HSBC	6.476
(70.000)	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd '144A'	Citibank	(1.525)	18.500	Bumi Serpong Damai Tbk PT	Citibank	222
(16.000)	Zhuguang Holdings Group Co Ltd	Citibank	(41)	215.200	Bumi Serpong Damai Tbk PT	JP Morgan	3.642
(26.500)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	JP Morgan	2.857	600	Gudang Garam Tbk PT	Citibank	126
(4.000)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	Citibank	(538)	5.500	Gudang Garam Tbk PT	HSBC	510
(21.600)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	HSBC	2.327	1.400	Gudang Garam Tbk PT	JP Morgan	140
38.000	Zijin Mining Group Co Ltd 'H'	HSBC	(1.305)	70.300	Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT	HSBC	2.123
161.800	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	HSBC	2.481	(47.900)	Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT	JP Morgan	(1.464)
				6.600	Harum Energy Tbk PT	JP Morgan	443
				31.600	Indah Kiat Pulp & Paper Corp Tbk PT	Citibank	9.951
				4.400	Indo Tambangraya Megah Tbk PT	Citibank	24
				4.900	Indo Tambangraya Megah Tbk PT	JP Morgan	1.288
				(92.600)	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	HSBC	(7.130)
				(16.500)	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	JP Morgan	(1.300)
				3.600	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	HSBC	84
				23.600	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	Citibank	1.256
				127.200	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	JP Morgan	3.539
				95.500	Inti Agri Resources Tbk PT	JP Morgan	418
				(6.000)	Jasa Marga Persero Tbk PT	HSBC	(201)

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Indonésie suite				Japon suite			
(47.800)	Jasa Marga Persero Tbk PT	JP Morgan	(1.620)	2.500	Alfresa Holdings Corp	Citibank	189
(134.000)	Kalbe Farma Tbk PT	JP Morgan	677	200	Alps Electric Co Ltd	JP Morgan	100
178.200	Logindo Samudramakmur Tbk PT	Citibank	(12)	2.400	Amada Holdings Co Ltd	Citibank	(1.744)
27.500	Matahari Department Store Tbk PT	Citibank	700	3.900	Amada Holdings Co Ltd	JP Morgan	(4.126)
198.900	Medco Energi Internasional Tbk PT	Citibank	(1.202)	1.800	Amada Holdings Co Ltd	HSBC	(1.897)
(50.500)	Pakuwon Jati Tbk PT	HSBC	(72)	(100)	Amuse Inc	HSBC	141
(1.052.400)	Pakuwon Jati Tbk PT	JP Morgan	(1.556)	(300)	Amuse Inc	JP Morgan	427
121.900	Perusahaan Gas Negara Persero Tbk	Citibank	1.735	(1.500)	ANA Holdings Inc	JP Morgan	(2.380)
10.100	Ramayana Lestari Sentosa Tbk PT	HSBC	77	100	AOI Electronics Co Ltd	Citibank	108
293.700	Ramayana Lestari Sentosa Tbk PT	Citibank	1.223	500	Aoyama Trading Co Ltd	JP Morgan	(1.337)
150.100	Ramayana Lestari Sentosa Tbk PT	JP Morgan	1.166	100	Aoyama Trading Co Ltd	Citibank	(148)
35.500	Semen Indonesia Persero Tbk PT	Citibank	432	(800)	Aozora Bank Ltd	JP Morgan	362
(316.600)	Semen Indonesia Persero Tbk PT	JP Morgan	11.018	7.500	Aplus Financial Co Ltd	Citibank	167
4.300	Timah Tbk PT	HSBC	13	34.100	Aplus Financial Co Ltd	HSBC	(1.698)
87.600	Timah Tbk PT	JP Morgan	279	28.800	Aplus Financial Co Ltd	JP Morgan	(1.445)
958.900	Timah Tbk PT	Citibank	(581)	400	Arakawa Chemical Industries Ltd	JP Morgan	(636)
74.700	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	HSBC	(296)	100	Arakawa Chemical Industries Ltd	Citibank	(74)
47.200	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	JP Morgan	(161)	200	Arcland Service Holdings Co Ltd	JP Morgan	(105)
74.600	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	Citibank	864	500	Arcs Co Ltd	JP Morgan	(192)
(2.100)	Unilever Indonesia Tbk PT	JP Morgan	147	(200)	Arealink Co Ltd	JP Morgan	767
1.800	United Tractors Tbk PT	HSBC	391	(800)	Ariake Japan Co Ltd	JP Morgan	(1.140)
7.700	United Tractors Tbk PT	JP Morgan	1.734	300	Ariake Japan Co Ltd	Citibank	137
310.900	Waskita Karya Persero Tbk PT	Citibank	3.751	100	Asahi Diamond Industrial Co Ltd	Citibank	(19)
44.000	Waskita Karya Persero Tbk PT	HSBC	1.319	400	Asahi Diamond Industrial Co Ltd	HSBC	(710)
47.900	Waskita Karya Persero Tbk PT	JP Morgan	1.446	600	Asahi Diamond Industrial Co Ltd	JP Morgan	(1.067)
(68.800)	XL Axiata Tbk PT	HSBC	50	500	Asahi Group Holdings Ltd	HSBC	521
			66.790	(400)	Asahi Group Holdings Ltd	JP Morgan	(783)
Japon				300	Asahi Holdings Inc	HSBC	(60)
(2.500)	77 Bank Ltd/The	JP Morgan	5.307	300	Asahi Holdings Inc	Citibank	83
400	ABC-Mart Inc	HSBC	(1.525)	(1.300)	Asahi Kasei Corp	JP Morgan	52
600	Adastria Co Ltd	JP Morgan	(517)	400	Asics Corp	HSBC	(909)
200	Adastria Co Ltd	Citibank	(224)	200	ASKA Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(84)
(200)	Advan Co Ltd	HSBC	59	200	ASKA Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(721)
(2.300)	Advan Co Ltd	JP Morgan	566	(200)	ASKUL Corp	JP Morgan	366
1.000	Advantest Corp	Citibank	(435)	(100)	ASKUL Corp	Citibank	(105)
900	Advantest Corp	HSBC	(998)	2.200	Astellas Pharma Inc	Citibank	627
(1.300)	Aeon Co Ltd	JP Morgan	(98)	3.200	Astellas Pharma Inc	HSBC	213
1.300	Aeon Co Ltd	Citibank	559	3.500	Astellas Pharma Inc	JP Morgan	192
1.900	Aeon Co Ltd	HSBC	193	200	Ateam Inc	HSBC	(52)
3.800	Aeon Co Ltd	JP Morgan	361	100	Ateam Inc	Citibank	(4)
500	Aeon Delight Co Ltd	Citibank	255	200	Ateam Inc	JP Morgan	(53)
100	Aeon Delight Co Ltd	JP Morgan	(11)	500	Autobacs Seven Co Ltd	HSBC	(719)
300	AEON Financial Service Co Ltd	Citibank	(155)	1.100	Autobacs Seven Co Ltd	JP Morgan	(1.589)
1.000	AEON Financial Service Co Ltd	HSBC	(678)	500	Autobacs Seven Co Ltd	Citibank	(170)
1.300	Aeon Mall Co Ltd	HSBC	428	(10.000)	Awa Bank Ltd/The	JP Morgan	2.630
(400)	Ai Holdings Corp	JP Morgan	1.404	400	Axial Retailing Inc	Citibank	114
(100)	Ai Holdings Corp	HSBC	350	800	Azbil Corp	JP Morgan	2.242
700	Aica Kogyo Co Ltd	Citibank	636	600	Bandai Namco Holdings Inc	Citibank	2.804
200	Aica Kogyo Co Ltd	HSBC	240	400	Bandai Namco Holdings Inc	HSBC	3.131
2.700	Aica Kogyo Co Ltd	JP Morgan	3.208	100	Bando Chemical Industries Ltd	HSBC	(12)
100	Aichi Steel Corp	JP Morgan	(283)	(1.800)	Bank of Kyoto Ltd/The	JP Morgan	10.281
(1.700)	Aida Engineering Ltd	JP Morgan	(628)	(100)	Bank of Kyoto Ltd/The	Citibank	309
7.300	Aiful Corp	HSBC	(1.751)	100	Bank of Nagoya Ltd/The	JP Morgan	(139)
1.200	Air Water Inc	HSBC	(68)	100	Bank of Saga Ltd/The	JP Morgan	(134)
100	Aisan Industry Co Ltd	JP Morgan	(73)	(100)	BayCurrent Consulting Inc	Citibank	10
500	Aisin Seiki Co Ltd	JP Morgan	(1.777)	(300)	BayCurrent Consulting Inc	JP Morgan	(454)
(100)	Alconix Corp	Citibank	171	300	Benesse Holdings Inc	Citibank	23
4.000	Alfresa Holdings Corp	JP Morgan	11.015	400	Benesse Holdings Inc	HSBC	(678)
				300	Benesse Holdings Inc	JP Morgan	(512)
				100	Bengo4.com Inc	Citibank	119
				100	Bengo4.com Inc	JP Morgan	306
				(7.700)	Bic Camera Inc	JP Morgan	7.752
				500	Brangista Inc	Citibank	(358)
				500	Bridgestone Corp	Citibank	(598)
				(100)	BRONCO BILLY Co Ltd	JP Morgan	252

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(300)	Bunka Shutter Co Ltd	JP Morgan	207	(10)	Daiwa House Investment Corp (Reit)	JP Morgan	104
(700)	Calbee Inc	Citibank	(654)	(100)	Daiwa Industries Ltd	HSBC	(66)
(1.100)	Calbee Inc	JP Morgan	(1.756)	(300)	Daiwa Industries Ltd	JP Morgan	(198)
(3.700)	Canon Inc	JP Morgan	1.490	4.000	Daiwa Securities Group Inc	Citibank	(384)
1.000	Canon Inc	HSBC	(467)	(2.300)	DeNA Co Ltd	JP Morgan	374
1.000	Canon Marketing Japan Inc	JP Morgan	(468)	700	Denka Co Ltd	JP Morgan	348
200	Career Co Ltd	Citibank	(51)	(300)	Denka Co Ltd	HSBC	(153)
(1.300)	Casio Computer Co Ltd	JP Morgan	(24)	(2.300)	Denka Co Ltd	JP Morgan	(1.142)
100	Cawachi Ltd	JP Morgan	(100)	(300)	Denki Kogyo Co Ltd	JP Morgan	126
(2.900)	Central Glass Co Ltd	JP Morgan	5.012	1.000	Denso Corp	HSBC	(942)
100	Change Inc	Citibank	(189)	(700)	DIC Corp	JP Morgan	533
6.500	Chiba Bank Ltd/The	JP Morgan	(2.026)	(300)	Digital Garage Inc	JP Morgan	(2.138)
3.200	Chiba Bank Ltd/The	Citibank	(383)	(700)	Digital Garage Inc	Citibank	(421)
300	Chiba Kogyo Bank Ltd/The	Citibank	(32)	100	Dip Corp	JP Morgan	(84)
600	Chiba Kogyo Bank Ltd/The	JP Morgan	(3)	2.700	DMG Mori Co Ltd	JP Morgan	(6.619)
2.400	Chiyoda Corp	HSBC	(3.415)	(800)	Don Quijote Holdings Co Ltd	JP Morgan	677
700	Chiyoda Corp	JP Morgan	(998)	1.400	Doutor Nichires Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.469)
3.800	Chubu Electric Power Co Inc	JP Morgan	(1.596)	(1.300)	Dowa Holdings Co Ltd	HSBC	5.751
1.700	Chubu Electric Power Co Inc	Citibank	446	(1.000)	Dowa Holdings Co Ltd	JP Morgan	5.903
(100)	Chudenko Corp	JP Morgan	49	(100)	Dowa Holdings Co Ltd	Citibank	192
(100)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(330)	100	DTS Corp	Citibank	47
3.200	Chugoku Bank Ltd/The	HSBC	(1.635)	400	DTS Corp	JP Morgan	1.397
5.500	Chugoku Bank Ltd/The	Citibank	(2.216)	100	Duskin Co Ltd	JP Morgan	(152)
5.300	Chugoku Bank Ltd/The	JP Morgan	(2.729)	100	East Japan Railway Co	HSBC	110
(4.800)	Chugoku Electric Power Co Inc/The	JP Morgan	(80)	100	East Japan Railway Co	Citibank	266
(300)	Chugoku Marine Paints Ltd	JP Morgan	192	400	East Japan Railway Co	JP Morgan	428
1.200	Citizen Watch Co Ltd	Citibank	(496)	(1.200)	Eiken Chemical Co Ltd	JP Morgan	(284)
1.600	Citizen Watch Co Ltd	HSBC	(1.325)	(1.400)	Eisai Co Ltd	JP Morgan	(6.546)
2.600	Citizen Watch Co Ltd	JP Morgan	(2.159)	(800)	Electric Power Development Co Ltd	JP Morgan	733
1.200	CKD Corp	HSBC	435	400	Electric Power Development Co Ltd	JP Morgan	(569)
400	CMIC Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.202)	100	Elematec Corp	JP Morgan	60
300	CMIC Holdings Co Ltd	HSBC	(899)	700	en-japan Inc	JP Morgan	(92)
(2.300)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	JP Morgan	802	500	en-japan Inc	Citibank	(1.128)
200	Colowide Co Ltd	Citibank	132	100	EPS Holdings Inc	JP Morgan	56
700	Colowide Co Ltd	JP Morgan	1.751	(1.100)	eRex Co Ltd	Citibank	181
(2)	Comforia Residential Inc (Reit)	Citibank	(203)	(1.800)	eRex Co Ltd	JP Morgan	(2.776)
(300)	Computer Engineering & Consulting Ltd	JP Morgan	(668)	(2.500)	ES-Con Japan Ltd	Citibank	1.623
900	COMSYS Holdings Corp	HSBC	(59)	(300)	ES-Con Japan Ltd	HSBC	885
(600)	Concordia Financial Group Ltd	JP Morgan	39	(400)	ES-Con Japan Ltd	JP Morgan	1.181
1.700	COOKPAD Inc	Citibank	48	(1.400)	Ezaki Glico Co Ltd	JP Morgan	1.579
100	Corona Corp	JP Morgan	(62)	300	F-Tech Inc	HSBC	(91)
400	Cosel Co Ltd	Citibank	(278)	400	F-Tech Inc	JP Morgan	(123)
(1.400)	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	JP Morgan	221	1.100	F@N Communications Inc	JP Morgan	106
100	Credit Saison Co Ltd	Citibank	(103)	(1.300)	Fanc! Corp	JP Morgan	(6.781)
100	Credit Saison Co Ltd	JP Morgan	(131)	(600)	FANUC Corp	JP Morgan	2.044
100	CyberAgent Inc	Citibank	(129)	(100)	FANUC Corp	Citibank	727
400	CyberAgent Inc	HSBC	(1.837)	(300)	Ferrotec Holdings Corp	Citibank	(325)
1.500	CYBERDYNE Inc	JP Morgan	(45)	(1.800)	Financial Products Group Co Ltd	HSBC	(321)
1.900	Dai Nippon Printing Co Ltd	JP Morgan	(188)	(200)	Financial Products Group Co Ltd	JP Morgan	53
(1.000)	Dai Nippon Printing Co Ltd	JP Morgan	99	(700)	FINDEX Inc	Citibank	(130)
1.200	Dai Nippon Printing Co Ltd	Citibank	381	(1.300)	FINDEX Inc	JP Morgan	(60)
1.100	Dai-ichi Life Holdings Inc	JP Morgan	(921)	300	Fixstars Corp	Citibank	199
1.100	Dai-ichi Life Holdings Inc	Citibank	(1.490)	500	Fixstars Corp	JP Morgan	935
2.300	Daicel Corp	Citibank	(778)	(200)	FP Corp	Citibank	(164)
1.500	Daicel Corp	JP Morgan	(552)	(900)	FP Corp	JP Morgan	1.732
(1.400)	Daido Metal Co Ltd	JP Morgan	991	400	FP Corp	Citibank	327
(400)	Daido Steel Co Ltd	JP Morgan	2.882	(200)	FP Corp	HSBC	381
(400)	Daiichi Kigenso Kagaku-Kogyo Co Ltd	Citibank	457	200	France Bed Holdings Co Ltd	HSBC	6
700	Daiichi Sankyo Co Ltd	JP Morgan	(1.657)	1.600	France Bed Holdings Co Ltd	JP Morgan	40
(1.800)	Daiichi Sankyo Co Ltd	JP Morgan	8.029	6.200	France Bed Holdings Co Ltd	Citibank	2.854
300	Daiichikosho Co Ltd	Citibank	(674)	1.500	Fuji Co Ltd/Ehime	Citibank	898
(300)	Daikin Industries Ltd	JP Morgan	701	700	Fuji Co Ltd/Ehime	JP Morgan	52
(5.700)	Daikyo Inc	JP Morgan	(9.285)	100	Fuji Co Ltd/Ehime	HSBC	8
(2.400)	Daiishi Bank Ltd/The	JP Morgan	6.015	(4.000)	Fuji Electric Co Ltd	Citibank	457
600	Daito Trust Construction Co Ltd	HSBC	(2.388)	(100)	Fuji Media Holdings Inc	Citibank	12
(600)	Daiwa House Industry Co Ltd	JP Morgan	760				

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(900)	Fuji Oil Holdings Inc	JP Morgan	(4.367)	1.900	Haseko Corp	Citibank	512
(100)	Fuji Seal International Inc	HSBC	(194)	(2.300)	Hazama Ando Corp	JP Morgan	(1.784)
400	Fuji Soft Inc	HSBC	652	700	Heiwa Corp	JP Morgan	1.335
500	Fuji Soft Inc	JP Morgan	809	200	Heiwa Real Estate Co Ltd	Citibank	(8)
1.000	Fuji Soft Inc	Citibank	(187)	100	Hibiya Engineering Ltd	JP Morgan	14
(100)	Fujiibo Holdings Inc	JP Morgan	235	(500)	Hikari Tsushin Inc	JP Morgan	(8.864)
(3.300)	FUJIFILM Holdings Corp	JP Morgan	587	200	Hikari Tsushin Inc	Citibank	706
1.100	Fujikura Ltd	HSBC	(73)	(2.900)	Hino Motors Ltd	JP Morgan	1.440
800	Fujikura Ltd	Citibank	(479)	300	Hiramatsu Inc	Citibank	14
(200)	Fujita Kanko Inc	Citibank	(154)	300	Hiramatsu Inc	JP Morgan	24
(600)	Fujita Kanko Inc	JP Morgan	(282)	(100)	Hirata Corp	JP Morgan	1.974
2.600	Fujitsu General Ltd	Citibank	(544)	(400)	Hirose Electric Co Ltd	JP Morgan	5.071
2.500	Fujitsu General Ltd	JP Morgan	(1.350)	3.100	Hiroshima Bank Ltd/The	HSBC	(1.385)
(1.000)	Fujitsu General Ltd	JP Morgan	540	2.800	Hiroshima Bank Ltd/The	JP Morgan	(1.292)
10.000	Fujitsu Ltd	Citibank	(1.382)	200	Hiroshima Bank Ltd/The	Citibank	(70)
(4.000)	Fujitsu Ltd	JP Morgan	381	300	HIS Co Ltd	JP Morgan	91
2.000	Fujitsu Ltd	JP Morgan	(288)	700	HIS Co Ltd	HSBC	220
700	Fukui Computer Holdings Inc	JP Morgan	(1.210)	(700)	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	JP Morgan	(1.306)
200	Fukui Computer Holdings Inc	Citibank	(135)	(1.000)	Hitachi Chemical Co Ltd	JP Morgan	16
(2.000)	Fukuoka Financial Group Inc	Citibank	181	6.000	Hitachi Ltd	HSBC	(3.154)
(2.000)	Fukuoka Financial Group Inc	JP Morgan	(161)	2.000	Hitachi Ltd	JP Morgan	(1.056)
400	Fukushima Industries Corp	JP Morgan	(778)	1.800	Hitachi Metals Ltd	JP Morgan	(1.441)
(200)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Citibank	(4)	(500)	Hitachi Metals Ltd	JP Morgan	376
(1.400)	Fukuyama Transporting Co Ltd	HSBC	(9.604)	1.300	Hitachi Transport System Ltd	Citibank	(53)
(200)	Fukuyama Transporting Co Ltd	JP Morgan	(1.369)	800	Hitachi Transport System Ltd	JP Morgan	(1.658)
(100)	FULLCAST Holdings Co Ltd	HSBC	(349)	500	Hitachi Transport System Ltd	HSBC	(1.031)
300	Funai Electric Co Ltd	Citibank	(71)	(300)	Hogy Medical Co Ltd	JP Morgan	(973)
(800)	Furukawa Electric Co Ltd	JP Morgan	8.291	(6.100)	Hokkaido Electric Power Co Inc	JP Morgan	3.998
400	Futaba Industrial Co Ltd	JP Morgan	(247)	1.000	Hokuhoku Financial Group Inc	JP Morgan	(455)
300	GameWith Inc	Citibank	350	200	Hokuhoku Financial Group Inc	Citibank	(102)
400	GameWith Inc	HSBC	505	4.200	Hokuriku Electric Power Co	HSBC	(1.864)
800	GameWith Inc	JP Morgan	1.005	900	Hokuriku Electric Power Co	JP Morgan	(403)
(400)	GCA Corp	JP Morgan	182	1.700	Hokuriku Electric Power Co	Citibank	12
(200)	GCA Corp	Citibank	61	(2.300)	Hokuriku Electric Power Co	HSBC	730
900	Geniee Inc	JP Morgan	(1.338)	(600)	Hokuto Corp	JP Morgan	(494)
300	Geniee Inc	Citibank	(365)	(3.000)	Hoosiers Holdings	Citibank	1.196
(200)	Genky DrugStores Co Ltd	HSBC	(97)	(3.000)	Hoosiers Holdings	HSBC	410
(100)	Genky DrugStores Co Ltd	JP Morgan	(47)	(2.700)	Hoosiers Holdings	JP Morgan	376
500	Geo Holdings Corp	Citibank	(390)	500	Horiba Ltd	HSBC	5.073
1.600	Geo Holdings Corp	JP Morgan	(1.276)	700	Horiba Ltd	JP Morgan	7.085
(100)	Giken Ltd	Citibank	(34)	(700)	Hoya Corp	JP Morgan	(4.367)
100	GMO Cloud K.K.	JP Morgan	382	(300)	Hyakugo Bank Ltd/The	Citibank	65
(300)	GMO Payment Gateway Inc	Citibank	(917)	(600)	Hyakugo Bank Ltd/The	HSBC	240
(300)	GMO Payment Gateway Inc	JP Morgan	(1.309)	(800)	Hyakugo Bank Ltd/The	JP Morgan	322
(100)	GMO Payment Gateway Inc	HSBC	(440)	(1.500)	Ibiden Co Ltd	HSBC	(491)
(1.000)	GNI Group Ltd	JP Morgan	870	(700)	Ibiden Co Ltd	JP Morgan	(225)
(1.000)	Goldcrest Co Ltd	JP Morgan	3.455	(5.700)	Ichigo Inc	JP Morgan	(1.645)
4.300	Gree Inc	Citibank	(549)	(13.600)	Ichigo Inc	Citibank	(3.488)
(1.000)	GS Yuasa Corp	HSBC	645	(4.900)	Ichigo Inc	HSBC	(1.421)
(13.000)	GS Yuasa Corp	JP Morgan	8.410	(30)	Ichigo Office Investment (Reit)	Citibank	(697)
6.700	GungHo Online Entertainment Inc	JP Morgan	(468)	(9)	Ichigo Office Investment (Reit)	JP Morgan	(66)
(7.400)	GungHo Online Entertainment Inc	Citibank	170	(900)	Ichikoh Industries Ltd	HSBC	(2.414)
(1.200)	GungHo Online Entertainment Inc	JP Morgan	84	(200)	Idec Corp/Japan	JP Morgan	(140)
(1.700)	Gunma Bank Ltd/The	JP Morgan	266	(2.200)	Idemitsu Kosan Co Ltd	JP Morgan	5.352
(600)	Gunze Ltd	JP Morgan	(567)	200	IGNIS Ltd	Citibank	(77)
1.000	H2O Retailing Corp	JP Morgan	(1.772)	(700)	IHI Corp	JP Morgan	(2.727)
200	H2O Retailing Corp	HSBC	(353)	1.200	Iida Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	174
100	H2O Retailing Corp	Citibank	(72)	300	Iino Kaiun Kaisha Ltd	Citibank	(62)
(6.200)	Hachijuni Bank Ltd/The	JP Morgan	3.304	100	Iino Kaiun Kaisha Ltd	HSBC	(14)
4.900	Hakuhodo DY Holdings Inc	Citibank	1.672	1.400	Iino Kaiun Kaisha Ltd	JP Morgan	(201)
2.100	Hakuhodo DY Holdings Inc	JP Morgan	1.443	(100)	Imagica Robot Holdings Inc	Citibank	27
1.000	Hakuhodo DY Holdings Inc	HSBC	692	200	Inaba Denki Sangyo Co Ltd	JP Morgan	(203)
(1.300)	Hankyu Hanshin Holdings Inc	JP Morgan	(2.522)	1	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (Reit)	Citibank	25
(800)	Hanwa Co Ltd	JP Morgan	1.123	400	Ines Corp	HSBC	(490)
(100)	Harmonic Drive Systems Inc	Citibank	331	1.100	Ines Corp	JP Morgan	(1.351)
800	Harmonic Drive Systems Inc	JP Morgan	183	300	Infocom Corp	HSBC	(235)
7.400	Haseko Corp	JP Morgan	(2.655)	400	Infocom Corp	JP Morgan	(317)
1.800	Haseko Corp	HSBC	(801)	(400)	Infomart Corp	Citibank	(11)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
200	Information Services International-Dentsu Ltd	Citibank	181	300	Japan Tissue Engineering Co Ltd	HSBC	(449)
(4.500)	Inpex Corp	JP Morgan	6.942	500	Japan Tissue Engineering Co Ltd	JP Morgan	(750)
200	Insource Co Ltd	HSBC	271	1.700	Japan Tobacco Inc	HSBC	(1.543)
100	Internet Initiative Japan Inc	HSBC	124	100	Japan Tobacco Inc	JP Morgan	(92)
800	Internet Initiative Japan Inc	JP Morgan	988	3.300	Japan Tobacco Inc	Citibank	1.011
(64)	Invincible Investment Corp (Reit)	JP Morgan	(82)	(100)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	HSBC	(1.206)
(100)	Iseki & Co Ltd	Citibank	50	(100)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	JP Morgan	(1.205)
100	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Citibank	4	100	JCU Corp	HSBC	187
100	Ishihara Sangyo Kaisha Ltd	Citibank	(71)	200	JCU Corp	JP Morgan	373
(400)	Istyle Inc	Citibank	73	1.100	JFE Holdings Inc	HSBC	(1.333)
(3.200)	Isuzu Motors Ltd	JP Morgan	5.930	200	JIG-SAW Inc	Citibank	43
(1.800)	Ito En Ltd	JP Morgan	(1.675)	(500)	Joshin Denki Co Ltd	HSBC	1.605
(3.900)	ITOCHU Corp	JP Morgan	914	(900)	Joyful Honda Co Ltd	HSBC	1.616
1.000	Itochu Enex Co Ltd	Citibank	(31)	(200)	Joyful Honda Co Ltd	Citibank	20
6.300	Itochu Techno-Solutions Corp	JP Morgan	(3.036)	(3.000)	Joyful Honda Co Ltd	JP Morgan	5.127
1.300	Itochu Techno-Solutions Corp	Citibank	(234)	1.900	JSR Corp	JP Morgan	944
2.900	Itochu Techno-Solutions Corp	HSBC	(1.380)	300	Juki Corp	JP Morgan	(64)
100	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Citibank	41	8.700	JVC Kenwood Corp	Citibank	(780)
(2.600)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	HSBC	(841)	(6.700)	JXTG Holdings Inc	JP Morgan	47
200	Itoham Yonekyu Holdings Inc	JP Morgan	64	100	Kadokawa Dwango	Citibank	(14)
3.100	Itoki Corp	Citibank	(358)	2.600	Kadokawa Dwango	JP Morgan	(775)
500	Itoki Corp	JP Morgan	(147)	(400)	Kagome Co Ltd	Citibank	(412)
(100)	IwaiCosmo Holdings Inc	HSBC	58	(900)	Kagome Co Ltd	JP Morgan	(150)
(700)	IwaiCosmo Holdings Inc	JP Morgan	490	(400)	Kagome Co Ltd	HSBC	(71)
400	Iwatani Corp	HSBC	(624)	4.000	Kajima Corp	Citibank	(468)
3.700	Iyo Bank Ltd/The	JP Morgan	(3.374)	7.000	Kajima Corp	HSBC	(658)
(3.800)	Iyo Bank Ltd/The	JP Morgan	3.466	1.100	Kakaku.com Inc	JP Morgan	2.556
400	Izumi Co Ltd	HSBC	(1.010)	(800)	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	2.650
(1.200)	J Front Retailing Co Ltd	JP Morgan	581	400	Kamigumi Co Ltd	Citibank	148
(900)	J Trust Co Ltd	HSBC	(515)	700	Kamigumi Co Ltd	HSBC	(615)
(900)	J Trust Co Ltd	JP Morgan	(513)	1.100	Kamigumi Co Ltd	JP Morgan	(975)
(100)	J Trust Co Ltd	Citibank	20	200	Kanamic Network Co Ltd	Citibank	(408)
(400)	Jaccs Co Ltd	JP Morgan	74	200	Kanamoto Co Ltd	JP Morgan	244
400	Jaeco Co Ltd	JP Morgan	(729)	(7.000)	Kaneka Corp	JP Morgan	(1.387)
700	Japan Airlines Co Ltd	HSBC	672	300	Kanematsu Electronics Ltd	JP Morgan	(214)
(600)	Japan Airport Terminal Co Ltd	HSBC	(2.782)	(1.300)	Kansai Electric Power Co Inc/The	JP Morgan	296
(1.300)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Citibank	(1.195)	(1.100)	Kansai Mirai Financial Group Inc	Citibank	(107)
500	Japan Airport Terminal Co Ltd	Citibank	460	1.000	Kansai Paint Co Ltd	JP Morgan	187
(1.000)	Japan Asset Marketing Co Ltd	HSBC	(107)	(3.100)	Kansai Paint Co Ltd	JP Morgan	2.156
(2.100)	Japan Asset Marketing Co Ltd	JP Morgan	(224)	100	Kansai Super Market Ltd	JP Morgan	71
2.000	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Citibank	(1.019)	(200)	Kanto Denka Kogyo Co Ltd	HSBC	(216)
18.300	Japan Display Inc	HSBC	(2.914)	(1.000)	Kanto Denka Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(1.077)
700	Japan Drilling Co Ltd	Citibank	(858)	200	Kao Corp	Citibank	1.010
1.100	Japan Drilling Co Ltd	JP Morgan	(1.752)	(500)	Kao Corp	JP Morgan	(3.419)
(6.700)	Japan Exchange Group Inc	JP Morgan	(2.330)	1.900	Kappa Create Co Ltd	JP Morgan	(1.676)
(35)	Japan Hotel Investment Corp (Reit)	JP Morgan	(311)	100	Kasai Kogyo Co Ltd	Citibank	(84)
(200)	Japan Investment Adviser Co Ltd	HSBC	(804)	100	Kasai Kogyo Co Ltd	HSBC	(49)
(300)	Japan Investment Adviser Co Ltd	JP Morgan	(1.201)	200	Kasai Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(99)
(1.000)	Japan Lifeline Co Ltd	JP Morgan	(1.636)	100	Katakura Industries Co Ltd	HSBC	(60)
(300)	Japan Lifeline Co Ltd	Citibank	(409)	100	Kato Works Co Ltd	Citibank	(27)
(13.100)	Japan Post Holdings Co Ltd	JP Morgan	10.457	(100)	KAWADA TECHNOLOGIES Inc	JP Morgan	(129)
3.400	Japan Post Holdings Co Ltd	JP Morgan	(2.714)	(700)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	JP Morgan	909
(1.200)	Japan Post Insurance Co Ltd	HSBC	2.383	600	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Citibank	(1.271)
(1.000)	Japan Post Insurance Co Ltd	JP Morgan	1.994	(800)	KDDI Corp	JP Morgan	(142)
(5)	Japan Prime Realty Investment Corp (Reit)	JP Morgan	129	100	Keihin Corp	HSBC	(76)
32	Japan Retail Fund Investment Corp (Reit)	Citibank	(403)	(1.000)	Keihin Corp	JP Morgan	769
38	Japan Retail Fund Investment Corp (Reit)	HSBC	(1.006)	400	Keihin Corp	JP Morgan	(308)
44	Japan Retail Fund Investment Corp (Reit)	JP Morgan	(1.344)	600	Keikeyu Corp	Citibank	248
700	Japan Steel Works Ltd/The	Citibank	(1.903)	100	Keikeyu Corp	JP Morgan	(120)
(200)	Japan Steel Works Ltd/The	Citibank	544	(100)	Keio Corp	Citibank	(196)
(200)	Japan Steel Works Ltd/The	HSBC	888	(1.500)	Keio Corp	JP Morgan	(2.742)
				700	Keisei Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	589
				4.000	Keiyo Bank Ltd/The	HSBC	(422)
				3.100	Keiyo Co Ltd	Citibank	(280)
				2.100	Keiyo Co Ltd	JP Morgan	(509)
				3.400	Kenedix Inc	HSBC	2.045
				3.400	Kenedix Inc	Citibank	111

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(7.700)	Kenedix Inc	JP Morgan	(4.617)	100	KYORIN Holdings Inc	JP Morgan	115
(19)	Kenedix Retail Corp (Reit)	JP Morgan	(2.119)	100	KYORIN Holdings Inc	Citibank	(112)
(800)	Kenko Mayonnaise Co Ltd	Citibank	(3.343)	700	KYORIN Holdings Inc	HSBC	806
(500)	Kenko Mayonnaise Co Ltd	JP Morgan	(1.009)	900	Kyowa Exeo Corp	HSBC	756
(200)	Kenko Mayonnaise Co Ltd	HSBC	(406)	800	Kyowa Exeo Corp	JP Morgan	665
900	Kewpie Corp	JP Morgan	88	(700)	Kyowa Exeo Corp	JP Morgan	(582)
(100)	KH Neochem Co Ltd	Citibank	158	1.200	Kyowa Hakko Kirin Co Ltd	Citibank	(101)
(400)	KH Neochem Co Ltd	JP Morgan	636	(2.400)	Kyudenko Corp	JP Morgan	(2.315)
(2.300)	Ki-Star Real Estate Co Ltd	Citibank	1.817	(4.800)	Kyushu Financial Group Inc	Citibank	1.315
(100)	Ki-Star Real Estate Co Ltd	HSBC	153	(2.100)	Kyushu Financial Group Inc	HSBC	573
(100)	Ki-Star Real Estate Co Ltd	JP Morgan	154	600	Kyushu Financial Group Inc	JP Morgan	(102)
800	Kikkoman Corp	JP Morgan	2.015	100	LAC Co Ltd	JP Morgan	76
300	Kinden Corp	HSBC	(236)	2.900	Leopalace21 Corp	Citibank	(3.235)
(600)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	(560)	(2.200)	LIFULL Co Ltd	JP Morgan	3.658
300	Kirin Holdings Co Ltd	Citibank	540	(300)	LINE Corp	HSBC	151
5.300	Kirin Holdings Co Ltd	JP Morgan	2.131	(500)	LINE Corp	JP Morgan	257
1.700	Kirin Holdings Co Ltd	HSBC	699	(600)	LINE Corp	Citibank	(639)
300	Kisoji Co Ltd	JP Morgan	239	(300)	Link And Motivation Inc	JP Morgan	(696)
300	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(71)	(400)	Lintec Corp	HSBC	(151)
1.400	Kitanotsujin Corp	Citibank	214	(1.800)	Lintec Corp	JP Morgan	(661)
300	Kitanotsujin Corp	HSBC	130	(100)	Lintec Corp	Citibank	50
500	Kitz Corp	Citibank	(159)	100	Lion Corp	JP Morgan	(317)
(1.200)	Kiyo Bank Ltd/The	JP Morgan	(701)	(900)	LIXIL Group Corp	JP Morgan	920
(500)	KLab Inc	Citibank	311	400	M&A Capital Partners Co Ltd	JP Morgan	5.580
(200)	KNT-CT Holdings Co Ltd	JP Morgan	442	100	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc	JP Morgan	(21)
900	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	380	100	Maeda Road Construction Co Ltd	Citibank	(115)
800	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	361	3.000	Makino Milling Machine Co Ltd	Citibank	(1.523)
200	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	8	1.000	Mandom Corp	Citibank	(98)
(600)	Kobe Bussan Co Ltd	JP Morgan	(525)	100	Mandom Corp	JP Morgan	(154)
(1.400)	Koito Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(6.529)	(700)	Mars Engineering Corp	JP Morgan	(1.168)
100	Kokuyo Co Ltd	JP Morgan	33	200	Marubeni Corp	Citibank	(46)
(300)	KOMEDA Holdings Co Ltd	HSBC	33	(1.700)	Marui Group Co Ltd	JP Morgan	334
(300)	KOMEDA Holdings Co Ltd	JP Morgan	35	200	Maruwa Co Ltd/Aichi	JP Morgan	(1.299)
400	Komeri Co Ltd	JP Morgan	(313)	100	Matsuda Sangyo Co Ltd	Citibank	(53)
100	Komeri Co Ltd	Citibank	(71)	(3.200)	Matsui Securities Co Ltd	JP Morgan	(614)
100	Komori Corp	Citibank	(17)	1.200	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Citibank	(1.435)
100	Komori Corp	HSBC	(43)	600	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	HSBC	1.524
200	Komori Corp	JP Morgan	(87)	800	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	JP Morgan	2.020
300	Konami Holdings Corp	Citibank	(611)	100	Maxell Holdings Ltd	JP Morgan	1
(500)	Konami Holdings Corp	JP Morgan	1.310	500	Mazda Motor Corp	HSBC	(390)
900	Konami Holdings Corp	JP Morgan	(2.770)	1.000	Mazda Motor Corp	JP Morgan	(784)
300	Konami Holdings Corp	HSBC	(918)	900	Mazda Motor Corp	Citibank	(697)
1.600	Koshidaka Holdings Co Ltd	Citibank	1.645	(300)	MCJ Co Ltd	JP Morgan	(929)
(400)	Koshidaka Holdings Co Ltd	JP Morgan	4	(400)	Medical Data Vision Co Ltd	JP Morgan	235
(100)	Krosaki Harima Corp	JP Morgan	(585)	300	Medipal Holdings Corp	JP Morgan	493
100	Kubota Corp	HSBC	9	1.200	Medipal Holdings Corp	HSBC	1.979
(2.000)	Kumagai Gumi Co Ltd	JP Morgan	1.237	400	Medipal Holdings Corp	Citibank	(54)
(200)	Kumagai Gumi Co Ltd	HSBC	121	(900)	Medipal Holdings Corp	JP Morgan	334
(200)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	Citibank	16	(300)	Megachips Corp	Citibank	(299)
(200)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	HSBC	28	200	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Citibank	76
(600)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	JP Morgan	87	400	Megmilk Snow Brand Co Ltd	HSBC	(475)
3.200	Kuraray Co Ltd	JP Morgan	(3.170)	400	Megmilk Snow Brand Co Ltd	JP Morgan	(479)
4.900	Kuraray Co Ltd	Citibank	(2.951)	(1.800)	MEIJI Holdings Co Ltd	JP Morgan	(8.989)
(400)	Kureha Corp	JP Morgan	459	200	Meiko Network Japan Co Ltd	JP Morgan	4
3.000	Kurita Water Industries Ltd	HSBC	(6.436)	800	Meitec Corp	JP Morgan	(6.942)
1.000	Kurita Water Industries Ltd	JP Morgan	(2.156)	900	Meitec Corp	Citibank	(227)
600	Kurita Water Industries Ltd	Citibank	(271)	500	Meitec Corp	HSBC	(4.330)
(100)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	HSBC	(294)	(200)	METAWATER Co Ltd	Citibank	217
(800)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	JP Morgan	(2.335)	(200)	METAWATER Co Ltd	JP Morgan	343
(3.900)	Kyocera Corp	JP Morgan	6.511	200	Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd	HSBC	(135)
100	Kyodo Printing Co Ltd	JP Morgan	(408)	(700)	MINEBEA MITSUMI Inc	HSBC	1.017
100	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	HSBC	(12)	(400)	MINEBEA MITSUMI Inc	JP Morgan	419
300	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(38)	1.300	Miraca Holdings Inc	HSBC	(8.307)
				1.000	Miraca Holdings Inc	JP Morgan	(6.403)
				500	Miraca Holdings Inc	Citibank	(117)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
100	Mitsuba Corp	HSBC	(463)	(800)	NGK Spark Plug Co Ltd	JP Morgan	(175)
1.800	Mitsuba Corp	JP Morgan	(8.350)	600	NH Foods Ltd	Citibank	(55)
1.700	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Citibank	(322)	400	NH Foods Ltd	HSBC	(998)
3.700	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JP Morgan	(447)	(2.100)	NHK Spring Co Ltd	Citibank	1.800
2.300	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	HSBC	(271)	(2.100)	NHK Spring Co Ltd	HSBC	2.783
800	Mitsubishi Corp	HSBC	(865)	(600)	Nichi-iko Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	470
5.800	Mitsubishi Estate Co Ltd	JP Morgan	(693)	(500)	Nichiban Co Ltd	JP Morgan	2.569
2.500	Mitsubishi Estate Co Ltd	HSBC	(284)	800	Nichicon Corp	Citibank	(272)
(1.200)	Mitsubishi Estate Co Ltd	JP Morgan	49	1.100	Nichicon Corp	JP Morgan	1.105
(400)	Mitsubishi Logisnext Co Ltd	JP Morgan	(189)	300	Nichiden Corp	HSBC	(31)
600	Mitsubishi Materials Corp	JP Morgan	(1.489)	600	Nichiden Corp	JP Morgan	(66)
400	Mitsubishi Materials Corp	HSBC	(989)	200	Nichiden Corp	Citibank	(22)
400	Mitsubishi Materials Corp	Citibank	(388)	900	Nichirei Corp	HSBC	713
6.300	Mitsubishi Motors Corp	HSBC	(248)	100	Nichirin Co Ltd	JP Morgan	(265)
3.900	Mitsubishi Motors Corp	Citibank	(1.956)	(500)	Nidec Corp	JP Morgan	(1.013)
600	Mitsubishi Pencil Co Ltd	HSBC	157	200	Nidec Corp	HSBC	500
600	Mitsubishi Pencil Co Ltd	Citibank	(236)	700	Nifco Inc/Japan	Citibank	(1.049)
200	Mitsubishi Pencil Co Ltd	JP Morgan	51	(200)	Nifco Inc/Japan	Citibank	300
500	Mitsubishi Research Institute Inc	Citibank	1.933	(400)	Nifco Inc/Japan	HSBC	406
200	Mitsubishi Research Institute Inc	JP Morgan	1.024	(2.400)	Nifco Inc/Japan	JP Morgan	2.466
100	Mitsubishi Shokuhin Co Ltd	JP Morgan	(200)	100	Nihon Chouzai Co Ltd	HSBC	(303)
(100)	Mitsubishi Steel Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	228	700	Nihon Kohden Corp	JP Morgan	93
4.000	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	Citibank	811	2.000	Nihon M&A Center Inc	JP Morgan	5.268
800	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	HSBC	(1.394)	(700)	Nihon M&A Center Inc	JP Morgan	(1.844)
600	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	JP Morgan	(1.049)	100	Nihon M&A Center Inc	Citibank	167
(700)	Mitsui Chemicals Inc	JP Morgan	(97)	(2.200)	Nihon Parkerizing Co Ltd	JP Morgan	2.124
(4.400)	Mitsui E&S Holdings Co Ltd	JP Morgan	7.912	(300)	Nihon Trim Co Ltd	JP Morgan	188
(2.400)	Mitsui Fudosan Co Ltd	JP Morgan	4.383	(900)	Nihon Unisys Ltd	JP Morgan	(3.691)
(1)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (Reit)	JP Morgan	81	(2.000)	Nikkon Holdings Co Ltd	HSBC	176
(1.000)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	JP Morgan	(944)	(600)	Nikkon Holdings Co Ltd	Citibank	(119)
4.000	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Citibank	(307)	400	Nikon Corp	HSBC	(517)
13.000	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	JP Morgan	(2.312)	1.700	Nikon Corp	JP Morgan	(2.207)
(1.100)	Mixi Inc	JP Morgan	3.215	300	Nikon Corp	Citibank	(140)
700	Miyakoshi Holdings Inc	JP Morgan	81	(700)	Nippon Beet Sugar Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	1.086
(100)	Miyazaki Bank Ltd/The	JP Morgan	35	4	Nippon Building Fund Inc (Reit)	Citibank	(61)
200	Mizuno Corp	HSBC	707	(100)	Nippon Chemical Industrial Co Ltd	HSBC	(1.311)
200	Mizuno Corp	JP Morgan	704	(400)	Nippon Chemical Industrial Co Ltd	JP Morgan	(5.240)
(800)	Modex Inc	JP Morgan	1.166	(900)	Nippon Commercial Development Co Ltd	Citibank	(1.010)
(7.900)	Monex Group Inc	HSBC	4.686	(7.400)	Nippon Commercial Development Co Ltd	JP Morgan	3.415
(600)	Monex Group Inc	JP Morgan	357	(4.400)	Nippon Denko Co Ltd	Citibank	702
700	MonotaRO Co Ltd	JP Morgan	1.693	(1.800)	Nippon Denko Co Ltd	JP Morgan	536
(100)	MonotaRO Co Ltd	JP Morgan	(221)	(500)	Nippon Gas Co Ltd	JP Morgan	(1.088)
4	Mori Trust Sogo Inc (Reit)	JP Morgan	3	(2)	NIPPON Investment Corp (Reit)	HSBC	(68)
8	Mori Trust Sogo Inc (Reit)	Citibank	347	(14)	NIPPON Investment Corp (Reit)	JP Morgan	(461)
(2.600)	Morinaga & Co Ltd/Japan	JP Morgan	(1.667)	100	Nippon Kanza Co Ltd	JP Morgan	77
(1.600)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	JP Morgan	5.276	2.900	Nippon Kayaku Co Ltd	HSBC	(4.172)
(600)	Musashino Bank Ltd/The	JP Morgan	349	3.600	Nippon Kayaku Co Ltd	JP Morgan	(2.881)
3.400	Nagase & Co Ltd	JP Morgan	(3.783)	8.600	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	HSBC	(3.288)
1.000	Nagase & Co Ltd	Citibank	(780)	(3.800)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	JP Morgan	(2.852)
(1.600)	Nagoya Railroad Co Ltd	JP Morgan	757	100	Nippon Paper Industries Co Ltd	Citibank	(119)
(900)	Namura Shipbuilding Co Ltd	JP Morgan	1.160	(200)	Nippon Pillar Packing Co Ltd	JP Morgan	(66)
(2.500)	Nankai Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	(563)	(26)	Nippon Prologis Inc (Reit)	JP Morgan	1.792
(200)	Nankai Electric Railway Co Ltd	Citibank	(68)	900	Nippon Seiki Co Ltd	Citibank	(147)
(200)	Nankai Electric Railway Co Ltd	HSBC	(47)	200	Nippon Seiki Co Ltd	JP Morgan	(339)
900	NEC Networks & System Integration Corp	JP Morgan	(2.114)	800	Nippon Sheet Glass Co Ltd	JP Morgan	1.462
(1.300)	Nexon Co Ltd	JP Morgan	(440)	2.400	Nippon Shokubai Co Ltd	JP Morgan	26.423
1.700	NGK Insulators Ltd	Citibank	(1.329)	800	Nippon Shokubai Co Ltd	Citibank	5.677
200	NGK Insulators Ltd	HSBC	(104)	(8.800)	Nippon Signal Company Ltd	JP Morgan	6.634
900	NGK Spark Plug Co Ltd	Citibank	(1.733)	1.000	Nippon Soda Co Ltd	JP Morgan	(240)
				(1.900)	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	JP Morgan	2.563

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(500)	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	Citibank	627	400	OBIC Business Consultants Co Ltd	HSBC	1.364
1.500	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	Citibank	(1.881)	(200)	OBIC Business Consultants Co Ltd	HSBC	(682)
(7.800)	Nippon Suisan Kaisha Ltd	JP Morgan	4.539	(100)	OBIC Business Consultants Co Ltd	JP Morgan	(339)
100	Nippon Systemware Co Ltd	HSBC	(62)	300	Obic Co Ltd	Citibank	1.109
200	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Citibank	(99)	800	Obic Co Ltd	HSBC	1.256
800	Nippon Telegraph & Telephone Corp	HSBC	(1.114)	1.600	Obic Co Ltd	JP Morgan	3.204
1.300	Nippon Telegraph & Telephone Corp	JP Morgan	(1.831)	1.000	Odakyu Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	(66)
(200)	Nippon Thompson Co Ltd	Citibank	234	(100)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd/The	Citibank	18
(300)	Nippon Thompson Co Ltd	HSBC	(185)	(200)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd/The	HSBC	(45)
(3.100)	Nippon Thompson Co Ltd	JP Morgan	(1.908)	(700)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd/The	JP Morgan	(151)
(1.200)	Nippon Yakin Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(425)	(5.000)	Oji Holdings Corp	JP Morgan	2.090
(2.200)	Nipro Corp	JP Morgan	4.292	(300)	Okabe Co Ltd	JP Morgan	128
(500)	Nipro Corp	HSBC	973	1.000	Oki Electric Industry Co Ltd	JP Morgan	(2.321)
(500)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Citibank	(108)	600	Oki Electric Industry Co Ltd	HSBC	(1.390)
(300)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	HSBC	565	(200)	Okumura Corp	JP Morgan	1.610
(1.600)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	JP Morgan	3.027	100	Olympus Corp	JP Morgan	(144)
(7.900)	Nishimatsu Construction Co Ltd	JP Morgan	(4.352)	1.100	Olympus Corp	Citibank	807
(16.700)	Nissan Motor Co Ltd	JP Morgan	4.185	(1.900)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(2.997)
(900)	Nissan Shatai Co Ltd	Citibank	286	900	Onward Holdings Co Ltd	Citibank	(107)
(1.000)	Nissan Shatai Co Ltd	HSBC	1.366	400	Onward Holdings Co Ltd	JP Morgan	(50)
(100)	Nissei Build Kogyo Co Ltd	HSBC	(52)	700	Onward Holdings Co Ltd	HSBC	(86)
(1.700)	Nissei Build Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(417)	300	Open Door Inc	Citibank	603
2.300	Nisshin Seifun Group Inc	JP Morgan	(2.257)	100	Open Door Inc	JP Morgan	90
900	Nisshin Seifun Group Inc	Citibank	579	(200)	Open House Co Ltd	JP Morgan	(1.510)
(1.300)	Nisshin Steel Co Ltd	JP Morgan	1.584	200	Optex Group Co Ltd	Citibank	141
(200)	Nisshinbo Holdings Inc	Citibank	239	(300)	Optorun Co Ltd	Citibank	(440)
(100)	Nisshinbo Holdings Inc	HSBC	239	(300)	Optorun Co Ltd	JP Morgan	(1.838)
(900)	Nisshinbo Holdings Inc	JP Morgan	1.238	1.300	Oracle Corp Japan	Citibank	(7.561)
500	Nissin Electric Co Ltd	Citibank	(185)	1.100	Oracle Corp Japan	JP Morgan	(6.360)
300	Nissin Electric Co Ltd	JP Morgan	(292)	(100)	Organo Corp	HSBC	160
(200)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	JP Morgan	76	(100)	Organo Corp	JP Morgan	161
300	Nisso Corp	JP Morgan	1.921	(2.600)	Orient Corp	Citibank	109
500	Nitori Holdings Co Ltd	JP Morgan	1.398	(23.900)	Orient Corp	HSBC	3.556
200	Nitori Holdings Co Ltd	HSBC	449	300	Oriental Land Co Ltd/Japan	Citibank	478
(1.400)	Nitto Denko Corp	JP Morgan	(98)	300	Oriental Land Co Ltd/Japan	JP Morgan	394
100	Nitto Denko Corp	HSBC	117	(200)	Oriental Land Co Ltd/Japan	JP Morgan	(195)
100	Nitto Kohki Co Ltd	JP Morgan	(187)	(3.700)	Osaka Gas Co Ltd	JP Morgan	(1.354)
(400)	Noevir Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.536)	(100)	Osaka Soda Co Ltd	HSBC	(143)
(1.200)	NOF Corp	JP Morgan	(3.367)	(100)	Osaka Soda Co Ltd	JP Morgan	(142)
400	NOK Corp	HSBC	(728)	(500)	Osaka Steel Co Ltd	JP Morgan	401
900	NOK Corp	JP Morgan	(1.644)	100	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	Citibank	(251)
3.600	NOK Corp	Citibank	(5.951)	100	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	JP Morgan	(91)
67	Nomura Real Estate Master Fund Inc (Reit)	Citibank	191	(500)	Osaki Electric Co Ltd	JP Morgan	(234)
46	Nomura Real Estate Master Fund Inc (Reit)	JP Morgan	243	100	OSG Corp	JP Morgan	(235)
38	Nomura Real Estate Master Fund Inc (Reit)	HSBC	(698)	(3.300)	OSJB Holdings Corp	HSBC	643
(500)	Noritsu Koki Co Ltd	JP Morgan	2.967	1.200	Otsuka Corp	HSBC	418
500	Noritz Corp	Citibank	(66)	1.100	Otsuka Corp	JP Morgan	369
700	Noritz Corp	JP Morgan	(995)	200	Otsuka Corp	Citibank	361
1.300	North Pacific Bank Ltd	JP Morgan	(27)	(900)	Otsuka Holdings Co Ltd	JP Morgan	1.544
6.600	North Pacific Bank Ltd	Citibank	(1.604)	(100)	Outsourcing Inc	HSBC	(99)
2.300	North Pacific Bank Ltd	HSBC	(45)	(700)	Outsourcing Inc	JP Morgan	(226)
700	NSD Co Ltd	Citibank	516	100	Oyo Corp*	Citibank	-
1.200	NSD Co Ltd	JP Morgan	697	(100)	Pacific Industrial Co Ltd	JP Morgan	22
1.200	NSK Ltd	HSBC	(2.329)	(200)	Pacific Metals Co Ltd	JP Morgan	(142)
1.100	NSK Ltd	JP Morgan	(2.140)	(100)	Pacific Metals Co Ltd	Citibank	292
2.200	NTN Corp	Citibank	(1.084)	100	PAL GROUP Holdings Co Ltd	JP Morgan	(109)
4.900	NTN Corp	HSBC	(612)	(300)	Paltac Corporation	JP Morgan	(2.754)
1.300	NTT Data Corp	Citibank	529	(2.300)	Parco Co Ltd	HSBC	1.272
900	NTT Data Corp	HSBC	68	(2.500)	Park24 Co Ltd	JP Morgan	2.031
400	NTT Data Corp	JP Morgan	204	300	Pasona Group Inc	Citibank	2
2.200	NTT Urban Development Corp	Citibank	365	(100)	PeptiDream Inc	Citibank	(91)
1.800	Obayashi Corp	JP Morgan	(572)	(800)	PeptiDream Inc	HSBC	(361)
3.200	Obayashi Corp	HSBC	(1.113)	600	PeptiDream Inc	JP Morgan	262
				(1.400)	Persol Holdings Co Ltd	JP Morgan	4.146
				100	Phil Co Inc	Citibank	509
				600	Pigeon Corp	Citibank	646

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(800)	Pilot Corp	JP Morgan	2.659	1.700	Sanwa Holdings Corp	HSBC	(3.225)
700	Pioneer Corp	Citibank	(48)	(100)	Sanyo Denki Co Ltd	JP Morgan	455
100	Plenus Co Ltd	Citibank	(7)	(900)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(478)
800	Plenus Co Ltd	JP Morgan	(506)	(600)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	802
1.000	Pola Orbis Holdings Inc	JP Morgan	3.539	(4.700)	SBI Holdings Inc/Japan	JP Morgan	(4.176)
8.200	Press Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(1.439)	1.000	SCSK Corp	HSBC	831
(400)	Pressance Corp	JP Morgan	(89)	100	SCSK Corp	JP Morgan	82
100	Prestige International Inc	HSBC	294	100	SCSK Corp	Citibank	64
4.000	Prima Meat Packers Ltd	JP Morgan	(619)	(400)	Secom Co Ltd	JP Morgan	609
100	Proto Corp	JP Morgan	148	(700)	Sega Sammy Holdings Inc	JP Morgan	(644)
500	Rakuten Inc	HSBC	(359)	(1.300)	Seibu Holdings Inc	JP Morgan	205
100	Rakuten Inc	JP Morgan	(72)	(100)	Seika Corp	HSBC	53
1.700	Rakuten Inc	Citibank	(369)	(200)	Seika Corp	JP Morgan	108
(100)	RaQualia Pharma Inc	Citibank	63	(9.500)	Seiko Epson Corp	JP Morgan	8.724
(300)	Raysum Co Ltd	JP Morgan	(1.267)	(800)	Seiko Holdings Corp	JP Morgan	1.751
(300)	Raysum Co Ltd	HSBC	(1.268)	100	Seiko PMC Corp	JP Morgan	(56)
(300)	Relia Inc	JP Morgan	(441)	(1.400)	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	660
(1.200)	Relo Group Inc	JP Morgan	(2.636)	(7)	Sekisui House Inc (Reit)	Citibank	(113)
400	Renaissance Inc	JP Morgan	984	(2)	Sekisui House Inc (Reit)	JP Morgan	(43)
(500)	Rengo Co Ltd	JP Morgan	(150)	300	Sekisui House Ltd	Citibank	(71)
1.700	ReproCELL Inc	Citibank	(642)	(6.900)	Sekisui House Ltd	JP Morgan	2.066
7.600	ReproCELL Inc	JP Morgan	(2.850)	500	Sekisui House Ltd	HSBC	(266)
5.700	Resona Holdings Inc	JP Morgan	(445)	2.300	Sekisui House Ltd	JP Morgan	(1.238)
1.200	Resorttrust Inc	HSBC	(3.485)	(2.400)	Sekisui House Ltd	Citibank	567
100	Rheon Automatic Machinery Co Ltd	JP Morgan	162	200	Sekisui Jushi Corp	JP Morgan	(74)
(2.800)	Ricoh Co Ltd	JP Morgan	1.368	14.700	Senshukai Co Ltd	Citibank	(1.800)
100	Ricoh Leasing Co Ltd	JP Morgan	(122)	700	Senshukai Co Ltd	HSBC	(336)
(3.400)	Right On Co Ltd	HSBC	835	700	Senshukai Co Ltd	JP Morgan	(337)
(100)	Riken Corp	JP Morgan	544	300	Seria Co Ltd	HSBC	(394)
(100)	Riken Keiki Co Ltd	HSBC	(139)	500	Seria Co Ltd	JP Morgan	(664)
600	Rinnai Corp	JP Morgan	(2.588)	1.300	Seria Co Ltd	Citibank	3.368
800	Rinnai Corp	Citibank	(563)	200	Seven & i Holdings Co Ltd	JP Morgan	81
(100)	Rohm Co Ltd	JP Morgan	277	(600)	Seven & i Holdings Co Ltd	JP Morgan	(153)
800	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	25	2.400	Seven Bank Ltd	HSBC	(599)
100	Roland DG Corp	Citibank	(105)	8.800	Seven Bank Ltd	Citibank	53
(100)	Rorze Corp	Citibank	11	900	Seven Bank Ltd	JP Morgan	(226)
(100)	RS Technologies Co Ltd	JP Morgan	139	(32.300)	Seven Bank Ltd	JP Morgan	8.104
(100)	Ryobi Ltd	Citibank	191	1.000	SG Holdings Co Ltd	JP Morgan	699
(100)	Ryobi Ltd	JP Morgan	(420)	200	SG Holdings Co Ltd	Citibank	(7)
100	Ryohin Keikaku Co Ltd	HSBC	(1.477)	(200)	Shikoku Bank Ltd/The	JP Morgan	141
200	Ryohin Keikaku Co Ltd	JP Morgan	(2.977)	(1.600)	Shikoku Electric Power Co Inc	JP Morgan	(232)
(1.200)	Sac's Bar Holdings Inc	Citibank	658	2.100	Shikoku Electric Power Co Inc	JP Morgan	305
(200)	Sac's Bar Holdings Inc	JP Morgan	207	(300)	Shima Seiki Manufacturing Ltd	JP Morgan	1.198
800	Saizeriya Co Ltd	Citibank	440	(200)	Shimadzu Corp	JP Morgan	(72)
700	Saizeriya Co Ltd	JP Morgan	(250)	(500)	Shimano Inc	JP Morgan	(3.182)
(1.100)	Sakai Chemical Industry Co Ltd	JP Morgan	1.147	2.300	Shimizu Corp	Citibank	(358)
(100)	Sakata Seed Corp	HSBC	(120)	100	Shimizu Corp	HSBC	16
(200)	Sakata Seed Corp	Citibank	(56)	2.100	Shimizu Corp	JP Morgan	329
(3.100)	Sakata Seed Corp	JP Morgan	(3.685)	600	Shinko Electric Industries Co Ltd	HSBC	(57)
400	San ju San Financial Group Inc	JP Morgan	140	(4.900)	Shinko Electric Industries Co Ltd	JP Morgan	476
(400)	San-A Co Ltd	JP Morgan	673	100	Shinoken Group Co Ltd	Citibank	(40)
(200)	SanBio Co Ltd	JP Morgan	102	(1.600)	Shinsei Bank Ltd	JP Morgan	(341)
300	Sanden Holdings Corp	HSBC	(411)	400	Shionogi & Co Ltd	Citibank	579
400	Sanden Holdings Corp	JP Morgan	(550)	100	Shionogi & Co Ltd	JP Morgan	52
200	Sanden Holdings Corp	Citibank	(569)	1.100	Ship Healthcare Holdings Inc	Citibank	482
(100)	Sanei Architecture Planning Co Ltd	Citibank	16	400	Ship Healthcare Holdings Inc	JP Morgan	785
(100)	Sanei Architecture Planning Co Ltd	JP Morgan	65	3.000	Shizuoka Bank Ltd/The	Citibank	(1.178)
1.000	Sanken Electric Co Ltd	Citibank	(285)	(200)	Shochiku Co Ltd	JP Morgan	1.442
1.000	Sanken Electric Co Ltd	HSBC	(722)	(1.400)	Showa Corp	JP Morgan	278
100	Sanki Engineering Co Ltd	Citibank	(30)	1.000	Showa Denko KK	JP Morgan	8.784
(1.100)	Sankyo Co Ltd	JP Morgan	(1.761)	100	Signpost Corp	Citibank	(72)
(700)	Sankyu Inc	JP Morgan	(3.716)	800	Signpost Corp	JP Morgan	(1.213)
1.200	Sanrio Co Ltd	HSBC	(360)	(1.000)	Sinfonia Technology Co Ltd	HSBC	(130)
(1.400)	Sanrio Co Ltd	Citibank	(426)	400	Sintokogio Ltd	JP Morgan	(488)
(100)	Sanshin Electronics Co Ltd*	Citibank	-	(20.000)	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	JP Morgan	1.586
(100)	Sanshin Electronics Co Ltd	HSBC	222	(400)	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	Citibank	43
(1.700)	Sanshin Electronics Co Ltd	JP Morgan	3.785	(1.400)	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	HSBC	109
1.300	Santen Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	478	(1.600)	Skylark Co Ltd	HSBC	(850)
				(11.200)	Skylark Co Ltd	Citibank	(6.609)

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(500)	SMS Co Ltd	JP Morgan	(1.305)	200	Sun-Wa Technos Corp	Citibank	(147)
700	SMS Co Ltd	JP Morgan	1.827	200	Sun-Wa Technos Corp	JP Morgan	(80)
(700)	SOFTBANK Corp ORD	JP Morgan	4.410	500	Sundrug Co Ltd	Citibank	(1.351)
(1.000)	Sohgo Security Services Co Ltd	JP Morgan	4.870	500	Suntory Beverage & Food Ltd	HSBC	(2.362)
6.000	Sojitz Corp	Citibank	(1.587)	2.500	Suruga Bank Ltd	JP Morgan	(3.669)
300	Solasia Pharma KK	JP Morgan	2	1.400	Suruga Bank Ltd	Citibank	(669)
(900)	Solasto Corp	Citibank	(5.163)	1.300	Suruga Bank Ltd	HSBC	(1.902)
(200)	Solasto Corp	HSBC	(1.404)	700	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	JP Morgan	1.306
(100)	Solasto Corp	JP Morgan	(701)	300	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	HSBC	564
200	SoldOut Inc	Citibank	336	(300)	Sysmex Corp	JP Morgan	(520)
100	Soliton Systems KK	Citibank	(5)	400	Systema Corp	Citibank	(179)
300	Soliton Systems KK	JP Morgan	(712)	(100)	T Hasegawa Co Ltd	JP Morgan	197
1.200	Sony Financial Holdings Inc	JP Morgan	(390)	2.300	T&D Holdings Inc	HSBC	(1.755)
300	Sosei Group Corp	Citibank	(263)	2.700	T&D Holdings Inc	JP Morgan	(2.075)
300	Sosei Group Corp	JP Morgan	(812)	1.400	T-Gaia Corp	Citibank	1.428
(1.500)	Sotetsu Holdings Inc	JP Morgan	68	600	T-Gaia Corp	HSBC	504
(1.100)	Square Enix Holdings Co Ltd	JP Morgan	(7.527)	100	T-Gaia Corp	JP Morgan	83
500	Square Enix Holdings Co Ltd	HSBC	1.153	300	Tachi-S Co Ltd	JP Morgan	(131)
300	ST Corp	Citibank	(52)	(2.000)	Tadano Ltd	JP Morgan	180
100	St Marc Holdings Co Ltd	Citibank	(18)	1.400	Tadano Ltd	JP Morgan	(126)
100	Stanley Electric Co Ltd	HSBC	(193)	(800)	Taihei Dengyo Kaisha Ltd	JP Morgan	(449)
800	Stanley Electric Co Ltd	JP Morgan	(1.557)	100	Taiho Kogyo Co Ltd	Citibank	(55)
400	Stanley Electric Co Ltd	Citibank	(603)	(100)	Taiko Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(47)
500	Star Micronics Co Ltd	HSBC	(471)	(400)	Taiyo Nippon Sanso Corp	Citibank	245
1.300	Star Micronics Co Ltd	Citibank	(1.116)	(200)	Taiyo Nippon Sanso Corp	HSBC	106
700	Star Micronics Co Ltd	JP Morgan	(663)	(2.400)	Taiyo Nippon Sanso Corp	JP Morgan	1.283
(2.100)	Start Today Co Ltd	JP Morgan	(6.321)	(1.000)	Taiyo Yuden Co Ltd	JP Morgan	(321)
(100)	Starts Corp Inc	Citibank	187	400	Takamatsu Construction Group Co Ltd	JP Morgan	(22)
(100)	Starts Corp Inc	HSBC	221	100	Takaoka Toko Co Ltd	JP Morgan	37
(800)	Starts Corp Inc	JP Morgan	1.478	100	Takaoka Toko Co Ltd	Citibank	32
(100)	Stella Chemifa Corp	Citibank	32	(1.200)	Takara Bio Inc	HSBC	(3.664)
(100)	Stella Chemifa Corp	HSBC	75	1.400	Takara Holdings Inc	Citibank	(216)
(100)	Stella Chemifa Corp	JP Morgan	76	100	Takara Standard Co Ltd	JP Morgan	(83)
1.000	Sugi Holdings Co Ltd	Citibank	1.043	1.500	Takasago Thermal Engineering Co Ltd	Citibank	(1.368)
100	Sugi Holdings Co Ltd	JP Morgan	120	3.100	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(2.699)
600	Sugi Holdings Co Ltd	HSBC	734	500	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	(748)
(7.000)	Sumitomo Bakelite Co Ltd	JP Morgan	(8.624)	(300)	Takeei Corp	Citibank	(93)
1.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Citibank	51	(100)	Takeei Corp*	HSBC	-
7.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	JP Morgan	1.551	500	Takuma Co Ltd	HSBC	286
(4.600)	Sumitomo Corp	JP Morgan	6.719	300	Takuma Co Ltd	Citibank	(16)
(1.700)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Citibank	(2.690)	200	Takuma Co Ltd	JP Morgan	114
(8.500)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	JP Morgan	(24.159)	400	Tatsuta Electric Wire and Cable Co Ltd	JP Morgan	(158)
800	Sumitomo Electric Industries Ltd	Citibank	(962)	(100)	Tayca Corp	HSBC	432
1.500	Sumitomo Electric Industries Ltd	HSBC	(311)	(500)	Tayca Corp	JP Morgan	1.600
7.600	Sumitomo Electric Industries Ltd	JP Morgan	(1.029)	(700)	TDK Corp	JP Morgan	(558)
1.300	Sumitomo Forestry Co Ltd	JP Morgan	(2.087)	(500)	TechnoPro Holdings Inc	JP Morgan	(755)
(600)	Sumitomo Heavy Industries Ltd	JP Morgan	972	1.200	Teijin Ltd	HSBC	(566)
(1.400)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	JP Morgan	6.480	(1.200)	Teikoku Sen-I Co Ltd	JP Morgan	(662)
500	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Citibank	(377)	(100)	Tekken Corp	JP Morgan	308
3.300	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	JP Morgan	139	(700)	THK Co Ltd	JP Morgan	(376)
(6.000)	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	JP Morgan	(960)	(600)	TIS Inc	JP Morgan	(439)
1.000	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	JP Morgan	(2.333)	400	TIS Inc	HSBC	3.049
1.200	Sumitomo Rubber Industries Ltd	HSBC	(898)	300	TIS Inc	Citibank	201
7.000	Sumitomo Warehouse Co Ltd/The	JP Morgan	(2.932)	(100)	Toa Corp/Tokyo	HSBC	183
10.000	Sumitomo Warehouse Co Ltd/The	HSBC	(4.165)	500	Toagosei Co Ltd	HSBC	199
(200)	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Citibank	(7)	2.500	Tobishima Corp	Citibank	69
(1.700)	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	HSBC	(313)	3.800	Tobishima Corp	JP Morgan	(213)
(200)	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	JP Morgan	(37)	800	Tobu Railway Co Ltd	Citibank	(407)
				(800)	Tobu Railway Co Ltd	JP Morgan	(155)
				500	TOC Co Ltd	HSBC	(438)
				800	TOC Co Ltd	JP Morgan	(703)
				1.000	TOC Co Ltd	Citibank	41
				(4.000)	Toda Corp	JP Morgan	(2.407)
				(500)	Toei Co Ltd	JP Morgan	1.392
				1.500	Toho Co Ltd/Tokyo	HSBC	(1.109)
				1.500	Toho Holdings Co Ltd	JP Morgan	(333)
				1.300	Toho Holdings Co Ltd	HSBC	(278)
				200	Toho Titanium Co Ltd	JP Morgan	(140)

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
300	Toho Titanium Co Ltd	Citibank	(271)	(800)	Toyoda Gosei Co Ltd	JP Morgan	411
700	Tokai Carbon Co Ltd	JP Morgan	4.698	100	Toyoda Gosei Co Ltd	Citibank	6
300	Tokai Corp/Gifu	Citibank	(126)	700	Toyoda Gosei Co Ltd	HSBC	(143)
500	TOKAI Holdings Corp	JP Morgan	116	800	Toyoda Gosei Co Ltd	JP Morgan	(171)
800	Tokai Rika Co Ltd	Citibank	(1.771)	400	Toyota Boshoku Corp	HSBC	(515)
1.200	Tokai Rika Co Ltd	JP Morgan	(1.654)	1.300	Toyota Boshoku Corp	JP Morgan	(1.682)
900	Tokai Rika Co Ltd	HSBC	(1.234)	1.700	Toyota Boshoku Corp	Citibank	(1.353)
(6.500)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	JP Morgan	927	(100)	Toyota Industries Corp	JP Morgan	362
300	Token Corp	Citibank	(266)	100	Toyota Tsusho Corp	Citibank	(281)
100	Token Corp	HSBC	(336)	500	Toyota Tsusho Corp	HSBC	(1.287)
100	Token Corp	JP Morgan	(340)	2.100	Toyota Tsusho Corp	JP Morgan	(5.432)
500	Tokio Marine Holdings Inc	JP Morgan	(45)	200	Trend Micro Inc/Japan	HSBC	(547)
(1.200)	Tokuyama Corp	JP Morgan	(1.306)	100	Trend Micro Inc/Japan	Citibank	7
700	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	JP Morgan	(443)	100	Trend Micro Inc/Japan	JP Morgan	(276)
400	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Citibank	(208)	(600)	Trend Micro Inc/Japan	JP Morgan	1.653
500	Tokyo Century Corp	JP Morgan	(1.828)	100	TS Tech Co Ltd	JP Morgan	49
1.600	Tokyo Dome Corp	Citibank	(211)	(600)	TS Tech Co Ltd	JP Morgan	601
300	Tokyo Dome Corp	HSBC	(87)	(700)	Tsubaki Nakashima Co Ltd	JP Morgan	(1.008)
3.600	Tokyo Dome Corp	JP Morgan	(1.056)	2.000	Tsubakimoto Chain Co	Citibank	(1.263)
(23.400)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	JP Morgan	9.784	300	Tsukishima Kikai Co Ltd	Citibank	380
100	Tokyo Electron Ltd	JP Morgan	(325)	(2.700)	Tsukuba Bank Ltd	HSBC	703
(900)	Tokyo Gas Co Ltd	JP Morgan	(382)	(300)	Tsukui Corp	JP Morgan	55
(200)	Tokyo Rope Manufacturing Co Ltd	Citibank	(74)	(400)	Tsumura & Co	JP Morgan	59
(600)	Tokyo Seimitsu Co Ltd	JP Morgan	2.008	1.000	Tsumura & Co	JP Morgan	(147)
(2.200)	Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	217	200	Tsuruha Holdings Inc	JP Morgan	(149)
500	Tokyo Tatemono Co Ltd	HSBC	(529)	(400)	Tsuruha Holdings Inc	JP Morgan	(652)
1.400	Tokyo Tatemono Co Ltd	JP Morgan	(1.487)	100	Tsutsumi Jewelry Co Ltd	Citibank	(60)
1.000	Tokyo Tatemono Co Ltd	Citibank	(283)	(100)	TV Asahi Holdings Corp	HSBC	196
(200)	Tokyotokeiba Co Ltd	Citibank	(362)	(1.200)	TV Asahi Holdings Corp	JP Morgan	2.365
(600)	Tokyotokeiba Co Ltd	HSBC	(1.482)	(800)	UACJ Corp	JP Morgan	2.533
(200)	Tokyotokeiba Co Ltd	JP Morgan	(491)	(1.300)	UKC Holdings Corp	JP Morgan	851
100	Tokyu Construction Co Ltd	Citibank	(58)	700	Ulvac Inc	HSBC	(8.218)
(1.900)	Tokyu Construction Co Ltd	JP Morgan	832	100	Ulvac Inc	JP Morgan	(1.176)
1.600	Tokyu Corp	Citibank	1.228	(100)	UMC Electronics Co Ltd	Citibank	217
4.600	Tokyu Fudosan Holdings Corp	JP Morgan	(1.947)	(400)	UMC Electronics Co Ltd	HSBC	609
200	Tokyu Fudosan Holdings Corp	HSBC	(84)	300	Unicharm Corp	HSBC	922
(400)	TOMONY Holdings Inc	JP Morgan	47	600	United Arrows Ltd	HSBC	(492)
200	Tomy Co Ltd	HSBC	(264)	(100)	UNITED Inc/Japan	JP Morgan	787
1.600	Tomy Co Ltd	JP Morgan	(2.119)	(300)	UNITED Inc/Japan	Citibank	(666)
1.400	Tomy Co Ltd	Citibank	(624)	(900)	Universal Entertainment Corp	JP Morgan	(2.205)
(1.400)	Tomy Co Ltd	JP Morgan	1.854	500	Universal Entertainment Corp	JP Morgan	1.225
300	Topcon Corp	JP Morgan	(553)	400	Unizo Holdings Co Ltd	Citibank	56
7.000	Toppan Printing Co Ltd	JP Morgan	(1.717)	500	Usen-Next Holdings Co Ltd	Citibank	(258)
1.000	Toppan Printing Co Ltd	HSBC	(243)	(2.200)	Ushio Inc	JP Morgan	3.356
7.000	Toppan Printing Co Ltd	Citibank	(510)	(1.200)	USS Co Ltd	JP Morgan	3.315
100	Topy Industries Ltd	JP Morgan	(161)	700	UT Group Co Ltd	Citibank	1.688
100	Topy Industries Ltd	HSBC	(160)	200	ValueCommerce Co Ltd	HSBC	(456)
(800)	Toridoll Holdings Corp	JP Morgan	3.003	(100)	Vector Inc	Citibank	39
800	Toridoll Holdings Corp	Citibank	(94)	700	VINX Corp	Citibank	(1.077)
100	Torii Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(43)	200	VINX Corp	JP Morgan	(460)
3.000	Toshiba Machine Co Ltd	Citibank	(1.418)	(100)	Vision Inc/Tokyo Japan	HSBC	(835)
(100)	Tosho Co Ltd	HSBC	247	(100)	Vision Inc/Tokyo Japan	JP Morgan	(834)
(100)	Tosho Co Ltd	JP Morgan	248	(600)	Wacoal Holdings Corp	JP Morgan	327
1.200	Tosoh Corp	Citibank	(383)	100	WATAMI Co Ltd	Citibank	22
1.700	Tosoh Corp	JP Morgan	(1.162)	400	WATAMI Co Ltd	HSBC	(484)
(500)	TOTO Ltd	JP Morgan	(125)	800	WATAMI Co Ltd	JP Morgan	(972)
(200)	Towa Bank Ltd/The	HSBC	375	100	WDB Holdings Co Ltd	JP Morgan	(601)
(200)	Towa Bank Ltd/The	Citibank	164	(600)	Welcia Holdings Co Ltd	JP Morgan	(981)
(4.400)	Towa Bank Ltd/The	JP Morgan	8.275	(600)	Wellnet Corp	JP Morgan	82
(100)	Toyo Kanetsu KK	JP Morgan	(388)	(100)	Wellnet Corp	Citibank	(33)
(900)	Toyo Kohan Co Ltd	JP Morgan	(20)	1.400	West Japan Railway Co	Citibank	1.434
1.300	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	JP Morgan	1.547	1.000	West Japan Railway Co	JP Morgan	(1.867)
1.900	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Citibank	236	600	West Japan Railway Co	HSBC	(1.105)
				(800)	YA-MAN Ltd	JP Morgan	(1.156)
				5.500	Yahoo Japan Corp	Citibank	240
				6.900	Yahoo Japan Corp	JP Morgan	(386)
				300	Yakult Honsha Co Ltd	Citibank	(217)
				600	Yakult Honsha Co Ltd	JP Morgan	(1.981)
				(200)	Yakuodo Co Ltd	JP Morgan	103
				(3.300)	Yamada Denki Co Ltd	JP Morgan	705
				1.600	Yamada Denki Co Ltd	HSBC	85

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Malaisie suite			
(200)	Yamagata Bank Ltd/The	JP Morgan	(1)	28.000	IGB Real Estate Investment Trust (Reit)	JP Morgan	1.113
1.000	Yamaguchi Financial Group Inc	Citibank	(412)	(63.800)	IHH Healthcare Bhd	JP Morgan	1.550
2.000	Yamaguchi Financial Group Inc	HSBC	(1.105)	(26.400)	IJM Corp Bhd	Citibank	2.499
(1.200)	Yamaha Corp	JP Morgan	141	2.850	Inari Amertron Bhd	Citibank	88
(900)	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	1.733	21.600	Inari Amertron Bhd	JP Morgan	2.365
(1.000)	Yamazaki Baking Co Ltd	JP Morgan	(397)	16.650	Inari Amertron Bhd	HSBC	1.819
1.800	Yamazen Corp	Citibank	(439)	(75.900)	IOI Properties Group Bhd	JP Morgan	(920)
4.900	Yamazen Corp	JP Morgan	241	(214.000)	IOI Properties Group Bhd	Citibank	1.897
600	Yamazen Corp	HSBC	32	(28.500)	Kossan Rubber Industries	Citibank	(4.131)
500	Yaskawa Electric Corp	JP Morgan	(408)	(24.000)	Kossan Rubber Industries	JP Morgan	(5.417)
(200)	Yaskawa Electric Corp	JP Morgan	163	(300)	Kuala Lumpur Kepong Bhd	JP Morgan	51
(5.100)	Yokohama Reito Co Ltd	Citibank	(865)	(1.000)	Kuala Lumpur Kepong Bhd	HSBC	174
(3.000)	Yokohama Reito Co Ltd	JP Morgan	932	135.800	Malakoff Corp Bhd	Citibank	(1.465)
(4.300)	Yokohama Rubber Co Ltd/The	JP Morgan	6.810	474.900	Malakoff Corp Bhd	JP Morgan	(4.996)
(700)	Yondoshi Holdings Inc	JP Morgan	(941)	23.700	Malakoff Corp Bhd	HSBC	(252)
300	Yossix Co Ltd	Citibank	991	100	Malayan Banking Bhd	Citibank	(32)
100	Yossix Co Ltd	JP Morgan	117	26.200	Malayan Banking Bhd	HSBC	(7.432)
100	Yuasa Trading Co Ltd	HSBC	109	2.300	Malayan Banking Bhd	JP Morgan	(649)
100	Yuasa Trading Co Ltd	JP Morgan	108	500	Malaysia Airports Holdings Bhd	HSBC	(75)
100	Yuasa Trading Co Ltd	Citibank	(61)	600	Malaysia Airports Holdings Bhd	JP Morgan	(89)
(700)	Yumeshin Holdings Co Ltd	Citibank	347	1.900	Malaysia Airports Holdings Bhd	Citibank	(296)
(600)	Yumeshin Holdings Co Ltd	JP Morgan	649	2.600	Maxis Bhd	Citibank	(12)
(200)	Yushin Precision Equipment Co Ltd	Citibank	103	8.100	My EG Services Bhd	HSBC	(1.757)
(600)	Zenkoku Hosho Co Ltd	Citibank	(1.336)	37.700	My EG Services Bhd	Citibank	(455)
300	Zenkoku Hosho Co Ltd	Citibank	668	56.500	My EG Services Bhd	JP Morgan	(22.096)
(1.400)	Zensho Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.927)	(1.400)	Nestle Malaysia Bhd	JP Morgan	(594)
1.200	Zeon Corp	Citibank	(253)	24.400	Padini Holdings Bhd	Citibank	2.283
1.800	Zeon Corp	HSBC	(1.058)	22.300	Padini Holdings Bhd	HSBC	6.681
200	Zeon Corp	JP Morgan	(19)	10.400	Padini Holdings Bhd	JP Morgan	3.123
100	ZERIA Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	23	(8.900)	Pentamaster Corp Bhd	Citibank	(118)
200	ZERIA Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(96)	4.300	Petronas Dagangan Bhd	JP Morgan	(1.636)
2.400	ZIGExN Co Ltd	HSBC	281	(11.200)	Pos Malaysia Bhd	Citibank	654
			(112.514)	(6.900)	Pos Malaysia Bhd	JP Morgan	275
				300	PPB Group Bhd	Citibank	(6)
				300	PPB Group Bhd	JP Morgan	46
				(48.300)	Press Metal Aluminium Holdings Bhd	Citibank	66
3.300	Astro Malaysia Holdings Bhd	Citibank	(112)	(112.800)	Press Metal Aluminium Holdings Bhd	JP Morgan	3.320
10.600	Astro Malaysia Holdings Bhd	HSBC	(1.186)	(1.100)	Public Bank Bhd	Citibank	203
209.600	Astro Malaysia Holdings Bhd	JP Morgan	(23.389)	(6.100)	Public Bank Bhd	JP Morgan	1.438
(5.000)	Axiata Group Bhd	Citibank	913	7.900	Public Bank Bhd	JP Morgan	(406)
(140.900)	Axiata Group Bhd	JP Morgan	34.370	8.900	Public Bank Bhd	Citibank	(3.181)
14.100	Berjaya Corp Bhd	Citibank	(110)	200	Public Bank Bhd	HSBC	(11)
18.400	Berjaya Corp Bhd	JP Morgan	(80)	(66.700)	Sapura Energy Bhd	JP Morgan	2.531
(7.000)	British American Tobacco Malaysia Bhd	Citibank	3.398	(74.900)	Sime Darby Bhd	Citibank	6.759
(6.800)	British American Tobacco Malaysia Bhd	JP Morgan	(16.171)	(69.200)	Sime Darby Bhd	JP Morgan	4.708
11.250	Bursa Malaysia Bhd	JP Morgan	633	(28.300)	Sime Darby Plantation Bhd	JP Morgan	(412)
24.150	Bursa Malaysia Bhd	Citibank	(2.768)	30.700	Sime Darby Plantation Bhd	JP Morgan	447
31.650	Bursa Malaysia Bhd	HSBC	1.745	(22.300)	SP Setia Bhd Group	Citibank	787
29.700	Dialog Group Bhd	JP Morgan	(433)	(45.120)	Sunway Bhd	JP Morgan	(4.138)
(102.300)	DRB-Hicom Bhd	Citibank	147	(129.633)	Sunway Bhd	JP Morgan	2.993
(284.700)	DRB-Hicom Bhd	JP Morgan	29.801	2.000	Sunway Construction Group Bhd	JP Morgan	(336)
7.800	Felda Global Ventures Holdings Bhd	JP Morgan	(103)	11.500	Sunway Construction Group Bhd	Citibank	(741)
2.400	Felda Global Ventures Holdings Bhd	HSBC	(32)	58.700	Supermax Corp Bhd	Citibank	(3.848)
300	Fraser & Neave Holdings Bhd	Citibank	56	8.700	Supermax Corp Bhd	HSBC	319
80.200	Gamuda Bhd	HSBC	(36.321)	102.200	Supermax Corp Bhd	JP Morgan	3.790
29.400	Gamuda Bhd	JP Morgan	(13.292)	(12.100)	Tenaga Nasional Bhd	Citibank	3.011
(9.400)	Gamuda Bhd	JP Morgan	4.250	(7.400)	Tenaga Nasional Bhd	HSBC	3.335
22.400	Genting Bhd	Citibank	685	16.700	Tenaga Nasional Bhd	HSBC	(5.564)
(2.100)	Genting Malaysia Bhd	Citibank	72	55.800	Tenaga Nasional Bhd	JP Morgan	(7.738)
(3.000)	Genting Malaysia Bhd	HSBC	69	15.900	Top Glove Corp Bhd	Citibank	(134)
(43.900)	Genting Malaysia Bhd	JP Morgan	980	600	Top Glove Corp Bhd	HSBC	54
(21.200)	HAP Seng Consolidated Bhd	JP Morgan	(134)	4.000	Top Glove Corp Bhd	JP Morgan	366
(1.800)	HAP Seng Consolidated Bhd	Citibank	5	(2.100)	UMW Holdings Bhd	HSBC	(78)
(45.100)	Hartalega Holdings Bhd	JP Morgan	(2.207)	(6.100)	UMW Holdings Bhd	Citibank	340
(3.200)	Hengyuan Refining Co Bhd	Citibank	501	1.100	Unisem M Bhd	HSBC	159
9.900	Hengyuan Refining Co Bhd	HSBC	(3.396)				

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Malaisie suite				Singapour suite			
69.600	Unisem M Bhd	JP Morgan	10.075	(40.100)	China Aviation Oil Singapore Corp Ltd	Citibank	(249)
(38)	Velesto Energy Bhd*	HSBC	—	13.600	China Sunsine Chemical Holdings Ltd	JP Morgan	415
27.700	Velesto Energy Bhd	JP Morgan	(50)	(121.500)	Chip Eng Seng Corp Ltd	Citibank	1.877
(28.750)	VS Industry Bhd	Citibank	261	(46.200)	Chip Eng Seng Corp Ltd	HSBC	605
(2.217)	WCT Holdings Bhd	Citibank	10	(55.200)	Chip Eng Seng Corp Ltd	JP Morgan	854
			(31.584)	(14.800)	City Developments Ltd	JP Morgan	8.181
Philippines				(9.700)	City Developments Ltd	HSBC	5.353
(81.930)	Aboitiz Equity Ventures Inc	JP Morgan	7.159	10.900	ComfortDelGro Corp Ltd	HSBC	619
290	Ayala Corp	HSBC	(38)	47.000	ComfortDelGro Corp Ltd	Citibank	2.369
1.925	Ayala Corp	JP Morgan	(256)	36.700	ComfortDelGro Corp Ltd	JP Morgan	2.978
165	Ayala Corp	Citibank	(60)	2.600	Dairy Farm International Holdings Ltd	JP Morgan	737
11.600	Ayala Land Inc	HSBC	(178)	(2.600)	DBS Group Holdings Ltd	JP Morgan	1.781
73.200	Ayala Land Inc	JP Morgan	(1.135)	(5.400)	Ezion Holdings Ltd*	HSBC	—
98.600	Ayala Land Inc	Citibank	(4.463)	(6.480)	Ezion Holdings Ltd*	JP Morgan	—
(102)	Bank of the Philippine Islands	JP Morgan	7	(20.340)	Ezion Holdings Ltd*	Citibank	—
8.100	Bloomerry Resorts Corp	Citibank	(164)	(2.100)	First Resources Ltd	HSBC	20
11.900	Bloomerry Resorts Corp	HSBC	(324)	294.700	Genting Singapore Plc	JP Morgan	1.994
(44.900)	DMCI Holdings Inc	JP Morgan	(176)	32.900	Genting Singapore Plc	HSBC	(461)
(5.520)	International Container Terminal Services Inc	JP Morgan	(56)	121.900	Genting Singapore Plc	Citibank	(4.067)
(10.080)	JG Summit Holdings Inc	JP Morgan	996	(475.800)	Golden Agri-Resources Ltd	HSBC	17.960
(1.070)	JG Summit Holdings Inc	HSBC	105	(570.000)	Golden Agri-Resources Ltd	JP Morgan	21.574
1.380	Jollibee Foods Corp	JP Morgan	(199)	(33.900)	Hi-P International Ltd	HSBC	665
3.420	Jollibee Foods Corp	HSBC	(489)	(1.100)	Hi-P International Ltd	JP Morgan	27
1.380	Jollibee Foods Corp	Citibank	(303)	(2.100)	Hongkong Land Holdings Ltd	JP Morgan	189
4.300	LT Group Inc	Citibank	(72)	(400)	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	JP Morgan	26
2.600	LT Group Inc	JP Morgan	(66)	(184.000)	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	HSBC	11.960
920	Manila Electric Co	JP Morgan	(129)	(2.900)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	HSBC	578
9.400	Melco Resorts And Entertainment Philippines Corp	JP Morgan	(102)	(4.200)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	JP Morgan	1.271
(2.850)	Metropolitan Bank & Trust Co	JP Morgan	226	(1.200)	Jardine Matheson Holdings Ltd	HSBC	938
(1.150)	Security Bank Corp	HSBC	100	(3.000)	Jardine Matheson Holdings Ltd	JP Morgan	2.563
(8.740)	Security Bank Corp	JP Morgan	770	(600)	Jardine Strategic Holdings Ltd	HSBC	540
(2.440)	SM Investments Corp	JP Morgan	2.258	(4.300)	Jardine Strategic Holdings Ltd	JP Morgan	3.870
(12.910)	Universal Robina Corp	JP Morgan	3.639	10.300	Keppel Corp Ltd	JP Morgan	(2.579)
(7.550)	Universal Robina Corp	HSBC	2.124	3.200	Keppel Corp Ltd	HSBC	(794)
			9.174	(45.800)	Keppel DC (Reit)	JP Morgan	(594)
Singapour				(14.400)	Keppel DC (Reit)	Citibank	(522)
6.700	APAC Realty Ltd	Citibank	(155)	21.700	M1 Ltd/Singapore	JP Morgan	15
(11.700)	Ascendas Real Estate Investment Trust (Reit)	HSBC	90	57.500	M1 Ltd/Singapore	Citibank	780
(7.600)	Ascott Residence Trust (Reit)	Citibank	120	(42.300)	Mapletree Commercial Trust (Reit)	JP Morgan	1.044
(55.300)	Ascott Residence Trust (Reit)	HSBC	896	48.900	Mapletree Commercial Trust (Reit)	HSBC	(1.184)
(3.400)	Best World International Ltd	Citibank	(160)	79.800	Mapletree Commercial Trust (Reit)	JP Morgan	(1.922)
17.400	Best World International Ltd	Citibank	503	5.900	Mapletree Industrial Trust (Reit)	Citibank	35
500	Bukit Sembawang Estates Ltd	JP Morgan	(31)	27.500	Mapletree Industrial Trust (Reit)	JP Morgan	(77)
600	Bukit Sembawang Estates Ltd	Citibank	(43)	(24.400)	Mapletree Logistics Trust (Reit)	HSBC	421
(3.400)	Cache Logistics Trust (Reit)	JP Morgan	17	182.300	Mapletree North Asia Commercial Trust (Reit)	JP Morgan	3.790
36.900	CapitaLand Commercial Trust (Reit)	HSBC	(885)	58.900	Mapletree North Asia Commercial Trust (Reit)	HSBC	1.243
19.000	CapitaLand Commercial Trust (Reit)	Citibank	92	81.500	Mapletree North Asia Commercial Trust (Reit)	Citibank	(74)
83.100	CapitaLand Commercial Trust (Reit)	JP Morgan	(574)	(3.600)	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	JP Morgan	1.089
(6.500)	CapitaLand Ltd	JP Morgan	520	400	Parkway Life Real Estate Investment Trust (Reit)	Citibank	14
(124.200)	CapitaLand Mall Trust (Reit)	JP Morgan	381	(84.600)	Sembcorp Industries Ltd	HSBC	8.506
(137.100)	CapitaLand Mall Trust (Reit)	HSBC	858	(27.600)	Sembcorp Industries Ltd	JP Morgan	2.799
6.300	CapitaLand Mall Trust (Reit)	HSBC	(15)	14.700	Sembcorp Marine Ltd	HSBC	354
54.700	CapitaLand Mall Trust (Reit)	JP Morgan	(161)	(19.500)	Sembcorp Marine Ltd	Citibank	2.073
1.800	CapitaLand Retail China Trust (Reit)	Citibank	38	(14.000)	Sembcorp Marine Ltd	JP Morgan	(481)
(27.000)	CDL Hospitality Trusts	HSBC	1.036	128.000	Sheng Siong Group Ltd	Citibank	856
(8.500)	CDL Hospitality Trusts	JP Morgan	223	248.100	Sheng Siong Group Ltd	JP Morgan	3.355
(8.400)	CDL Hospitality Trusts	Citibank	74	15.100	Singapore Airlines Ltd	HSBC	160
(17.100)	China Aviation Oil Singapore Corp Ltd	HSBC	(863)				

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

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(4.884)	Deutsch Motors Inc	Citibank	(569)	(621)	HAESUNG DS Co Ltd	Citibank	34
(3.692)	Dexter Studios Co Ltd	JP Morgan	1.856	(376)	HAESUNG DS Co Ltd	JP Morgan	77
(2.483)	Dexter Studios Co Ltd	Citibank	893	477	Hana Financial Group Inc	JP Morgan	(1.662)
(830)	DGB Financial Group Inc	JP Morgan	742	(202)	Hana Tour Service Inc	JP Morgan	355
(2.814)	DIO Corp	Citibank	1.455	(253)	Hana Tour Service Inc	HSBC	(347)
(496)	DIO Corp	JP Morgan	1.289	837	Hanall Biopharma Co Ltd	Citibank	2.810
102	Dong-A Socio Holdings Co Ltd	HSBC	(253)	(84)	Hanall Biopharma Co Ltd	Citibank	(282)
89	Dong-A ST Co Ltd	Citibank	(195)	(146)	Hanall Biopharma Co Ltd	JP Morgan	(598)
78	Dongjin Semichem Co Ltd	Citibank	(15)	(48)	Hancom Inc	Citibank	14
541	DongKook Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	(711)	(151)	Hancom Inc	HSBC	288
548	Dongkuk Steel Mill Co Ltd	JP Morgan	(236)	238	Handok Inc	HSBC	516
771	Dongsuh Cos Inc	HSBC	(911)	(228)	Hanil Cement Co Ltd	Citibank	(1.953)
(16.279)	DONGSUNG Corp	JP Morgan	7.378	(2.744)	Hanjin Kal Corp	Citibank	(5.786)
(9.516)	DONGSUNG Corp	Citibank	4.445	(117)	Hanjin Kal Corp	JP Morgan	(249)
(526)	Dongsung Finetec Co Ltd	Citibank	(42)	391	Hankook Tire Co Ltd	JP Morgan	(1.546)
(2.677)	Dongsung Finetec Co Ltd	JP Morgan	(1.147)	(1.115)	Hankook Tire Co Ltd	HSBC	5.394
182	Dongwon Industries Co Ltd	JP Morgan	(1.423)	(1.006)	Hankook Tire Co Ltd	Citibank	4.093
659	Doosan Bobcat Inc	HSBC	1.338	(297)	Hankook Tire Co Ltd	JP Morgan	1.491
2.484	Doosan Bobcat Inc	JP Morgan	4.747	(83)	Hanmi Pharm Co Ltd	JP Morgan	(3.037)
152	Doosan Corp	Citibank	(1.231)	(140)	Hanmi Pharm Co Ltd	Citibank	(864)
172	Doosan Corp	JP Morgan	(681)	2.284	Hanon Systems	HSBC	(1.630)
(4.832)	Doosan Engine Co Ltd	Citibank	(748)	(1.299)	Hanon Systems	HSBC	927
(1.905)	Doosan Heavy Industries & Construction Co Ltd	Citibank	1.329	(66)	Hanon Systems	JP Morgan	50
(36)	Doosan Heavy Industries & Construction Co Ltd	HSBC	(13)	(406)	Hansol Chemical Co Ltd	Citibank	(1.084)
(94)	Doosan Heavy Industries & Construction Co Ltd	JP Morgan	(28)	(36)	Hansol Chemical Co Ltd	JP Morgan	(261)
6.892	Doosan Infracore Co Ltd	Citibank	(3.348)	12.999	Hansol Technics Co Ltd	JP Morgan	(14.052)
(2.748)	Doosan Infracore Co Ltd	Citibank	1.335	(193)	Hanssem Co Ltd	JP Morgan	(1.140)
(2.140)	Doosan Infracore Co Ltd	JP Morgan	(372)	(380)	Hanssem Co Ltd	Citibank	(448)
4.587	Doosan Infracore Co Ltd	JP Morgan	797	(591)	Hanssem Co Ltd	HSBC	(3.727)
(815)	DoubleUGames Co Ltd	Citibank	2.011	(343)	Hanwha Aerospace Co Ltd	JP Morgan	(1.739)
(660)	DoubleUGames Co Ltd	HSBC	1.248	(1.025)	Hanwha Aerospace Co Ltd	Citibank	(4.629)
(770)	DoubleUGames Co Ltd	JP Morgan	1.623	(62)	Hanwha Aerospace Co Ltd	HSBC	(297)
1.322	Douzone Bizon Co Ltd	HSBC	(4.130)	910	Hanwha Chemical Corp	Citibank	(1.295)
469	Douzone Bizon Co Ltd	Citibank	(367)	56	Hanwha Galleria Timeworld Co Ltd	JP Morgan	(40)
(320)	Duk San Neolux Co Ltd	JP Morgan	(306)	12.785	Hanwha Life Insurance Co Ltd	HSBC	(4.546)
37	e Tec E&C Ltd	HSBC	(264)	1	Hanwha Life Insurance Co Ltd*	JP Morgan	-
(2.777)	Ecopro Co Ltd	Citibank	(747)	233	HLB Inc	Citibank	4.816
(1.411)	ELP Corp	JP Morgan	(1.536)	52	HLB Inc	JP Morgan	1.745
(562)	EM-Tech Co Ltd	JP Morgan	(954)	(195)	Hotel Shilla Co Ltd	HSBC	(154)
(93)	Eo Technics Co Ltd	HSBC	(672)	(4)	Hotel Shilla Co Ltd	Citibank	(4)
(168)	Eo Technics Co Ltd	JP Morgan	(1.171)	3.845	Huchems Fine Chemical Corp	Citibank	(2.551)
(1.180)	Eo Technics Co Ltd	Citibank	784	(55)	Hugel Inc	JP Morgan	(217)
(378)	Eubiologics Co Ltd	Citibank	52	(4)	Hugel Inc	Citibank	3
4.296	Eugene Corp	JP Morgan	9.765	42	Hugel Inc	JP Morgan	367
(1.101)	Eugene Technology Co Ltd	Citibank	(45)	(308)	Humedix Co Ltd	Citibank	3.169
(3.332)	Eugene Technology Co Ltd	JP Morgan	(1.321)	(253)	Humedix Co Ltd	JP Morgan	433
1.417	F&F Co Ltd	JP Morgan	24.310	327	Huons Co Ltd	JP Morgan	3.094
1.280	Fila Korea Ltd	Citibank	2.452	(3.245)	Huvitz Co Ltd	JP Morgan	647
1.520	Fila Korea Ltd	HSBC	4.685	(772)	Huvitz Co Ltd	Citibank	(20)
(662)	Foosung Co Ltd	Citibank	48	(740)	Hwaseung Enterprise Co Ltd	Citibank	(75)
(2.888)	Foosung Co Ltd	JP Morgan	(49)	(1.684)	Hwaseung Enterprise Co Ltd	JP Morgan	(4.879)
651	G-treeBNT Co Ltd	Citibank	(211)	168	Hyosung Corp	JP Morgan	78
(3.155)	G-treeBNT Co Ltd	Citibank	1.023	(42)	Hyundai Construction Equipment Co Ltd	Citibank	198
(1.056)	Gamevil Inc	Citibank	(1.126)	(124)	Hyundai Construction Equipment Co Ltd	JP Morgan	1.061
(1.127)	GemVax & Kael Co Ltd	HSBC	1.627	4.522	Hyundai Corp	Citibank	(4.618)
212	Genexine Co Ltd	JP Morgan	862	(270)	Hyundai Department Store Co Ltd	JP Morgan	(2.222)
(317)	Genexine Co Ltd	Citibank	(638)	(344)	Hyundai Department Store Co Ltd	HSBC	(2.965)
5	Gigalane Co Ltd	Citibank	(1)	1.195	Hyundai Development Co-Engineering & Construction	JP Morgan	(65)
(1.316)	Grand Korea Leisure Co Ltd	Citibank	(446)	164	Hyundai Development Co-Engineering & Construction	Citibank	17
(2.069)	Grand Korea Leisure Co Ltd	JP Morgan	(511)	(25)	Hyundai Electric & Energy System Co Ltd	Citibank	(95)
163	Green Cross Corp/South Korea	JP Morgan	(564)	(569)	Hyundai Elevator Co Ltd	Citibank	(13.334)
232	Green Cross Corp/South Korea	Citibank	114	(71)	Hyundai Elevator Co Ltd	HSBC	(2.396)
1.229	GS Engineering & Construction Corp	JP Morgan	2.561	(10)	Hyundai Elevator Co Ltd	JP Morgan	(334)
369	GS Holdings Corp	JP Morgan	(711)				
373	GS Holdings Corp	Citibank	(918)				
900	GS Holdings Corp	HSBC	(1.529)				

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(1.624)	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	JP Morgan	(15.758)	828	KG Chemical Corp	JP Morgan	1.895
(426)	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	Citibank	(2.002)	998	Kginicis Co Ltd	JP Morgan	(71)
(51)	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	Citibank	553	739	Kia Motors Corp	HSBC	(1.728)
217	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	Citibank	(459)	20	Kolon Corp	HSBC	(73)
(76)	Hyundai Heavy Industries Holdings Co Ltd	HSBC	1.470	805	Kolon Corp	JP Morgan	(3.071)
(30)	Hyundai Heavy Industries Holdings Co Ltd	Citibank	571	(99)	Kolon Industries Inc	JP Morgan	146
1.771	Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	HSBC	(5.659)	(187)	Kolon Industries Inc	Citibank	(287)
(170)	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	JP Morgan	1.171	(372)	Kolon Life Science Inc	Citibank	906
271	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	HSBC	(1)	(64)	Kolon Life Science Inc	JP Morgan	166
(614)	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	Citibank	2.372	(9)	Kolon Life Science Inc	HSBC	21
(80)	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	HSBC	521	667	Kolon TissueGene Inc	HSBC	(3.075)
(60)	Hyundai Mobis Co Ltd	JP Morgan	963	1.425	KoMiCo Ltd	JP Morgan	(3.827)
(71)	Hyundai Mobis Co Ltd	Citibank	1.871	471	Komipharm International Co Ltd	JP Morgan	(2.116)
(284)	Hyundai Motor Co	JP Morgan	2.058	(700)	Komipharm International Co Ltd	Citibank	667
(282)	Hyundai Motor Co	Citibank	1.348	(293)	Korea Aerospace Industries Ltd	JP Morgan	314
(259)	Hyundai Rotem Co Ltd	HSBC	(1.048)	(1.441)	Korea Aerospace Industries Ltd	HSBC	1.302
(935)	Hyundai Steel Co	JP Morgan	(193)	80	Korea District Heating Corp	Citibank	57
96	Hyundai Steel Co	JP Morgan	(299)	(1.779)	Korea Electric Power Corp	HSBC	4.449
(487)	Hyundai Wia Corp	Citibank	170	21	Korea Electric Terminal Co Ltd	JP Morgan	(115)
(2)	Hyundai Wia Corp	HSBC	7	290	Korea Investment Holdings Co Ltd	Citibank	88
1.382	HyVision System Inc	JP Morgan	(1.570)	703	Korea Investment Holdings Co Ltd	JP Morgan	3.710
(87)	i-SENS Inc	JP Morgan	184	(61)	Korea Kolmar Co Ltd	Citibank	18
(158)	i3system Inc	JP Morgan	114	(365)	Korea Kolmar Co Ltd	JP Morgan	745
88	Il Dong Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(84)	(473)	Korea Kolmar Holdings Co Ltd	JP Morgan	(70)
(981)	Iljin Materials Co Ltd	JP Morgan	(2.466)	784	Korea Line Corp	HSBC	(1.109)
(117)	Iljin Materials Co Ltd	Citibank	(85)	(1.196)	Korea Line Corp	JP Morgan	1.596
692	Iljin Materials Co Ltd	HSBC	1.823	(72)	Korea Petrochemical Ind Co Ltd	Citibank	(440)
2.152	iMarketKorea Inc	JP Morgan	(2.438)	(57)	Korea Petrochemical Ind Co Ltd	JP Morgan	599
2.412	InBody Co Ltd	JP Morgan	(14.095)	71	Korea Petrochemical Ind Co Ltd	Citibank	434
4.407	Industrial Bank of Korea	JP Morgan	(3.150)	(2.620)	Korea Real Estate Investment & Trust Co Ltd	Citibank	56
(3.674)	Industrial Bank of Korea	JP Morgan	3.258	316	Korea United Pharm Inc	JP Morgan	(98)
(173)	Industrial Bank of Korea	HSBC	199	(2)	KT Corp	HSBC	1
(363)	ING Life Insurance Korea Ltd '144A'	JP Morgan	691	2.642	KT Skylife Co Ltd	HSBC	699
(109)	Insun ENT Co Ltd	Citibank	41	(1.651)	KT&G Corp	JP Morgan	1.502
(208)	Insun ENT Co Ltd	JP Morgan	(4)	963	Kumho Petrochemical Co Ltd	HSBC	(228)
(411)	Interflex Co Ltd	JP Morgan	238	459	Kwang Dong Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(281)
(48)	Interjo Co Ltd	Citibank	96	127	Kwangju Bank Co Ltd	Citibank	(44)
(67)	Interjo Co Ltd	HSBC	(62)	15.031	Kyobo Securities Co Ltd	HSBC	(1.693)
23.502	Interpark Holdings Corp	HSBC	(8.622)	(132)	L&F Co Ltd	JP Morgan	(1.396)
9.381	Interpark Holdings Corp	Citibank	(762)	(2.440)	L&F Co Ltd	Citibank	(11.444)
(242)	IS Dongseo Co Ltd	Citibank	85	1.455	LEENO Industrial Inc	Citibank	4.243
175	ISU Chemical Co Ltd	Citibank	(68)	3.555	LF Corp	Citibank	(1.745)
401	Jahwa Electronics Co Ltd	Citibank	255	1.133	LG Corp	HSBC	(3.033)
252	JB Financial Group Co Ltd	HSBC	(31)	(123)	LG Corp	Citibank	435
7	Jcontentree Corp	JP Morgan	6	(131)	LG Corp	HSBC	869
(204)	Jeil Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	48	(1.943)	LG Corp	JP Morgan	10.120
1.582	Jeju Air Co Ltd	JP Morgan	2.992	(1.260)	LG Display Co Ltd	HSBC	102
4	Jenax Inc	Citibank	(11)	(410)	LG Display Co Ltd	Citibank	169
1.303	Jin Air Co Ltd	JP Morgan	(2.345)	(6.932)	LG Display Co Ltd	JP Morgan	1.145
1.923	JoyCity Corp	JP Morgan	681	426	LG Electronics Inc	JP Morgan	(956)
(266)	Jusung Engineering Co Ltd	JP Morgan	(130)	(158)	LG Electronics Inc	HSBC	479
550	JW Pharmaceutical Corp	HSBC	668	(762)	LG Electronics Inc	JP Morgan	2.742
360	JW Pharmaceutical Corp	JP Morgan	384	(192)	LG Hausys Ltd	HSBC	1.066
(547)	Kakao Corp	Citibank	4.430	(892)	LG Hausys Ltd	JP Morgan	5.211
(15)	Kakao Corp	JP Morgan	120	19	LG Household & Health Care Ltd	JP Morgan	853
110	Kakao M Corp	JP Morgan	(460)	8	LG Household & Health Care Ltd	HSBC	398
1.035	KB Financial Group Inc	HSBC	(6.180)	(77)	LG Innatek Co Ltd	HSBC	(990)
452	KB Financial Group Inc	Citibank	(1.454)	(171)	LG Innatek Co Ltd	JP Morgan	(2.116)
(4)	KCC Corp	JP Morgan	55	3.357	LG International Corp	JP Morgan	365
(368)	KEPCO Engineering & Construction Co Inc	Citibank	778	11.266	LG Uplus Corp	HSBC	(12.164)
(223)	KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd	JP Morgan	268	2.493	LG Uplus Corp	JP Morgan	(2.813)
				(110)	LIG Nex1 Co Ltd	Citibank	(1.046)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(345)	LIS Co Ltd	Citibank	245	(121)	Osstem Implant Co Ltd	JP Morgan	74
(1.745)	Lock&Lock Co Ltd	Citibank	1.118	26	Ottogi Corp	JP Morgan	1.473
(257)	Lock&Lock Co Ltd	JP Morgan	55	146	Ottogi Corp	Citibank	5.263
(67)	Lotte Chemical Corp	Citibank	503	122	Ottogi Corp	HSBC	7.254
(115)	Lotte Chemical Corp	JP Morgan	1.919	(1.592)	Pan Ocean Co Ltd	Citibank	100
32	Lotte Confectionery Co Ltd	Citibank	161	(3.276)	Pan Ocean Co Ltd	JP Morgan	324
107	Lotte Confectionery Co Ltd	HSBC	843	(2.976)	Paradise Co Ltd	JP Morgan	7.531
371	Lotte Corp	HSBC	(802)	(639)	Paradise Co Ltd	Citibank	91
20	Lotte Food Co Ltd	JP Morgan	(239)	(5.188)	Partron Co Ltd	HSBC	1.529
1.991	LOTTE Himart Co Ltd	Citibank	3.666	(6.282)	Partron Co Ltd	Citibank	9
324	LOTTE Himart Co Ltd	HSBC	935	78	Pearl Abyss Corp	JP Morgan	(1.143)
(148)	Lotte Shopping Co Ltd	Citibank	(74)	12	Pearl Abyss Corp	Citibank	(151)
2.467	LS Corp	HSBC	12.415	53	POSCO	JP Morgan	(946)
1.296	LS Corp	JP Morgan	6.131	258	POSCO	HSBC	(4.427)
287	LS Corp	Citibank	(344)	(1.236)	POSCO Chemtech Co Ltd	Citibank	(1.569)
507	LS Industrial Systems Co Ltd	JP Morgan	3.298	(83)	POSCO Chemtech Co Ltd	JP Morgan	(564)
(40)	Maeil Dairies Co Ltd	JP Morgan	(330)	2.568	Posco Daewoo Corp	JP Morgan	2.078
(1.005)	Mando Corp	HSBC	6.222	2.578	Posco ICT Co Ltd	Citibank	(389)
(305)	Mando Corp	JP Morgan	1.940	632	Posco ICT Co Ltd	JP Morgan	42
(270)	Mando Corp	Citibank	1.364	(195)	Protec Co Ltd	JP Morgan	(357)
(124)	Medipost Co Ltd	Citibank	(224)	4.480	Pyeong Hwa Automotive Co Ltd	Citibank	(935)
(36)	Medipost Co Ltd	JP Morgan	121	392	Reyon Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(252)
(78)	Medy-Tox Inc	Citibank	(6.592)	415	S-1 Corp	JP Morgan	(1.739)
(37)	Medy-Tox Inc	JP Morgan	(3.528)	(183)	S-Oil Corp	Citibank	803
248	Meerecompany Inc	HSBC	(1.081)	(594)	S-Oil Corp	JP Morgan	(400)
(3.753)	Meritz Financial Group Inc	Citibank	(293)	781	Sajo Industries Co Ltd	HSBC	(3.043)
6.357	Meritz Fire & Marine Insurance Co Ltd	HSBC	(250)	444	Sam Chun Dang Pharm Co Ltd	JP Morgan	1.255
4.989	Meritz Securities Co Ltd	Citibank	(462)	1.820	Samjin Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	5.584
4.733	Meritz Securities Co Ltd	JP Morgan	(440)	(13)	Samsung Biologics Co Ltd	HSBC	(708)
(9.518)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	JP Morgan	2.226	(418)	Samsung Biologics Co Ltd	Citibank	(12.498)
(3.717)	Mirae Asset Life Insurance Co Ltd	JP Morgan	(1.597)	(29)	Samsung Biologics Co Ltd	JP Morgan	(1.723)
5.497	Moorim P&P Co Ltd	JP Morgan	5.370	(1.287)	Samsung Card Co Ltd	JP Morgan	2.805
1.847	Namhae Chemical Corp	HSBC	2.909	(421)	Samsung Card Co Ltd	HSBC	855
126	Naturalendo Tech Co Ltd	Citibank	(141)	216	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Citibank	1.264
564	Naturecell Co Ltd	JP Morgan	897	(25)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	JP Morgan	(414)
(115)	NAVER Corp	JP Morgan	4.939	(30)	Samsung Engineering Co Ltd	JP Morgan	(33)
(26)	NAVER Corp	Citibank	322	1.565	Samsung Engineering Co Ltd	Citibank	(805)
1.808	NeoPharm Co Ltd	Citibank	59	(1.237)	Samsung Life Insurance Co Ltd	HSBC	10.540
377	NEPES Corp	HSBC	666	(5)	Samsung Life Insurance Co Ltd	JP Morgan	45
(519)	Netmarble Corp '144A'	Citibank	(5.705)	48	Samsung Life Insurance Co Ltd	Citibank	(322)
(114)	Netmarble Corp '144A'	JP Morgan	(2.362)	273	Samsung Life Insurance Co Ltd	HSBC	(2.326)
(3.387)	Nexon GT Co Ltd	Citibank	1.426	843	Samsung Life Insurance Co Ltd	JP Morgan	(7.540)
(2.406)	NH Investment & Securities Co Ltd	JP Morgan	(626)	169	Samsung SDI Co Ltd	HSBC	2.668
280	NHN Entertainment Corp	JP Morgan	1.877	160	Samsung SDI Co Ltd	JP Morgan	2.415
322	NHN Entertainment Corp	Citibank	(489)	(388)	Samsung SDI Co Ltd	HSBC	(6.125)
(1.561)	NHN Entertainment Corp	JP Morgan	(10.464)	(119)	Samsung SDI Co Ltd	JP Morgan	(1.796)
312	NHN Entertainment Corp	HSBC	2.161	109	Samsung SDS Co Ltd	Citibank	(756)
(238)	NHN Entertainment Corp	Citibank	361	46	Samsung SDS Co Ltd	JP Morgan	96
11.366	NICE Holdings Co Ltd	JP Morgan	1.322	540	Samsung Securities Co Ltd	JP Morgan	403
3.203	NICE Information Service Co Ltd	HSBC	5.435	(16)	Samsung Securities Co Ltd	HSBC	9
895	NUTRIBIOTECH Co Ltd	JP Morgan	(2.727)	(700)	Samsung Securities Co Ltd	JP Morgan	391
(107)	NUTRIBIOTECH Co Ltd	JP Morgan	326	672	Samwha Capacitor Co Ltd	JP Morgan	(618)
264	OCI Co Ltd	HSBC	(3.817)	(1.355)	Samyang Corp	Citibank	3.754
(1.129)	OptoElectronics Solutions Co Ltd	Citibank	(131)	(160)	Samyang Corp	HSBC	246
(1.008)	OptoElectronics Solutions Co Ltd	JP Morgan	574	(1.359)	Sangsangin Co Ltd	HSBC	(1.963)
4.492	Organic Tea Cosmetics Holdings Co Ltd	JP Morgan	(787)	(564)	Sangsangin Co Ltd	JP Morgan	(771)
(833)	Orion Corp/Republic of Korea	JP Morgan	(3.356)	1.802	Sangsangin Co Ltd	HSBC	2.603
(56)	Orion Corp/Republic of Korea	HSBC	(252)	(3.804)	Sangsangin Co Ltd	Citibank	(10)
(885)	Orion Holdings Corp	HSBC	(178)	5.310	Seah Besteel Corp	JP Morgan	(14.201)
(4.043)	Orion Holdings Corp	Citibank	906	669	Seegene Inc	HSBC	(378)
(9.077)	Orion Holdings Corp	JP Morgan	(987)	(745)	Sekonix Co Ltd	Citibank	384
(242)	Oscotec Inc	Citibank	(710)	7.338	Seohan Co Ltd	Citibank	143
(308)	Oscotec Inc	JP Morgan	(1.020)	29.735	Seohan Co Ltd	HSBC	1.156
(1.310)	Osstem Implant Co Ltd	Citibank	1.065	(110)	Seojin System Co Ltd	Citibank	130
				(176)	Seojin System Co Ltd	JP Morgan	783
				(144)	Seoul Auction Co Ltd	Citibank	57
				(279)	Seoul Auction Co Ltd*	JP Morgan	-
				192	SFA Engineering Corp	HSBC	569

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(132)	Shindaeyang Paper Co Ltd	Citibank	427	(6.753)	Taeyoung Engineering & Construction Co Ltd	JP Morgan	(35.305)
(14)	Shindaeyang Paper Co Ltd	HSBC	34	831	Taihan Fiberoptics Co Ltd	Citibank	1.110
(121)	Shindaeyang Paper Co Ltd	JP Morgan	282	3.548	Taihan Fiberoptics Co Ltd	Citibank	1.140
(488)	Shinhan Financial Group Co Ltd	Citibank	1.420	5.051	TBH Global Co Ltd	Citibank	2.144
(5.009)	Shinhan Financial Group Co Ltd	JP Morgan	14.724	(1.121)	TechWing Inc	JP Morgan	753
541	Shinhan Financial Group Co Ltd	Citibank	(1.574)	(881)	TES Co Ltd/Korea	Citibank	(222)
(1.025)	Shinhan Financial Group Co Ltd	HSBC	3.584	(613)	TES Co Ltd/Korea	HSBC	(1.690)
54	Shinsegae Food Co Ltd	Citibank	226	(2.807)	TES Co Ltd/Korea	JP Morgan	(7.593)
(53)	Shinsegae Inc	HSBC	(1.171)	1.687	Union Semiconductor Equipment & Materials Co Ltd	Citibank	(195)
(89)	Shinsegae Inc	JP Morgan	(1.382)	1.088	UniTest Inc	JP Morgan	1.437
(56)	Shinsegae Inc	Citibank	253	65	V One Tech Co Ltd	Citibank	(102)
(79)	SillaJen Inc	JP Morgan	(1.079)	(319)	Vieworks Co Ltd	JP Morgan	1.538
(71)	SillaJen Inc	Citibank	(414)	11	ViroMed Co Ltd	Citibank	98
1.635	Sindoh Co Ltd	JP Morgan	(10.245)	13	ViroMed Co Ltd	JP Morgan	692
111	SK Bioland Co Ltd	Citibank	(67)	124	ViroMed Co Ltd	HSBC	8.172
(286)	SK Chemicals Co Ltd	Citibank	287	(456)	Webzen Inc	Citibank	1.132
(486)	SK Chemicals Co Ltd	HSBC	4.294	(140)	Webzen Inc	JP Morgan	(67)
(149)	SK Chemicals Co Ltd	JP Morgan	1.372	457	WeMade Entertainment Co Ltd	Citibank	689
260	SK Chemicals Co Ltd	Citibank	(261)	129	Whanin Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	150
(1.856)	SK D&D Co Ltd	Citibank	(4.601)	82	WiSoL Co Ltd	Citibank	(36)
(868)	SK Gas Ltd	JP Morgan	(6.994)	(3.768)	Wonik Holdings Co Ltd	JP Morgan	(851)
(243)	SK Gas Ltd	Citibank	958	8.469	Woongjin Thinkbig Co Ltd	Citibank	(3.398)
209	SK Holdings Co Ltd	JP Morgan	(4.338)	3.359	Woori Bank	Citibank	(1.440)
(146)	SK Holdings Co Ltd	JP Morgan	3.030	10.533	YeaRimDang Publishing Co Ltd	JP Morgan	26.727
329	SK Hynix Inc	HSBC	3.093	(532)	Yest Co Ltd	JP Morgan	(1.200)
(200)	SK Innovation Co Ltd	Citibank	(277)	(6.227)	YG Entertainment Inc	JP Morgan	(10.201)
(209)	SK Innovation Co Ltd	HSBC	(811)	(297)	YG Entertainment Inc	Citibank	(322)
(632)	SK Innovation Co Ltd	JP Morgan	(2.762)	(660)	YMT Co Ltd	Citibank	364
(125)	SK Materials Co Ltd	JP Morgan	(2.205)	(701)	Yong Pyong Resort Co Ltd	JP Morgan	(566)
(195)	SK Materials Co Ltd	Citibank	848	(780)	Yong Pyong Resort Co Ltd	HSBC	(653)
124	SK Materials Co Ltd	JP Morgan	2.187	1.320	Yong Pyong Resort Co Ltd	Citibank	356
(16)	SK Materials Co Ltd	HSBC	(291)	6	Young Poong Corp	Citibank	(350)
(340)	SK Networks Co Ltd	Citibank	64	235	Youngone Corp	JP Morgan	(21)
(5.189)	SK Networks Co Ltd	HSBC	562	1.356	Yuantia Securities Korea Co Ltd	JP Morgan	(265)
(6.091)	SK Securities Co Ltd	JP Morgan	348				(53.354)
(171)	SK Telecom Co Ltd	Citibank	311	Taiwan			
(633)	SK Telecom Co Ltd	HSBC	3.148	(126.000)	AcBel Polytech Inc	Citibank	(3.058)
612	SKC Co Ltd	Citibank	(60)	(79.000)	AcBel Polytech Inc	HSBC	(1.935)
1.776	SKC Co Ltd	HSBC	(972)	(22.000)	AcBel Polytech Inc	JP Morgan	(540)
(1.287)	SM Culture & Contents Co Ltd	Citibank	(92)	(48.000)	Accton Technology Corp	Citibank	(9.153)
(1.853)	SM Entertainment Co Ltd	Citibank	(4.030)	(3.000)	Accton Technology Corp	JP Morgan	(645)
(531)	SMCore Inc	JP Morgan	8	(21.000)	Acer Inc	HSBC	(2.009)
(101)	SMCore Inc	Citibank	62	(16.000)	Acer Inc	Citibank	203
6.862	Solid Inc	JP Morgan	(23)	1.000	Addcn Technology Co Ltd	JP Morgan	467
(382)	Songwon Industrial Co Ltd	JP Morgan	(348)	1.000	Addcn Technology Co Ltd	Citibank	273
551	Songwon Industrial Co Ltd	JP Morgan	(43)	3.000	Advanced Ceramic X Corp	Citibank	819
(329)	Songwon Industrial Co Ltd	Citibank	(203)	2.000	Advanced Ceramic X Corp	HSBC	2.105
(428)	Soulbrain Co Ltd	HSBC	(5.700)	1.000	Advanced Ceramic X Corp	JP Morgan	1.053
777	Spigen Korea Co Ltd	Citibank	(925)	4.000	Advantech Co Ltd	HSBC	(437)
(74)	Ssangyong Cement Industrial Co Ltd	HSBC	259	4.000	Advantech Co Ltd	JP Morgan	(435)
(2.501)	Ssangyong Cement Industrial Co Ltd	Citibank	(1.114)	(2.000)	Airtac International Group	Citibank	1.245
(1.392)	Ssangyong Cement Industrial Co Ltd	JP Morgan	(2.661)	6.000	Alchip Technologies Ltd	HSBC	(166)
17.337	Ssangyong Motor Co	HSBC	(5.407)	(8.000)	ALI Corp	JP Morgan	(97)
(100)	ST Pharm Co Ltd	HSBC	(56)	(17.000)	Alpha Networks Inc	Citibank	(468)
(105)	ST Pharm Co Ltd	JP Morgan	(44)	(5.000)	Alpha Networks Inc	HSBC	(280)
741	Suheung Co Ltd	JP Morgan	(235)	(29.000)	Alpha Networks Inc	JP Morgan	(1.626)
568	SundayToz Corp	HSBC	(1.446)	30.000	AmTRAN Technology Co Ltd	HSBC	101
(467)	Sung Kwang Bend Co Ltd	JP Morgan	(427)	3.000	AmTRAN Technology Co Ltd	Citibank	(2)
(918)	Sung Kwang Bend Co Ltd	Citibank	398	131.000	AmTRAN Technology Co Ltd	JP Morgan	(844)
73	Taekwang Industrial Co Ltd	JP Morgan	(7.102)	38.000	Anpec Electronics Corp	Citibank	8.298
18	Taekwang Industrial Co Ltd	HSBC	(1.740)	3.000	Anpec Electronics Corp	HSBC	737
(2.738)	Taewoong Co Ltd	JP Morgan	4.001	19.000	Anpec Electronics Corp	JP Morgan	4.673
(2.517)	Taeyoung Engineering & Construction Co Ltd	Citibank	(6.619)	2.105	APAQ Technology Co Ltd	Citibank	120
				7.370	APAQ Technology Co Ltd	JP Morgan	3.346
				9.000	Arcadyan Technology Corp	Citibank	68
				5.000	Arcadyan Technology Corp	JP Morgan	280

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
10.000	Arcadyan Technology Corp	HSBC	(553)	(10.000)	Chin-Poon Industrial Co Ltd	JP Morgan	(70)
12.000	Ardentec Corp	JP Morgan	96	168.000	China Airlines Ltd	JP Morgan	(1.195)
22.000	Ardentec Corp	Citibank	(509)	17.000	China Airlines Ltd	Citibank	78
8.000	Ardentec Corp	HSBC	63	62.000	China Development Financial Holding Corp	Citibank	(546)
(89.000)	ASE Industrial Holding Co Ltd	Citibank	8.818	16.000	China Development Financial Holding Corp	HSBC	70
(10.000)	ASE Industrial Holding Co Ltd	HSBC	729	3.000	China Development Financial Holding Corp	JP Morgan	13
(4.000)	ASE Industrial Holding Co Ltd	JP Morgan	291	(7.000)	China General Plastics Corp	Citibank	476
47.000	Asia Cement Corp	Citibank	(1.821)	(2.000)	China General Plastics Corp	HSBC	167
80.000	Asia Cement Corp	HSBC	369	(19.000)	China General Plastics Corp	JP Morgan	1.583
1.000	Asia Cement Corp	JP Morgan	15	173.000	China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	Citibank	(8.315)
(8.000)	Asia Optical Co Inc	Citibank	(557)	13.000	China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	HSBC	46
(14.000)	Asia Pacific Telecom Co Ltd	JP Morgan	291	77.000	China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	JP Morgan	280
(284.000)	Asia Pacific Telecom Co Ltd	Citibank	1.706	(53.000)	China Petrochemical Development Corp	JP Morgan	(1.363)
1.000	Asia Vital Components Co Ltd	JP Morgan	16	(63.000)	China Petrochemical Development Corp	Citibank	667
2.000	Asia Vital Components Co Ltd	Citibank	(29)	(29.000)	China Steel Corp	Citibank	(263)
33.000	Asia Vital Components Co Ltd	HSBC	523	(23.000)	China Steel Corp	JP Morgan	(43)
(1.000)	ASMedia Technology Inc	HSBC	(1.652)	(27.000)	China Synthetic Rubber Corp	JP Morgan	(4.585)
(3.000)	Asustek Computer Inc	JP Morgan	323	(15.000)	Chipbond Technology Corp	Citibank	339
3.000	AU Optronics Corp	Citibank	33	33.000	ChipMOS TECHNOLOGIES Inc	HSBC	290
326.000	AU Optronics Corp	HSBC	2.942	(8.000)	ChipMOS TECHNOLOGIES Inc	HSBC	50
79.000	AU Optronics Corp	JP Morgan	716	1.000	Chilitina Holding Ltd	HSBC	1.539
(77.000)	AU Optronics Corp	HSBC	(699)	7.000	Chilitina Holding Ltd	Citibank	2.612
(79.000)	AU Optronics Corp	JP Morgan	(1.018)	1.000	Chilitina Holding Ltd	JP Morgan	1.539
(196.000)	AU Optronics Corp	Citibank	(2.188)	(40.000)	Chong Hong Construction Co Ltd	HSBC	(9.298)
3.000	Bioteque Corp	JP Morgan	580	(4.000)	Chong Hong Construction Co Ltd	Citibank	(439)
3.000	Bioteque Corp	Citibank	(667)	5.000	Chroma ATE Inc	Citibank	(2.620)
1.000	Bioteque Corp	HSBC	193	14.000	Chroma ATE Inc	JP Morgan	(1.368)
4.000	Bizlink Holding Inc	JP Morgan	(1.785)	5.000	Chung Hwa Pulp Corp	HSBC	(45)
(3.000)	Brogent Technologies Inc	Citibank	578	6.000	Chung Hwa Pulp Corp	JP Morgan	(54)
(2.000)	Brogent Technologies Inc	JP Morgan	658	(13.000)	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp	Citibank	98
(1.000)	Casetek Holdings Ltd	JP Morgan	(132)	(2.000)	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp	JP Morgan	12
(31.000)	Casetek Holdings Ltd	Citibank	(7.260)	(1.000)	Chunghwa Precision Test Tech Co Ltd	JP Morgan	(1.883)
13.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	Citibank	(299)	(92.000)	Chunghwa Telecom Co Ltd	HSBC	5.793
(1.000)	Cayman Engley Industrial Co Ltd	Citibank	(277)	(9.000)	Chunghwa Telecom Co Ltd	JP Morgan	216
(4.000)	Cayman Engley Industrial Co Ltd	HSBC	(605)	37.000	Compal Electronics Inc	HSBC	284
2.000	Chailease Holding Co Ltd	Citibank	(42)	42.000	Compal Electronics Inc	Citibank	(378)
8.000	Chailease Holding Co Ltd	HSBC	(446)	(13.000)	Compeq Manufacturing Co Ltd	HSBC	(259)
65.000	Chailease Holding Co Ltd	JP Morgan	(3.605)	(34.000)	Compeq Manufacturing Co Ltd	Citibank	(181)
(1.000)	Charoen Pokphand Enterprise Corp	JP Morgan	133	(19.000)	Compeq Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(380)
(7.000)	Chaun-Choung Technology Corp	JP Morgan	(308)	(9.000)	Coremax Corp	Citibank	(179)
(5.000)	Cheng Loong Corp	Citibank	(38)	74.000	Coretronic Corp	JP Morgan	7.698
(59.000)	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	Citibank	2.081	66.000	Coretronic Corp	Citibank	5.182
(106.000)	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	HSBC	3.140	8.000	Coretronic Corp	HSBC	831
(90.000)	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	JP Morgan	2.653	9.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	HSBC	35
8.000	Cheng Uei Precision Industry Co Ltd	Citibank	(38)	110.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	437
33.000	Cheng Uei Precision Industry Co Ltd	JP Morgan	(4.506)	1.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	Citibank	(19)
6.000	Cheng Uei Precision Industry Co Ltd	HSBC	(820)	(5.200)	Cub Elecparts Inc	Citibank	2.508
5.005	Chicony Electronics Co Ltd	Citibank	(65)	4.000	D-Link Corp	JP Morgan	451
1.005	Chicony Electronics Co Ltd	HSBC	(79)	2.000	Darwin Precisions Corp	Citibank	(39)
26.045	Chicony Electronics Co Ltd	JP Morgan	(2.039)	18.000	Delta Electronics Inc	Citibank	(2.187)
30.200	Chicony Power Technology Co Ltd	JP Morgan	(1.128)	14.000	Delta Electronics Inc	HSBC	(1.968)
1.000	Chicony Power Technology Co Ltd	HSBC	(37)	45.000	Delta Electronics Inc	JP Morgan	(6.311)
8.050	Chicony Power Technology Co Ltd	Citibank	(205)	(31.000)	Delta Electronics Inc	HSBC	4.358
5.000	Chilisin Electronics Corp	Citibank	197				
(37.000)	Chimei Materials Technology Corp	Citibank	(232)				
(7.000)	Chin-Poon Industrial Co Ltd	Citibank	(35)				

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
4.000	E Ink Holdings Inc	JP Morgan	335	(4.000)	Foxsemicon Integrated Technology Inc	JP Morgan	(2.178)
(21.000)	E Ink Holdings Inc	Citibank	(5)	(4.000)	Foxsemicon Integrated Technology Inc	Citibank	(1.235)
1.000	E Ink Holdings Inc	Citibank	(33)				
1.000	E Ink Holdings Inc	HSBC	84	(7.000)	GCS Holdings Inc	Citibank	487
2.000	E.Sun Financial Holding Co Ltd	Citibank	(25)	(9.000)	General Interface Solution Holding Ltd	HSBC	(6.292)
257.000	E.Sun Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	627	(3.000)	General Interface Solution Holding Ltd	JP Morgan	(2.099)
13.000	E.Sun Financial Holding Co Ltd	HSBC	31	(1.000)	Giant Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	648
6.000	Eclat Textile Co Ltd	JP Morgan	549	(11.000)	Giant Manufacturing Co Ltd	Citibank	2.264
2.000	Eclat Textile Co Ltd	Citibank	(765)	17.000	Gigabyte Technology Co Ltd	Citibank	(5.565)
(6.000)	Egis Technology Inc	Citibank	(3.169)	(10.000)	Gigabyte Technology Co Ltd	Citibank	3.274
(2.000)	Egis Technology Inc	JP Morgan	(1.715)	(12.000)	Gigabyte Technology Co Ltd	JP Morgan	(57)
11.000	Elan Microelectronics Corp	JP Morgan	1.368	94.000	Gigabyte Technology Co Ltd	JP Morgan	28.467
1.000	Elite Advanced Laser Corp	Citibank	12	16.000	Gigabyte Technology Co Ltd	HSBC	4.842
(3.000)	Elite Material Co Ltd	HSBC	(867)	(3.000)	Gigasolar Materials Corp	Citibank	(178)
(9.000)	Elite Material Co Ltd	JP Morgan	(2.603)	(1.000)	Ginko International Co Ltd	HSBC	(918)
3.000	Elite Semiconductor Memory Technology Inc	Citibank	10	(3.000)	Ginko International Co Ltd	Citibank	(268)
2.000	Elite Semiconductor Memory Technology Inc	HSBC	43	2.000	Gintech Energy Corp	JP Morgan	(60)
2.000	Elitegroup Computer Systems Co Ltd	Citibank	49	1.000	Global Unichip Corp	JP Morgan	(707)
2.000	eMemory Technology Inc	HSBC	319	3.000	Global Unichip Corp	Citibank	(733)
1.000	eMemory Technology Inc	Citibank	837	33.000	Globe Union Industrial Corp	Citibank	(744)
1.000	eMemory Technology Inc	JP Morgan	161	3.000	Globe Union Industrial Corp	HSBC	(68)
24.000	Episil Holdings Inc	Citibank	7.295	47.000	Globe Union Industrial Corp	JP Morgan	(1.062)
(74.000)	Epistar Corp	Citibank	(10.016)	(43.000)	Gloria Material Technology Corp	HSBC	532
(7.000)	Epistar Corp	HSBC	(1.022)	(4.000)	Gloria Material Technology Corp	JP Morgan	49
(11.000)	Epistar Corp	JP Morgan	(1.608)	72.000	Gold Circuit Electronics Ltd	HSBC	(551)
1.000	Eson Precision Ind Co Ltd	JP Morgan	2	83.000	Gold Circuit Electronics Ltd	Citibank	468
(27.000)	Eva Airways Corp	HSBC	221	100.000	Gold Circuit Electronics Ltd	JP Morgan	(762)
(91.000)	Eva Airways Corp	JP Morgan	740	(4.000)	Gourmet Master Co Ltd	HSBC	4.960
6.000	Eva Airways Corp	JP Morgan	(49)	5.000	Gourmet Master Co Ltd	JP Morgan	(6.195)
73.000	Eva Airways Corp	Citibank	199	1.000	Gourmet Master Co Ltd	HSBC	(1.240)
16.000	Eva Airways Corp	HSBC	(131)	17.000	Grand Pacific Petrochemical	Citibank	(676)
(11.000)	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	HSBC	108	16.000	Grand Pacific Petrochemical	JP Morgan	(374)
(95.000)	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	Citibank	1.803	5.000	Grand Pacific Petrochemical	HSBC	(117)
(4.000)	Everlight Electronics Co Ltd	JP Morgan	(92)	4.000	Grape King Bio Ltd	Citibank	(171)
(72.000)	Everlight Electronics Co Ltd	Citibank	(2.047)	11.000	Great Wall Enterprise Co Ltd	JP Morgan	301
126.000	Far Eastern Department Stores Ltd	Citibank	1.162	1.000	Greatek Electronics Inc	Citibank	15
284.000	Far Eastern Department Stores Ltd	HSBC	(1.645)	1.000	Greatek Electronics Inc	HSBC	32
3.000	Far Eastern Department Stores Ltd	JP Morgan	(17)	1.000	Greatek Electronics Inc	JP Morgan	33
(365.000)	Far Eastern New Century Corp	JP Morgan	293	20.000	Green Energy Technology Inc	Citibank	(947)
(14.000)	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Citibank	835	2.000	Green Energy Technology Inc	HSBC	(177)
(8.000)	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	HSBC	289	63.000	Green Energy Technology Inc	JP Morgan	(5.571)
(2.000)	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	JP Morgan	65	3.000	Green Seal Holding Ltd	Citibank	(9)
(1.000)	Faraday Technology Corp	JP Morgan	147	41.000	Hannstar Board Corp	Citibank	7.624
11.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	Citibank	(603)	28.000	Hannstar Board Corp	HSBC	6.359
16.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	HSBC	1.767	46.000	Hannstar Board Corp	JP Morgan	4.744
33.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	JP Morgan	3.656	(34.000)	Highwealth Construction Corp	Citibank	801
4.000	Formosa Plastics Corp	HSBC	179	(9.000)	Highwealth Construction Corp	HSBC	85
11.000	Formosa Plastics Corp	JP Morgan	497	(51.000)	Highwealth Construction Corp	JP Morgan	474
5.000	Formosa Plastics Corp	Citibank	(356)	4.000	Hiwin Technologies Corp	JP Morgan	(482)
5.000	Formosa Sumco Technology Corp	Citibank	1.607	3.000	Hiwin Technologies Corp	HSBC	(366)
2.000	Formosa Taffeta Co Ltd	Citibank	(46)	6.000	Hiwin Technologies Corp	Citibank	(5.918)
13.000	Formosa Taffeta Co Ltd	HSBC	(90)	6.000	Ho Tung Chemical Corp	Citibank	(6)
23.000	Formosa Taffeta Co Ltd	JP Morgan	(157)	2.000	Holtek Semiconductor Inc	HSBC	70
(71.000)	Foxconn Technology Co Ltd	JP Morgan	5.840	40.000	Holtek Semiconductor Inc	Citibank	(120)
(4.000)	Foxconn Technology Co Ltd	Citibank	39	8.000	Holtek Semiconductor Inc	JP Morgan	282
				5.000	Holy Stone Enterprise Co Ltd	HSBC	5.996
				(88.000)	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	Citibank	(4.692)
				(49.000)	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	JP Morgan	(2.268)
				(4.000)	Hota Industrial Manufacturing Co Ltd	Citibank	(177)
				13.000	Hsin Kuang Steel Co Ltd	JP Morgan	177
				(53.000)	HTC Corp	Citibank	(759)
				(24.000)	Hui Lane Associate Inc	Citibank	(1.062)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Taiwan suite				Taiwan suite			
31.000	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	JP Morgan	124	(5.000)	Nanya Technology Corp	HSBC	(61)
5.000	Innodisk Corp	Citibank	(532)	(7.000)	Nanya Technology Corp	JP Morgan	(65)
(400.000)	Innolux Corp	Citibank	189	7.000	Nichidenbo Corp	Citibank	(887)
(71.000)	Innolux Corp	JP Morgan	288	(2.000)	Nien Made Enterprise Co Ltd	Citibank	287
(62.000)	Innolux Corp	HSBC	253	(1.000)	Nien Made Enterprise Co Ltd	JP Morgan	888
7.000	ITEQ Corp	Citibank	403	4.000	On-Bright Electronics Inc	Citibank	(581)
(20.000)	Kenda Rubber Industrial Co Ltd	HSBC	879	3.000	On-Bright Electronics Inc	JP Morgan	2.746
(10.000)	Kenda Rubber Industrial Co Ltd	JP Morgan	438	3.000	Oriental Union Chemical Corp	Citibank	(159)
(208.000)	Kenda Rubber Industrial Co Ltd	Citibank	633	4.000	Oriental Union Chemical Corp	HSBC	(54)
(6.000)	King Slide Works Co Ltd	Citibank	3.516	6.000	Oriental Union Chemical Corp	JP Morgan	(80)
(2.000)	King Slide Works Co Ltd	JP Morgan	(1.164)	(7.000)	Paiho Shih Holdings Corp	JP Morgan	1.625
(26.000)	King Yuan Electronics Co Ltd	JP Morgan	68	(33.000)	Paiho Shih Holdings Corp	Citibank	4.359
61.000	King Yuan Electronics Co Ltd	HSBC	259	(14.000)	Pan Jit International Inc	Citibank	(4.597)
21.000	King Yuan Electronics Co Ltd	JP Morgan	91	(10.000)	Pan Jit International Inc	JP Morgan	(2.898)
(4.000)	Kingpak Technology Inc	Citibank	1.238	(3.000)	Pan-International Industrial Corp	Citibank	(203)
1.000	Kinik Co	Citibank	7	(33.000)	Pan-International Industrial Corp	JP Morgan	(3.278)
4.000	Kinik Co	JP Morgan	(88)	(4.000)	Parade Technologies Ltd	JP Morgan	(4.272)
(4.000)	Kinpo Electronics	HSBC	50	1.186	PChome Online Inc	Citibank	171
(47.000)	Kinpo Electronics	Citibank	270	4.248	PChome Online Inc	HSBC	942
(305.000)	Kinpo Electronics	JP Morgan	3.795	8.558	PChome Online Inc	JP Morgan	1.902
(16.000)	Kinsus Interconnect Technology Corp	HSBC	(991)	(14.000)	PCL Technologies Inc	Citibank	938
(28.000)	KS Terminals Inc	Citibank	(2.088)	(35.000)	Pegatron Corp	Citibank	1.824
(1.000)	KS Terminals Inc	HSBC	(119)	(12.000)	Pegatron Corp	HSBC	1.552
(1.000)	KS Terminals Inc	JP Morgan	(120)	(38.000)	Pegatron Corp	JP Morgan	6.270
(10.000)	LandMark Optoelectronics Corp	Citibank	1.125	12.000	Phison Electronics Corp	JP Morgan	3.756
(3.000)	LandMark Optoelectronics Corp	JP Morgan	(370)	1.000	Phison Electronics Corp	HSBC	312
(1.000)	Largan Precision Co Ltd	Citibank	(3.843)	9.000	Pixart Imaging Inc	Citibank	(2.897)
1.000	LCY Chemical Corp	HSBC	61	10.000	Pixart Imaging Inc	HSBC	(3.415)
1.000	LCY Chemical Corp	Citibank	20	8.000	Pixart Imaging Inc	JP Morgan	(2.729)
1.000	LCY Chemical Corp	JP Morgan	61	(4.000)	Posiflex Technology Inc	Citibank	487
(8.000)	Lealea Enterprise Co Ltd	Citibank	71	(4.000)	Posiflex Technology Inc	JP Morgan	432
(11.000)	Lealea Enterprise Co Ltd	JP Morgan	(48)	24.000	Pou Chen Corp	JP Morgan	(462)
2.000	Lelon Electronics Corp	Citibank	556	39.000	Powertech Technology Inc	JP Morgan	3.216
46.000	Lextar Electronics Corp	HSBC	369	13.000	Powertech Technology Inc	Citibank	(178)
2.000	Lextar Electronics Corp	JP Morgan	16	4.000	Powertech Technology Inc	HSBC	329
14.000	Lextar Electronics Corp	Citibank	411	22.000	Primax Electronics Ltd	HSBC	(931)
1.000	Li Cheng Enterprise Co Ltd	JP Morgan	40	23.000	Primax Electronics Ltd	Citibank	1.175
5.000	Lien Hwa Industrial Corp	Citibank	51	24.000	Primax Electronics Ltd	JP Morgan	(1.012)
1.000	Lien Hwa Industrial Corp	JP Morgan	48	(68.000)	Quanta Computer Inc	JP Morgan	280
7.000	Lion Travel Service Co Ltd	Citibank	549	15.000	Quanta Computer Inc	JP Morgan	(14)
4.000	Lion Travel Service Co Ltd	HSBC	1.038	(6.000)	Quanta Computer Inc	HSBC	26
41.000	Lion Travel Service Co Ltd	JP Morgan	10.478	23.000	Radiant Opto-Electronics Corp	JP Morgan	1.172
6.000	Lite-On Semiconductor Corp	JP Morgan	1.186	5.000	Radiant Opto-Electronics Corp	Citibank	154
8.000	Lite-On Semiconductor Corp	Citibank	1.202	13.000	Radiant Opto-Electronics Corp	HSBC	660
10.000	Lite-On Semiconductor Corp	HSBC	1.976	(4.000)	Rafael Microelectronics Inc	Citibank	624
2.000	Liton Technology Corp	JP Morgan	1.017	(2.000)	Rafael Microelectronics Inc	JP Morgan	156
(53.000)	Long Chen Paper Co Ltd	Citibank	(194)	(57.000)	Rechi Precision Co Ltd	Citibank	72
(3.000)	Long Chen Paper Co Ltd	JP Morgan	217	16.000	Rexon Industrial Corp Ltd	Citibank	1.550
19.000	Long Chen Paper Co Ltd	Citibank	70	7.000	Ritek Corp	HSBC	2.140
(1.000)	Lotes Co Ltd	Citibank	(276)	(197.600)	Ruentex Development Co Ltd	JP Morgan	(2.852)
(22.000)	Macauto Industrial Co Ltd	Citibank	4.885	(53.000)	Ruentex Industries Ltd	HSBC	(5.911)
(9.000)	Macauto Industrial Co Ltd	JP Morgan	1.880	(3.000)	Ruentex Industries Ltd	JP Morgan	(335)
2.000	Machvision Inc	JP Morgan	5.653	10.000	Ruentex Industries Ltd	JP Morgan	1.117
(20.000)	Macronix International	JP Morgan	(4.519)	(94.000)	Run Long Construction Co Ltd	Citibank	8.090
(23.000)	Macronix International	Citibank	(2.644)	(34.000)	Run Long Construction Co Ltd	JP Morgan	(1.852)
(1.000)	MediaTek Inc	Citibank	313	1.000	Samebest Co Ltd	JP Morgan	(1.002)
(37.000)	Mega Financial Holding Co Ltd	Citibank	720	14.000	Sanyang Motor Co Ltd	HSBC	290
(32.000)	Merry Electronics Co Ltd	JP Morgan	422	46.000	Sanyang Motor Co Ltd	JP Morgan	954
(2.000)	Merry Electronics Co Ltd	HSBC	27	50.000	Sanyang Motor Co Ltd	Citibank	958
18.000	Micro-Star International Co Ltd	Citibank	(189)	2.000	Scientech Corp	JP Morgan	62
8.000	Micro-Star International Co Ltd	JP Morgan	(688)	(49.000)	ScinoPharm Taiwan Ltd	Citibank	(3.698)
(3.000)	Mitac Holdings Corp	Citibank	(6)	1.000	Senao Networks Inc	HSBC	606
5.000	momo.com Inc	JP Morgan	(3.674)	2.000	Senao Networks Inc	JP Morgan	1.213
9.000	momo.com Inc	Citibank	(1.888)	3.000	Senao Networks Inc	Citibank	(219)
2.000	momo.com Inc	HSBC	(1.471)	(107.000)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	Citibank	(428)
40.000	Nan Ya Plastics Corp	HSBC	379	(3.000)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	HSBC	(31)
5.000	Nan Ya Plastics Corp	Citibank	(518)	(12.000)	Shin Zu Shing Co Ltd	Citibank	(1.160)
91.000	Nan Ya Plastics Corp	JP Morgan	887				

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
(1.000)	ShunSin Technology Holding Ltd	Citibank	274	1.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(180)
(3.000)	ShunSin Technology Holding Ltd	HSBC	1.030	(47.000)	Taiwan Styrene Monomer	Citibank	(1.131)
6.000	Sigurd Microelectronics Corp	Citibank	252	(148.000)	Taiwan Styrene Monomer	HSBC	(10.684)
1.000	Sigurd Microelectronics Corp	HSBC	14	(83.000)	Taiwan Styrene Monomer	JP Morgan	(5.997)
6.000	Sigurd Microelectronics Corp	JP Morgan	85	(18.000)	Taiwan Union Technology Corp	JP Morgan	(2.976)
(7.000)	Silergy Corp	Citibank	(8.459)	(118.000)	Tatung Co Ltd	Citibank	503
(39.000)	Sincere Navigation Corp	Citibank	(559)	1.110	TCI Co Ltd	Citibank	(1.056)
(16.000)	Sino-American Silicon Products Inc	Citibank	(2.314)	753	TCI Co Ltd	HSBC	(1.225)
(8.000)	Sino-American Silicon Products Inc	JP Morgan	(2.187)	753	TCI Co Ltd	JP Morgan	(1.224)
(1.000)	Sitronix Technology Corp	Citibank	(123)	(2.000)	TCI Co Ltd	Citibank	1.903
15.000	Soft-World International Corp	Citibank	(805)	(24.000)	Teco Electric and Machinery Co Ltd	Citibank	344
2.000	Soft-World International Corp	HSBC	166	6.000	Thermaltake Technology Co Ltd	Citibank	391
8.000	Soft-World International Corp	JP Morgan	664	11.000	Thermaltake Technology Co Ltd	HSBC	1.922
3.000	Solartech Energy Corp	HSBC	(78)	1.000	Thermaltake Technology Co Ltd	JP Morgan	175
2.000	Solartech Energy Corp	Citibank	(4)	(9.000)	Tong Yang Industry Co Ltd	Citibank	109
9.000	Solartech Energy Corp	JP Morgan	(235)	(12.000)	Tong Yang Industry Co Ltd	JP Morgan	850
(31.000)	Sonix Technology Co Ltd	Citibank	(167)	26.000	Tripod Technology Corp	Citibank	(524)
(16.000)	Sonix Technology Co Ltd	JP Morgan	212	4.000	Tripod Technology Corp	HSBC	(688)
8.000	Sunonwealth Electric Machine Industry Co Ltd	JP Morgan	(202)	29.000	Tripod Technology Corp	JP Morgan	(4.983)
(71.000)	Supreme Electronics Co Ltd	Citibank	2.587	(87.000)	TSRC Corp	JP Morgan	(3.530)
(27.000)	Supreme Electronics Co Ltd	HSBC	(811)	(28.000)	TXC Corp	Citibank	(706)
(20.000)	Supreme Electronics Co Ltd	JP Morgan	(603)	(58.000)	TXC Corp	JP Morgan	(762)
(1.000)	Swancor Holding Co Ltd	JP Morgan	20	9.000	Ultra Chip Inc	Citibank	409
74.000	Synnex Technology International Corp	JP Morgan	11.326	1.000	Ultra Chip Inc	HSBC	147
22.000	Synnex Technology International Corp	Citibank	178	1.000	Ultra Chip Inc	JP Morgan	148
39.000	Synnex Technology International Corp	HSBC	5.964	15.000	Uni-President Enterprises Corp	Citibank	607
(15.000)	Synnex Technology International Corp	Citibank	(121)	48.000	Uni-President Enterprises Corp	JP Morgan	4.602
3.000	TA Chen Stainless Pipe	JP Morgan	(25)	2.000	Uni-President Enterprises Corp	HSBC	191
5.000	TaiDoc Technology Corp	Citibank	219	5.000	Unimicron Technology Corp	JP Morgan	(84)
(1.000)	TaiMed Biologics Inc	JP Morgan	31	(2.000)	Unitech Printed Circuit Board Corp	JP Morgan	(121)
50.000	Taishin Financial Holding Co Ltd	Citibank	(197)	(9.000)	Unitech Printed Circuit Board Corp	Citibank	(518)
78.000	Taishin Financial Holding Co Ltd	HSBC	547	(9.000)	United Microelectronics Corp	Citibank	(129)
130.000	Taishin Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	917	(17.000)	United Microelectronics Corp	HSBC	(398)
5.000	Taita Chemical Co Ltd	Citibank	139	(90.000)	United Microelectronics Corp	JP Morgan	(2.111)
4.000	Taita Chemical Co Ltd	HSBC	376	(15.000)	United Orthopedic Corp	Citibank	488
9.000	Taita Chemical Co Ltd	JP Morgan	846	(16.000)	United Orthopedic Corp	JP Morgan	1.971
92.000	Taiwan Cement Corp	Citibank	(5.097)	5.000	Userjoy Technology Co Ltd	HSBC	592
162.000	Taiwan Cement Corp	JP Morgan	7.103	2.000	Userjoy Technology Co Ltd	JP Morgan	237
98.000	Taiwan Cement Corp	HSBC	(192)	11.000	Userjoy Technology Co Ltd	Citibank	(630)
33.000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	324	(12.000)	Vanguard International Semiconductor Corp	JP Morgan	(79)
1.000	Taiwan Fertilizer Co Ltd	HSBC	100	(40.000)	Walsin Lihwa Corp	Citibank	642
2.000	Taiwan High Speed Rail Corp	Citibank	(39)	126.000	Walsin Lihwa Corp	Citibank	(2.023)
25.000	Taiwan High Speed Rail Corp	JP Morgan	553	17.000	Walsin Lihwa Corp	HSBC	2.509
5.000	Taiwan High Speed Rail Corp	HSBC	110	77.000	Walsin Lihwa Corp	JP Morgan	6.751
(27.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	HSBC	617	1.000	Walsin Technology Corp	HSBC	5.142
(2.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	Citibank	(91)	11.000	Wan Hai Lines Ltd	Citibank	29
(10.000)	Taiwan Paiho Ltd	Citibank	229	17.000	Wan Hai Lines Ltd	JP Morgan	(286)
(1.000)	Taiwan Paiho Ltd	JP Morgan	256	3.000	Wan Hai Lines Ltd	HSBC	(51)
23.000	Taiwan Prosperity Chemical Corp	Citibank	(952)	(1.000)	Win Semiconductors Corp	JP Morgan	947
1.000	Taiwan Prosperity Chemical Corp	HSBC	359	(17.000)	Win Semiconductors Corp	Citibank	17.495
29.000	Taiwan Prosperity Chemical Corp	JP Morgan	8.771	(2.000)	Win Semiconductors Corp	HSBC	(134)
(4.000)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	HSBC	1.401	(8.000)	Winbond Electronics Corp	JP Morgan	170
(6.000)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	2.078	(57.000)	Winbond Electronics Corp	Citibank	1.112
				105.680	Wistron Corp	Citibank	(3.452)
				12.296	Wistron Corp	HSBC	(594)
				75.362	Wistron Corp	JP Morgan	(3.637)
				(3.000)	Wistron NeWeb Corp	Citibank	(182)
				6.000	Wowprime Corp	HSBC	(3.253)
				16.000	Wowprime Corp	JP Morgan	(5.636)
				30.000	Wowprime Corp	Citibank	875
				40.000	WPG Holdings Ltd	Citibank	865
				70.000	WPG Holdings Ltd	JP Morgan	1.774
				(118)	WT Microelectronics Co Ltd*	Citibank	-

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

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Taiwan suite				Thaïlande suite			
(18.000)	WT Microelectronics Co Ltd	JP Morgan	409	51.000	Erawan Group PCL/The	JP Morgan	(44)
(29.182)	WT Microelectronics Co Ltd	HSBC	668	(47.500)	GFPT PCL	Citibank	(39)
(1.000)	XinTec Inc	JP Morgan	(304)	(10.800)	GFPT PCL	JP Morgan	1.267
(5.000)	XinTec Inc	Citibank	232	9.800	Glow Energy PCL	Citibank	210
(1.000)	Yeong Guan Energy			13.100	Glow Energy PCL	HSBC	932
	Technology Group Co Ltd	Citibank	9	58.800	Glow Energy PCL	JP Morgan	8.697
1.000	Youngtek Electronics Corp	Citibank	(22)	(12.800)	Hana Microelectronics PCL	Citibank	769
102.000	Yuanta Financial Holding			(9.300)	Home Product Center PCL	JP Morgan	69
	Co Ltd	Citibank	(1.422)	49.600	Home Product Center PCL	JP Morgan	80
2.000	Yuanta Financial Holding			23.000	Home Product Center PCL	Citibank	238
	Co Ltd	HSBC	(16)	25.400	Home Product Center PCL	HSBC	207
492.000	Yuanta Financial Holding			33.300	Indorama Ventures PCL	HSBC	(2.652)
	Co Ltd	JP Morgan	(3.897)	13.600	Indorama Ventures PCL	JP Morgan	(886)
(2.000)	Yulon Nissan Motor Co Ltd	JP Morgan	574	17.800	IRPC PCL	Citibank	(131)
(2.000)	Yulon Nissan Motor Co Ltd	Citibank	(80)	7.200	IRPC PCL	HSBC	(15)
(3.000)	Yungtay Engineering Co Ltd	HSBC	6	4.700	IRPC PCL	JP Morgan	(188)
(27.000)	Yungtay Engineering Co Ltd	Citibank	145	(17.700)	Kasikornbank PCL	Citibank	1.697
(36.000)	Yungtay Engineering Co Ltd	JP Morgan	66	(37.200)	KCE Electronics PCL	HSBC	4.184
				(16.400)	KCE Electronics PCL	JP Morgan	1.856
			57.159	(24.000)	Kiatnakin Bank PCL	Citibank	(1.048)
				(4.600)	Krung Thai Bank PCL	HSBC	(8)
				(574.800)	Krung Thai Bank PCL	JP Morgan	(1.188)
				(287.900)	Krung Thai Bank PCL	Citibank	1.409
				700	Krungthai Card PCL	HSBC	5.827
				2.100	Krungthai Card PCL	JP Morgan	(654)
				700	Krungthai Card PCL	Citibank	(245)
				100.600	Land & Houses PCL	JP Morgan	514
				8.100	Land & Houses PCL	Citibank	6
				58.600	Land & Houses PCL	HSBC	679
				(335.500)	LPN Development PCL	Citibank	824
				(5.000)	LPN Development PCL	HSBC	412
				(15.800)	LPN Development PCL	JP Morgan	1.305
				1.600	Malee Group PCL	Citibank	(48)
				300	PTT Exploration		
					& Production PCL	Citibank	(138)
				31.600	PTT Exploration		
					& Production PCL	JP Morgan	1.561
				9.300	PTT Exploration		
					& Production PCL	HSBC	(561)
				67.400	PTT Global Chemical PCL	JP Morgan	(23.109)
				23.900	PTT Global Chemical PCL	Citibank	(4.327)
				139.400	PTT Global Chemical PCL	HSBC	(14.539)
				34.300	PTT PCL	Citibank	(3.087)
				102.500	PTT PCL	HSBC	(7.980)
				162.200	PTT PCL	JP Morgan	(17.756)
				12.700	Quality Houses PCL	Citibank	35
				755.200	Quality Houses PCL	JP Morgan	5.571
				10.600	Robinson PCL	Citibank	294
				86.100	Rojana Industrial Park PCL	HSBC	(720)
				18.500	Rojana Industrial Park PCL	JP Morgan	(157)
				146.200	Rojana Industrial Park PCL	Citibank	974
				1.800	RS PCL	HSBC	(330)
				9.900	RS PCL	JP Morgan	(330)
				16.200	RS PCL	Citibank	(1.546)
				(773.900)	Sansiri PCL	Citibank	(1.057)
				(65.800)	Sansiri PCL	HSBC	(31)
				(13.700)	Siam Cement PCL/The	Citibank	8.984
				(4.800)	Siam Cement PCL/The	JP Morgan	3.838
				(11.600)	Siam City Cement PCL	Citibank	1.261
				(700)	Siam City Cement PCL	HSBC	1.243
				(70.900)	Siam Commercial Bank		
					PCL/The	Citibank	5.991
				(4.800)	Siamgas & Petrochemicals		
					PCL	Citibank	199
				(7.800)	Sino-Thai Engineering		
					& Construction PCL	JP Morgan	(1.156)
				(112.900)	Sino-Thai Engineering		
					& Construction PCL	Citibank	(1.935)
				(2.000)	Sino-Thai Engineering		
					& Construction PCL	HSBC	(297)
				34.100	Supalai PCL	Citibank	1.069

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

* Les investissements inférieurs à 0.5 USD ont été arrondis à zéro.

BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute

Return Fund suite

Opérations de change à terme en cours
au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	59.292	USD	70.158	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1.032)
USD	3.007	EUR	2.552	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	32
						(1.000)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	4.567.299	USD	6.202.528	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(128.870)
USD	401.779	GBP	297.282	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	6.450
						(122.420)
Total (exposition brute sous-jacente – 6.541.089 USD)						(123.420)

Répartition sectorielle
au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	74,86
Gouvernement	16,92
Biens de consommation non cyclique	4,44
Biens de consommation cyclique	3,35
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,57
Autres éléments de l'actif net	0,43
	100,00

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES				Etats-Unis suite			
Irlande				51.850	News Corp 'A'	667.614	0,09
6.981	Accenture Plc 'A'	931.398	0,12	3.361	Northrop Grumman Corp	942.249	0,12
		931.398	0,12	17.072	Nucor Corp	938.792	0,12
Pays-Bas				25.170	Pfizer Inc	774.744	0,10
9.588	LyondellBasell Industries NV 'A'	920.934	0,12	5.127	Praxair Inc	686.323	0,09
27.935	Mylan NV	920.398	0,12	3.523	PVH Corp	482.892	0,06
		1.841.332	0,24	3.054	Ralph Lauren Corp	352.101	0,05
Etats-Unis				5.421	S&P Global Inc	917.200	0,12
5.313	3M Co	897.698	0,12	11.037	Teradata Corp	376.977	0,05
12.020	Abbott Laboratories	633.591	0,08	9.848	Texas Instruments Inc	944.136	0,13
10.324	AbbVie Inc	875.059	0,12	12.464	Total System Services Inc	909.628	0,12
86.386	Advanced Micro Devices Inc	1.016.088	0,13	22.235	TripAdvisor Inc	993.175	0,13
31.039	AES Corp	339.028	0,05	9.303	United Parcel Service Inc	925.439	0,12
11.586	Agilent Technologies Inc	614.585	0,08	8.635	United Technologies Corp	923.345	0,12
1.964	Albemarle Corp	157.265	0,02	9.175	Varian Medical Systems Inc	926.461	0,12
19.727	Altria Group Inc	941.989	0,12	8.491	VeriSign Inc	948.827	0,13
10.036	Amgen Inc	1.544.305	0,20	6.915	Vertex Pharmaceuticals Inc	912.285	0,12
17.077	AO Smith Corp	922.682	0,12	38.017	Viacom Inc 'B'	882.602	0,12
9.494	Archer-Daniels-Midland Co	355.588	0,05	3.956	Western Digital Corp	283.017	0,04
9.541	Baxter International Inc	579.015	0,08	79.580	Western Union Co/The	1.355.989	0,18
13.683	Best Buy Co Inc	800.021	0,11	9.230	Whirlpool Corp	1.144.558	0,15
9.736	BorgWarner Inc	406.855	0,05	10.171	Xerox Corp	236.827	0,03
23.755	Boston Scientific Corp	618.448	0,08	12.905	Yum! Brands Inc	899.138	0,12
18.556	Brown-Forman Corp 'B'	899.107	0,12			58.354.991	7,68
9.948	Cboe Global Markets Inc	831.429	0,11	Total des actions ordinaires		61.127.721	8,04
19.763	CBS Corp 'B non-voting share'	852.791	0,11	OBLIGATIONS			
19.486	Cisco Systems Inc	712.968	0,09	Luxembourg			
19.563	Corning Inc	455.347	0,06	USD 4.760.000	SG Issuer SA 14/8/2019 (Zero Coupon)	3.662.261	0,48
7.344	Cummins Inc	895.839	0,12	USD 5.380.000	SG Issuer SA 15/5/2020 (Zero Coupon)	4.758.257	0,63
8.610	Danaher Corp	732.289	0,10			8.420.518	1,11
16.224	DaVita Inc	928.992	0,12	Etats-Unis			
10.005	Eastman Chemical Co	894.048	0,12	USD 25.032.319	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/7/2025	21.086.685	2,77
7.883	Edwards Lifesciences Corp	927.281	0,12			21.086.685	2,77
9.433	Equifax Inc	920.916	0,12	Total des obligations		29.507.203	3,88
5.835	Facebook Inc 'A'	958.654	0,13	EXCHANGE TRADED FUNDS			
4.348	FedEx Corp	927.931	0,12	Guernesey			
19.562	FLIR Systems Inc	903.274	0,12	1.862.100	Better Capital PCC Ltd	520.057	0,07
22.185	Fluor Corp	926.323	0,12	7.420.354	Funding Circle SME Income Fund Ltd	8.797.103	1,16
13.229	Franklin Resources Inc	380.449	0,05	2.011.277	NB Distressed Debt Investment Fund Ltd	1.951.689	0,25
34.516	Gap Inc /The*	827.343	0,11			11.268.849	1,48
6.027	Gilead Sciences Inc	348.000	0,05	Irlande			
2.491	Goldman Sachs Group Inc/The	482.024	0,06	6.728.854	Carador Income Fund Plc	3.718.077	0,49
41.751	Goodyear Tire & Rubber Co /The	873.792	0,12	411.949	iShares Core MSCI World UCITS ETF ¹	19.256.556	2,54
38.687	H&R Block Inc	909.756	0,12	340.700	iShares EUR Ultrashort Bond UCITS ETF EUR Dist ¹	34.141.547	4,49
10.186	Hanesbrands Inc	159.077	0,02			57.116.180	7,52
6.944	Harris Corp	895.112	0,12	Jersey			
11.608	Hershey Co/The	895.386	0,12	12.318.140	Blackstone GSO Loan Financing Ltd	11.209.508	1,47
6.327	Hess Corp	327.489	0,04	10.638.795	Foresight Solar Fund Ltd	12.976.510	1,71
16.246	Hewlett Packard Enterprise Co	212.104	0,03			24.186.018	3,18
24.708	HP Inc	466.305	0,06				
4.926	Huntington Ingalls Industries Inc	932.914	0,12				
3.893	International Business Machines Corp	471.276	0,06				
5.667	Intuit Inc	978.726	0,13				
28.795	Masco Corp	919.378	0,12				
5.602	Mastercard Inc 'A'	912.407	0,12				
12.155	Mattel Inc	161.609	0,02				
28.761	Merck & Co Inc	1.466.755	0,19				
8.584	Monsanto Co	937.306	0,12				
9.960	Motorola Solutions Inc	915.880	0,12				
8.405	Murphy Oil Corp	221.412	0,03				
9.466	National Oilwell Varco Inc	335.888	0,04				
12.896	Nektar Therapeutics	886.800	0,12				
9.296	NetApp Inc	544.078	0,07				

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

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Organismes de placement collectif			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni				Luxembourg suite			
2.110.708	BlackRock Frontiers Investment Trust Plc ¹	3.705.361	0,49	581.085	BlackRock Global Funds - Asean Leaders X2 RF ¹	7.282.853	0,96
4.195.537	Scottish Mortgage Investment Trust Plc	24.391.552	3,21	821.731	BlackRock Global Funds - Euro Short Duration Bond Fund X2 (EUR) ¹	13.994.079	1,84
5.109.797	Woodford Patient Capital Trust Plc	4.292.920	0,56	8.243.462	BlackRock Global Funds - Global Corporate Bond Fund X2 (EUR) Hedged ¹	112.935.431	14,86
		32.389.833	4,26	1.838.646	BlackRock Global Funds - Global Equity Income X2 (USD) ¹	29.155.607	3,84
Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		124.960.880	16,44	165.024	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Impact World Equity Fund X2 (GBP) ¹	29.669.865	3,90
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		215.595.804	28,36	80.000	BlackRock Strategic Funds - European Credit Strategies Fund I2RF ¹	9.008.000	1,18
Organismes de placement collectif				39.873	Schroder International Selection Fund - Frontier Markets Equity I	6.243.540	0,82
Irlande						227.622.362	29,94
104.977.256	Institutional Cash Series Plc - Institutional Euro Liquidity Fund Agency Dis ¹	104.977.256	13,81	Total des organismes de placement collectif		496.028.213	65,25
1.200.000	Institutional Cash Series Plc - Institutional Ultra Bond Fund ¹	133.222.668	17,53	Portefeuille de titres à la valeur de marché		711.624.017	93,61
1.233.600	iShares Developed World Index Fund ¹	30.205.927	3,97	Autres éléments de l'actif net		48.556.593	6,39
		268.405.851	35,31	Total de l'actif net (EUR)		760.180.610	100,00
Luxembourg							
1.541.488	BlackRock Global Fund - Emerging Markets Equity Income Fund X2 (USD) ¹	19.332.987	2,54				

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
IRS	HUF 371.550.000	Fund receives Fixed 2,225% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	Barclays Bank	19/9/2028	(27.182)	(27.182)
IRS	HUF 495.395.000	Fund receives Fixed 2,229% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	BNP Paribas	19/9/2028	(35.682)	(35.682)
IRS	HUF 464.435.000	Fund receives Fixed 2,230% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	Goldman Sachs	19/9/2028	(33.320)	(33.320)
IRS	HUF 380.785.000	Fund receives Fixed 2,240% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	HSBC	19/9/2028	(26.242)	(26.242)
IRS	HUF 1.315.325.000	Fund receives Fixed 2,238% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	JP Morgan	19/9/2028	(91.575)	(91.575)
IRS	HUF 402.510.000	Fund receives Fixed 2,218% and pays Floating HUF 6 Month BUBOR	Morgan Stanley	19/9/2028	(30.244)	(30.244)
TRS	USD 21.490.007	Fund receives Vortex Alpha Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	17/9/2018	2.710.764	2.710.764
TRS	USD 9.046.952	Fund receives Bank of America Merrill Lynch Short Synthetic Rates Variance Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2019	(481.222)	(481.222)
TRS	USD 9.037.705	Fund receives Barclays WSEX Strategy Index and pays Fixed 0,600%	Barclays Bank	14/12/2018	(3.817)	(3.817)
TRS	EUR 21.847.010	Fund receives BNP Paribas European Share Buyback Basket Index and pays 3 Month EURIBOR	BNP Paribas	31/10/2018	1.460.179	1.460.179
TRS	EUR 1.445.800	Fund receives J.P. Morgan Euro Dispersion Strategy Index and pays Fixed 0,000%	BNP Paribas	20/12/2019	30.940	30.940
TRS	EUR 956.000	Fund receives J.P. Morgan Euro Dispersion Strategy Index and pays Fixed 0,000%	BNP Paribas	20/12/2019	20.458	20.458
TRS	USD 2.316.900	Fund receives BNP Paribas S&P 500 Stocks vs Index Volatility and pays Fixed 0,000%	BNP Paribas	17/1/2020	12.306	12.306
TRS	USD 2.316.800	Fund receives BNP Paribas S&P 500 Stocks vs Index Volatility and pays Fixed 0,000%	BNP Paribas	17/1/2020	31.114	12.305
TRS	USD 2.157.000	Fund receives BNP Paribas S&P 500 Stocks vs Index Volatility and pays Fixed 0,000%	BNP Paribas	17/1/2020	11.457	11.457
TRS	USD 46.841.150	Fund receives Emerging Lifestyle Trend Series 4 Basket Index and pays 6 Month LIBOR	Citibank	31/8/2018	4.624.602	4.624.602
TRS	USD 3.889.078	Fund receives Emerging Lifestyle Trend Series 4 Basket Index and pays 6 Month LIBOR	Citibank	31/8/2018	(54.135)	(54.135)
TRS	USD 8.840.034	Fund receives Citi Commodities Custom Basket B2 Index and pays Fixed 0,000%	Citibank	9/5/2019	(165.034)	(165.034)
TRS	USD 8.103.195	Fund receives DB US Equity Volatility Carry Straddle 5D Put Customised Index and pays Fixed 0,000%	Deutsche Bank	27/11/2018	(239.451)	(239.451)
TRS	EUR 1.411.980	Fund receives J.P. Morgan Euro Dispersion Strategy Index and pays Fixed 0,000%	Deutsche Bank	21/12/2018	105.193	105.193
TRS	USD 10.729.959	Fund receives Bloomberg WTI Crude Oil Subindex Total Return Capped Index and pays 3 Month LIBOR	Goldman Sachs	8/2/2019	9.116	9.116
TRS	EUR 1.050.600	Fund receives J.P. Morgan Euro Dispersion Strategy Index and pays Fixed 0,000%	JP Morgan	21/12/2018	83.313	83.313
TRS	EUR 1.292.500	Fund receives J.P. Morgan Euro Dispersion Strategy Index and pays Fixed 0,000%	JP Morgan	20/12/2019	(27.401)	(27.401)
TRS	USD 7.956.010	Fund receives MSCI Japan Small Cap Net Total Return USD Index and pays 3 Month LIBOR	Morgan Stanley	4/6/2018	173.468	173.468
TRS	USD 11.344.558	Fund receives MSCI Japan Small Cap Net Total Return USD Index and pays 3 Month LIBOR	Morgan Stanley	4/6/2018	247.350	247.350
TRS	EUR 22.912.511	Fund receives MSCI Brazil Index and pays 1 Month Euro Overnight Index Average	Morgan Stanley	21/5/2019	(821.983)	(821.983)
TRS	EUR 2.561.100	Fund receives J.P. Morgan Euro Dispersion Strategy Index and pays Fixed 0,000%	Societe Generale	19/6/2020	(29.967)	(29.967)
VAR	JPY 2.763.685	Nikkei 225 Index strike price JPY 26,50	Bank of America Merrill Lynch	13/12/2019	(148.730)	(148.730)
VAR	GBP 19.565	FTSE 100 Index strike price GBP 21,50	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2019	127.968	127.968
VAR	USD 30.296	GLD Index strike price USD 16,85	Citibank	15/6/2018	(144.377)	(144.377)
VAR	USD 30.330	GLD Index strike price USD 16,85	Citibank	15/6/2018	(144.894)	(144.894)
VAR	USD 145.462	GLD Index strike price USD 16,85	Citibank	15/6/2018	(689.698)	(689.698)
VAR	USD 32.857	GLD Index strike price USD 16,85	Citibank	15/6/2018	(155.791)	(155.791)
VAR	USD 60.681	GLD Index strike price USD 16,85	Citibank	15/6/2018	(285.801)	(285.801)
VAR	USD 151.550	GLD Index strike price USD 17,50	Citibank	15/6/2018	(779.610)	(779.610)
VAR	KRW 52.153.954	KOSPI 200 Index strike price KRW 19,60	Citibank	12/12/2019	(37.553)	(37.553)
VAR	KRW 34.543.120	KOSPI 200 Index strike price KRW 20,00	Citibank	12/12/2019	(34.416)	(34.416)
VAR	USD 48.470	S&P 500 Index strike price USD 19,80	Citibank	20/12/2019	56.008	56.008
VAR	USD 32.320	S&P 500 Index strike price USD 20,20	Citibank	20/12/2019	46.708	46.708
VAR	GBP 27.030	FTSE 100 Index strike price GBP 17,00	Societe Generale	13/12/2019	41.517	41.517
VAR	JPY 3.894.455	Nikkei 225 Index strike price JPY 21,70	Societe Generale	13/12/2019	(55.856)	(55.856)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
VAR	JPY 7.718.523	Nikkei 225 Index strike price JPY 21,90	Societe Generale	13/12/2019	(122.023)	(122.023)
VAR	JPY 3.859.284	Nikkei 225 Index strike price JPY 22,00	Societe Generale	13/12/2019	(63.772)	(63.772)
VAR	JPY 3.940.167	Nikkei 225 Index strike price JPY 22,975	Societe Generale	13/12/2019	(98.890)	(98.890)
VAR	JPY 7.308.800	Nikkei 225 Index strike price JPY 23,925	Societe Generale	13/12/2019	(239.003)	(239.003)
VAR	JPY 3.625.105	Nikkei 225 Index strike price JPY 23,98	Societe Generale	13/12/2019	(121.662)	(121.662)
VAR	JPY 7.139.436	Nikkei 225 Index strike price JPY 24,20	Societe Generale	13/12/2019	(251.663)	(251.663)
VAR	JPY 7.087.338	Nikkei 225 Index strike price JPY 24,30	Societe Generale	13/12/2019	(269.989)	(269.989)
VAR	JPY 7.250.200	Nikkei 225 Index strike price JPY 25,00	Societe Generale	13/12/2019	(314.393)	(314.393)
VAR	JPY 3.621.830	Nikkei 225 Index strike price JPY 25,10	Societe Generale	13/12/2019	(159.680)	(159.680)
VAR	JPY 7.494.394	Nikkei 225 Index strike price JPY 26,96	Societe Generale	13/12/2019	(423.473)	(423.473)
VAR	GBP 27.288	FTSE 100 Index strike price GBP 16,70	Societe Generale	20/12/2019	33.036	33.036
VAR	GBP 54.114	FTSE 100 Index strike price GBP 16,90	Societe Generale	20/12/2019	77.485	77.485
VAR	GBP 26.926	FTSE 100 Index strike price GBP 17,975	Societe Generale	20/12/2019	70.788	70.788
VAR	GBP 50.719	FTSE 100 Index strike price GBP 18,925	Societe Generale	20/12/2019	185.818	185.818
VAR	GBP 25.433	FTSE 100 Index strike price GBP 18,98	Societe Generale	20/12/2019	96.180	96.180
VAR	GBP 51.149	FTSE 100 Index strike price GBP 19,20	Societe Generale	20/12/2019	204.174	204.174
VAR	GBP 50.605	FTSE 100 Index strike price GBP 19,30	Societe Generale	20/12/2019	219.751	219.751
VAR	GBP 52.000	FTSE 100 Index strike price GBP 20,00	Societe Generale	20/12/2019	260.961	260.961
VAR	GBP 26.050	FTSE 100 Index strike price GBP 20,10	Societe Generale	20/12/2019	133.464	133.464
VAR	GBP 52.616	FTSE 100 Index strike price GBP 21,96	Societe Generale	20/12/2019	366.369	366.369
Total (exposition brute sous-jacente – 203.183.518 EUR)					4.831.958	4.813.149

IRS (*interest rate swaps*) : swaps sur taux d'intérêt

TRS (*total return swaps*) : swaps sur rendement total

VAR (*variance swaps*) : swaps de variance

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
(314)	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	36.560.712	674.605
(553)	EUR	EURO STOXX 50 Index	Juin 2018	19.316.290	(308.704)
(87)	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	7.656.784	(196.212)
(313)	USD	Mini MSCI Emerging Markets Index	Juin 2018	15.259.860	(105.493)
110	JPY	Topix Index	Juin 2018	15.352.313	171.923
348	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	29.006.789	4.279
Total				123.152.748	240.398

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	(Moins-value) non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
588	Put	EURO STOXX 50 Index	Bank of America Merrill Lynch	EUR 3.350,00	15/6/2018	(119.129)	151.704
49.750.000	Call	OTC USD/CNH	HSBC	USD 7,13	9/11/2018	(343.732)	20.031
Total (exposition brute sous-jacente – 6.546.091 EUR)						(462.861)	171.735

Options vendues au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	(Moins-value) non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
(49.750.000)	Put	OTC USD/CNH	HSBC	USD 6,56	9/11/2018	(687.374)	(997.642)
Total (exposition brute sous-jacente – 1.164.548 EUR)						(687.374)	(997.642)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	73.160.000	GBP	63.363.657	Goldman Sachs	26/7/2018	973.181
EUR	9.031.887	JPY	1.200.000.000	Bank of America Merrill Lynch	26/7/2018	(456.917)
EUR	181.800.000	USD	226.537.344	Goldman Sachs	26/7/2018	(11.855.788)
HUF	1.708.646.500	EUR	5.500.000	Morgan Stanley	26/7/2018	(149.815)
USD	4.080.000	AUD	5.244.418	ANZ	26/7/2018	90.576
USD	6.830.000	CAD	8.571.650	Citibank	26/7/2018	174.826
USD	7.950.000	CHF	7.555.004	Morgan Stanley	26/7/2018	213.803
USD	2.150.200	EUR	1.754.177	Barclays Bank	26/7/2018	83.925
USD	3.788.172	EUR	3.090.859	Goldman Sachs	26/7/2018	147.466
USD	920.979	EUR	750.788	JP Morgan	26/7/2018	36.513
USD	2.149.889	EUR	1.754.177	Morgan Stanley	26/7/2018	83.661
USD	6.841.081	GBP	4.802.667	Goldman Sachs	26/7/2018	376.687
USD	6.561.165	GBP	4.687.333	JP Morgan	26/7/2018	268.794
USD	2.790.000	SGD	3.647.758	Toronto Dominion Bank	26/7/2018	54.566
						(9.958.522)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Catégorie d'Actions couverte en dollars canadiens						
CAD	7.462	EUR	4.856	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	69
						69
Catégorie d'Actions couverte en couronnes suédoises						
EUR	1.332.985	SEK	13.716.811	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	2.414
SEK	476.967.723	EUR	45.944.110	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	323.136
						325.550
Total (exposition brute sous-jacente – 394.735.577 EUR)						(9.632.903)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund suite

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Organismes de placement collectif	65,25
<i>Exchange Traded Funds</i>	16,44
Biens de consommation non cyclique	2,79
Gouvernement	2,77
Valeurs industrielles	1,58
Finance	1,45
Communications	0,92
Technologie	0,85
Biens de consommation cyclique	0,81
Matériaux de base	0,59
Énergie	0,11
Services aux collectivités	0,05
Portefeuille de titres à la valeur de marché	93,61
Autres éléments de l'actif net	6,39
	100,00

BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Argentine				Qatar			
11.037	Grupo Financiero Galicia SA ADR	467.417	2,26	18.079	Industries Qatar QSC	507.400	2,45
		467.417	2,26			507.400	2,45
Bermudes				Russie			
950.350	Skyworth Digital Holdings Ltd	451.642	2,18	66.184	Gazprom PJSC ADR	304.447	1,47
		451.642	2,18	45.071	MegaFon PJSC	345.160	1,67
				36.302	Sberbank of Russia PJSC ADR	529.465	2,55
				373.538.132	VTB Bank PJSC	304.963	1,47
						1.484.035	7,16
Brésil				Afrique du Sud			
58.651	BRF SA ADR	335.484	1,62	67.818	AngloGold Ashanti Ltd	582.430	2,81
37.048	Cia Hering	168.922	0,81	27.103	Shoprite Holdings Ltd	508.159	2,45
3.998	Lojas Americanas SA (Pref)	19.077	0,09			1.090.589	5,26
139.621	MRV Engenharia e Participacoes SA	505.014	2,44				
		1.028.497	4,96				
Canada				Corée du Sud			
251.494	Eldorado Gold Corp	291.216	1,41	3.315	Hyundai Motor Co	427.464	2,06
		291.216	1,41	3.640	Hyundai Motor Co (Pref)	301.884	1,46
				812	Hyundai Motor Co GDR	33.698	0,16
Îles Caïmans				100.312	Pan Ocean Co Ltd	470.874	2,27
274.396	Crystal International Group Ltd p'144A'	275.141	1,33	8.208	Shinhan Financial Group Co Ltd	333.133	1,61
		275.141	1,33	9.601	Shinhan Financial Group Co Ltd ADR	392.393	1,90
				2.299	SK Holdings Co Ltd	590.772	2,85
						2.550.218	12,31
Chine				Taïwan			
802.000	Bank of China Ltd 'H'	418.948	2,02	49.000	Merry Electronics Co Ltd	239.591	1,16
22.911	China Life Insurance Co Ltd ADR	317.088	1,53	61.000	Nanya Technology Corp	202.780	0,98
1.002.000	Huadian Power International Corp Ltd	460.869	2,23			442.371	2,14
		1.196.905	5,78				
Grèce				Thaïlande			
154.692	Alpha Bank AE*	334.164	1,61	915.500	Land & Houses PCL	320.525	1,55
1.193.368	National Bank of Greece SA*	372.641	1,80	2.013.800	Land & Houses PCL NVDR	698.755	3,37
		706.805	3,41			1.019.280	4,92
Hong Kong				Turquie			
66.500	China Mobile Ltd	593.092	2,86	89.720	Arcelik AS	327.911	1,58
268.000	China Resources Power Holdings Co Ltd	548.381	2,65			327.911	1,58
1.087.000	Guotai Junan International Holdings Ltd*	296.378	1,43	Émirats arabes unis			
367.000	SJM Holdings Ltd	526.510	2,54	573.335	Emaar Properties PJSC	811.658	3,92
		1.964.361	9,48			811.658	3,92
Inde				Total des actions ordinaires et privilégiées			
141.751	Bank of India	207.115	1,00			17.059.724	82,34
173.576	Fortis Healthcare Ltd	378.365	1,83	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
95.517	Jindal Steel & Power Ltd	324.064	1,56			17.059.724	82,34
		909.544	4,39				
Indonésie				Organismes de placement collectif			
761.400	Semen Indonesia Persero Tbk PT	460.292	2,22	Irlande			
		460.292	2,22	1.503.185	Institutional Cash Series Plc - Institutional US Dollar Liquidity Fund Agency Dis ¹	1.503.185	7,25
Malaisie						1.503.185	7,25
1.894.300	Sapura Energy Bhd	261.775	1,26	Total des organismes de placement collectif			
		261.775	1,26			1.503.185	7,25
Pologne				Portefeuille de titres à la valeur de marché			
9.198	Alior Bank SA	171.977	0,83			18.562.909	89,59
21.225	Bank Pekao SA	640.690	3,09	Autres éléments de l'actif net			
		812.667	3,92			2.155.974	10,41
				Total de l'actif net (USD)			
						20.718.883	100,00

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

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Brésil				Corée du Sud			
(25.931)	Raia Drogasil SA	HSBC	17.330	(2.391)	Celltrion Inc	HSBC	(66.899)
			17.330	(4.100)	Daelim Industrial Co Ltd	HSBC	13.708
				(4.682)	S-Oil Corp	Credit Suisse	(5.895)
				17.504	Samsung Engineering Co Ltd	HSBC	20.270
							(38.816)
France				Taiwan			
(1.653)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Deutsche Bank	9.152	(389.000)	HannStar Display Corp	Bank of America	
			9.152			Merrill Lynch	(8.131)
				(93.000)	Micro-Star International Co Ltd	Deutsche Bank	(6.667)
Hong Kong				(87.000)	Primax Electronics Ltd	HSBC	3.683
(72.400)	AIA Group Ltd	Credit Suisse	(24.051)	(36.000)	Win Semiconductors Corp	Credit Suisse	33.199
(263.000)	Country Garden Holdings Co Ltd	Credit Suisse	22.050	(390.000)	Wistron Corp	Credit Suisse	18.824
(43.000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Deutsche Bank	(4.440)				40.908
(143.000)	Geely Automobile Holdings Ltd	Credit Suisse	12.718	Thaïlande			
(128.000)	Sunac China Holdings Ltd	Deutsche Bank	83.901	(258.380)	Airports of Thailand PCL	Deutsche Bank	19.247
(36.900)	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	Deutsche Bank	(47.122)	(276.266)	BTS Group Holdings PCL (Wts 1/11/2018)	Deutsche Bank	88
(418.000)	Xinyi Solar Holdings Ltd	Credit Suisse	13.687	(261.100)	CP ALL PCL	Deutsche Bank	38.036
(52.000)	Xinyi Solar Holdings Ltd	Deutsche Bank	1.935				57.371
			58.678	Turquie			
Hongrie				(177.876)	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	HSBC	(12.788)
(13.874)	OTP Bank Nyrt	Deutsche Bank	60.381	(115.101)	Tekfen Holding AS	HSBC	24.407
			60.381	(112.876)	Turk Hava Yollari AO	HSBC	4.924
Indonésie				(468.988)	Yapi ve Kredi Bankasi AS	Goldman Sachs	36.597
1.365.900	Astra International Tbk PT	Deutsche Bank	4.430				53.140
			4.430	Émirats arabes unis			
Malaisie				(57.053)	Emaar Malls PJSC	Bank of America	
(459.900)	IHH Healthcare Bhd	Deutsche Bank	20.311			Merrill Lynch	2.960
(110.900)	Public Bank Bhd	Deutsche Bank	(42.606)	(5.636)	Emaar Malls PJSC	HSBC	–
			(22.295)	60.230	Emaar Properties PJSC	Deutsche Bank	653
							3.613
Philippines				Royaume-Uni			
(188.700)	Ayala Land Inc	Citibank	8.684	(27.832)	Prudential Plc	HSBC	46.031
(221.550)	Ayala Land Inc	Deutsche Bank	10.662				46.031
(227.300)	Ayala Land Inc	HSBC	3.564	Etats-Unis			
(36.955)	Bank of the Philippine Islands	HSBC	2.516	(2.415)	Credicorp Ltd	HSBC	18.233
(191.862)	Bank of the Philippine Islands	Deutsche Bank	15.139	(9.548)	Ctrip.com International Ltd ADR	Deutsche Bank	(15.695)
(52.570)	Bank of the Philippine Islands	Credit Suisse	3.564	(10.905)	JD.com Inc ADR	Credit Suisse	12.105
(85.350)	BDO Unibank Inc	HSBC	(2.263)	(13.688)	Pagseguro Digital Ltd	Deutsche Bank	(5.910)
(102.806)	BDO Unibank Inc	Bank of America		(14.412)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	HSBC	9.296
		Merrill Lynch	7.303	(8.376)	Tencent Holdings Ltd ADR	Deutsche Bank	(2.680)
(2)	BDO Unibank Inc	Deutsche Bank	–	(41.865)	Vale SA ADR	HSBC	1.256
			49.169				16.605
Qatar				Total (exposition brute sous-jacente – 19.382.240 USD)			
(26.632)	Commercial Bank PQSC/The	HSBC	(149)				386.561
			(149)				
Russie							
(29.766)	Tatneft PJSC	HSBC	(5.398)				
			(5.398)				
Afrique du Sud							
(43.858)	MTN Group Ltd	HSBC	36.411				
			36.411				

BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
(51)	INR	Bajaj Auto Ltd	Juin 2018	523.433	3.932
Total				523.433	3.932

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
BRL	15.336	USD	4.102	State Street Bank & Trust Company	1/6/2018	16
BRL	48.620	USD	13.036	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	20
TRY	6.164.920	USD	1.285.698	Deutsche Bank	27/8/2018	28.996
USD	1.560	BRL	5.831	State Street Bank & Trust Company	1/6/2018	(6)
USD	2.587	BRL	9.649	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(4)
USD	884.939	TRY	4.110.000	HSBC	27/8/2018	8.465
						37.487

Catégorie d'Actions couverte en euros

EUR	16.663.320	USD	19.820.166	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(393.054)
USD	1.277.624	EUR	1.076.817	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	22.206
						(370.848)

Catégorie d'Actions couverte en livres sterling

GBP	12.662	USD	17.192	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(353)
USD	1.045	GBP	771	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	20
						(333)
Total (exposition brute sous-jacente – 22.912.891 USD)						(333.694)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	27,02
Biens de consommation cyclique	19,57
Matériaux de base	8,23
Organismes de placement collectif	7,25
Biens de consommation non cyclique	5,90
Valeurs industrielles	5,65
Services aux collectivités	4,88
Communications	4,53
Technologie	3,83
Énergie	2,73
Portefeuille de titres à la valeur de marché	89,59
Autres éléments de l'actif net	10,41
100,00	

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS				Chili suite			
USD 150.000	Argentine Argentine Republic Government International Bond 6,875% 22/4/2021	151.613	0,22	USD 200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile RegS 3,625% 1/8/2027	191.115	0,28
USD 225.000	Argentine Republic Government International Bond 5,625% 26/1/2022	221.344	0,32	USD 200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile RegS 4,25% 17/7/2042	190.258	0,27
USD 400.000	Argentine Republic Government International Bond 7,50% 22/4/2026	397.500	0,57			1.632.955	2,36
USD 300.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875% 26/1/2027	285.750	0,41	Chine			
USD 150.000	Argentine Republic Government International Bond 6,625% 6/7/2028	137.100	0,20	USD 200.000	China Development Bank RegS 2,125% 1/6/2021	192.950	0,28
USD 238.346	Argentine Republic Government International Bond 8,28% 31/12/2033	241.028	0,35	USD 200.000	Export-Import Bank of China / The RegS 3,375% 14/3/2027	190.000	0,27
USD 70.102	Argentine Republic Government International Bond 8,28% 31/12/2033	69.312	0,10			382.950	0,55
USD 150.000	Argentine Republic Government International Bond 7,125% 6/7/2036	133.500	0,19	Colombie			
USD 150.000	Argentine Republic Government International Bond 7,625% 22/4/2046	134.625	0,20	USD 300.000	Colombia Government International Bond 4,375% 12/7/2021	305.250	0,44
USD 325.000	Argentine Republic Government International Bond (Step-up Coupon) 2,50% 31/12/2038	197.437	0,29	USD 175.000	Colombia Government International Bond 2,625% 15/3/2023	164.412	0,24
USD 175.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 7,125% 28/6/2117	147.175	0,21	USD 200.000	Colombia Government International Bond 4,00% 26/2/2024	198.800	0,29
		2.116.384	3,06	USD 200.000	Colombia Government International Bond 4,50% 28/1/2026	202.500	0,29
Brésil				USD 200.000	Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	192.000	0,28
USD 300.000	Brazilian Government International Bond 4,25% 7/1/2025	289.500	0,42	USD 200.000	Colombia Government International Bond 7,375% 18/9/2037	249.500	0,36
USD 300.000	Brazilian Government International Bond 6,00% 7/4/2026	315.750	0,46	USD 450.000	Colombia Government International Bond 6,125% 18/1/2041	498.150	0,72
USD 100.000	Brazilian Government International Bond 5,625% 7/1/2041	89.900	0,13	USD 200.000	Colombia Government International Bond 5,625% 26/2/2044	211.000	0,30
USD 400.000	Brazilian Government International Bond 5,00% 27/1/2045	328.000	0,47	USD 200.000	Colombia Government International Bond 5,00% 15/6/2045	193.800	0,28
		1.023.150	1,48			2.215.412	3,20
Îles Vierges britanniques				Hongrie			
USD 100.000	Sinochem Overseas Capital Co Ltd RegS 4,50% 12/11/2020	102.040	0,15	USD 200.000	Hungary Government International Bond 6,25% 29/1/2020	209.390	0,30
USD 200.000	Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd RegS 4,375% 17/10/2023	205.786	0,30	USD 450.000	Hungary Government International Bond 6,375% 29/3/2021	483.048	0,70
USD 200.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd RegS 3,25% 13/9/2027	187.673	0,27	USD 300.000	Hungary Government International Bond 5,375% 21/2/2023	318.957	0,46
USD 200.000	State Grid Overseas Investment 2013 Ltd RegS 3,125% 22/5/2023	195.705	0,28	USD 500.000	Hungary Government International Bond 5,75% 22/11/2023	542.620	0,79
		691.204	1,00	USD 350.000	Hungary Government International Bond 5,375% 25/3/2024	374.468	0,54
Chili				USD 200.000	Hungary Government International Bond 7,625% 29/3/2041	278.100	0,40
CLP 649.879.680	Bonos del Banco Central de Chile en UF 3,00% 1/3/2022	1.108.707	1,60			2.206.583	3,19
USD 150.000	Chile Government International Bond 2,25% 30/10/2022	142.875	0,21	Indonésie			
				USD 350.000	Indonesia Government International Bond RegS 4,875% 5/5/2021	361.421	0,52
				USD 500.000	Indonesia Government International Bond RegS 5,875% 15/1/2024	541.360	0,78
				USD 500.000	Indonesia Government International Bond RegS 4,75% 8/1/2026	514.660	0,75
				USD 150.000	Indonesia Government International Bond RegS 7,75% 17/1/2038	197.850	0,29
				USD 300.000	Indonesia Government International Bond RegS 5,25% 17/1/2042	306.900	0,44
				USD 350.000	Indonesia Government International Bond RegS 6,75% 15/1/2044	429.919	0,62
				USD 200.000	Indonesia Government International Bond RegS 5,125% 15/1/2045	202.980	0,29
				USD 200.000	Indonesia Government International Bond RegS 5,25% 8/1/2047	204.644	0,30

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Indonésie suite				Pérou			
IDR 18.509.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,00% 15/5/2027	1.327.526	1,92	USD 200.000	Peruvian Government International Bond 7,35% 21/7/2025	245.500	0,35
USD 200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III RegS 4,35% 10/9/2024	200.378	0,29	USD 100.000	Peruvian Government International Bond 4,125% 25/8/2027	102.200	0,15
		4.287.638	6,20	USD 100.000	Peruvian Government International Bond 8,75% 21/11/2033	146.563	0,21
Kazakhstan				USD 200.000	Peruvian Government International Bond 6,55% 14/3/2037	251.500	0,36
USD 200.000	Kazakhstan Government International Bond RegS 5,125% 21/7/2025	213.300	0,31	USD 200.000	Peruvian Government International Bond 5,625% 18/11/2050	232.500	0,34
USD 200.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 4,75% 19/4/2027	197.750	0,28	USD 200.000	Petroleos del Peru SA RegS 4,75% 19/6/2032	190.750	0,28
		411.050	0,59			1.169.013	1,69
Malaisie				Philippines			
USD 250.000	Malaysia Sukuk Global Bhd RegS 3,179% 27/4/2026	241.026	0,35	USD 150.000	Philippine Government International Bond 8,375% 17/6/2019	158.389	0,23
USD 150.000	Petronas Capital Ltd RegS 7,875% 22/5/2022	173.692	0,25	USD 100.000	Philippine Government International Bond 4,00% 15/1/2021	101.885	0,15
USD 200.000	Petronas Capital Ltd RegS 3,50% 18/3/2025	195.352	0,28	USD 200.000	Philippine Government International Bond 4,20% 21/1/2024	205.343	0,30
USD 200.000	Petronas Capital Ltd RegS 4,50% 18/3/2045	204.024	0,30	USD 100.000	Philippine Government International Bond 10,625% 16/3/2025	140.530	0,20
		814.094	1,18	USD 200.000	Philippine Government International Bond 5,50% 30/3/2026	221.435	0,32
Mexique				USD 200.000	Philippine Government International Bond 9,50% 2/2/2030	294.800	0,43
MXN 11.203.973	Mexican Udbonos 4,50% 4/12/2025	592.984	0,86	USD 200.000	Philippine Government International Bond 7,75% 14/1/2031	266.879	0,39
USD 100.000	Mexico Government International Bond 3,50% 21/1/2021	99.975	0,14	USD 100.000	Philippine Government International Bond 6,375% 15/1/2032	121.211	0,17
USD 126.000	Mexico Government International Bond 3,625% 15/3/2022	125.622	0,18	USD 100.000	Philippine Government International Bond 6,375% 23/10/2034	123.348	0,18
USD 400.000	Mexico Government International Bond 4,00% 2/10/2023	402.200	0,58	USD 200.000	Philippine Government International Bond 5,00% 13/1/2037	217.681	0,31
USD 400.000	Mexico Government International Bond 3,60% 30/1/2025	386.900	0,56	USD 200.000	Philippine Government International Bond 3,95% 20/1/2040	194.395	0,28
USD 200.000	Mexico Government International Bond 4,125% 21/1/2026	198.750	0,29	USD 200.000	Philippine Government International Bond 3,70% 1/3/2041	187.372	0,27
USD 200.000	Mexico Government International Bond 4,15% 28/3/2027	196.800	0,28	USD 200.000	Philippine Government International Bond 3,70% 2/2/2042	187.146	0,27
USD 190.000	Mexico Government International Bond 6,75% 27/9/2034	224.533	0,33			2.420.414	3,50
USD 200.000	Mexico Government International Bond 6,05% 11/1/2040	218.200	0,32	Pologne			
USD 376.000	Mexico Government International Bond 4,75% 8/3/2044	348.740	0,50	USD 250.000	Poland Government International Bond 6,375% 15/7/2019	260.297	0,38
USD 225.000	Mexico Government International Bond 5,55% 21/1/2045	232.875	0,34	USD 550.000	Poland Government International Bond 5,125% 21/4/2021	578.174	0,83
USD 200.000	Mexico Government International Bond 4,60% 23/1/2046	181.200	0,26	USD 775.000	Poland Government International Bond 5,00% 23/3/2022	818.129	1,18
USD 400.000	Mexico Government International Bond 5,75% 12/10/2110	388.400	0,56	USD 250.000	Poland Government International Bond 3,00% 17/3/2023	243.945	0,35
		3.597.179	5,20	USD 550.000	Poland Government International Bond 4,00% 22/1/2024	559.152	0,81
Panama				USD 500.000	Poland Government International Bond 3,25% 6/4/2026	483.430	0,70
USD 200.000	Panama Government International Bond 4,00% 22/9/2024	203.000	0,29			2.943.127	4,25
USD 200.000	Panama Government International Bond 3,75% 16/3/2025	197.750	0,29	Roumanie			
USD 100.000	Panama Government International Bond 7,125% 29/1/2026	119.750	0,17	USD 550.000	Romanian Government International Bond RegS 6,75% 7/2/2022	600.531	0,87
USD 50.000	Panama Government International Bond 8,875% 30/9/2027	68.000	0,10	USD 300.000	Romanian Government International Bond RegS 4,375% 22/8/2023	303.375	0,44
USD 400.000	Panama Government International Bond 3,875% 17/3/2028	394.500	0,57	USD 100.000	Romanian Government International Bond RegS 4,875% 22/1/2024	103.375	0,15
USD 150.000	Panama Government International Bond 6,70% 26/1/2036	185.997	0,27	USD 226.000	Romanian Government International Bond RegS 6,125% 22/1/2044	263.855	0,38
USD 200.000	Panama Government International Bond 4,30% 29/4/2053	188.500	0,27			1.271.136	1,84
		1.357.497	1,96				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Russie				Turquie suite			
USD 600.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,50% 4/4/2022	611.700	0,88	USD 200.000	Turkey Government International Bond 5,75% 11/5/2047	166.125	0,24
USD 200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,875% 16/9/2023	208.500	0,30			2.301.369	3,33
USD 200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,75% 27/5/2026	201.750	0,29	Ukraine			
USD 400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 5,625% 4/4/2042	414.000	0,60	USD 100.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2024	100.750	0,14
USD 200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 5,875% 16/9/2043	212.750	0,31			100.750	0,14
USD 400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 5,25% 23/6/2047	381.000	0,55	Royaume-Uni			
USD 445.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS (Step-up Coupon) 7,50% 31/3/2030	494.840	0,72	USD 100.000	HSBC Holdings Plc 6,50% 15/9/2037	120.417	0,17
		2.524.540	3,65	USD 150.000	HSBC Holdings Plc 6,10% 14/1/2042	185.506	0,27
						305.923	0,44
Afrique du Sud				Etats-Unis			
USD 100.000	South Africa Government International Bond 6,875% 27/5/2019	103.438	0,15	USD 50.000	Amazon.com Inc 4,95% 5/12/2044	57.062	0,08
USD 150.000	South Africa Government International Bond 5,875% 30/5/2022	159.187	0,23	USD 150.000	Amazon.com Inc '144A' 4,05% 22/8/2047	149.977	0,22
ZAR 9.145.818	South Africa Government International Bond 5,50% 7/12/2023	843.160	1,22	USD 175.000	Apple Inc 3,85% 4/5/2043	170.493	0,25
USD 200.000	South Africa Government International Bond 4,665% 17/1/2024	199.250	0,29	USD 175.000	Apple Inc 4,65% 23/2/2046	191.472	0,28
USD 400.000	South Africa Government International Bond 5,875% 16/9/2025	417.500	0,60	USD 50.000	Apple Inc 4,25% 9/2/2047	51.552	0,07
USD 200.000	South Africa Government International Bond 4,30% 12/10/2028	183.250	0,26	USD 150.000	Apple Inc 3,75% 13/11/2047	143.362	0,21
USD 100.000	South Africa Government International Bond 6,25% 8/3/2041	103.625	0,15	USD 100.000	Cisco Systems Inc 5,90% 15/2/2039	126.311	0,18
		2.009.410	2,90	USD 50.000	Cisco Systems Inc 5,50% 15/1/2040	61.070	0,09
Corée du Sud				USD 100.000	Eli Lilly & Co 3,70% 1/3/2045	96.612	0,14
KRW 923.887.800	Inflation Linked Korea Treasury Bond 1,125% 10/6/2023	865.264	1,25	USD 125.000	Exxon Mobil Corp 4,114% 1/3/2046	128.423	0,19
		865.264	1,25	USD 200.000	General Electric Co 5,875% 14/1/2038	228.753	0,33
Turquie				USD 50.000	General Electric Co 6,875% 10/1/2039	63.821	0,09
USD 100.000	Turkey Government International Bond 7,50% 7/11/2019	104.000	0,15	USD 50.000	General Electric Co 4,125% 9/10/2042	46.017	0,07
USD 200.000	Turkey Government International Bond 7,00% 5/6/2020	207.000	0,30	USD 125.000	Goldman Sachs Group Inc /The 6,125% 15/2/2033	145.368	0,21
USD 100.000	Turkey Government International Bond 5,625% 30/3/2021	100.750	0,15	USD 50.000	Goldman Sachs Group Inc /The 6,25% 1/2/2041	60.114	0,09
USD 200.000	Turkey Government International Bond 6,25% 26/9/2022	204.250	0,29	USD 150.000	Intel Corp 4,25% 15/12/2042	155.675	0,22
USD 200.000	Turkey Government International Bond 5,75% 22/3/2024	197.375	0,28	USD 50.000	Intel Corp '144A' 3,734% 8/12/2047	47.979	0,07
USD 220.000	Turkey Government International Bond 4,25% 14/4/2026	192.775	0,28	USD 100.000	International Business Machines Corp 4,00% 20/6/2042	99.104	0,14
USD 400.000	Turkey Government International Bond 6,00% 25/3/2027	384.250	0,56	USD 50.000	Johnson & Johnson 4,375% 5/12/2033	53.973	0,08
USD 100.000	Turkey Government International Bond 11,875% 15/1/2030	138.500	0,20	USD 100.000	Johnson & Johnson 3,625% 3/3/2037	98.775	0,14
USD 125.000	Turkey Government International Bond 6,75% 30/5/2040	117.969	0,17	USD 50.000	Johnson & Johnson 4,50% 1/9/2040	55.185	0,08
USD 400.000	Turkey Government International Bond 4,875% 16/4/2043	304.750	0,44	USD 100.000	Johnson & Johnson 3,70% 1/3/2046	98.983	0,14
USD 200.000	Turkey Government International Bond 6,625% 17/2/2045	183.625	0,27	USD 50.000	Merck & Co Inc 3,60% 15/9/2042	47.322	0,07
				USD 125.000	Merck & Co Inc 3,70% 10/2/2045	120.195	0,17
				USD 175.000	Microsoft Corp 3,45% 8/8/2036	169.634	0,24
				USD 100.000	Microsoft Corp 4,10% 6/2/2037	105.176	0,15
				USD 150.000	Microsoft Corp 5,30% 8/2/2041	182.069	0,26
				USD 75.000	Microsoft Corp 3,70% 8/8/2046	73.346	0,11
				USD 200.000	Microsoft Corp 4,25% 6/2/2047	213.838	0,31
				USD 50.000	Morgan Stanley 6,375% 24/7/2042	62.459	0,09
				USD 175.000	Morgan Stanley 4,30% 27/1/2045	169.286	0,24
				USD 100.000	NIKE Inc 3,875% 1/11/2045	97.529	0,14
				USD 50.000	Oracle Corp 3,85% 15/7/2036	49.351	0,07
				USD 175.000	Oracle Corp 3,80% 15/11/2037	171.347	0,25
				USD 50.000	Oracle Corp 4,125% 15/5/2045	49.939	0,07
				USD 175.000	Oracle Corp 4,00% 15/7/2046	172.562	0,25
				USD 150.000	Oracle Corp 4,00% 15/11/2047	147.895	0,21
				USD 100.000	PepsiCo Inc 4,25% 22/10/2044	103.341	0,15
				USD 75.000	PepsiCo Inc 4,45% 14/4/2046	79.737	0,12
				USD 75.000	PepsiCo Inc 3,45% 6/10/2046	68.154	0,10
				USD 150.000	Pfizer Inc 4,30% 15/6/2043	155.588	0,22
				USD 50.000	Pfizer Inc 4,40% 15/5/2044	52.917	0,08
				USD 1.300.000	United States Treasury Bill 31/5/2018 (Zero Coupon)	1.300.000	1,88

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis			
USD 1.400.000	United States Treasury Bill 28/6/2018 (Zero Coupon)	1.398.167	2,02	USD 500.000	Bank of Nova Scotia/Houston 0% 21/9/2018	500.000	0,72
USD 2.000.000	United States Treasury Bill 5/7/2018 (Zero Coupon)	1.996.721	2,89	USD 600.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 0% 13/11/2018	600.000	0,87
USD 500.000	United States Treasury Bill 29/11/2018 (Zero Coupon)	494.903	0,72	USD 900.000	Citibank/New York 0% 10/7/2018	900.000	1,30
USD 50.000	Visa Inc 4,15% 14/12/2035	52.621	0,08	USD 800.000	DNB ASA 0% 6/8/2018	800.000	1,16
USD 100.000	Visa Inc 4,30% 14/12/2045	105.599	0,15	USD 250.000	Royal Bank of Canada/New York 0% 6/11/2018	250.000	0,36
USD 50.000	Walmart Inc 6,20% 15/4/2038	66.087	0,10	USD 1.500.000	Standard Chartered Bank 0% 14/6/2018	1.500.000	2,17
USD 50.000	Walmart Inc 4,00% 11/4/2043	50.836	0,07	USD 800.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 0% 21/8/2018	800.000	1,16
USD 175.000	Walmart Inc 3,625% 15/12/2047	167.966	0,24	USD 700.000	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 0% 12/10/2018	700.000	1,01
USD 50.000	Walt Disney Co /The 4,125% 1/6/2044	50.106	0,07	USD 500.000	The Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ 0% 22/6/2018	500.000	0,72
		10.304.772	14,89	USD 750.000	Wells Fargo Bank NA 0% 15/11/2018	750.000	1,08
Uruguay				USD 500.000	Wells Fargo Bank NA 0% 19/11/2018	500.000	0,72
USD 50.000	Uruguay Government International Bond 4,50% 14/8/2024	51.625	0,07			7.800.000	11,27
USD 75.000	Uruguay Government International Bond 4,125% 20/11/2045	67.499	0,10	Total des certificats de dépôt		8.800.000	12,72
USD 150.000	Uruguay Government International Bond 5,10% 18/6/2050	149.438	0,22				
		268.562	0,39	BILLET DE TRÉSORERIE			
Venezuela				France			
USD 570.000	Venezuela Government International Bond (Defaulted) 9,25% 15/9/2027	171.710	0,25	USD 500.000	BPCE SA 1/10/2018 (Zero Coupon)	495.882	0,72
USD 105.000	Venezuela Government International Bond (Defaulted) 9,375% 13/1/2034	33.075	0,05			495.882	0,72
USD 300.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 6,00% 9/12/2020	86.249	0,12	USD 750.000	Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 10/7/2018 (Zero Coupon)	748.521	1,08
USD 85.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 9,00% 7/5/2023	24.501	0,04	USD 450.000	Bedford Row Funding Corp FRN 11/6/2018	450.000	0,65
USD 75.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 7,65% 21/4/2025	21.468	0,03	USD 700.000	BPCE SA 1/8/2018 (Zero Coupon)	697.118	1,01
USD 240.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 11,75% 21/10/2026	73.499	0,11	USD 700.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 22/8/2018 (Zero Coupon)	700.000	1,01
USD 215.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 9,25% 7/5/2028	61.974	0,09	USD 650.000	Federation des caisses Desjardins du Quebec 14/6/2018 (Zero Coupon)	649.582	0,94
USD 105.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 7,75% 13/10/2019	30.581	0,04	USD 350.000	HSBC Bank Plc RegS 11/4/2019 (Zero Coupon)	350.000	0,51
USD 250.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 12,75% 23/8/2022	75.187	0,11	USD 1.500.000	ING US Funding LLC 9/7/2018 (Zero Coupon)	1.500.000	2,17
USD 410.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 8,25% 13/10/2024	118.386	0,17	USD 750.000	JP Morgan Securities LLC 7/8/2018 (Zero Coupon)	747.599	1,08
USD 270.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 11,95% 5/8/2031	81.202	0,12	USD 250.000	JP Morgan Securities LLC 22/2/2019 (Zero Coupon)	245.419	0,35
USD 75.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 7,00% 31/3/2038	22.219	0,03	USD 250.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 13/6/2018 (Zero Coupon)	249.833	0,36
		800.051	1,16	USD 1.000.000	NRW. Bank 17/7/2018 (Zero Coupon)	997.342	1,44
Total des obligations		48.020.427	69,40	USD 250.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 8/6/2018 (Zero Coupon)	249.895	0,36
CERTIFICATS DE DÉPÔT				USD 500.000	Prudential Plc 18/6/2018 (Zero Coupon)	499.528	0,72
France				USD 250.000	Prudential Plc 27/6/2018 (Zero Coupon)	249.614	0,36
USD 1.000.000	Credit Industriel et Commercial/ New York FRN15/11/2018	1.000.000	1,45	USD 1.400.000	Sheffield Receivables Corp 2/7/2018 (Zero Coupon)	1.397.191	2,02
		1.000.000	1,45	USD 500.000	UBS AG/London 4/4/2019 (Zero Coupon)	500.000	0,72
						10.231.642	14,78
				Total des billets de trésorerie		10.727.524	15,50
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		67.547.951	97,62
				Portefeuille de titres à la valeur de marché		67.547.951	97,62
				Autres éléments de l'actif net		1.648.649	2,38
				Total de l'actif net (USD)		69.196.600	100,00

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Brésil				Grèce suite			
3.300	Banco do Brasil SA	Deutsche Bank	(3.770)	666	National Bank of Greece SA	Bank of America	
7.900	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA 'B' (Pref)	Deutsche Bank	(2.811)	1.630	OPAP SA	Merrill Lynch	(23)
9.600	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA 'B' (Pref)	Bank of America				Bank of America	
2.754	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	Merrill Lynch	(3.147)	6	Piraeus Bank SA	Merrill Lynch	(548)
11.700	Equatorial Energia SA	Bank of America	(1.433)	1.748	Piraeus Bank SA	Bank of America	(3)
13.600	Hypera SA	Merrill Lynch	(10.587)	37	Titan Cement Co SA	Deutsche Bank	(906)
68.600	Hypera SA	Deutsche Bank	(3.137)	264	Titan Cement Co SA	Deutsche Bank	(33)
		Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(12.676)			Merrill Lynch	(228)
21.050	Iochpe Maxion SA	Deutsche Bank	(19.355)				(10.778)
41.500	Iochpe Maxion SA	Bank of America		Hong Kong			
		Merrill Lynch	(38.128)	22.000	Angang Steel Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(1.174)
1.000	IRB Brasil Resseguros S/A	Bank of America	(765)	122.000	Anhui Expressway Co Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch				Merrill Lynch	(5.582)
3.021	Itau Unibanco Holding SA (Pref)	Deutsche Bank	(4.136)	23.500	BAIC Motor Corp Ltd 'H' '144A'	Deutsche Bank	(535)
30.096	Itau Unibanco Holding SA (Pref)	Bank of America		41.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	Bank of America	
600	Magazine Luiza SA	Merrill Lynch	(38.918)	51.000	BBMG Corp 'H'	Merrill Lynch	(830)
		Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	87	2.200	BOC Aviation Ltd '144A'	Merrill Lynch	(452)
30.800	Minerva SA/Brazil	Deutsche Bank	(790)			Bank of America	
11.600	Minerva SA/Brazil	Bank of America		133.500	BYD Electronic International Co Ltd	Merrill Lynch	(40)
		Merrill Lynch	(166)			Deutsche Bank	(16.294)
3.700	Petrobras Distribuidora SA	Bank of America	(3.310)	81.000	BYD Electronic International Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch				Merrill Lynch	(9.887)
75.250	Randon SA Implementos e Participacoes (Pref)	Deutsche Bank	(29.051)	7.000	CAR Inc	Deutsche Bank	1.125
23.300	Randon SA Implementos e Participacoes (Pref)	Bank of America		17.000	China Agri-Industries Holdings Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.688)			Merrill Lynch	(129)
13.600	Sul America SA (Unit)	Deutsche Bank	350	96.000	China Aoyuan Property Group Ltd	Bank of America	
300	TIM Participacoes SA	Deutsche Bank	(52)			Merrill Lynch	(3.535)
9.300	TIM Participacoes SA	Bank of America		227.000	China Aoyuan Property Group Ltd	Deutsche Bank	(6.691)
		Merrill Lynch	(1.406)			Deutsche Bank	(10.471)
3.800	Ultrapar Participacoes SA	Deutsche Bank	(5.122)	179.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	Deutsche Bank	
1.750	Ultrapar Participacoes SA	Bank of America		64.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.207)			Merrill Lynch	(3.744)
8.300	Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de Pagamento e Identificacao SA	Bank of America		69.000	China Coal Energy Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(1.226)
		Merrill Lynch	(2.615)	18.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'	Deutsche Bank	(44)
5.000	Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de Pagamento e Identificacao SA	Deutsche Bank	(1.729)	148.000	China Communications Services Corp Ltd 'H'	Bank of America	
			(193.562)			Merrill Lynch	(363)
France				34.000	China Everbright Ltd	Deutsche Bank	98
12	Alstom SA	Deutsche Bank	14	154.000	China Everbright Ltd	Bank of America	
11	LafargeHolcim Ltd Reg	Deutsche Bank	(281)			Merrill Lynch	442
			(267)	16.000	China First Capital Group Ltd	Bank of America	
Grèce						Merrill Lynch	1.001
553	Alpha Bank AE	Deutsche Bank	(216)	53.000	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Bank of America	
9.498	Alpha Bank AE	Bank of America				Merrill Lynch	(1.278)
		Merrill Lynch	(3.683)	13.200	China International Capital Corp Ltd 'H' '144A'	Bank of America	
12.521	Eurobank Ergasias SA	Bank of America				Merrill Lynch	(769)
		Merrill Lynch	(1.309)	11.300	China International Marine Containers Group Co Ltd 'H'	Bank of America	
211	FF Group	Deutsche Bank	(612)			Merrill Lynch	(1.573)
902	Hellenic Telecommunications Organization SA	Deutsche Bank	(908)	29.000	China Lesso Group Holdings Ltd	Deutsche Bank	(2.694)
865	Hellenic Telecommunications Organization SA	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(855)	346.000	China Lesso Group Holdings Ltd	Merrill Lynch	(32.141)
77	JUMBO SA	Deutsche Bank	(89)	600	China Literature Ltd	Bank of America	
515	JUMBO SA	Bank of America				Merrill Lynch	368
		Merrill Lynch	(581)	30.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Deutsche Bank	(1.639)
14.875	National Bank of Greece SA	Deutsche Bank	(784)			Bank of America	
				14.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Merrill Lynch	(765)
				31.000	China Power International Development Ltd	Bank of America	
						Merrill Lynch	1
				28.000	China Railway Signal & Communication Corp Ltd	Deutsche Bank	(710)
				131.000	China Reinsurance Group Corp 'H'	Bank of America	
						Merrill Lynch	4

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
20.000	China Resources Cement Holdings Ltd	Deutsche Bank	2.450	24.000	MMG Ltd	Deutsche Bank	(1.771)
2.800	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(195)	283.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(26.612)
28.400	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.975)	9.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(217)
16.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	247	4.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Deutsche Bank	(202)
1.172.000	China Travel International Investment Hong Kong Ltd	Bank of America Merrill Lynch	34.416	6.500	Shenzhen International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(279)
16.400	China Zhongwang Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(521)	26.000	Shenzhen Investment Ltd	Deutsche Bank	234
72.000	Chong Sing Holdings FinTech Gr	Deutsche Bank	277	25.000	Shui On Land Ltd	Bank of America Merrill Lynch	65
40.000	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(1.881)	14.500	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	1.240
82.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	Deutsche Bank	(3.333)	9.000	Sinotruk Hong Kong Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.194
73.000	COSCO SHIPPING Development Co Ltd	Deutsche Bank	(184)	122.000	Skyworth Digital Holdings Ltd	Deutsche Bank	(302)
18.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	621	68.000	Skyworth Digital Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(168)
49.000	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	1.315	10.000	SSY Group Ltd	Deutsche Bank	435
42.500	Dali Foods Group Co Ltd '144A'	Deutsche Bank	1.142	25.000	Tencent Holdings Ltd	Deutsche Bank	3.717
3.854	Dalian Wanda Commercial Properties Co Ltd 'H'**.***	Deutsche Bank	153	3.400	Tencent Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	516
88.000	Datang International Power Generation Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(1.005)	56.000	Tianneng Power International Ltd	Deutsche Bank	1.871
113.000	Far East Horizon Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.169	390.000	Tianneng Power International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9.031
67.000	Far East Horizon Ltd	Deutsche Bank	694	4.000	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(126)
18.000	Future Land Development Holdings Ltd	Deutsche Bank	(800)	9.000	Towngas China Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	345
6.000	Genscript Biotech Corp	Bank of America Merrill Lynch	156	28.000	Uni-President China Holdings Ltd	Deutsche Bank	1.182
7.000	Greentown China Holdings Ltd	Deutsche Bank	(248)	10.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	945
8.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	3.624	207.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	19.554
31.000	Guotai Junan Securities Co Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(3.544)	4.000	Wuxi Biologics Cayman Inc '144A'	Deutsche Bank	3.217
134.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Deutsche Bank	16.290	17.400	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(3.986)
42.000	Huadian Power International Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.501	24.000	Xinyi Solar Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(427)
16.200	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	Deutsche Bank	(1.357)	8.500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.689)
37.000	Jiangxi Copper Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(652)	822.000	Yuexiu Property Co Ltd	Deutsche Bank	(4.160)
8.000	Jiayuan International Group Ltd	Deutsche Bank	43	1.030.000	Yuexiu Property Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.215)
19.000	Kaisa Group Holdings Ltd	Deutsche Bank	(386)	13.000	Yuzhou Properties Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(495)
30.500	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.559)	10.000	Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	511
51.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Deutsche Bank	(5.317)	170.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Deutsche Bank	30.402
24.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.555)				(96.251)
10.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	524	Hongrie			
168.000	KWG Property Holding Ltd	Deutsche Bank	(18.798)	20.588	OTP Bank Nyrt	Deutsche Bank	(89.601)
364.000	KWG Property Holding Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(40.732)				(89.601)
7.300	Legend Holdings Corp 'H' '144A'	Deutsche Bank	(415)	Indonésie			
54.000	Lenovo Group Ltd	Deutsche Bank	1.999	634.400	Bukit Asam Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	14.619
18.000	Logan Property Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.601)	16.900	Indah Kiat Pulp & Paper Corp Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	5.648
670.000	Lonking Holdings Ltd	Deutsche Bank	12.000	396.600	Matahari Department Store Tbk PT	Deutsche Bank	1.229
10.500	Luye Pharma Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.135)	129.000	Matahari Department Store Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	400
28.000	Maanshan Iron & Steel Co Ltd	Deutsche Bank	(604)				
433.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(9.358)				

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

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Indonésie suite				Afrique du Sud suite			
413.000	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	Bank of America Merrill Lynch	5.472	39.730	Barloworld Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(80.757)
			27.368	4.368	Capitec Bank Holdings Ltd	Deutsche Bank	7.858
				752	Clicks Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(241)
Malaisie				837	Coronation Fund Managers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(321)
72.400	Astro Malaysia Holdings Bhd	Bank of America Merrill Lynch	(5.828)	4.901	Coronation Fund Managers Ltd	Deutsche Bank	(2.073)
1.200	Fraser & Neave Holdings Bhd	Deutsche Bank	423	11.789	Gold Fields Ltd	Deutsche Bank	(820)
11.300	My EG Services Bhd	Deutsche Bank	(1.101)	81.190	Harmony Gold Mining Co Ltd	Deutsche Bank	(16.921)
44.000	Sime Darby Bhd	Deutsche Bank	(2.714)	2.640	Kumba Iron Ore Ltd	Deutsche Bank	(1.160)
4.000	Top Glove Corp Bhd	Deutsche Bank	79	27.962	Massmart Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(63.065)
			(9.141)	19.565	Massmart Holdings Ltd	Deutsche Bank	(46.890)
Mexique				4.752	Mondi Ltd	Deutsche Bank	2.951
2.700	Alsea SAB de CV	Bank of America Merrill Lynch	(632)	24.432	Mondi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	20.047
266.800	America Movil SAB de CV 'L'	Bank of America Merrill Lynch	(19.209)	6.486	Mr Price Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(895)
12.800	GMexico Transportes SAB de CV	Bank of America Merrill Lynch	(87)	143	Naspers Ltd 'N'	Bank of America Merrill Lynch	(1.525)
10.600	Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	Bank of America Merrill Lynch	(4.100)	29.982	Old Mutual PLC	Deutsche Bank	(6.456)
1.161	Industrias Penoles SAB de CV	Bank of America Merrill Lynch	(1.142)	3.736	Pick n Pay Stores Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(454)
362.500	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Bank of America Merrill Lynch	8.128	444	Reinet Investments SCA	Deutsche Bank	(5)
			(17.042)	5.856	Sanlam Ltd	Deutsche Bank	(1.626)
Philippines				2.299	Sanlam Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(532)
10.305	Ayala Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.306)	4.008	Sappi Ltd	Deutsche Bank	(2.171)
1.030	Ayala Corp	Deutsche Bank	(930)	3.828	Standard Bank Group Ltd	Deutsche Bank	(514)
			(10.236)	4.352	Standard Bank Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(55)
Qatar							(285.734)
4.388	Qatar Islamic Bank SAQ	Bank of America Merrill Lynch	8.183	Corée du Sud			
			8.183	106	Celltrion Pharm Inc	Bank of America Merrill Lynch	489
Russie				5.580	DB HiTek Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.985
1.478.000	Inter RAO UES PJSC	Deutsche Bank	3.065	1.382	Dongkuk Steel Mill Co Ltd	Deutsche Bank	(1.142)
1.843	Lukoil PJSC	Deutsche Bank	9.494	765	Green Cross Corp/South Korea	Deutsche Bank	(4.143)
437.200	Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC	Deutsche Bank	26.887	144	Green Cross Corp/South Korea	Bank of America Merrill Lynch	(780)
214.850	Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC	Bank of America Merrill Lynch	14.169	111	HLB Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.133
8.730	Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC	Deutsche Bank	(669)	3.269	Hyundai Development Co-Engineering & Construction	Deutsche Bank	(524)
36.310	Raspanskaya OJSC	Bank of America Merrill Lynch	(1.536)	3.361	Hyundai Development Co-Engineering & Construction	Bank of America Merrill Lynch	(539)
122.335	Raspanskaya OJSC	Deutsche Bank	(6.374)	2.929	Jahwa Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.750)
1.670	Severstal PJSC	Bank of America Merrill Lynch	614	2.942	Jusung Engineering Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	35
12.207	Tatneft PJSC	Bank of America Merrill Lynch	(1.965)	4.541	Jusung Engineering Co Ltd	Deutsche Bank	54
			43.685	3.167	KB Financial Group Inc	Deutsche Bank	(16.786)
Afrique du Sud				613	Korea Investment Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(998)
3.525	Anglo American Platinum Ltd	Deutsche Bank	(7.873)	596	KT Corp	Deutsche Bank	(194)
7.752	Anglo American Platinum Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15.647)	151	KT Corp	Bank of America Merrill Lynch	(49)
31.629	Anglo American Plc	Deutsche Bank	(22.215)	9.588	LG Electronics Inc	Deutsche Bank	(38.779)
2.888	Anglo American Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.505)	22.820	LG International Corp	Deutsche Bank	(88.135)
1.155	AngloGold Ashanti Ltd	Deutsche Bank	(105)	1.385	LG International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.349)
960	AngloGold Ashanti Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(26)	5.693	LG Uplus Corp	Deutsche Bank	(5.796)
20.103	Barloworld Ltd	Deutsche Bank	(42.738)	1.333	Lotte Himart Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.741
				1.036	Lotte Himart Co Ltd	Deutsche Bank	2.130
				31.327	Meritz Securities Co Ltd	Deutsche Bank	(5.255)

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Turquie suite			
3.219	Meritz Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(102)	239.219	Turkiye Is Bankasi AS 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(4.797)
39	Pearl Abyss Corp	Deutsche Bank	(553)				20.047
11.643	Samsung Electronics Co Ltd	Deutsche Bank	14.222	Émirats arabes unis			
14.250	Samsung Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	17.407	12.497	Emaar Development PJSC	Deutsche Bank	(885)
873	Samsung Securities Co Ltd	Deutsche Bank	(640)				(885)
1.454	Samsung Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.065)	Royaume-Uni			
1.573	Seegene Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.344)	152.695	Hochschild Mining Plc	Bank of America Merrill Lynch	8.436
49	ViroMed Co Ltd	Deutsche Bank	3.062	53.853	Hochschild Mining Plc	Deutsche Bank	783
			(122.665)	177	Hutchison China Meditech Ltd	Deutsche Bank	(1.926)
Suisse				9.890	Lukoil PJSC ADR	Deutsche Bank	(21.372)
(11)	LafargeHolcim Ltd Reg	Deutsche Bank	(104)	3.621	Lukoil PJSC ADR	Bank of America Merrill Lynch	(7.825)
			(104)	492	Novatek PSJC GDR RegS	Deutsche Bank	7.331
Taiwan				225	Novatek PSJC GDR RegS	Bank of America Merrill Lynch	3.352
203.000	Chailease Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(23.223)	45.816	Polymetal International Plc	Deutsche Bank	93
3.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	Deutsche Bank	(35)	11.072	Polymetal International Plc	Bank of America Merrill Lynch	163
14.000	FocalTech Systems Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	70	2.705	Sistema PJSC FC GDR RegS	Bank of America Merrill Lynch	(168)
388.000	Gemtek Technology Corp	Deutsche Bank	(8.017)	10.946	TMK PJSC GDR RegS	Deutsche Bank	3.393
2.000	Global Unichip Corp	Deutsche Bank	(4.217)	828	X5 Retail Group NV GDR RegS	Bank of America Merrill Lynch	(1.639)
115.000	Lite-On Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	16.502				(9.379)
68.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Deutsche Bank	(53.761)	Etats-Unis			
16.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.949)	188	51job Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	1.229
6.000	TPK Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	191	440	Alibaba Group Holding Ltd ADR	Deutsche Bank	793
62.000	TPK Holding Co Ltd	Deutsche Bank	2.206	4.314	Alibaba Group Holding Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	8.585
153.000	Uni-President Enterprises Corp	Deutsche Bank	4.836	1.037	Banco Santander Brasil SAADR	Deutsche Bank	(799)
232.000	Uni-President Enterprises Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.351	4.660	Banco Santander Brasil SAADR	Bank of America Merrill Lynch	(3.588)
2.000	Walsin Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.925	1.085	Bancolumbia SA	Deutsche Bank	(911)
			(58.121)	1.112	China Biologic Products Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.717
Thaïlande				1.218	China Biologic Products Holdings Inc	Deutsche Bank	8.453
121.100	Bangkok Chain Hospital PCL	Deutsche Bank	(875)	220	China Lodging Group Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	45
202.400	Bangkok Chain Hospital PCL	Bank of America Merrill Lynch	(195)	1.368	Fang Holdings Ltd ADR	Deutsche Bank	(301)
124.400	Glow Energy PCL	Deutsche Bank	4.249	378	GDS Holdings Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	888
38.700	Glow Energy PCL	Bank of America Merrill Lynch	1.322	25.124	Genpact Ltd	Deutsche Bank	(3.769)
1.900	RS PCL	Bank of America Merrill Lynch	(288)	2.300	Genpact Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(345)
217.900	Thanachart Capital PCL	Deutsche Bank	4.459	49.833	Gold Fields Ltd ADR	Deutsche Bank	(1.993)
222.700	Thanachart Capital PCL	Bank of America Merrill Lynch	(16.367)	17.169	Gold Fields Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(687)
			(7.695)	406	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ADR	Deutsche Bank	(881)
Turquie				5.787	Hollysys Automation Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.877)
5.132	Coca-Cola Icecek AS	Bank of America Merrill Lynch	(1.377)	2.860	Hollysys Automation Technologies Ltd	Deutsche Bank	(1.916)
2.547	Ford Otomotiv Sanayi AS	Deutsche Bank	3.894	2.329	KB Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.747)
27.947	Ford Otomotiv Sanayi AS	Bank of America Merrill Lynch	44.382	8.458	KB Financial Group Inc	Deutsche Bank	(39.922)
185.402	Tekfen Holding AS	Deutsche Bank	(18.039)	3.934	Mobile TeleSystems PJSC ADR	Deutsche Bank	(905)
47.872	Turkiye Garanti Bankasi AS	Bank of America Merrill Lynch	(2.161)	172	Noah Holdings Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(729)
70.510	Turkiye Is Bankasi AS 'C'	Deutsche Bank	(1.855)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
5.419	SINA Corp/China	Deutsche Bank	(3.627)	2.870	Ultrapar Participacoes SA ADR	Deutsche Bank	(3.731)
4.253	SINA Corp/China	Bank of America		2.532	Weibo Corp ADR	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.615)			Merrill Lynch	(2.861)
4.112	Sohu.com Inc	Deutsche Bank	(1.110)	19.893	Yandex NV 'A'	Bank of America	
18.260	Sohu.com Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(3.581)
		Merrill Lynch	(4.930)				(106.040)
29.380	TIM Participacoes SA ADR	Deutsche Bank	(33.493)	Total (exposition brute sous-jacente – 39.064.269 USD)			(918.218)
8.274	TIM Participacoes SA ADR	Bank of America					
		Merrill Lynch	(9.432)				

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
CCIRS	ZAR 10.840.000	Fund receives Fixed 7,255% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(11.050)	(11.037)
IRS	KRW 986.190.000	Fund receives Fixed 2,252% and pays Floating KRW 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(312)	(312)
IRS	THB 27.570.000	Fund receives Fixed 2,015% and pays Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(6.032)	(6.032)
IRS	THB 29.710.000	Fund receives Fixed 2,050% and pays Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(4.965)	(4.965)
IRS	TWD 28.240.000	Fund receives Fixed 1,100% and pays Floating TWD 3 Month LIBOR	BNP Paribas	19/9/2023	489	489
IRS	CLP 531.730.000	Fund receives Fixed 3,933% and pays Floating CLP 1 Month Sinacofi Chile Interbank Rate Average	Goldman Sachs	20/9/2023	(1.256)	(1.256)
IRS	MYR 3.730.000	Fund receives Fixed 4,010% and pays Floating MYR 3 Month LIBOR	JP Morgan	19/9/2023	(968)	(968)
IRS	MYR 3.890.000	Fund receives Fixed 4,045% and pays Floating MYR 3 Month LIBOR	JP Morgan	19/9/2023	542	542
IRS	TWD 24.130.000	Fund receives Fixed 1,070% and pays Floating TWD 3 Month TAIBOR	JP Morgan	19/9/2023	(758)	(758)
Total (exposition brute sous-jacente – 8.030.844 USD)					(24.310)	(24.297)

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

IRS (*interest rate swaps*) : swaps sur taux d'intérêt

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
AUD	232.000	USD	175.306	Deutsche Bank	21/6/2018	451
AUD	116.000	USD	87.658	JP Morgan	21/6/2018	220
AUD	629.000	USD	470.666	UBS	21/6/2018	5.847
CAD	658.539	USD	511.176	Deutsche Bank	21/6/2018	(2.538)
CAD	268.000	USD	210.004	HSBC	21/6/2018	(3.007)
CAD	465.461	USD	361.464	JP Morgan	21/6/2018	(1.954)
CHF	901.000	EUR	755.697	BNP Paribas	21/6/2018	33.797
CHF	326.000	EUR	283.721	Deutsche Bank	21/6/2018	218
CLP	301.100.000	USD	480.645	JP Morgan	21/6/2018	(3.686)
COP	1.446.344.000	USD	510.534	JP Morgan	21/6/2018	(11.074)
EUR	310.546	HUF	98.551.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	21/6/2018	2.169
EUR	185.686	NOK	1.764.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	21/6/2018	1.065
EUR	350.333	NOK	3.329.000	JP Morgan	21/6/2018	1.903
EUR	613.227	PLN	2.616.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	21/6/2018	8.899
EUR	238.407	PLN	1.024.000	BNP Paribas	21/6/2018	1.578
EUR	680.472	SEK	6.944.000	HSBC	21/6/2018	5.559
EUR	395.668	SEK	4.085.000	JP Morgan	21/6/2018	(2.141)
EUR	1.695.420	USD	2.037.690	Bank of America		
				Merrill Lynch	21/6/2018	(59.767)
EUR	1.048.000	USD	1.218.655	Deutsche Bank	21/6/2018	3.969
EUR	574.000	USD	686.031	JP Morgan	21/6/2018	(16.388)
GBP	163.000	USD	216.549	Deutsche Bank	21/6/2018	305
GBP	544.000	USD	739.427	JP Morgan	21/6/2018	(15.693)
HUF	98.133.000	EUR	311.911	BNP Paribas	21/6/2018	(5.289)
HUF	173.545.000	EUR	551.868	HSBC	21/6/2018	(9.660)
HUF	77.227.000	EUR	244.736	JP Morgan	21/6/2018	(3.315)
IDR	10.363.333.000	USD	732.650	JP Morgan	21/6/2018	11.324
INR	169.639.368	USD	2.577.832	HSBC	6/7/2018	(72.817)
JPY	91.705.000	USD	844.050	Deutsche Bank	21/6/2018	2.156
KRW	416.064.000	USD	385.727	BNP Paribas	21/6/2018	456
KRW	445.759.000	USD	414.852	JP Morgan	21/6/2018	(1.107)
MXN	6.870.000	USD	372.965	Goldman Sachs	7/6/2018	(29.576)
MXN	6.027.000	USD	308.791	Deutsche Bank	21/6/2018	(8.282)
NOK	1.959.000	EUR	205.645	Deutsche Bank	21/6/2018	(521)
NOK	19.937.000	EUR	2.080.805	UBS	21/6/2018	8.784
NZD	219.975	USD	153.344	BNP Paribas	21/6/2018	832
NZD	1.123.025	USD	783.058	Deutsche Bank	21/6/2018	4.053
PHP	19.675.000	USD	377.893	JP Morgan	21/6/2018	(3.731)
PLN	5.213.000	EUR	1.225.600	BNP Paribas	21/6/2018	(21.933)
PLN	2.143.000	EUR	496.749	JP Morgan	21/6/2018	(757)
RON	1.421.000	EUR	305.145	JP Morgan	21/6/2018	(249)
SEK	2.677.000	EUR	261.002	Deutsche Bank	21/6/2018	(593)
SEK	3.482.000	EUR	338.672	JP Morgan	21/6/2018	180
SEK	1.498.000	EUR	145.467	UBS	21/6/2018	350
SGD	267.000	USD	200.507	HSBC	21/6/2018	(1.107)
SGD	3.181.000	USD	2.374.857	JP Morgan	21/6/2018	758
THB	2.740.000	USD	86.239	HSBC	21/6/2018	(542)
THB	11.734.000	USD	366.161	UBS	21/6/2018	832
TRY	1.840.000	USD	415.689	HSBC	21/6/2018	(12.789)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
TWD	36.252.000	USD	1.220.812	JP Morgan	21/6/2018	(9.477)
USD	554.309	BRL	1.983.000	BNP Paribas	21/6/2018	22.692
USD	1.490.984	CAD	1.905.000	Deutsche Bank	21/6/2018	19.611
USD	216.730	CLP	130.000.000	HSBC	7/6/2018	10.852
USD	950.190	CLP	570.000.000	Nomura		
				International	7/6/2018	47.498
USD	378.799	CLP	238.094.000	BNP Paribas	21/6/2018	1.645
USD	289.772	CLP	183.904.000	JP Morgan	21/6/2018	(1.542)
USD	19.028	EUR	16.000	HSBC	21/6/2018	362
USD	1.030.348	EUR	865.000	JP Morgan	21/6/2018	21.216
USD	474.250	GBP	349.000	BNP Paribas	21/6/2018	9.943
USD	542.072	GBP	398.000	HSBC	21/6/2018	12.575
USD	576.757	IDR	8.010.000.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	7/6/2018	726
USD	747.291	IDR	10.356.330.000	Deutsche Bank	7/6/2018	2.526
USD	605.378	IDR	8.544.912.000	JP Morgan	7/6/2018	(9.121)
USD	324.066	IDR	4.564.788.000	JP Morgan	21/6/2018	(3.636)
USD	1.037.329	INR	70.139.000	JP Morgan	21/6/2018	(93)
USD	1.358.583	JPY	148.706.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	21/6/2018	(13.599)
USD	862.437	KRW	930.000.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	7/6/2018	(381)
USD	1.057.469	KRW	1.130.085.000	BNP Paribas	21/6/2018	8.544
USD	1.043.935	MXN	19.610.000	Goldman Sachs	7/6/2018	63.752
USD	13.355	MXN	250.000	HSBC	7/6/2018	859
USD	314.288	MXN	6.141.000	Deutsche Bank	21/6/2018	8.094
USD	496.289	MXN	9.883.000	JP Morgan	21/6/2018	3.517
USD	1.522.537	NZD	2.196.000	Deutsche Bank	21/6/2018	(16.604)
USD	410.521	PHP	21.632.000	JP Morgan	21/6/2018	(857)
USD	357.560	RUB	22.377.000	JP Morgan	21/6/2018	(1.227)
USD	696.895	SGD	934.000	BNP Paribas	21/6/2018	(629)
USD	285.765	SGD	383.000	Deutsche Bank	21/6/2018	(264)
USD	117.179	SGD	157.000	HSBC	21/6/2018	(71)
USD	606.998	SGD	817.000	JP Morgan	21/6/2018	(3.149)
USD	202.516	TRY	902.000	HSBC	21/6/2018	5.007
USD	73.326	TRY	344.000	JP Morgan	21/6/2018	(1.998)
USD	392.877	TWD	11.749.000	JP Morgan	21/6/2018	293
USD	864.947	ZAR	10.400.000	HSBC	7/6/2018	42.003
USD	58.238	ZAR	700.000	JP Morgan	7/6/2018	2.848
USD	18.971	ZAR	237.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	21/6/2018	252
						29.356
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	2.453.585	USD	2.919.257	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(58.718)
USD	397.938	EUR	335.783	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	6.462
						(52.256)
Total (exposition brute sous-jacente – 65.382.276 USD)						(22.900)

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
120	USD	SGX NIFTY 50 Index	Juin 2018	2.571.840	7.668
Total				2.571.840	7.668

BlackRock Emerging Markets Allocation Fund suite

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	56,76
Finance	29,38
Technologie	3,16
Énergie	2,15
Titres adossés à des actifs	2,02
Biens de consommation non cyclique	1,49
Communications	0,64
Matériaux de base	0,55
Biens de consommation cyclique	0,55
Valeurs industrielles	0,49
Services aux collectivités	0,28
Diversifiés	0,15
Portefeuille de titres à la valeur de marché	97,62
Autres éléments de l'actif net	2,38
	100,00

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Argentine				Indonésie			
23.066	Banco Macro SA ADR			6.242.600	Astra International Tbk PT	3.099.960	2,23
				66.345	Astra International Tbk PT ADR	665.692	0,48
65.109	Grupo Financiero Galicia SA ADR	1.815.294	1,31	4.190.800	Semen Indonesia Persero Tbk PT	2.533.481	1,83
		2.757.366	1,98			6.299.133	4,54
		4.572.660	3,29				
Bermudes				Israël			
4.849.332	Skyworth Digital Holdings Ltd	2.304.587	1,66	746.133	Israel Chemicals Ltd	3.446.279	2,48
		2.304.587	1,66			3.446.279	2,48
Brésil				Pologne			
354.177	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	2.070.443	1,49	143.123	Bank Polska Kasa Opieki SA	4.320.257	3,11
206.004	BB Seguridade Participacoes	1.441.566	1,04			4.320.257	3,11
913.600	BR Malls Participacoes SA	2.526.841	1,82	Qatar			
94.238	BRF SA ADR*	539.041	0,39	119.973	Industries Qatar QSC	3.367.127	2,42
137.738	Cia Hering	628.024	0,45			3.367.127	2,42
315.964	MRV Engenharia e Participacoes SA	1.142.851	0,82	Russie			
		8.348.766	6,01	516.261	Gazprom PJSC ADR	2.374.800	1,71
Canada				329.890	Sberbank of Russia PJSC ADR	4.811.446	3,46
1.359.262	Eldorado Gold Corp*	1.573.949	1,13	2.838.559.732	VTB Bank PJSC	2.317.452	1,67
		1.573.949	1,13	241.896	VTB Bank PJSC GDR 'S'	398.403	0,29
Chine						9.902.101	7,13
7.096.500	Bank of China Ltd 'H'	3.707.066	2,67	Afrique du Sud			
56.353	Huaneng Power International Inc ADR	1.723.274	1,24	218.159	Shoprite Holdings Ltd	4.090.303	2,94
3.688.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	3.054.264	2,20			4.090.303	2,94
41.498	PetroChina Co Ltd ADR	3.448.484	2,48	Corée du Sud			
		11.933.088	8,59	18.287	Hyundai Motor Co	2.358.081	1,70
Grèce				24.891	Hyundai Motor Co (Pref)	2.064.340	1,49
924.263	Alpha Bank AE*	1.996.581	1,44	5.561	Hyundai Motor Co GDR	230.781	0,17
6.535.956	National Bank of Greece SA*	2.040.918	1,47	610.537	Pan Ocean Co Ltd	2.865.919	2,06
		4.037.499	2,91	64.250	Samsung Electronics Co Ltd	3.021.917	2,17
Hong Kong				92.116	Shinhan Financial Group Co Ltd	3.738.647	2,69
2.126.000	Cathay Pacific Airways Ltd*	3.461.755	2,49	47.202	Shinhan Financial Group Co Ltd ADR	1.929.146	1,39
648.000	China Mobile Ltd	5.779.301	4,16			16.208.831	11,67
1.400.000	China Resources Power Holdings Co Ltd	2.864.678	2,06	Taiwan			
2.627	CNOOC Ltd ADR*	442.072	0,32	15.000	Land Mark Optoelectronics Corp	150.193	0,11
6.350.000	Guotai Junan International Holdings Ltd*	1.731.370	1,25	192.000	MediaTek Inc	1.996.162	1,44
		14.279.176	10,28	345.000	Merry Electronics Co Ltd	1.686.915	1,21
Hongrie				403.000	Nanya Technology Corp	1.339.679	0,96
189.667	Richter Gedeon Nyrt	3.689.924	2,66			5.172.949	3,72
		3.689.924	2,66	Thaïlande			
Inde				1.145.500	Indorama Ventures PCL	2.085.820	1,50
881.052	Fortis Healthcare Ltd	1.920.538	1,38	4.130.200	Land & Houses PCL	1.446.022	1,04
648.641	Jindal Steel & Power Ltd	2.200.665	1,58	13.201.000	Land & Houses PCL NVDR	4.580.528	3,30
150.969	Larsen & Toubro Ltd	3.064.906	2,21			8.112.370	5,84
412.719	State Bank of India	1.651.304	1,19	Turquie			
37.052	State Bank of India GDR 'S'	1.459.849	1,05	460.690	Arcelik AS*	1.683.740	1,21
		10.297.262	7,41			1.683.740	1,21
				Émirats arabes unis			
				4.353.944	Emaar Properties PJSC	6.163.786	4,44
						6.163.786	4,44
				Total des actions ordinaires et privilégiées			
				129.803.787 93,44			

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Organismes de placement collectif			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
EXCHANGE TRADED FUNDS				Irlande			
75.357	iShares MSCI Korea UCITS ETF USD (Dist)	3.665.294	2,64	2.639.835	Institutional Cash Series Plc - Institutional US Dollar Liquidity Fund Agency Dis ¹	2.639.835	1,90
		3.665.294	2,64			2.639.835	1,90
Total des <i>Exchange Traded Funds</i>					Total des organismes de placement collectif	2.639.835	1,90
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé					Portefeuille de titres à la valeur de marché	136.108.916	97,98
					Autres éléments de l'actif net	2.812.935	2,02
					Total de l'actif net (USD)	138.921.851	100,00

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Brésil				Afrique du Sud			
622.313	MRV Engenharia e Participacoes SA	Credit Suisse	(303.919)	221.752	AngloGold Ashanti Ltd	Credit Suisse	(12.148)
			(303.919)	400.033	FirstRand Ltd	Deutsche Bank	(101.446)
				(11.437)	Naspers Ltd 'N'	Credit Suisse	220.357
							106.763
France				Corée du Sud			
(8.593)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Deutsche Bank	47.576	(6.486)	Celltrion Inc	Credit Suisse	(175.588)
			47.576	741	Hyundai Motor Co	HSBC	(11.386)
				117.460	Samsung Engineering Co Ltd	HSBC	136.023
				20.920	Shinhan Financial Group Co Ltd	HSBC	(59.552)
25.252	Alpha Bank AE	Credit Suisse	(10.687)	13.317	SK Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(276.764)
			(10.687)				(387.267)
Hong Kong				Taiwan			
(388.800)	AIA Group Ltd	Credit Suisse	(129.157)	20.000	MediaTek Inc	HSBC	(10.361)
184.000	Bank of China Ltd 'H'	Deutsche Bank	(3.501)				(10.361)
11.000	China Mobile Ltd	Deutsche Bank	(5.660)				
476.000	China Resources Power Holdings Co Ltd	HSBC	47.404				
5.372.000	Huadian Power International Corp Ltd 'H'	Deutsche Bank	191.995				
2.472.000	SJM Holdings Ltd	Credit Suisse	712.015				
348.000	Skyworth Digital Holdings Ltd	Deutsche Bank	(861)				
(578.000)	Sunac China Holdings Ltd	HSBC	345.848				
			1.158.083				
Indonésie							
499.600	Astra International Tbk PT	Deutsche Bank	1.620				
			1.620				
Malaisie							
(1.879.000)	IHH Healthcare Bhd	Deutsche Bank	48.743				
12.821.000	Sapura Energy Bhd	HSBC	(419.793)				
			(371.050)				
Mexique							
2.079.021	Alpek SAB de CV	Credit Suisse	231.972				
			231.972				
Philippines							
(1.570.500)	Ayala Land Inc	HSBC	26.333				
(1.609.700)	Ayala Land Inc	Deutsche Bank	75.083				
(52.300)	Ayala Land Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	2.543				
(93.700)	Ayala Land Inc	Credit Suisse	1.425				
(536.636)	BDO Unibank Inc	Credit Suisse	(14.443)				
(159.689)	BDO Unibank Inc	Deutsche Bank	11.344				
(229.270)	BDO Unibank Inc	HSBC	(6.079)				
(66.800)	BDO Unibank Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	4.746				
			100.952				
Qatar							
(176.783)	Commercial Bank PQSC/The	HSBC	(784)				
			(784)				
				Royaume-Uni			
				(120.155)	Prudential Plc	HSBC	198.724
							198.724
				Etats-Unis			
				97.310	AngloGold Ashanti Ltd ADR	Credit Suisse	(17.516)
				357.051	BRF SA ADR	HSBC	(360.621)
				463.829	Cemex SAB de CV ADR	Credit Suisse	(6.957)
				15.472	CNOOC Ltd ADR	HSBC	(4.487)
				11.819	Huaneng Power International Inc ADR	HSBC	51.176
				(91.982)	Pagseguro Digital Ltd	Deutsche Bank	(106.250)
				2.101	Shinhan Financial Group Co Ltd ADR	HSBC	(5.610)
				(180.715)	Vale SA ADR	Credit Suisse	5.422
							(444.843)
				Total (exposition brute sous-jacente – 76.220.020 USD)			538.774

BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
BRL	139.889	USD	37.420	State Street Bank & Trust Company	1/6/2018	144
BRL	442.892	USD	118.747	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	180
TRY	13.547.100	USD	2.825.255	Deutsche Bank	27/8/2018	63.717
USD	5.800	BRL	21.681	State Street Bank & Trust Company	1/6/2018	(22)
USD	9.632	BRL	35.925	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(15)
USD	1.944.282	TRY	9.030.000	HSBC	27/8/2018	18.599
						82.603

Catégorie d'Actions couverte en euros

EUR	32.266.299	USD	38.377.248	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(759.237)
USD	5.707.728	EUR	4.810.835	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	98.965
						(660.272)
Total (exposition brute sous-jacente – 48.213.391 USD)						(577.669)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	35,96
Biens de consommation cyclique	17,04
Matériaux de base	9,11
Valeurs industrielles	7,42
Biens de consommation non cyclique	7,37
Technologie	4,57
Énergie	4,51
Communications	4,16
Services aux collectivités	3,30
Exchange Traded Funds	2,64
Organismes de placement collectif	1,90
Portefeuille de titres à la valeur de marché	97,98
Autres éléments de l'actif net	2,02
	100,00

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS							
Angola				Biélorussie			
USD 33.031.000	Angolan Government International Bond RegS 9,50% 12/11/2025*	37.287.540	1,08	USD 10.740.000	Republic of Belarus International Bond RegS 6,875% 28/2/2023	11.411.250	0,33
USD 24.221.000	Angolan Government International Bond RegS 8,25% 9/5/2028	25.169.979	0,73	USD 45.166.000	Republic of Belarus International Bond RegS 7,625% 29/6/2027	48.880.903	1,42
USD 66.428.000	Angolan Government International Bond RegS 9,375% 8/5/2048	71.069.988	2,06	USD 39.246.000	Republic of Belarus International Bond RegS 6,20% 28/2/2030	38.412.023	1,11
		133.527.507	3,87			98.704.176	2,86
Argentine				Bolivie			
ARS 388.891.617	Argentina POM Politica Monetaria FRN 21/6/2020	16.331.242	0,47	USD 2.636.000	Bolivian Government International Bond RegS 4,875% 29/10/2022	2.637.239	0,08
USD 12.284.000	Argentine Republic Government International Bond 5,625% 26/1/2022	12.084.385	0,35	USD 8.618.000	Bolivian Government International Bond RegS 5,95% 22/8/2023	9.008.740	0,26
USD 12.878.000	Banco de Galicia y Buenos Aires SA '144A' FRN 19/7/2026	13.264.142	0,38	USD 5.829.000	Bolivian Government International Bond RegS 4,50% 20/3/2028	5.187.810	0,15
USD 7.942.000	Banco Hipotecario SA RegS 9,75% 30/11/2020	8.378.810	0,24			16.833.789	0,49
USD 4.324.000	Banco Macro SA RegS FRN 4/11/2026*	4.182.327	0,12	Brésil			
USD 5.916.000	Genneia SA RegS 8,75% 20/1/2022	6.034.230	0,18	USD 11.340.000	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social RegS 5,50% 12/7/2020	11.634.160	0,34
USD 4.000.000	Pampa Energia SA RegS 7,50% 24/1/2027	3.865.680	0,11	BRL 86.085.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 1/7/2020 (Zero Coupon)	19.588.173	0,57
USD 9.938.000	Province of Salta Argentina RegS 9,125% 7/7/2024	9.838.473	0,29	BRL 23.628.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,00% 1/1/2025	6.363.838	0,18
ARS 103.197.000	Provincia de Buenos Aires/Argentina FRN 31/5/2022	3.865.207	0,11	BRL 25.762.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,00% 1/1/2027	6.769.054	0,20
USD 13.285.000	Provincia de Buenos Aires/Argentina RegS 10,875% 26/1/2021	14.065.494	0,41	USD 400.000	Brazilian Government International Bond 4,625% 13/1/2028	373.110	0,01
USD 7.365.000	Provincia de Buenos Aires/Argentina RegS 6,50% 15/2/2023	7.208.494	0,21	USD 6.206.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island RegS (Contingent Convertible Bond) FRN 31/12/2099	5.862.777	0,17
USD 31.939.000	Provincia de Buenos Aires/Argentina RegS 9,125% 16/3/2024*	33.176.141	0,96			50.591.112	1,47
ARS 389.865.000	Provincia de Buenos Aires/Argentina RegS FRN 12/4/2025	14.854.756	0,43	Colombie			
USD 8.743.000	Provincia de Buenos Aires/Argentina RegS 9,625% 18/4/2028*	9.059.934	0,26	USD 15.129.000	Banco de Bogota SA RegS 6,25% 12/5/2026	15.406.163	0,45
USD 14.996.000	Provincia de Cordoba RegS 7,45% 1/9/2024	14.789.805	0,43	USD 9.419.000	Bancolombia SA 5,125% 11/9/2022*	9.502.358	0,27
USD 12.908.000	Tarjeta Naranja SA RegS FRN 11/4/2022	9.598.296	0,28			24.908.521	0,72
USD 12.368.000	YPF SA '144A' FRN 7/7/2020	7.102.324	0,21	Costa Rica			
USD 5.022.000	YPF SA RegS FRN 7/7/2020	2.883.883	0,08	USD 6.064.000	Banco Nacional de Costa Rica RegS 5,875% 25/4/2021*	6.162.448	0,18
USD 28.105.000	YPF SA RegS 8,50% 28/7/2025*	28.807.625	0,84	USD 31.018.000	Costa Rica Government International Bond RegS 7,158% 12/3/2045*	30.203.328	0,87
USD 11.532.000	YPF SA RegS 6,95% 21/7/2027	10.888.352	0,32			36.365.776	1,05
		230.279.600	6,68	Croatie			
Azerbaïdjan				USD 13.219.000	Croatia Government International Bond RegS 6,75% 5/11/2019	13.790.722	0,40
USD 200.000	Republic of Azerbaijan International Bond RegS 4,75% 18/3/2024	200.750	0,01			13.790.722	0,40
USD 34.815.000	Southern Gas Corridor CJSC RegS 6,875% 24/3/2026	38.052.795	1,10	République dominicaine			
		38.253.545	1,11	USD 16.152.000	Dominican Republic International Bond RegS 7,50% 6/5/2021	17.012.175	0,50
Bahreïn				USD 7.530.000	Dominican Republic International Bond RegS 6,875% 29/1/2026	8.025.737	0,23
USD 2.460.000	Bahrain Government International Bond RegS 6,125% 5/7/2022	2.380.050	0,07	USD 19.232.000	Dominican Republic International Bond RegS 5,95% 25/1/2027	19.394.895	0,56
USD 5.566.000	Bahrain Government International Bond RegS 6,00% 19/9/2044*	4.327.565	0,12	USD 14.895.000	Dominican Republic International Bond RegS 6,85% 27/1/2045	14.918.683	0,43
		6.707.615	0,19			59.351.490	1,72

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

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Égypte				Indonésie suite			
EGP 336.195.000	Egypt Government Bond 14,95% 20/3/2021	18.498.460	0,54	USD 6.682.000	Pertamina Persero PT RegS 6,45% 30/5/2044	7.324.541	0,21
EGP 333.264.000	Egypt Government Bond 14,85% 10/4/2023	18.041.510	0,52	IDR 123.920.000.000	Wijaya Karya Persero Tbk PT RegS 7,70% 31/1/2021	8.838.943	0,26
USD 18.734.000	Egypt Government International Bond RegS 5,75% 29/4/2020	19.272.602	0,56			87.648.475	2,54
USD 25.573.000	Egypt Government International Bond RegS 6,125% 31/1/2022	25.924.629	0,75	Iraq			
USD 21.390.000	Egypt Government International Bond RegS 5,577% 21/2/2023	21.229.575	0,62	USD 19.321.000	Iraq International Bond RegS 6,752% 9/3/2023	19.502.134	0,57
USD 6.820.000	Egypt Government International Bond RegS 7,50% 31/1/2027	7.169.525	0,21	USD 34.767.000	Iraq International Bond RegS 5,80% 15/1/2028	32.941.733	0,95
USD 44.598.000	Egypt Government International Bond RegS 8,50% 31/1/2047	47.580.491	1,38			52.443.867	1,52
USD 350.000	Egypt Government International Bond RegS 7,903% 21/2/2048	354.594	0,01	Côte d'Ivoire			
EGP 5.000.000	Egypt Treasury Bills 12/6/2018 (Zero Coupon)	279.218	0,01	USD 5.660.000	Ivory Coast Government International Bond RegS 6,375% 3/3/2028	5.487.370	0,16
EGP 215.500.000	Egypt Treasury Bills 25/9/2018 (Zero Coupon)	11.376.713	0,33	USD 15.232.000	Ivory Coast Government International Bond RegS 6,125% 15/6/2033	13.994.400	0,40
EGP 784.800.000	Egypt Treasury Bills 2/10/2018 (Zero Coupon)	41.294.904	1,20	USD 14.987.700	Ivory Coast Government International Bond RegS (Step-up Coupon) 5,75% 31/12/2032	14.107.173	0,41
EGP 731.400.000	Egypt Treasury Bills 23/10/2018 (Zero Coupon)	38.108.253	1,10			33.588.943	0,97
EGP 534.950.000	Egypt Treasury Bills 30/10/2018 (Zero Coupon)	27.782.009	0,80	Jamaïque			
		276.912.483	8,03	USD 8.241.000	Jamaica Government International Bond 7,875% 28/7/2045	9.332.793	0,27
El Salvador						9.332.793	0,27
USD 14.150.000	El Salvador Government International Bond RegS 7,375% 1/12/2019	14.591.268	0,42	Jordanie			
		14.591.268	0,42	USD 250.000	Jordan Government International Bond RegS 5,75% 31/1/2027	238.437	0,01
Gabon						238.437	0,01
USD 32.788.820	Gabon Government International Bond RegS 6,375% 12/12/2024	31.682.197	0,92	Kazakhstan			
USD 75.864.000	Gabon Government International Bond RegS 6,95% 16/6/2025	74.204.475	2,15	KZT 3.337.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC RegS 9,50% 14/12/2020	10.255.427	0,30
		105.886.672	3,07	KZT 6.833.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC RegS 8,95% 4/5/2023	20.147.696	0,58
Ghana				USD 5.290.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 4,75% 24/4/2025*	5.323.063	0,16
USD 5.201.229	Ghana Government International Bond RegS 7,875% 7/8/2023	5.519.804	0,16	USD 29.474.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 4,75% 19/4/2027	29.142.417	0,85
USD 27.363.000	Ghana Government International Bond RegS 8,125% 18/1/2026*	28.867.965	0,84	USD 79.437.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 5,75% 19/4/2047	77.399.441	2,24
USD 7.292.000	Ghana Government International Bond RegS 7,625% 16/5/2029	7.393.213	0,21	USD 15.410.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 6,375% 24/10/2048	15.837.242	0,46
USD 67.374.000	Ghana Government International Bond RegS 8,627% 16/6/2049	68.881.830	2,00	USD 353.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 6,375% 24/10/2048	362.787	0,01
GHS 22.418.669	Ghana Treasury Note 16,50% 17/2/2020	4.758.853	0,14			158.468.073	4,60
		115.421.665	3,35	Kenya			
Guatemala				USD 3.585.000	Kenya Government International Bond RegS 8,25% 28/2/2048	3.588.639	0,10
USD 250.000	Guatemala Government Bond RegS 5,75% 6/6/2022	260.934	0,01			3.588.639	0,10
		260.934	0,01	Liban			
Indonésie				USD 5.172.000	Lebanon Government International Bond 6,375% 9/3/2020	5.062.095	0,15
IDR 749.854.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/9/2026	58.010.206	1,68	USD 2.349.000	Lebanon Government International Bond 6,15% 19/6/2020*	2.274.537	0,07
IDR 122.932.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2036	9.300.631	0,27	USD 2.069.000	Lebanon Government International Bond RegS 5,45% 28/11/2019	2.022.447	0,06
IDR 58.740.000.000	Jasa Marga Persero Tbk PT RegS 7,50% 11/12/2020	4.174.154	0,12				

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Liban suite				Nigéria			
USD 14.847.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,10% 4/10/2022	13.529.329	0,39	NGN 17.299.330.000	Nigeria Government Bond 14,50% 15/7/2021	49.261.073	1,43
USD 12.728.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,00% 27/1/2023	11.463.155	0,33	NGN 5.752.124.000	Nigeria Government Bond 16,288% 17/3/2027	18.223.157	0,53
USD 3.651.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,85% 23/3/2027	3.089.659	0,09	NGN 4.930.113.000	Nigeria Government Bond 13,98% 23/2/2028	14.151.030	0,41
		37.441.222	1,09	NGN 3.210.181.000	Nigeria Government Bond 16,25% 18/4/2037	10.638.450	0,31
Luxembourg				USD 20.784.000	Nigeria Government International Bond '144A' 7,875% 16/2/2032	21.784.230	0,63
USD 4.243.000	MHP SE RegS 7,75% 10/5/2024	4.368.911	0,13	USD 5.980.000	Nigeria Government International Bond RegS 6,75% 28/1/2021*	6.212.323	0,18
		4.368.911	0,13	USD 23.887.000	Nigeria Government International Bond RegS 6,375% 12/7/2023*	24.603.610	0,71
Mexique				USD 71.413.000	Nigeria Government International Bond RegS 7,875% 16/2/2032	74.849.751	2,17
USD 4.285.000	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman RegS FRN 4/10/2031	4.017.187	0,12	USD 44.450.000	Nigeria Government International Bond RegS 7,625% 28/11/2047	43.866.594	1,27
USD 32.418.000	Cemex SAB de CV RegS 7,75% 16/4/2026*	35.064.119	1,02	NGN 819.156.000	Nigeria Treasury Bill FRN 14/6/2018	2.260.882	0,07
MXN 180.903.500	Mexican Bonos 10,00% 5/12/2024	10.097.666	0,29			265.851.100	7,71
MXN 135.619.200	Mexican Bonos 7,50% 3/6/2027	6.663.755	0,19	Oman			
MXN 1.026.821.100	Mexican Bonos 7,75% 13/11/2042	50.500.888	1,46	USD 300.000	Oman Government International Bond RegS 4,75% 15/6/2026	282.000	0,01
MXN 241.143.600	Mexican Bonos 8,00% 7/11/2047	12.123.637	0,35	USD 19.530.000	Oman Government International Bond RegS 6,75% 17/1/2048	18.724.387	0,54
USD 39.920.000	Mexico Government International Bond 5,75% 12/10/2110	38.762.320	1,12			19.006.387	0,55
USD 8.609.000	Petroleos Mexicanos 6,00% 5/3/2020	8.903.858	0,26	Pakistan			
USD 200.000	Petroleos Mexicanos 6,375% 4/2/2021	210.000	0,01	USD 2.535.000	Third Pakistan International Sukuk Co Ltd/The RegS 5,625% 5/12/2022	2.428.061	0,07
USD 2.742.000	Petroleos Mexicanos 4,625% 21/9/2023	2.695.112	0,08			2.428.061	0,07
USD 39.460.000	Petroleos Mexicanos 6,50% 13/3/2027	40.543.572	1,17	Panama			
USD 3.513.000	Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047	3.356.672	0,10	USD 2.788.000	Global Bank Corp RegS 4,50% 20/10/2021	2.751.407	0,08
		212.938.786	6,17			2.751.407	0,08
Mongolie				Pérou			
USD 6.190.000	Mongolia Government International Bond RegS 5,125% 5/12/2022	5.970.255	0,17	PEN 2.385.000	Peru Government Bond RegS '144A' 6,15% 12/8/2032	746.084	0,02
USD 6.196.000	Mongolia Government International Bond RegS 5,625% 1/5/2023	6.017.865	0,18	PEN 1.239.000	Peruvian Government International Bond RegS 6,90% 12/8/2037	405.524	0,01
USD 6.133.000	Trade & Development Bank of Mongolia LLC RegS 9,375% 19/5/2020*	6.527.168	0,19	USD 12.975.000	Petroleos del Peru SA RegS 5,625% 19/6/2047	12.598.725	0,37
		18.515.288	0,54	USD 4.806.000	SAN Miguel Industrias Pet SA RegS 4,50% 18/9/2022	4.655.813	0,13
Mozambique						18.406.146	0,53
USD 12.927.000	Mozambique International Bond RegS (Flat Trading) 10,50% 18/1/2023**	10.779.050	0,31	Qatar			
		10.779.050	0,31	USD 40.000.000	Qatar Government International Bond RegS 5,103% 23/4/2048	39.975.000	1,16
Pays-Bas						39.975.000	1,16
USD 13.199.000	Kazakhstan Temir Zholy Finance BV RegS 6,95% 10/7/2042	14.320.915	0,42	Roumanie			
USD 24.651.000	Petrobras Global Finance BV 7,375% 17/1/2027	25.267.275	0,73	RON 710.000	Romania Government Bond 5,80% 26/7/2027	189.474	0,01
USD 65.901.000	Petrobras Global Finance BV 6,85% 5/6/2115	57.836.036	1,68			189.474	0,01
USD 28.722.188	Republic of Angola Via Northern Lights III BV RegS 7,00% 17/8/2019	29.115.882	0,84				
		126.540.108	3,67				

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

** Le Compartiment a cessé de calculer les intérêts courus pour ce titre.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
USD 7.675.000	Sénégal			Ukraine suite			
	Senegal Government International Bond RegS 6,25% 23/5/2033	7.176.125	0,21	USD 7.433.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2022	7.629.974	0,22
		7.176.125	0,21	USD 31.249.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2024	31.483.367	0,91
USD 19.900.000	Afrique du Sud			USD 4.702.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2025	4.690.245	0,14
	Eskom Holdings SOC Ltd RegS 5,75% 26/1/2021	19.890.050	0,58	USD 4.729.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2026	4.693.533	0,14
	Eskom Holdings SOC Ltd RegS 7,125% 11/2/2025*	44.058.140	1,28	USD 4.735.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2027	4.675.813	0,13
ZAR 247.205.873	Republic of South Africa Government Bond 7,25% 15/1/2020	19.534.715	0,57	USD 40.515.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,375% 25/9/2032*	37.678.950	1,09
ZAR 7.397.075	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048	546.351	0,01			111.815.361	3,24
	Republic of South Africa Government International Bond 5,00% 12/10/2046*	8.081.935	0,23	Royaume-Uni			
		92.111.191	2,67	USD 7.503.000	State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 Plc RegS (Step-up Coupon) 9,375% 10/3/2023	7.786.238	0,22
USD 6.105.000	Sri Lanka			USD 10.185.000	Ukreximbank Via Biz Finance Plc RegS 9,625% 27/4/2022	10.566.683	0,31
	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,125% 11/4/2019	6.135.616	0,18			18.352.921	0,53
USD 15.351.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,875% 25/7/2022	15.335.879	0,45	Etats-Unis			
USD 6.040.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,75% 18/4/2023*	5.979.993	0,17	USD 71.382.000	United States Treasury Bill 6/12/2018 (Zero Coupon)	70.732.483	2,05
USD 5.895.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 6,75% 18/4/2028*	5.851.525	0,17	USD 213.781.200	United States Treasury Note 2,25% 29/2/2020	213.259.272	6,18
		33.303.013	0,97			283.991.755	8,23
				Uruguay			
USD 15.529.000	Trinité-et-Tobago			UYU 488.010.000	Uruguay Government International Bond RegS 9,875% 20/6/2022	15.840.474	0,46
	Petroleum Co of Trinidad & Tobago Ltd RegS 9,75% 14/8/2019*	16.072.515	0,47			15.840.474	0,46
		16.072.515	0,47	Venezuela			
USD 10.069.000	Turquie			USD 7.344.599	Petroleos de Venezuela SA RegS (Defaulted) 9,00% 17/11/2021	1.952.900	0,06
	Petkim Petrokimya Holding AS RegS 5,875% 26/1/2023	9.515.205	0,28	USD 23.858.200	Petroleos de Venezuela SA RegS (Defaulted) 12,75% 17/2/2022	6.560.907	0,19
TRY 7.542.000	Turkey Government Bond 10,50% 15/1/2020	1.531.851	0,05	USD 27.852.579	Petroleos de Venezuela SA RegS (Defaulted) 6,00% 16/5/2024	6.538.393	0,19
TRY 23.849.000	Turkey Government Bond 11,00% 24/2/2027	4.442.936	0,13	USD 28.128.009	Petroleos de Venezuela SA RegS (Defaulted) 6,00% 15/11/2026	6.469.346	0,19
USD 6.692.000	Turkey Government International Bond 7,50% 7/11/2019	6.959.680	0,20	USD 269.102.828	Petroleos de Venezuela SA RegS (Defaulted) 9,75% 17/5/2035	70.166.894	2,03
USD 5.759.000	Turkey Government International Bond 7,00% 5/6/2020	5.960.565	0,17	USD 161.326.500	Petroleos de Venezuela SA RegS (Flat Trading) 8,50% 27/10/2020	136.818.956	3,97
USD 3.569.000	Turkey Government International Bond 5,125% 25/3/2022	3.515.465	0,10	USD 10.110.200	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 7,75% 13/10/2019	2.944.552	0,08
USD 76.231.000	Turkey Government International Bond 4,875% 16/4/2043	58.078.493	1,68	USD 13.531.800	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 12,75% 23/8/2022	4.069.689	0,12
USD 50.667.000	Turkey Government International Bond 6,625% 17/2/2045	46.518.639	1,35				
		136.522.834	3,96				
USD 14.596.000	Ukraine						
	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2019*	15.063.072	0,44				
	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2020	5.900.407	0,17				

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

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Venezuela suite				OBLIGATIONS			
USD 7.500.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 9,00% 7/5/2023	2.161.875	0,06	Égypte			
USD 13.351.600	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 8,25% 13/10/2024	3.855.217	0,11	EGP 64.550.000	Egypt Treasury Bills 5/6/2018 (Zero Coupon)	3.612.780	0,10
USD 42.032.900	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 11,95% 5/8/2031	12.641.395	0,37			3.612.780	0,10
		254.180.124	7,37	Nigéria			
Zambie				NGN 9.473.785.000	Nigeria Treasury Bill 17/1/2019 (Zero Coupon)	24.250.426	0,70
ZMW 176.445.000	Republic of Zambia Treasury Bills 21/1/2019 (Zero Coupon)	15.718.900	0,46	NGN 2.700.000.000	Nigeria Treasury Bill FRN 21/9/2019	6.763.334	0,20
USD 2.000.000	Zambia Government International Bond RegS 5,375% 20/9/2022	1.737.280	0,05			31.013.760	0,90
		17.456.180	0,51	Total des obligations		34.626.540	1,00
Total des obligations		3.313.709.535	96,09	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		34.626.540	1,00
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		3.313.709.535	96,09	Organismes de placement collectif			
				Luxembourg			
				4.050.000	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Corporate Bond Fund X2 (USD) ¹	51.111.000	1,48
						51.111.000	1,48
				Total des organismes de placement collectif		51.111.000	1,48
				Portefeuille de titres à la valeur de marché		3.399.447.075	98,57
				Autres éléments de l'actif net		49.228.489	1,43
				Total de l'actif net (USD)		3.448.675.564	100,00

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values latentes USD	Valeur de marché USD
CCCDs	EUR 304.639.816	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	3.182.517	(31.505.248)
CDS	USD 4.928.751	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	248.782	(234.323)
CDS	USD 14.299.120	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	236.348	(679.810)
CDS	USD 4.767.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	78.793	(226.633)
CDS	USD 15.581.318	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	338.602	(740.769)
CDS	USD 40.595.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	942.960	2.190.112
CDS	USD 316.348.128	Fund receives default protection on Markit CDX.EM.29 and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	3.540.787	10.057.558
CDS	USD 31.029.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	212.491	473.393
CDS	USD 17.104.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	113.279	260.946
CDS	USD 11.440.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	461.884	(543.882)
CDS	USD 42.740.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	1.027.757	2.305.836
CDS	USD 35.858.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	234.225	547.066
CDS	USD 28.659.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	248.492	437.235
CDS	USD 12.920.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	570.911	(614.244)
CDS	USD 8.607.204	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	359.801	(409.205)
CDS	USD 32.415.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	813.632	1.748.799
CDS	USD 23.316.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	1.253.711	(1.108.492)
CDS	USD 14.678.387	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	789.263	(697.842)
CDS	USD 9.561.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	HSBC	20/6/2023	462.706	(454.550)
CDS	USD 16.800.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Rep Turkey	HSBC	20/6/2023	174.579	(1.190.305)
CDS	USD 170.709.605	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.30 and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2023	696.538	(10.775.149)
CDS	USD 17.234.424	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	320.746	(819.361)
Total (exposition brute sous-jacente – 1.254.140.109 USD)					16.308.804	(31.978.868)

CCCDs : Centrally Cleared Credit Default Swaps ou swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale
CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
ARS	1.363.488.116	USD	66.482.164	BNP Paribas	14/6/2018	(12.292.773)
ARS	41.418.761	USD	1.985.218	Citibank	14/6/2018	(339.104)
ARS	6.381.973	USD	303.759	Morgan Stanley	14/6/2018	(50.119)
ARS	98.435.506	USD	4.638.808	Royal Bank of Scotland	14/6/2018	(726.665)
ARS	263.226.992	USD	13.071.715	BNP Paribas	27/7/2018	(2.778.873)
AUD	183.866.460	USD	137.864.909	Bank of America		
				Merrill Lynch	5/6/2018	1.414.625
AUD	190.774.378	USD	143.316.968	Barclays Bank	5/6/2018	1.195.340
AUD	139.376.782	USD	105.617.375	Deutsche Bank	5/6/2018	(38.938)
AUD	26.304.766	USD	19.813.206	Goldman Sachs	5/6/2018	112.753
AUD	83.880.101	USD	62.563.560	HSBC	5/6/2018	975.932
AUD	702.104.106	USD	527.705.100	Morgan Stanley	5/6/2018	4.141.398
BRL	163.901.057	USD	43.765.302	Barclays Bank	5/6/2018	241.817
BRL	6.000.000	USD	1.685.478	BNP Paribas	5/6/2018	(74.490)
BRL	40.960.542	USD	11.575.680	Deutsche Bank	5/6/2018	(577.853)
BRL	1.032.335.108	USD	285.064.608	Goldman Sachs	5/6/2018	(7.884.614)
BRL	804.429.655	USD	223.312.117	Standard Chartered Bank	5/6/2018	(7.324.300)
				State Street Bank & Trust Company	5/6/2018	(379.116)
BRL	80.694.549	USD	21.505.356	Goldman Sachs	27/6/2018	115.722
CAD	54.556.205	USD	42.604.394	Citibank	5/6/2018	(486.087)
CAD	58.461.037	USD	45.891.314	Credit Suisse	5/6/2018	(758.411)
CAD	410.701.576	USD	320.380.375	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	(3.311.851)
CLP	13.688.653.151	USD	22.007.481	Bank of America		
				Merrill Lynch	5/6/2018	(329.747)
CLP	2.278.554.128	USD	3.675.087	BNP Paribas	5/6/2018	(66.705)
CLP	32.212.652.120	USD	52.056.645	Credit Suisse	5/6/2018	(1.043.787)
CLP	6.787.687.143	USD	10.722.197	Goldman Sachs	5/6/2018	26.975
CLP	26.446.525.000	USD	42.078.799	HSBC	5/6/2018	(197.341)
CLP	26.446.521.814	USD	42.199.652	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	(318.199)
CLP	55.156.766.485	USD	87.904.833	Royal Bank of Scotland	27/6/2018	(523.624)
CNY	600.805.860	USD	94.323.954	Goldman Sachs	5/6/2018	(509.814)
COP	231.830.866.736	USD	81.990.015	Goldman Sachs	5/6/2018	(1.880.383)
COP	231.830.865.000	USD	81.374.143	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	(1.264.512)
COP	255.064.862.906	USD	88.562.651	Goldman Sachs	27/6/2018	(503.500)
EUR	9.010.879	USD	10.700.985	Citibank	5/6/2018	(201.295)
EUR	596.912.180	USD	704.465.692	Goldman Sachs	5/6/2018	(8.929.470)
EUR	428.382.181	USD	505.635.590	HSBC	5/6/2018	(6.474.518)
EUR	7.519.452	USD	8.851.541	Morgan Stanley	5/6/2018	(89.697)
EUR	2.953.718	USD	3.486.755	Nomura International	5/6/2018	(45.013)
EUR	5.000.000	USD	5.762.115	UBS	5/6/2018	64.004
EUR	4.321	USD	5.141	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(103)
GBP	62.635.451	USD	84.823.746	Citibank	5/6/2018	(1.559.172)
GBP	99.450.099	USD	132.087.632	Deutsche Bank	5/6/2018	116.575
GBP	129.186.957	USD	174.818.536	HSBC	5/6/2018	(3.083.571)
GBP	132.751.054	USD	179.624.935	Morgan Stanley	5/6/2018	(3.152.030)
HUF	52.759.451.398	USD	194.620.076	BNP Paribas	5/6/2018	(2.034.836)
HUF	24.906.470.055	USD	92.455.864	Citibank	5/6/2018	(1.540.997)
HUF	12.102.825.000	USD	43.747.391	Deutsche Bank	5/6/2018	430.958
HUF	9.927.119.271	USD	36.802.653	Goldman Sachs	5/6/2018	(566.176)
HUF	11.761.206.700	USD	43.766.701	HSBC	5/6/2018	(835.344)
HUF	12.088.244.540	USD	43.755.500	JP Morgan	5/6/2018	369.626
HUF	11.761.210.000	USD	43.791.157	Societe Generale	5/6/2018	(859.789)
HUF	19.033.917.055	USD	72.643.548	UBS	5/6/2018	(3.164.973)
IDR	637.983.690.196	USD	45.231.031	Deutsche Bank	5/6/2018	664.010
IDR	1.268.111.760.833	USD	89.824.552	Deutsche Bank	27/6/2018	1.021.991
IDR	1.949.461.861.672	USD	138.122.448	Goldman Sachs	27/6/2018	1.535.489
IDR	1.362.045.149.193	USD	96.069.154	HSBC	27/6/2018	1.506.705
IDR	578.444.856.886	USD	41.053.574	Standard Chartered Bank	27/6/2018	385.767
IDR	68.419.956.618	USD	4.818.986	State Street Bank & Trust Company	27/6/2018	82.567

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
IDR	1.295.674.760.153	USD	91.664.291	UBS	27/6/2018	1.156.844
INR	954.560.188	USD	14.050.187	Goldman Sachs	5/6/2018	93.690
INR	2.979.001.851	USD	43.799.189	Deutsche Bank	27/6/2018	221.132
INR	2.032.205.435	USD	29.559.352	Goldman Sachs	27/6/2018	470.282
INR	954.560.188	USD	14.100.272	HSBC	27/6/2018	5.139
INR	6.035.398.559	USD	88.664.589	UBS	27/6/2018	519.707
JPY	385.048.320	USD	3.545.946	Bank of America		
				Merrill Lynch	5/6/2018	3.248
JPY	9.922.252.515	USD	91.223.585	Deutsche Bank	5/6/2018	235.067
JPY	171.059.207	USD	1.572.452	Goldman Sachs	5/6/2018	4.291
JPY	17.912.626.118	USD	164.416.722	HSBC	5/6/2018	693.433
JPY	37.962.008.839	USD	349.204.815	Morgan Stanley	5/6/2018	711.110
KRW	7.910.237.868	USD	7.344.111	Goldman Sachs	5/6/2018	(8.075)
KRW	48.194.900.000	USD	45.181.307	Morgan Stanley	5/6/2018	(484.861)
KRW	94.811.021.852	USD	88.533.964	State Street Bank & Trust Company	5/6/2018	(605.248)
KRW	5.991.969.770	USD	5.561.509	Goldman Sachs	27/6/2018	(11.676)
KZT	412.360.419	USD	1.244.674	Barclays Bank	5/6/2018	7.185
KZT	1.252.774.822	USD	3.804.935	HSBC	13/7/2018	(27.065)
MXN	70.514.824	USD	3.615.232	Barclays Bank	5/6/2018	(89.371)
MXN	864.368.120	USD	44.872.403	Citibank	5/6/2018	(1.652.530)
MXN	1.845.479.320	USD	94.032.977	Goldman Sachs	5/6/2018	(1.755.880)
MXN	1.991.290.029	USD	103.206.665	HSBC	5/6/2018	(3.638.785)
MXN	208.609.241	USD	10.560.354	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	(129.538)
MXN	772.105.256	USD	39.283.892	UBS	5/6/2018	(677.319)
MXN	1.952.943.035	USD	98.487.248	Royal Bank of Scotland	27/6/2018	(1.214.677)
MYR	558.290.172	USD	141.536.417	UBS	5/6/2018	(1.262.504)
NZD	2.561.467	USD	1.795.788	BNP Paribas	5/6/2018	(456)
NZD	5.577.644	USD	3.904.516	Goldman Sachs	5/6/2018	4.855
NZD	340.176.848	USD	236.008.720	HSBC	5/6/2018	2.421.252
NZD	233.313.508	USD	161.099.477	Morgan Stanley	5/6/2018	2.429.967
NZD	127.948.312	USD	88.381.576	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	1.297.399
PEN	503.858.633	USD	153.867.883	Barclays Bank	5/6/2018	(97.403)
PHP	7.216.289.026	USD	139.391.328	Deutsche Bank	5/6/2018	(2.083.171)
PHP	2.332.031.027	USD	44.572.458	HSBC	5/6/2018	(199.668)
PHP	2.323.424.818	USD	44.104.495	HSBC	27/6/2018	(76.611)
PLN	399.601.960	USD	109.963.516	Bank of America		
				Merrill Lynch	5/6/2018	(2.071.753)
PLN	483.637.431	USD	135.121.094	BNP Paribas	5/6/2018	(4.539.914)
PLN	366.162.552	USD	102.356.076	Citibank	5/6/2018	(3.492.889)
PLN	399.958.691	USD	110.075.849	Deutsche Bank	5/6/2018	(2.087.769)
PLN	321.328.503	USD	86.302.605	Goldman Sachs	5/6/2018	455.475
PLN	941.413.819	USD	257.275.702	HSBC	5/6/2018	(3.095.776)
PLN	12.965.154	USD	3.579.369	JP Morgan	5/6/2018	(78.802)
PLN	185.255.000	USD	50.396.073	Morgan Stanley	5/6/2018	(377.578)
PLN	351.831.393	USD	96.104.530	Societe Generale	5/6/2018	(1.110.728)
PLN	3.200.000	USD	900.066	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	(36.073)
RON	41.419.501	USD	10.626.176	Goldman Sachs	5/6/2018	(254.094)
RUB	4.336.495.088	USD	69.486.914	Bank of America		
				Merrill Lynch	5/6/2018	170.499
RUB	11.852.768.255	USD	186.885.857	Citibank	5/6/2018	3.505.960
RUB	2.877.019.384	USD	46.211.601	Goldman Sachs	5/6/2018	2.156
RUB	1.398.836.152	USD	22.771.222	HSBC	5/6/2018	(301.622)
RUB	2.844.859.738	USD	46.040.779	JP Morgan	5/6/2018	(343.605)
RUB	2.852.157.360	USD	45.036.434	Morgan Stanley	5/6/2018	777.962
RUB	2.816.070.000	USD	45.089.585	Bank of America		
				Merrill Lynch	27/6/2018	31.772
RUB	2.816.067.778	USD	45.107.605	HSBC	27/6/2018	13.716
SEK	241.254	USD	27.658	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(288)
THB	2.266.900.550	USD	71.445.698	HSBC	5/6/2018	(581.329)
TRY	59.999.857	USD	12.976.365	Barclays Bank	5/6/2018	245.004
TRY	137.505.000	USD	30.041.292	Citibank	5/6/2018	258.853
TRY	185.276.358	USD	43.011.704	Deutsche Bank	5/6/2018	(2.184.822)
TRY	15.688.314	USD	3.415.226	Goldman Sachs	5/6/2018	41.799
TRY	682.080.253	USD	151.080.991	HSBC	5/6/2018	(780.054)

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
TRY	648.934.185	USD	141.427.775	Morgan Stanley	5/6/2018	1.569.205
TRY	12.154.635	USD	2.625.475	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	52.880
TRY	1.179.878.056	USD	266.532.980	Standard Chartered Bank	5/6/2018	(6.538.974)
TRY	84.915.099	USD	18.351.106	State Street Bank & Trust Company	5/6/2018	360.503
USD	17.800.059	ARS	400.501.322	Bank of America Merrill Lynch	14/6/2018	1.882.852
USD	15.991.685	ARS	364.290.575	Deutsche Bank	14/6/2018	1.513.609
USD	17.839.703	ARS	400.501.322	HSBC	14/6/2018	1.922.495
USD	13.627.346	AUD	18.122.893	Bank of America Merrill Lynch	5/6/2018	(100.813)
USD	71.140.389	AUD	95.461.624	Citibank	5/6/2018	(1.172.150)
USD	53.249.780	AUD	70.735.430	Deutsche Bank	5/6/2018	(332.574)
USD	83.888.961	AUD	112.404.318	Goldman Sachs	5/6/2018	(1.257.732)
USD	237.263.850	AUD	316.549.771	HSBC	5/6/2018	(2.523.791)
USD	179.379.588	AUD	239.408.097	Morgan Stanley	5/6/2018	(1.972.946)
USD	2.817.945	BRL	10.321.991	BNP Paribas	5/6/2018	46.510
USD	215.011.455	BRL	762.826.421	Deutsche Bank	5/6/2018	10.194.027
USD	150.834.712	BRL	563.062.871	Goldman Sachs	5/6/2018	(346.588)
USD	45.043.744	BRL	162.517.830	HSBC	5/6/2018	1.408.019
USD	44.280.607	BRL	158.856.679	JP Morgan	5/6/2018	1.627.894
USD	130.896.833	BRL	477.434.164	Standard Chartered Bank	5/6/2018	2.706.677
USD	54.409.722	BRL	204.758.941	Goldman Sachs	27/6/2018	(452.833)
USD	1.006.983	CAD	1.303.587	BNP Paribas	5/6/2018	592
USD	97.615.265	CAD	125.961.517	Goldman Sachs	5/6/2018	370.855
USD	130.010.421	CAD	168.314.297	HSBC	5/6/2018	68.953
USD	47.383.204	CAD	61.159.417	Morgan Stanley	5/6/2018	167.105
USD	18.459.152	CAD	23.873.182	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	28.654
USD	66.278.824	CAD	85.633.190	Standard Chartered Bank	5/6/2018	168.561
USD	44.185.384	CAD	57.192.235	UBS	5/6/2018	32.016
USD	21.942.268	CLP	13.648.090.723	Bank of America Merrill Lynch	5/6/2018	328.769
USD	27.593.009	CLP	17.306.335.000	Credit Suisse	5/6/2018	186.212
USD	27.601.803	CLP	17.306.330.509	Deutsche Bank	5/6/2018	195.013
USD	7.172.059	CLP	4.443.070.639	Goldman Sachs	5/6/2018	135.887
USD	87.864.224	CLP	55.156.766.485	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	516.424
USD	89.982.718	CNY	574.926.583	HSBC	5/6/2018	209.554
USD	4.065.992	CNY	25.897.617	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	22.152
USD	130.813.656	COP	377.573.444.900	Goldman Sachs	5/6/2018	342.377
USD	5.778.138	COP	16.500.802.458	HSBC	5/6/2018	76.252
USD	24.091.218	COP	69.587.484.378	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	45.120
USD	40.319.554	EUR	33.803.208	Citibank	5/6/2018	931.255
USD	183.649.598	EUR	153.226.480	Deutsche Bank	5/6/2018	5.106.471
USD	560.608.984	EUR	476.309.109	Goldman Sachs	5/6/2018	5.602.319
USD	197.073.396	EUR	167.377.359	HSBC	5/6/2018	2.041.330
USD	265.086.756	EUR	228.506.291	Morgan Stanley	5/6/2018	(1.174.191)
USD	9.075.112	EUR	7.618.494	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	197.862
USD	176	EUR	148	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	3
USD	88.543.056	EUR	76.119.946	Morgan Stanley	27/6/2018	(304.280)
USD	173.122.056	GBP	128.984.761	Barclays Bank	5/6/2018	1.655.881
USD	206.056.921	GBP	152.409.770	HSBC	5/6/2018	3.450.659
USD	143.176.377	GBP	106.350.769	Morgan Stanley	5/6/2018	1.798.748
USD	87.969.290	GBP	66.599.355	Standard Chartered Bank	5/6/2018	(564.709)
USD	98.503.177	GBP	72.518.121	State Street Bank & Trust Company	5/6/2018	2.101.053
USD	67.897.873	HUF	18.167.904.531	Bank of America Merrill Lynch	5/6/2018	1.580.461
USD	43.003.802	HUF	11.585.568.818	Barclays Bank	5/6/2018	713.568
USD	241.268.168	HUF	64.890.546.929	BNP Paribas	5/6/2018	4.401.384

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	8.341.708	HUF	2.271.676.973	Credit Suisse	5/6/2018	49.517
USD	12.058.862	HUF	3.292.794.527	Deutsche Bank	5/6/2018	39.336
USD	66.787.794	HUF	17.573.131.098	Goldman Sachs	5/6/2018	2.641.455
USD	5.508.690	HUF	1.482.699.163	HSBC	5/6/2018	96.466
USD	1.988.781	HUF	541.795.671	JP Morgan	5/6/2018	11.091
USD	37.828.004	HUF	10.148.387.873	Morgan Stanley	5/6/2018	783.841
USD	87.364.292	HUF	23.821.669.266	Societe Generale	5/6/2018	409.220
USD	1.906.724	HUF	519.461.178	UBS	5/6/2018	10.560
USD	45.635.457	IDR	637.983.690.196	Deutsche Bank	5/6/2018	(259.584)
USD	141.266.915	IDR	1.995.486.546.668	Goldman Sachs	27/6/2018	(1.688.194)
USD	1.863.531	IDR	26.096.887.871	JP Morgan	27/6/2018	(6.030)
USD	14.141.632	INR	954.560.188	HSBC	5/6/2018	(2.245)
USD	64.973.275	JPY	7.172.009.966	Citibank	5/6/2018	(1.134.937)
USD	348.761.986	JPY	38.520.232.948	Goldman Sachs	5/6/2018	(6.299.386)
USD	97.253.264	JPY	10.656.470.338	Morgan Stanley	5/6/2018	(973.063)
USD	3.509.692	JPY	384.552.046	Nomura		
USD	3.660.462	JPY	399.116.691	International Toronto	5/6/2018	(34.928)
USD	53.273.603	KRW	57.440.359.720	Dominion Bank	5/6/2018	(18.407)
USD	42.286.099	KRW	45.599.215.000	Goldman Sachs	5/6/2018	2.823
USD	44.101.497	KRW	47.876.585.000	HSBC	5/6/2018	(3.081)
USD	5.428.975	KRW	5.849.177.624	Standard Chartered Bank	5/6/2018	(299.740)
USD	3.682.705	KZT	1.227.261.359	Goldman Sachs	27/6/2018	11.398
USD	44.691.097	MXN	865.683.213	HSBC	13/7/2018	(18.227)
USD	45.555.404	MXN	885.348.782	Citibank	5/6/2018	1.405.467
USD	10.849.922	MXN	210.800.183	Credit Suisse	5/6/2018	1.286.463
USD	43.310.319	MXN	856.740.000	HSBC	5/6/2018	309.555
USD	102.342.116	MXN	2.022.075.608	JP Morgan	5/6/2018	471.866
USD	3.057.842	MXN	59.918.243	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	1.234.906
USD	43.778.892	MXN	858.933.112	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	61.828
USD	10.520.199	MXN	208.609.241	UBS	5/6/2018	830.780
USD	89.889.669	MYR	357.903.483	Royal Bank of Scotland	27/6/2018	129.749
USD	4.757.960	MYR	19.043.734	Barclays Bank	5/6/2018	(35.829)
USD	45.389.555	MYR	180.950.000	Goldman Sachs	5/6/2018	(26.898)
USD	43.734.788	NZD	63.087.969	UBS	5/6/2018	(75.269)
USD	1.981.487	NZD	2.826.343	Bank of America Merrill Lynch	5/6/2018	(483.571)
USD	92.814.863	NZD	132.850.771	BNP Paribas	5/6/2018	503
USD	116.864.299	NZD	169.422.509	Deutsche Bank	5/6/2018	(300.246)
USD	57.657.324	NZD	83.622.794	Goldman Sachs	5/6/2018	(1.883.942)
USD	44.482.282	NZD	63.849.585	HSBC	5/6/2018	(953.895)
USD	44.472.291	NZD	63.850.000	JP Morgan	5/6/2018	(269.894)
USD	90.820.900	NZD	130.238.118	Morgan Stanley Toronto	5/6/2018	(280.175)
USD	61.235.088	PEN	201.068.624	Dominion Bank	5/6/2018	(463.000)
USD	45.011.407	PEN	147.975.000	Barclays Bank	5/6/2018	(128.193)
USD	3.536.927	PEN	11.664.679	Goldman Sachs	5/6/2018	(148.456)
USD	43.484.304	PEN	143.150.330	HSBC	5/6/2018	(22.967)
USD	41.722.360	PEN	136.565.630	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	(203.138)
USD	45.094.138	PHP	2.356.845.135	Toronto Barclays Bank	27/6/2018	94.324
USD	21.803.922	PHP	1.150.920.000	Deutsche Bank	5/6/2018	249.196
USD	70.023.087	PHP	3.683.709.918	Goldman Sachs	5/6/2018	(95.243)
USD	45.098.450	PHP	2.356.845.000	HSBC	5/6/2018	(68.815)
USD	198.566.552	PLN	709.026.032	Standard Chartered Bank	5/6/2018	253.511
USD	33.359.485	PLN	122.766.763	Bank of America Merrill Lynch	5/6/2018	7.130.882
USD	133.733.077	PLN	482.288.443	Barclays Bank	5/6/2018	212.694
USD	24.716.920	PLN	88.214.959	BNP Paribas	5/6/2018	3.516.122
USD	196.157.296	PLN	713.484.157	Deutsche Bank	5/6/2018	899.051
USD	66.267.240	PLN	238.940.000	Goldman Sachs	5/6/2018	3.517.942
USD	9.531.103	PLN	35.152.137	HSBC	5/6/2018	1.753.898
USD	183.101.883	PLN	671.830.000	Morgan Stanley	5/6/2018	40.093
USD	20.701.795	PLN	76.340.430	Societe Generale	5/6/2018	1.709.071
USD		PLN		UBS	5/6/2018	90.025

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	10.813.689	RON	42.176.138	Goldman Sachs	5/6/2018	252.134
USD	43.997.050	RUB	2.759.055.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	5/6/2018	(321.837)
USD	49.879.533	RUB	3.121.960.000	Barclays Bank	5/6/2018	(268.721)
USD	44.181.104	RUB	2.737.136.226	Citibank	5/6/2018	214.300
USD	2.996.360	RUB	189.519.780	Goldman Sachs	5/6/2018	(47.909)
USD	27.012.817	RUB	1.665.610.280	HSBC	5/6/2018	258.006
USD	43.955.068	RUB	2.759.059.605	JP Morgan	5/6/2018	(363.893)
USD	76.456.314	RUB	4.749.601.964	UBS	5/6/2018	163.137
USD	2.135	SEK	18.387	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	49
USD	2.610.996	THB	83.708.541	Goldman Sachs	5/6/2018	(5.772)
USD	68.226.299	THB	2.183.192.009	HSBC	5/6/2018	(21.302)
USD	42.425.633	TRY	190.372.301	Bank of America		
				Merrill Lynch	5/6/2018	475.826
USD	2.806.336	TRY	13.110.753	Deutsche Bank	5/6/2018	(82.706)
USD	132.223.205	TRY	583.948.848	HSBC	5/6/2018	3.546.178
USD	32.632.268	TRY	156.384.042	JP Morgan	5/6/2018	(1.828.000)
USD	16.614.931	TRY	73.330.000	Morgan Stanley	5/6/2018	456.176
USD	7.415.242	TRY	35.517.899	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	(411.364)
USD	44.425.936	TRY	202.510.456	Standard Chartered Bank	5/6/2018	(198.595)
USD	75.289.429	TRY	331.912.732	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	2.150.242
USD	944.817	ZAR	11.980.560	Barclays Bank	5/6/2018	(3.446)
USD	46.971.385	ZAR	580.352.930	Citibank	5/6/2018	1.036.388
USD	7.267.165	ZAR	89.378.866	Goldman Sachs	5/6/2018	192.818
USD	46.235.285	ZAR	585.633.253	HSBC	5/6/2018	(117.651)
USD	36.048.552	ZAR	450.344.981	Morgan Stanley	5/6/2018	403.698
USD	43.654.236	ZAR	544.996.939	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	517.669
ZAR	1.195.898.988	USD	94.311.569	Barclays Bank	5/6/2018	343.966
ZAR	552.126.410	USD	43.953.111	Citibank	5/6/2018	(252.246)
ZAR	556.574.071	USD	44.672.451	Deutsche Bank	5/6/2018	(619.553)
ZAR	219.735.263	USD	17.558.313	Goldman Sachs	5/6/2018	(166.243)
ZAR	1.529.394.107	USD	122.661.770	HSBC	5/6/2018	(1.610.060)
ZAR	2.305.500.566	USD	181.650.429	Morgan Stanley	5/6/2018	830.191
ZAR	593.231.024	USD	46.945.090	Toronto Dominion Bank	5/6/2018	9.210
						(24.744.123)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Catégorie d'Actions couverte en dollars australiens						
AUD	686.740.315	USD	511.936.058	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	8.293.622
USD	31.552.865	AUD	42.235.827	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(442.243)
						7.851.379
Catégorie d'Actions couverte en dollars canadiens						
CAD	261.761.308	USD	202.714.746	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(588.081)
USD	9.107.110	CAD	11.709.782	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	65.058
						(523.023)
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	275.792	USD	275.219	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	4.775
USD	20.770	CHF	20.792	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(338)
						4.437
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	1.376.724.520	USD	1.638.416.285	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(33.347.177)
USD	163.811.277	EUR	137.559.390	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	3.436.181
						(29.910.996)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	196.941.425	USD	267.396.589	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(5.501.090)
USD	18.637.337	GBP	13.727.269	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	382.620
						(5.118.470)
Total (exposition brute sous-jacente – 22.128.448.202 USD)						(52.440.796)

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
3.686	EUR	Euro BOBL	Juin 2018	469.092.240	4.672.040
(57)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	6.695.936	(267.332)
(104)	EUR	Euro Bund	Septembre 2018	12.424.758	41.200
496	EUR	Euro BUXL	Juin 2018	87.724.132	2.862.215
283	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	28.489.330	106.637
2.625	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	255.407.250	43.587
39	USD	US Ultra Bond	Septembre 2018	4.436.367	70.850
Total				864.270.013	7.529.197

BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund

suite

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values latentes USD	Valeur de marché USD
180.000.000	Put	OTC AUD/JPY	Bank of America Merrill Lynch	AUD 83,50	6/7/2018	1.674.870	3.211.452
Total (exposition brute sous-jacente – 98.059.254 USD)						1.674.870	3.211.452

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	70,68
Énergie	17,98
Finance	3,92
Services aux collectivités	2,15
Valeurs industrielles	1,95
Organismes de placement collectif	1,48
Matériaux de base	0,28
Biens de consommation non cyclique	0,13
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,57
Autres éléments de l'actif net	1,43
	100,00

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS							
Angola				Colombie			
USD 494.000	Angolan Government International Bond RegS 8,25% 9/5/2028	513.355	0,88	USD 553.000	Bancolombia SA 5,125% 11/9/2022	557.894	0,96
		513.355	0,88	USD 599.000	Ecopetrol SA 4,125% 16/1/2025	575.340	0,99
						1.133.234	1,95
Argentine				Costa Rica			
USD 1.149.000	Argentine Republic Government International Bond 4,625% 11/1/2023	1.053.633	1,81	USD 400.000	Banco Nacional de Costa Rica RegS 5,875% 25/4/2021	406.494	0,70
USD 332.000	Genneia SA RegS 8,75% 20/1/2022	338.635	0,58	USD 200.000	Costa Rica Government International Bond RegS 4,25% 26/1/2023	188.747	0,32
USD 482.000	Provincia de Buenos Aires/ Argentina RegS 10,875% 26/1/2021	510.318	0,88			595.241	1,02
USD 355.000	Provincia de Buenos Aires/ Argentina RegS 6,50% 15/2/2023	347.456	0,60	Croatie			
		2.250.042	3,87	USD 816.000	Croatia Government International Bond RegS 6,75% 5/11/2019	851.292	1,46
Azerbaïdjan						851.292	1,46
USD 603.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic RegS 4,75% 13/3/2023	600.739	1,03	République dominicaine			
		600.739	1,03	USD 1.521.000	Dominican Republic International Bond RegS 7,50% 6/5/2021	1.602.001	2,75
Bahreïn				USD 170.000	Dominican Republic International Bond RegS 5,95% 25/1/2027	171.440	0,30
USD 700.000	Bahrain Government International Bond RegS 6,125% 5/7/2022	677.250	1,16			1.773.441	3,05
USD 400.000	Bahrain Government International Bond RegS 6,00% 19/9/2044	311.000	0,54	Ecuador			
		988.250	1,70	USD 735.000	Ecuador Government International Bond RegS 10,50% 24/3/2020	769.901	1,32
Biélorussie				USD 390.000	Ecuador Government International Bond RegS 7,95% 20/6/2024	370.982	0,64
USD 1.315.000	Republic of Belarus International Bond RegS 6,875% 28/2/2023	1.397.188	2,40			1.140.883	1,96
		1.397.188	2,40	Égypte			
Bolivie				USD 829.000	Egypt Government International Bond RegS 5,75% 29/4/2020	852.834	1,46
USD 532.000	Bolivian Government International Bond RegS 4,875% 29/10/2022	532.250	0,91	USD 1.247.000	Egypt Government International Bond RegS 5,577% 21/2/2023	1.237.647	2,13
USD 200.000	Bolivian Government International Bond RegS 5,95% 22/8/2023	209.068	0,36			2.090.481	3,59
		741.318	1,27	El Salvador			
Brésil				USD 868.000	El Salvador Government International Bond RegS 7,375% 1/12/2019	895.069	1,54
USD 666.000	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social RegS 5,50% 12/7/2020	683.276	1,18			895.069	1,54
BRL 1.820.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,00% 1/1/2025	490.189	0,84	Gabon			
USD 818.000	Caixa Economica Federal RegS 4,25% 13/5/2019	822.601	1,41	USD 593.661	Gabon Government International Bond RegS 6,375% 12/12/2024	573.625	0,99
USD 400.000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	377.878	0,65			573.625	0,99
		2.373.944	4,08	Ghana			
Îles Caïmans				USD 600.000	Ghana Government International Bond RegS 7,875% 7/8/2023	636.750	1,10
USD 469.000	Avi Funding Co Ltd RegS 2,85% 16/9/2020	462.136	0,79	USD 582.000	Ghana Government International Bond RegS 7,625% 16/5/2029	590.078	1,01
USD 41.000	Vale Overseas Ltd 4,375% 11/1/2022	41.267	0,07			1.226.828	2,11
		503.403	0,86	Guatemala			
				USD 200.000	Guatemala Government Bond RegS 5,75% 6/6/2022	208.747	0,36
						208.747	0,36

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Hong Kong				Pays-Bas			
USD 894.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd RegS 4,625% 14/3/2023	901.233	1,55	USD 309.000	Petrobras Global Finance BV 4,375% 20/5/2023	294.322	0,51
		901.233	1,55	USD 301.563	Republic of Angola Via Northern Lights III BV RegS 7,00% 17/8/2019	305.640	0,52
Indonésie						599.962	1,03
IDR 6.160.000.000	Jasa Marga Persero Tbk PT RegS 7,50% 11/12/2020	437.739	0,75	Nigéria			
USD 865.000	Pertamina Persero PT RegS 4,30% 20/5/2023	864.641	1,49	NGN 79.400.000	Nigeria Government Bond 14,50% 15/7/2021	226.097	0,39
IDR 5.060.000.000	Wijaya Karya Persero Tbk PT RegS 7,70% 31/1/2021	360.919	0,62	USD 546.000	Nigeria Government International Bond RegS 6,75% 28/1/2021	567.212	0,97
		1.663.299	2,86	USD 483.000	Nigeria Government International Bond RegS 6,375% 12/7/2023	497.490	0,86
Iraq						1.290.799	2,22
USD 590.000	Iraq International Bond RegS 6,752% 9/3/2023	595.531	1,02	Oman			
		595.531	1,02	USD 1.198.000	Oman Government International Bond RegS 4,125% 17/1/2023	1.160.563	1,99
Kazakhstan						1.160.563	1,99
KZT 145.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC RegS 8,95% 4/5/2023	427.545	0,74	Pakistan			
USD 400.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 3,875% 19/4/2022	396.750	0,68	USD 450.000	Pakistan Government International Bond RegS 6,875% 5/12/2027	416.880	0,71
USD 200.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 4,40% 30/4/2023	199.750	0,34	USD 200.000	Third Pakistan International Sukuk Co Ltd/The RegS 5,625% 5/12/2022	191.563	0,33
USD 420.000	KazMunayGas National Co JSC RegS 4,75% 24/4/2025	422.625	0,73			608.443	1,04
		1.446.670	2,49	Panama			
Liban				USD 931.000	Global Bank Corp RegS 4,50% 20/10/2021	918.781	1,58
USD 280.000	Lebanon Government International Bond 6,15% 19/6/2020	271.124	0,47			918.781	1,58
USD 180.000	Lebanon Government International Bond RegS 5,45% 28/11/2019	175.950	0,30	Pérou			
USD 696.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,10% 4/10/2022	634.230	1,09	USD 572.000	SAN Miguel Industrias Pet SA RegS 4,50% 18/9/2022	554.125	0,95
USD 861.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,00% 27/1/2023	775.438	1,33			554.125	0,95
		1.856.742	3,19	Qatar			
Mexique				USD 1.052.000	Qatar Government International Bond RegS 3,875% 23/4/2023	1.052.657	1,81
MXN 10.180.400	Mexican Bonos 7,50% 3/6/2027	500.222	0,86	USD 301.000	Qatar Government International Bond RegS 5,103% 23/4/2048	300.812	0,52
USD 531.000	Petroleos Mexicanos 6,00% 5/3/2020	549.186	0,94			1.353.469	2,33
USD 449.000	Petroleos Mexicanos 4,875% 24/1/2022	452.929	0,78	Roumanie			
USD 1.729.000	Petroleos Mexicanos 4,625% 21/9/2023	1.699.434	2,92	RON 3.040.000	Romania Government Bond 5,80% 26/7/2027	811.271	1,39
		3.201.771	5,50			811.271	1,39
Mongolie				Arabie Saoudite			
USD 1.005.000	Mongolia Government International Bond 5,625% 1/5/2023	976.106	1,68	USD 200.000	Saudi Government International Bond RegS 4,50% 17/4/2030	199.100	0,34
USD 400.000	Mongolia Government International Bond RegS 5,125% 5/12/2022	385.800	0,66			199.100	0,34
USD 275.000	Trade & Development Bank of Mongolia LLC RegS 9,375% 19/5/2020	292.674	0,50	Serbie			
		1.654.580	2,84	USD 875.000	Serbia International Bond RegS 4,875% 25/2/2020	888.125	1,53
						888.125	1,53

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Afrique du Sud				Venezuela			
USD 1.446.000	Eskom Holdings SOC Ltd RegS 5,75% 26/1/2021	1.445.277	2,48	USD 2.859.869	Petroleos de Venezuela SA 9,75% 17/5/2035	745.693	1,28
USD 1.297.000	Transnet SOC Ltd RegS 4,00% 26/7/2022	1.253.226	2,16	USD 96.100	Petroleos de Venezuela SA RegS (Defaulted) 12,75% 17/2/2022	26.427	0,05
		2.698.503	4,64	USD 624.000	Petroleos de Venezuela SA RegS (Flat Trading) 8,50% 27/10/2020	529.207	0,91
Sri Lanka				USD 473.500	Venezuela Government International Bond 9,00% 7/5/2023	136.486	0,23
USD 200.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,125% 11/4/2019	201.003	0,35	USD 985.800	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 7,75% 13/10/2019	287.110	0,49
USD 1.162.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,875% 25/7/2022	1.160.856	1,99	USD 402.900	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 12,75% 23/8/2022	121.172	0,21
USD 220.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,75% 18/4/2023	217.814	0,37			1.846.095	3,17
		1.579.673	2,71	Zambie			
Trinité-et-Tobago				USD 521.000	Zambia Government International Bond RegS 5,375% 20/9/2022	452.561	0,78
USD 1.004.000	Petroleum Co of Trinidad & Tobago Ltd RegS 9,75% 14/8/2019	1.039.140	1,78			452.561	0,78
		1.039.140	1,78	Total des obligations		56.287.128	96,71
Turquie				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		56.287.128	96,71
USD 706.000	Petkim Petrokimya Holding AS RegS 5,875% 26/1/2023	667.170	1,15	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
USD 405.000	Turkey Government International Bond 7,50% 7/11/2019	421.200	0,72	OBLIGATIONS			
USD 342.000	Turkey Government International Bond 7,00% 5/6/2020	353.970	0,61	Égypte			
USD 676.000	Turkey Government International Bond 3,25% 23/3/2023	610.935	1,05	EGP 4.975.000	Egypt Treasury Bills 10/7/2018 (Zero Coupon)	272.482	0,47
USD 780.000	Turkey Government International Bond 4,875% 16/4/2043	594.262	1,02			272.482	0,47
		2.647.537	4,55	Nigéria			
Ukraine				NGN 93.537.000	Nigeria Treasury Bill 17/1/2019 (Zero Coupon)	239.430	0,41
USD 271.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2019	279.672	0,48	NGN 98.603.000	Nigeria Treasury Bill FRN 14/6/2018	272.146	0,47
USD 441.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2020	456.986	0,79			511.576	0,88
USD 140.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2021	145.425	0,25	Zambie			
USD 717.000	Ukraine Government International Bond RegS 7,75% 1/9/2022	736.001	1,26	ZMW 1.430.000	Republic of Zambia Treasury Bills 21/1/2019 (Zero Coupon)	127.394	0,22
		1.618.084	2,78	ZMW 1.130.000	Republic of Zambia Treasury Bills 18/3/2019 (Zero Coupon)	97.651	0,16
Royaume-Uni						225.045	0,38
USD 461.000	State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 Plc RegS (Step-up coupon) 9,375% 10/3/2023	478.403	0,82	Total des obligations		1.009.103	1,73
USD 793.000	Ukreximbank Via Biz Finance Plc RegS 9,625% 27/4/2022	822.717	1,42	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		1.009.103	1,73
		1.301.120	2,24	Portefeuille de titres à la valeur de marché		57.296.231	98,44
Etats-Unis				Autres éléments de l'actif net		905.067	1,56
USD 550.000	United States Treasury Bill 28/3/2019 (Zero Coupon)	540.718	0,93	Total de l'actif net (USD)		58.201.298	100,00
USD 3.009.500	United States Treasury Note/Bond 2,25% 29/2/2020	3.002.153	5,16				
		3.542.871	6,09				

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values latentes USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 193.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	4.483	10.412
CDS	USD 147.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	1.007	2.243
CDS	USD 68.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	450	1.037
CDS	USD 200.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	4.809	10.790
CDS	USD 170.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	1.111	2.594
CDS	USD 135.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	888	2.060
CDS	USD 1.500.000	Fund receives default protection on Markit CDX.EM.29 and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	20.239	47.689
CDS	USD 1.300.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.30 and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	11.492	(82.056)
CDS	USD 1.300.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.30 and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	527	(82.056)
CDS	USD 147.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	3.690	7.931
CDS	EUR 950.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	18.986	(98.247)
CDS	EUR 970.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	13.955	(100.315)
CDS	USD 400.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	8.709	21.580
CDS	USD 388.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	3.522	5.919
CDS	USD 3.400.000	Fund receives default protection on Markit CDX.EM.29 and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	40.095	108.095
Total (exposition brute sous-jacente – 11.727.411 USD)					133.963	(142.324)

CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
(9)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	1.057.253	(41.677)
(9)	EUR	Euro Bund	Septembre 2018	1.075.219	3.565
(33)	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	3.908.395	(12.013)
Total				6.040.867	(50.125)

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values latentes USD	Valeur de marché USD
1.350.000	Put	OTC AUD/JPY	Barclays Bank	AUD 82,50	19/6/2018	1.708	12.693
Total (exposition brute sous-jacente – 585.632 USD)						1.708	12.693

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
ARS	2.618.972	USD	125.654	Citibank	14/6/2018	(21.568)
ARS	1.321.631	USD	63.115	Morgan Stanley	14/6/2018	(10.589)
ARS	3.379.555	USD	142.297	HSBC	27/7/2018	(10.148)
ARS	2.154.312	USD	102.028	Royal Bank of Scotland	27/7/2018	(17.789)
BRL	801.891	USD	214.220	Goldman Sachs	5/6/2018	1.086
BRL	1.043.606	USD	289.665	Morgan Stanley	5/6/2018	(9.459)
CLP	183.746.165	USD	296.365	BNP Paribas	5/6/2018	(5.379)
CLP	550.219.544	USD	869.155	Goldman Sachs	5/6/2018	2.188
CLP	365.763.128	USD	582.927	Royal Bank of Scotland	27/6/2018	(3.472)
CNY	947.390	USD	148.736	Goldman Sachs	5/6/2018	(735)
EUR	376.972	USD	436.374	Goldman Sachs	5/6/2018	2.883
EUR	257.053	USD	301.601	State Street Bank & Trust Company	5/6/2018	(2.077)
IDR	918.495.058	USD	65.008	Goldman Sachs	27/6/2018	901
IDR	12.566.176.309	USD	889.536	HSBC	27/6/2018	12.181
INR	78.973.842	USD	1.162.393	Goldman Sachs	5/6/2018	7.763
INR	59.820.984	USD	883.645	HSBC	27/6/2018	583
JPY	31.923.769	USD	293.965	Credit Suisse	5/6/2018	293
JPY	30.725.043	USD	282.438	Goldman Sachs	5/6/2018	771
KRW	313.519.489	USD	290.834	Goldman Sachs	5/6/2018	21
KZT	99.211.657	USD	298.291	Deutsche Bank	13/7/2018	609
KZT	99.023.358	USD	300.754	HSBC	13/7/2018	(2.421)
MXN	5.817.659	USD	294.370	Goldman Sachs	5/6/2018	(3.476)
MXN	5.642.631	USD	289.266	HSBC	5/6/2018	(7.125)
MXN	16.372.797	USD	828.835	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	(10.167)
MXN	5.821.380	USD	293.573	Royal Bank of Scotland	27/6/2018	(3.621)
NZD	111.106	USD	77.894	BNP Paribas	5/6/2018	(20)
NZD	207.158	USD	145.333	Goldman Sachs	5/6/2018	(136)
PHP	27.258.279	USD	526.527	Deutsche Bank	5/6/2018	(7.700)
PHP	27.258.279	USD	518.514	HSBC	5/6/2018	313
PHP	7.672.392	USD	145.465	Deutsche Bank	27/6/2018	394
PHP	27.258.279	USD	517.431	HSBC	27/6/2018	771
PLN	1.847.506	USD	518.795	Bank of America Merrill Lynch	5/6/2018	(19.972)
RUB	9.335.861	USD	147.201	Citibank	5/6/2018	2.761
RUB	9.456.654	USD	149.741	Goldman Sachs	5/6/2018	2.162
TRY	1.856.900	USD	431.266	Goldman Sachs	5/6/2018	(22.085)
TRY	2.705.075	USD	598.589	HSBC	5/6/2018	(2.507)
TRY	1.364.820	USD	285.129	Morgan Stanley	5/6/2018	15.618
USD	15.039	AUD	20.000	Bank of America Merrill Lynch	5/6/2018	(111)
USD	234.910	BRL	860.462	BNP Paribas	5/6/2018	3.877
USD	278.392	BRL	985.035	HSBC	5/6/2018	13.912
USD	213.707	BRL	801.891	Goldman Sachs	27/6/2018	(1.150)
USD	594.334	CLP	368.202.581	Goldman Sachs	5/6/2018	11.238

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	582.657	CLP	365.763.128	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	3.425
USD	147.783	CNY	947.390	HSBC	5/6/2018	(218)
USD	314.331	EUR	262.210	Goldman Sachs	5/6/2018	8.797
USD	583.268	EUR	487.736	JP Morgan	5/6/2018	14.947
USD	13.312	GBP	10.000	BNP Paribas	5/6/2018	18
USD	14.139	GBP	10.409	State Street Bank & Trust Company	5/6/2018	302
USD	39.821	GBP	30.000	UBS	5/6/2018	(60)
USD	1.037.274	IDR	14.617.296.244	Goldman Sachs	27/6/2018	(11.626)
USD	148.561	IDR	2.080.443.324	JP Morgan	27/6/2018	(727)
USD	279.880	INR	19.152.858	BNP Paribas	5/6/2018	(3.909)
USD	886.237	INR	59.820.984	HSBC	5/6/2018	(131)
USD	306.822	JPY	33.454.262	Credit Suisse	5/6/2018	(1.544)
USD	289.124	JPY	31.678.907	Goldman Sachs	5/6/2018	(2.877)
USD	291.714	KRW	313.519.489	Goldman Sachs	5/6/2018	858
USD	290.996	KRW	313.519.489	Goldman Sachs	27/6/2018	(68)
USD	296.588	KZT	98.837.930	HSBC	13/7/2018	(1.186)
USD	294.261	MXN	5.847.188	BNP Paribas	5/6/2018	1.892
USD	831.811	MXN	16.164.519	HSBC	5/6/2018	23.557
USD	294.694	MXN	5.821.380	Royal Bank of Scotland	5/6/2018	3.615
USD	825.683	MXN	16.372.797	Royal Bank of Scotland	27/6/2018	10.183
USD	223.123	NZD	318.257	BNP Paribas	5/6/2018	57
USD	526.527	PHP	27.258.279	Deutsche Bank	5/6/2018	7.700
USD	518.514	PHP	27.258.279	HSBC	5/6/2018	(313)
USD	517.431	PHP	27.258.279	HSBC	27/6/2018	(771)
USD	221.096	PLN	787.356	Bank of America Merrill Lynch	5/6/2018	8.511
USD	859.308	RON	3.390.000	Citibank	5/6/2018	10.399
USD	232.614	TRY	1.086.734	Deutsche Bank	5/6/2018	(6.855)
USD	145.946	TRY	628.400	Goldman Sachs	5/6/2018	7.474
USD	319.975	ZAR	4.057.382	Barclays Bank	5/6/2018	(1.167)
USD	283.549	ZAR	3.596.360	Citibank	5/6/2018	(1.103)
USD	597.724	ZAR	7.351.412	Goldman Sachs	5/6/2018	15.859
ZAR	7.818.694	USD	616.602	Barclays Bank	5/6/2018	2.249
ZAR	7.186.460	USD	573.888	HSBC	5/6/2018	(5.079)
						827
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	16.602.147	USD	19.754.498	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(398.707)
USD	1.013.489	EUR	852.390	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	19.720
						(378.987)
Total (exposition brute sous-jacente – 48.673.335 USD)						(378.160)

BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund suite

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	65,16
Énergie	14,43
Finance	8,54
Valeurs industrielles	4,48
Services aux collectivités	3,06
Matériaux de base	2,77
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,44
Autres éléments de l'actif net	1,56
	100,00

BlackRock European Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES				OBLIGATIONS			
Belgique				Pays-Bas			
287.180	Telenet Group Holding NV	12.589.971	1,17	EUR 95.000.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 19/3/2019	95.368.600	8,89
		12.589.971	1,17			95.368.600	8,89
Danemark				Total des obligations		95.368.600	8,89
91.079	Chr Hansen Holding A/S*	7.510.427	0,70				
273.788	DSV A/S	19.597.383	1,83	CERTIFICATS DE DÉPÔT			
197.353	GN Store Nord A/S	6.503.704	0,61	Canada			
703.825	Novo Nordisk A/S 'B'	28.673.781	2,67	EUR 29.500.000	Toronto Dominion Bank/The 13/9/2018 (Zero Coupon)	29.525.960	2,76
161.195	Royal Unibrew A/S	9.874.972	0,92			29.525.960	2,76
		72.160.267	6,73	France			
Finlande				EUR 70.500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 13/8/2018 (Zero Coupon)	70.544.767	6,58
923.175	Wartsila OYJ Abp	16.838.712	1,57			70.544.767	6,58
		16.838.712	1,57	Royaume-Uni			
France				EUR 49.500.000	Mizuho Corporate Bank 23/7/2018 (Zero Coupon)	49.530.443	4,62
26.134	Kering SA	12.803.047	1,20	EUR 10.000.000	Toronto Dominion Bank/The 4/6/2018 (Zero Coupon)	10.000.000	0,93
113.103	Remy Cointreau SA	14.386.701	1,34			59.530.443	5,55
		27.189.748	2,54	Total des certificats de dépôt		159.601.170	14,89
Allemagne				BILLET DE TRÉSORERIE			
51.106	adidas AG*	9.963.115	0,93	France			
72.585	Aumann AG	4.333.324	0,41	EUR 30.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 8/6/2018 (Zero Coupon)	30.002.280	2,80
83.526	Continental AG	18.267.136	1,70			30.002.280	2,80
186.105	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	16.045.973	1,50	Luxembourg			
2.177	Puma SE	1.108.093	0,10	EUR 14.500.000	Albion Capital Corp SA RegS 18/6/2018 (Zero Coupon)	14.502.740	1,35
71.132	SAP SE	6.872.063	0,64	EUR 5.000.000	Antalis SA 2/8/2018 (Zero Coupon)	5.002.844	0,47
		56.589.704	5,28	EUR 8.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel 5/9/2018 (Zero Coupon)	8.000.000	0,74
Irlande				EUR 500.000	Banque Federative du Credit Mutuel 20/9/2018 (Zero Coupon)	500.556	0,05
2.379.011	Irish Continental Group Plc	12.846.660	1,20	EUR 10.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 24/7/2018 (Zero Coupon)	10.005.236	0,93
		12.846.660	1,20	EUR 9.500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 13/8/2018 (Zero Coupon)	9.506.947	0,89
Luxembourg				EUR 16.500.000	Collateralized Commercial Paper II 8/11/2018 (Zero Coupon)	16.524.977	1,54
304.750	Stabilus SA	25.629.475	2,39	EUR 15.000.000	Honeywell International Inc 18/6/2018 (Zero Coupon)	15.002.482	1,40
		25.629.475	2,39	EUR 15.000.000	Honeywell International Inc 10/8/2018 (Zero Coupon)	15.010.074	1,40
Pays-Bas				EUR 20.000.000	Honeywell International Inc 24/8/2018 (Zero Coupon)	20.016.118	1,87
28.274	ASML Holding NV	4.807.994	0,45	EUR 5.000.000	LMA SA 5/6/2018 (Zero Coupon)	5.000.211	0,46
870.221	RELX NV	16.312.292	1,52	EUR 10.000.000	LMA SA 11/6/2018 (Zero Coupon)	10.001.084	0,93
		21.120.286	1,97	EUR 2.000.000	LMA SA 29/6/2018 (Zero Coupon)	2.000.607	0,19
Espagne				EUR 13.000.000	OP Corporate Bank Plc 19/11/2018 (Zero Coupon)	13.023.511	1,21
927.221	Industria de Diseno Textil SA	25.257.500	2,36	EUR 20.000.000	Procter & Gamble Co/The RegS 17/8/2018 (Zero Coupon)	20.016.700	1,87
		25.257.500	2,36				
Suède							
1.911.420	Bygghemma Group First AB	7.644.086	0,71				
		7.644.086	0,71				
Suisse							
166.454	Cie Financiere Richemont SA Reg	13.229.501	1,23				
40.824	Kuehne + Nagel International AG Reg*	5.314.108	0,50				
145.537	Lonza Group AG Reg	33.733.009	3,15				
1.948	Sika AG 'BR'	13.492.820	1,26				
38.141	Straumann Holding AG Reg	21.685.971	2,02				
		87.455.409	8,16				
Total des actions ordinaires		365.321.818	34,08				

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

BlackRock European Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Organismes de placement collectif			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Luxembourg suite				Irlande			
EUR 84.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 30/11/2018 (Zero Coupon)	84.155.315	7,85	103.827.597	Institutional Cash Series Plc - Institutional Euro Assets Liquidity Fund Agency Dis ¹	103.827.597	9,68
EUR 12.500.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 2/8/2018 (Zero Coupon)	12.508.304	1,17			103.827.597	9,68
EUR 20.000.000	Svenska Handelsbanken AB RegS 7/8/2018 (Zero Coupon)	20.014.358	1,87	Total des organismes de placement collectif		103.827.597	9,68
EUR 29.000.000	Svenska Handelsbanken AB Regs 17/9/2018 (Zero Coupon)	29.033.993	2,71	Portefeuille de titres à la valeur de marché		1.068.955.934	99,71
EUR 5.000.000	Svenska Handelsbanken AB Regs 5/11/2018 (Zero Coupon)	5.008.412	0,47	Autres éléments de l'actif net		3.094.843	0,29
		314.834.469	29,37	Total de l'actif net (EUR)		1.072.050.777	100,00
Total des billets de trésorerie		344.836.749	32,17				
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		965.128.337	90,03				

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock European Absolute Return Fund suite

« *Contracts for difference* » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Autriche				Irlande			
(177.364)	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	Bank of America Merrill Lynch	340.539	(388.523)	Glanbia Plc	Citibank	(439.031)
			340.539				(439.031)
Belgique				Italie			
(225.700)	Greenyard NV	JP Morgan	61.241	(192.508)	Fiat Chrysler Automobiles NV	JP Morgan	(59.293)
			61.241	(43.073)	Gima TT SpA '144A'	JP Morgan	37.391
				(135.028)	Tod's SpA	Citibank	162.034
							140.132
Danemark				Pays-Bas			
50.353	Genmab A/S	Bank of America Merrill Lynch	(1.885.982)	(30.357)	Boskalis Westminster	JP Morgan	45.232
(210.041)	H Lundbeck A/S	JP Morgan	(1.275.446)	(215.747)	Koninklijke Vopak NV	Citibank	(15.102)
(250.985)	Novozymes A/S 'B'	JP Morgan	(505.776)	(1.161.591)	SNS REAAL NV	Deutsche Bank	10
			(3.667.204)				30.140
Finlande				Norvège			
(140.223)	Huhtamaki OYJ	JP Morgan	(54.687)	(1.057.613)	Otello Corp ASA	Bank of America Merrill Lynch	(60.967)
			(54.687)				108.796
France				(423.684)	Telenor ASA	Citibank	
(444.201)	Air France-KLM	JP Morgan	191.895	(218.530)	Yara International ASA	Bank of America Merrill Lynch	(47.596)
(143.475)	BNP Paribas SA	Citibank	576.070				233
(358.534)	Carrefour SA	Citibank	356.741	Portugal			
(181.063)	Casino Guichard Perrachon SA	Bank of America Merrill Lynch	702.525	(729.505)	CTT-Correios de Portugal SA	Citibank	90.459
(21.562)	Eurofins Scientific SE	Citibank	185.433				90.459
(88.578)	Imerys SA	Citibank	223.843				
(59.012)	Ingenico Group SA	Bank of America Merrill Lynch	18.884	Espagne			
(209.189)	Korian SA	Bank of America Merrill Lynch	167.351	(1.400.844)	Banco Santander SA	Citibank	1.783
(92.065)	Sodexo SA	Bank of America		(1.850.941)	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	Bank of America Merrill Lynch	668.190
(313.620)	TechnipFMC Plc	JP Morgan	27.620	(628.509)	Gestamp Automocion SA '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(43.996)
(197.905)	Total SA	Bank of America	18.817	(475.681)	Mediaset Espana Comunicacion SA	JP Morgan	224.521
(1.676.274)	Vallourec SA	Merrill Lynch	395.810				850.498
113.214	Vinci SA	JP Morgan	(702.359)				
		JP Morgan	(79.250)				
			2.083.380	Suède			
Allemagne				471.223	AddTech AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	-
(570.052)	ADVA Optical Networking SE	Citibank	57.005	(545.509)	Arjo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	53.080
(122.156)	BASF SE	Citibank	618.109				(451.096)
(89.611)	Bayerische Motoren Werke AG	JP Morgan	569.926	(73.296)	Autoliv Inc SDR	JP Morgan	
(200.291)	Ceconomy AG	Citibank	86.125	(817.442)	Dometic Group AB '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(434.442)
(40.549)	Ceconomy AG	JP Morgan	33.737	(628.140)	Getinge AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	9.779
(104.245)	Covestro AG '144A'	JP Morgan	(125.094)				319.726
(111.778)	Daimler AG Reg	JP Morgan	557.772	315.949	Hexagon AB 'B'	Deutsche Bank	
(663.854)	Deutsche Bank AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1.333.019	(228.758)	Millicom International Cellular SA SDR	Bank of America Merrill Lynch	55.647
(166.297)	Deutsche EuroShop AG	JP Morgan	(23.281)	503.738	Thule Group AB '144A'	Deutsche Bank	519.563
(238.019)	Deutsche Lufthansa AG Reg	Citibank	445.096				72.257
(245.320)	Dialog Semiconductor Plc	JP Morgan	(55.197)	Suisse			
(292.494)	Evonik Industries AG	Citibank	479.690	(494.780)	ABB Ltd Reg	JP Morgan	624.674
(647.936)	Metro AG	Bank of America Merrill Lynch	(307.770)	(5.991)	Barry Callebaut AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	318.202
(146.230)	RIB Software SE	Bank of America Merrill Lynch	81.424				123.523
(5.620)	Sartorius AG (Pref)	JP Morgan	3.372	(14.046)	Dufry AG Reg	Deutsche Bank	664.055
(162.095)	SLM Solutions Group AG	Bank of America Merrill Lynch	166.839	(70.945)	Dufry AG Reg	JP Morgan	748.640
(126.297)	Software AG	Bank of America Merrill Lynch	213.442	(636.892)	GAM Holding AG	Citibank	368.209
(353.721)	Suedzucker AG	Bank of America Merrill Lynch	(413.853)	(153.776)	Landis+Gyr Group AG	Citibank	(206.953)
(2.583)	Suedzucker AG	JP Morgan	(2.906)	55.275	Medartis Holding AG	JP Morgan	
(19.960)	zooplus AG	JP Morgan	169.660	(29.908)	Panalpina Welttransport Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	148.435
			3.887.115	(17.340)	Sonova Holding AG Reg	Citibank	(210.619)
				(114.477)	Swiss Prime Site AG Reg	JP Morgan	199.353

BlackRock European Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Suisse suite				Royaume-Uni suite			
(51.642)	u-blox Holding AG	JP Morgan	40.469	206.551	London Stock Exchange		
(75.961)	VAT Group AG '144A'	Citibank	132.280		Group Plc	JP Morgan	308.702
			2.950.268	(1.290.101)	Meggitt Plc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(107.445)
				(263.511)	Ocado Group Plc	Citibank	7.817
				(882.678)	Pearson Plc	Citibank	126.886
				(285.181)	Persimmon Plc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(87.847)
(4.191.118)	Royaume-Uni AA Plc	Bank of America		(563.518)	Petrofac Ltd	Citibank	106.723
		Merrill Lynch	444.687	(1.054.688)	Royal Mail Plc	JP Morgan	1.034.817
(1.216.962)	Aggreko Plc	Citibank	539.247	(1.180.290)	RPC Group Plc	Citibank	306.867
664.932	Associated British Foods Plc	Bank of America		689.263	Sanne Group Plc	Citibank	(235.911)
		Merrill Lynch	(379.305)	97.638	Shire Plc	JP Morgan	89.672
906.666	Auto Trader Group Plc '144A'	JP Morgan	(209.983)	143.157	Spirax-Sarco Engineering Plc	Citibank	48.998
1.157.776	Beazley Plc	Citibank	(72.649)	(386.810)	Travis Perkins Plc	Citibank	2.207
(1.764.487)	BP Plc	Citibank	285.856	(4.860.298)	Vodafone Group Plc	JP Morgan	774.189
407.004	British American Tobacco Plc	Citibank	413.266	753.363	Weir Group Plc/The	JP Morgan	(318.015)
(3.678.067)	Carillion Plc**	JP Morgan	595.825				2.701.349
(1.306.072)	ConvaTec Group Plc '144A'	JP Morgan	(530.225)				
277.866	DCC Plc	Deutsche Bank	(31.701)				
540.635	Hargreaves Lansdown Plc	Bank of America					
		Merrill Lynch	27.756				
515.989	Hiscox Ltd	Citibank	(117.737)				
765.747	Hunting Plc	JP Morgan	314.506				
(606.325)	Inchcape Plc	JP Morgan	48.422				
(451.538)	Intu Properties Plc (Reit)	Citibank	(5.151)				
(207.012)	Johnson Matthey Plc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(108.641)				
(3.105.824)	Kingfisher Plc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(570.484)				

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock European Absolute Return Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
CHF	81.559.379	EUR	70.860.198	UBS	1/6/2018	154.382
EUR	60.659.632	CHF	72.405.763	Bank of America		
				Merrill Lynch	1/6/2018	(2.384.801)
EUR	7.665.652	CHF	9.153.616	Societe Generale	1/6/2018	(304.495)
EUR	70.887.543	CHF	81.559.379	UBS	6/7/2018	(154.657)
						(2.689.571)
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	3.526.520	EUR	2.967.772	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	103.131
EUR	43.380	CHF	51.606	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1.559)
						101.572
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
EUR	2.147	GBP	1.879	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	4
GBP	345.665	EUR	394.484	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(210)
						(206)
Total (exposition brute sous-jacente – 216.583.620 EUR)						(2.588.205)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	49,41
Biens de consommation non cyclique	15,69
Valeurs industrielles	13,83
Organismes de placement collectif	9,68
Biens de consommation cyclique	7,52
Communications	2,49
Technologie	1,09
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,71
Autres éléments de l'actif net	0,29
	100,00

BlackRock European Credit Strategies Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES							
Grèce				Hong Kong			
373.504	National Bank of Greece SA	100.099	0,12	USD 3.780.000	Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN (Perpetual)	2.427.941	2,93
		100.099	0,12			2.427.941	2,93
Italie				Irlande			
294.746	Telecom Italia SpA/Milano	203.788	0,25	EUR 200.000	Allied Irish Banks Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	218.674	0,26
		203.788	0,25	EUR 230.000	Avoca CLO XV DAC '15X FR' RegS FRN 15/4/2031	215.412	0,26
Luxembourg				EUR 220.000	Bank of Ireland RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	237.354	0,29
31.550	Aroundtown SA	224.478	0,27	GBP 200.000	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC RegS 5,50% 15/9/2024	226.770	0,27
		224.478	0,27			898.210	1,08
Total des actions ordinaires		528.365	0,64				
OBLIGATIONS				Italie			
Belgique				EUR 255.000	Enel SpA RegS FRN 24/11/2078	244.746	0,29
EUR 500.000	AG Insurance SA RegS FRN 30/6/2047	501.665	0,60	EUR 630.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	659.925	0,80
EUR 1.300.000	Nyrstar NV RegS 5,00% 11/7/2022	1.290.250	1,56	EUR 640.000	Sisal Group SpA RegS 7,00% 31/7/2023	648.000	0,78
		1.791.915	2,16	EUR 2.900.000	Telecom Italia SpA/Milano RegS 1,125% 26/3/2022	2.768.021	3,33
Danemark				EUR 425.000	UniCredit SpA RegS FRN 28/10/2025	454.070	0,55
EUR 200.000	Danske Bank A/S RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	219.589	0,27	EUR 200.000	UniCredit SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	204.086	0,25
EUR 1.140.000	TDC A/S 3,75% 2/3/2022	1.206.109	1,45	EUR 800.000	UniCredit SpA RegS FRN (Perpetual)	904.000	1,09
		1.425.698	1,72	USD 600.000	Wind Tre SpA '144A' 5,00% 20/1/2026	412.609	0,50
Finlande				EUR 400.000	Wind Tre SpA RegS 3,125% 20/1/2025	334.728	0,40
EUR 379.000	Stora Enso OYJ RegS 2,50% 21/3/2028	383.934	0,46			6.630.185	7,99
		383.934	0,46	Jersey			
France				EUR 350.000	Adient Global Holdings Ltd RegS 3,50% 15/8/2024	342.685	0,41
USD 940.000	Altice France SA/France '144A' 7,375% 1/5/2026	790.628	0,95	GBP 400.000	Enterprise Funding Ltd RegS 3,50% 10/9/2020	456.353	0,55
EUR 200.000	BNP Paribas Cardif SA RegS FRN (Perpetual)	210.130	0,25	USD 392.000	HBOS Capital Funding LP RegS 6,85% (Perpetual)	340.756	0,41
EUR 200.000	BNP Paribas SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	221.012	0,27	EUR 762.000	LHC3 Plc RegS (Pay-in-kind) 4,125% 15/8/2024	772.478	0,93
EUR 250.000	CMA CGM SA RegS 5,25% 15/1/2025	217.252	0,26	USD 2.000.000	Tullow Oil Jersey Ltd RegS 6,625% 12/7/2021	2.253.685	2,72
EUR 100.000	Credit Agricole SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	109.385	0,13			4.165.957	5,02
EUR 325.000	Orange SA RegS FRN (Perpetual)	369.476	0,45	Luxembourg			
EUR 800.000	Orano SA 4,875% 23/9/2024	864.088	1,04	USD 640.000	Altice Financing SA '144A' 7,50% 15/5/2026	532.604	0,64
EUR 350.000	RCI Banque SA RegS 1,625% 26/5/2026	351.701	0,42	EUR 370.000	Altice Finco SA RegS 4,75% 15/1/2028	319.587	0,38
EUR 500.000	Societe Generale SA RegS FRN 23/2/2028	484.880	0,59	USD 200.000	Altice Luxembourg SA '144A' 7,75% 15/5/2022	165.644	0,20
		3.618.552	4,36	EUR 1.200.000	Aroundtown SA RegS 1,50% 18/1/2021	1.570.698	1,89
Allemagne				GBP 250.000	Cabot Financial Luxembourg SA RegS 7,50% 1/10/2023	299.465	0,36
EUR 300.000	ADLER Real Estate AG RegS 2,125% 6/2/2024	294.477	0,35	USD 1.000.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA '144A' 7,625% 1/11/2021	818.273	0,99
EUR 200.000	ADLER Real Estate AG RegS 3,00% 27/4/2026	198.304	0,24	EUR 100.000	Matterhorn Telecom SA RegS 4,00% 15/11/2027	96.255	0,12
EUR 510.000	IHO Verwaltungs GmbH RegS (Pay-in-kind) 3,75% 15/9/2026	531.955	0,64			3.802.526	4,58
EUR 1.100.000	Senvion Holding GmbH RegS 3,875% 25/10/2022	958.661	1,16				
EUR 2.620.000	Unitymedia GmbH RegS 3,75% 15/1/2027	2.760.393	3,33				
		4.743.790	5,72				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas				Suisse			
EUR 300.000	ABN AMRO Bank NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	291.510	0,35	EUR 200.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	218.322	0,26
EUR 500.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV RegS 3,75% 15/1/2025	520.020	0,63	USD 200.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	155.165	0,19
EUR 200.000	Constellium NV RegS 4,25% 15/2/2026	199.488	0,24			373.487	0,45
EUR 200.000	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG RegS FRN 29/9/2047	204.046	0,25	Royaume-Uni			
EUR 841.000	Hertz Holdings Netherlands BV RegS 5,50% 30/3/2023	831.598	1,00	GBP 1.325.000	Ardonagh Midco 3 Plc RegS 8,375% 15/7/2023	1.571.517	1,89
EUR 200.000	NN Group NV RegS FRN (Perpetual)	211.683	0,25	GBP 1.200.000	Care UK Health & Social Care Plc RegS FRN 15/7/2019	1.366.732	1,65
EUR 100.000	Nyrstar Netherlands Holdings BV RegS 6,875% 15/3/2024	97.005	0,12	GBP 1.400.000	GKN Holdings Plc RegS 4,625% 12/5/2032	1.658.698	2,00
EUR 700.000	Petrobras Global Finance BV 4,75% 14/1/2025	736.837	0,89	EUR 200.000	HSBC Holdings Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	212.957	0,26
EUR 2.000.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	2.220.480	2,67	GBP 668.000	Jerrold Finco Plc RegS 6,125% 15/1/2024	770.120	0,93
EUR 1.400.000	United Group BV RegS 4,875% 1/7/2024	1.436.680	1,73	EUR 925.000	Lloyds Banking Group Plc RegS 1,50% 12/9/2027	891.811	1,07
EUR 1.360.000	UPC Holding BV RegS 3,875% 15/6/2029	1.296.298	1,56	GBP 400.000	Mclaren Finance Plc RegS 5,00% 1/8/2022	452.725	0,55
EUR 200.000	Ziggo Bond Finance BV RegS 4,625% 15/1/2025	201.125	0,24	USD 1.500.000	National Westminster Bank Plc FRN (Perpetual)	1.052.955	1,27
EUR 130.000	Ziggo BV RegS 4,25% 15/1/2027	130.585	0,16	USD 500.000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6,625% 15/5/2025	426.984	0,51
		8.377.355	10,09	GBP 200.000	Santander UK Group Holdings Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	242.285	0,29
Norvège				GBP 640.000	Shop Direct Funding Plc RegS 7,75% 15/11/2022	580.847	0,70
USD 375.000	Aker BP ASA '144A' 5,875% 31/3/2025	331.502	0,40	GBP 3.000	Tesco Plc 5,50% 13/1/2033	4.062	0,00
		331.502	0,40	GBP 100.000	Tesco Plc RegS 5,00% 24/3/2023	127.386	0,15
Portugal				GBP 1.192.000	Unique Pub Finance Co Plc/The RegS 6,464% 30/3/2032	1.332.734	1,61
EUR 13.800.000	Banco Espirito Santo SA RegS (Defaulted) 4,00% 21/1/2019	4.111.779	4,95	GBP 1.800.000	Vodafone Group Plc RegS 26/11/2020 (Zero Coupon)	1.974.013	2,38
		4.111.779	4,95			12.665.826	15,26
Espagne				Etats-Unis			
EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS FRN (Perpetual)	227.004	0,27	EUR 235.000	American Tower Corp 1,95% 22/5/2026	237.187	0,28
EUR 400.000	Banco Santander SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	372.668	0,45	EUR 256.000	Chemours Co/The 4,00% 15/5/2026	253.913	0,31
EUR 200.000	Banco Santander SA RegS FRN (Perpetual)	217.610	0,26	EUR 800.000	Federal-Mogul LLC Via Federal-Mogul Financing Corp RegS 5,00% 15/7/2024	834.800	1,01
EUR 200.000	Bankia SA RegS FRN 22/5/2024	205.438	0,25			1.325.900	1,60
EUR 400.000	Bankia SA RegS FRN 15/3/2027	411.740	0,50	Total des obligations		60.836.295	73,30
EUR 800.000	Bankia SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	816.128	0,98	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		61.364.660	73,94
EUR 200.000	CaixaBank SA RegS FRN 14/7/2028	199.870	0,24				
EUR 200.000	CaixaBank SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	185.032	0,22				
		2.635.490	3,17				
Suède							
EUR 1.130.000	Volvo Car AB RegS 2,00% 24/1/2025	1.126.248	1,36				
		1.126.248	1,36				

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
ACTIONS PRIVILÉGIÉES				Norvège			
	Luxembourg			USD 7.695.000	Norske Skogindustrier ASA (Defaulted) '144A' 7,125% 15/10/2033**		
13.907	Concrete Investment II SCA (Pref)*	—	0,00			150.499	0,18
13.907	Concrete Investment II SCA (Pref)**	229.466	0,28			150.499	0,18
		229.466	0,28				
Total des Actions privilégiées							
		229.466	0,28	Total des obligations		3.051.593	3,68
OBLIGATIONS				Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
						3.281.059	3,96
	Irlande			Organismes de placement collectif			
EUR 800.000	Avoca Capital CLO X Ltd '10X ER' RegS FRN 15/1/2030	821.752	0,99				
		821.752	0,99				
	Luxembourg						
EUR 7.100.000	Banco Espirito Santo SA RegS 4,75% 15/1/2019	2.079.342	2,51				
		2.079.342	2,51				
	Pays-Bas						
EUR 8.170.000	Jubilee CDO BV "VIII-X" RegS FRN 15/1/2024***	—	0,00				
		—	0,00				

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

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Belgique				Pays-Bas			
584	KBC Group NV	Credit Suisse	(2.780)	22.680	Altice NV	Credit Suisse	133.177
			(2.780)	18.084	Altice NV 'A'	Credit Suisse	(42.254)
							90.923
France				Espagne			
6.162	BNP Paribas SA	Credit Suisse	(53.055)	(26.585)	Banco Bilbao Vizcaya		
10.996	Credit Agricole SA	Credit Suisse	(18.363)		Argentaria SA	Credit Suisse	24.086
14.287	Europcar Groupe SA '144A'	Credit Suisse	(11.430)	39.708	CaixaBank SA	Credit Suisse	(21.720)
			(82.848)				2.366
Allemagne				Royaume-Uni			
35.612	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG	Credit Suisse	(1.068)	187.129	GVC Holdings Plc**	Credit Suisse	2
			(1.068)	(3.023)	Metro Bank Plc	Credit Suisse	276
Grèce				(511.932)	Tullow Oil Plc	Credit Suisse	(4.233)
116.885	Eurobank Ergasias SA	Credit Suisse	(9.585)	50.453	Vodafone Group Plc	Credit Suisse	(8.755)
13.850	Hellenic Telecommunications Organization SA	Credit Suisse	(13.711)				(12.710)
			(23.296)	Total (exposition brute sous-jacente – 3.460.895 EUR)			38.594
Italie							
(632)	Banca IFIS SpA	Credit Suisse	3.010				
(74.967)	Unione di Banche Italiane SpA	Credit Suisse	64.997				
			68.007				

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

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 1.800.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2022	(31.386)	20.123
CDS	EUR 220.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/12/2022	18.399	6.073
CDS	EUR 400.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Deutsche Bank AG	Barclays Bank	20/12/2022	(8.281)	(7.999)
CDS	EUR 4.000.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 28 Version 1	Barclays Bank	20/12/2022	(23.510)	72.195
CDS	EUR 780.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 28 Version 1	Barclays Bank	20/12/2022	(3.942)	14.078
CDS	EUR 820.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 28 Version 1	Barclays Bank	20/12/2022	(13.882)	79.647
CDS	EUR 2.025.000	Fund receives default protection on Ardagh Packaging Finance Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	39.297	(243.178)
CDS	EUR 1.960.000	Fund receives default protection on ITV Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	(5.802)	(365.953)
CDS	EUR 1.700.000	Fund receives default protection on Kingfisher Plc and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	993	(31.236)
CDS	EUR 3.110.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	45.350	(276.042)
CDS	EUR 840.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	12.285	(74.558)
CDS	EUR 1.720.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	29.767	(152.666)
CDS	EUR 3.520.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	15.431	(55.373)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Smurfit Kappa Group Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	941	(20.704)
CDS	EUR 137.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	2.209	5.637
CDS	EUR 257.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	3.063	10.575
CDS	EUR 402.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1	Barclays Bank	20/6/2023	308	6.324
CDS	EUR 180.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on SFR Group SA	Barclays Bank	20/6/2023	11.199	13.937
CDS	EUR 1.080.000	Fund receives default protection on Cellnex Telecom SA and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/12/2022	30.083	(176.299)
CDS	EUR 1.100.000	Fund receives default protection on Unitymedia GmbH and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/12/2022	(7.970)	(212.449)
CDS	EUR 1.160.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1	BNP Paribas	20/12/2022	(10.394)	12.968
CDS	EUR 580.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 28 Version 1	BNP Paribas	20/12/2022	(3.065)	10.468
CDS	EUR 890.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2023	8.386	(78.996)
CDS	EUR 1.780.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2023	14.539	(157.992)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Ziggo Finance BV and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2023	764	(14.180)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Ziggo Finance BV and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2023	764	(14.180)
CDS	EUR 210.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA	BNP Paribas	20/6/2023	(4.219)	(22.456)
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA	BNP Paribas	20/6/2023	(4.018)	(21.387)
CDS	EUR 170.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Financing SA	BNP Paribas	20/6/2023	(801)	4.158
CDS	EUR 206.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc	BNP Paribas	20/6/2023	(4.954)	24.369
CDS	EUR 1.660.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	BNP Paribas	20/6/2023	(29.096)	147.341
CDS	EUR 3.109.787	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Grohe Holding GmbH	Citibank	20/12/2018	(439.993)	87.591
CDS	EUR 360.000	Fund receives default protection on Constellium NV and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/12/2021	(1.025)	(41.910)
CDS	EUR 3.560.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1	Citibank	20/12/2022	(39.603)	39.799
CDS	EUR 4.200.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1	Citibank	20/12/2022	(59.854)	46.954
CDS	EUR 5.370.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 28 Version 1	Citibank	20/12/2022	(23.269)	96.921
CDS	EUR 220.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Financing SA	Citibank	20/12/2022	(3.272)	8.259

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 60.000	Fund receives default protection on Altice Financing SA and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	606	(1.468)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	4.498	4.712
CDS	EUR 3.866.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	30.743	(343.144)
CDS	EUR 900.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	10.499	(79.883)
CDS	EUR 850.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	11.837	(75.446)
CDS	EUR 420.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1	Citibank	20/6/2023	(1.974)	6.607
CDS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ladbroke's Coral Group Plc	Citibank	20/6/2023	1.784	16.393
CDS	EUR 890.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	Citibank	20/6/2023	(6.323)	78.996
CDS	EUR 900.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	Citibank	20/6/2023	(10.031)	79.884
CDS	USD 1.310.000	Fund receives default protection on People's Republic of China and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	(5.613)	(23.463)
CDS	USD 1.300.000	Fund receives default protection on Republic of Korea and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	(5.865)	(29.925)
CDS	EUR 360.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Constellium NV	Citibank	20/12/2024	1.803	38.915
CDS	EUR 6.170.213	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Grohe Holding GmbH	Credit Suisse	20/12/2018	(875.350)	173.792
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2022	7.905	2.761
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum Justitia AB	Credit Suisse	20/12/2022	(16.627)	15.895
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Wind Acquisition Finance SA	Credit Suisse	20/12/2022	(2.766)	30.336
CDS	EUR 390.000	Fund receives default protection on Care UK Health and Social Care Plc and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	(9.733)	(73.218)
CDS	EUR 710.000	Fund receives default protection on Carrefour SA and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	4.802	(5.048)
CDS	EUR 1.700.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	22.535	(150.891)
CDS	EUR 1.836.000	Fund receives default protection on Marks & Spencer Plc and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	3.925	47.547
CDS	EUR 280.000	Fund receives default protection on Stena AB and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	(290)	10.560
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Wind Tre SpA and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	1.280	5.783
CDS	EUR 190.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG	Credit Suisse	20/6/2023	(3.554)	29.999
CDS	USD 1.600.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.30 and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	6.025	(86.677)
CDS	USD 800.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.30 and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	2.798	(43.338)
CDS	EUR 1.040.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 28 Version 1	Deutsche Bank	20/12/2022	(14.470)	101.016
CDS	EUR 230.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	4.384	(20.415)
CDS	EUR 890.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	10.616	(78.996)
CDS	EUR 850.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	12.975	(75.446)
CDS	EUR 1.030.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	17.235	(91.422)
CDS	EUR 1.600.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	(697)	(25.170)
CDS	EUR 800.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	Deutsche Bank	20/6/2023	(1.291)	71.008
CDS	USD 250.000	Fund receives default protection on Republic of South Africa and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	(116)	7.006
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Constellium NV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(402)	(9.962)
CDS	EUR 415.000	Fund receives default protection on Stena AB and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2021	3.398	(14.706)
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Constellium NV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2021	1.478	(34.925)
CDS	EUR 570.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2022	9.728	17.753

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 600.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Commerzbank AG	Goldman Sachs	20/12/2022	(4.972)	(23.887)
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Wind Acquisition Finance SA	Goldman Sachs	20/12/2022	(2.311)	30.336
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Altice Financing SA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	1.850	(3.669)
CDS	EUR 790.000	Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo SpA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	56.344	94.024
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Societe Generale SA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	8.011	8.780
CDS	EUR 390.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	(1.965)	16.047
CDS	EUR 210.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA	Goldman Sachs	20/6/2023	(4.029)	(22.456)
CDS	EUR 340.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Deutsche Bank AG	Goldman Sachs	20/6/2023	(6.570)	(8.624)
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice NV	Goldman Sachs	20/6/2023	188	11.614
CDS	EUR 120.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc	Goldman Sachs	20/6/2023	(3.207)	14.195
CDS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	Goldman Sachs	20/6/2023	(4.525)	26.628
CDS	EUR 70.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV	Goldman Sachs	20/6/2023	(403)	7.863
CDS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Constellium NV	Goldman Sachs	20/12/2024	(7.526)	32.429
CDS	EUR 190.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Constellium NV	Goldman Sachs	20/12/2024	1.946	20.539
CDS	EUR 590.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 28 Version 1	HSBC	20/12/2022	(3.204)	10.649
CDS	EUR 230.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	HSBC	20/6/2023	3.979	(20.415)
CDS	EUR 841.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	HSBC	20/6/2023	7.115	(74.647)
CDS	EUR 3.520.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	14.375	(55.373)
CDS	EUR 1.065.000	Fund receives default protection on Sol Melia Europe BV and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2022	17.973	(197.031)
CDS	EUR 2.387.108	Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2022	(39.518)	(52.932)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Stena AB and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/12/2022	604	2.667
CDS	EUR 1.150.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1	JP Morgan	20/12/2022	(13.701)	12.856
CDS	EUR 450.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1	JP Morgan	20/12/2022	(7.650)	5.031
CDS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Financing SA	JP Morgan	20/12/2022	365	3.754
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Financing SA	JP Morgan	20/12/2022	(147)	7.508
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Vue International Bidco Plc	JP Morgan	20/12/2022	1.521	17.965
CDS	EUR 450.000	Fund receives default protection on Deutsche Lufthansa AG and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	1.031	(5.241)
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	995	9.538
CDS	EUR 550.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2023	(3.867)	(48.818)
CDS	EUR 460.000	Fund receives default protection on Suedzucker AG and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	4.605	(816)
CDS	EUR 330.000	Fund receives default protection on UPC Holding BV and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2023	1.735	(54.286)
CDS	EUR 220.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA	JP Morgan	20/6/2023	(4.605)	(23.526)
CDS	EUR 1.600.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1	JP Morgan	20/6/2023	1.716	25.170
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on HEMA Bondco I BV	JP Morgan	20/6/2023	(3.984)	3.040
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2022	15.973	5.521
CDS	EUR 230.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2022	18.717	6.349
CDS	EUR 180.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum Justitia AB	Morgan Stanley	20/12/2022	(15.249)	14.305

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 340.000	Fund receives default protection on Enel SpA and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	(2.033)	(1.200)
CDS	EUR 840.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	Morgan Stanley	20/6/2023	(11.735)	74.558
CDS	EUR 890.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	Morgan Stanley	20/6/2023	(6.638)	78.996
CDS	EUR 1.030.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	Morgan Stanley	20/6/2023	(14.912)	91.422
TRS	EUR 2.000.000	Fund receives iBoxx Euro Liquid High Yield Index and pays 3 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	7.450	7.450
TRS	EUR 900.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Ardagh Packaging Finance Plc Via Ardagh Holdings USA Inc	Credit Suisse	14/3/2019	(21.045)	(21.045)
TRS	EUR 700.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Mobilux Finance SAS	Credit Suisse	13/4/2019	28.396	28.396
TRS	USD 600.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ARD Finance SA	Credit Suisse	12/7/2019	36.332	36.332
TRS	EUR 580.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Cooperativa Muratori & Cementisti-CMC di Ravenna SC	Credit Suisse	9/11/2019	91.017	91.016
TRS	EUR 870.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Luxembourg SA	Credit Suisse	13/12/2019	18.358	18.358
TRS	USD 1.300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays McLaren Finance Plc	Credit Suisse	14/12/2019	22.919	22.919
TRS	EUR 550.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Luxembourg SA	Credit Suisse	2/1/2020	15.772	15.772
TRS	USD 3.300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Bank of Communications Co Ltd	Credit Suisse	2/1/2020	(21.551)	(21.551)
TRS	USD 3.800.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Industrial & Commercial Bank of China Ltd	Credit Suisse	4/2/2020	(6.803)	(6.803)
TRS	EUR 1.600.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Monitchem Holdco 3 SA	Credit Suisse	8/2/2020	(101.067)	(101.067)
TRS	GBP 300.000	Fund receives Wagamama Finance Plc and pays 3 Month LIBOR	Credit Suisse	27/2/2020	2.895	2.895
TRS	GBP 440.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Wagamama Finance Plc	Credit Suisse	9/3/2020	1.171	1.171
TRS	EUR 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Luxembourg SA	Credit Suisse	20/3/2020	(6.873)	(6.873)
TRS	EUR 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Hema Bondco I BV	Credit Suisse	13/4/2020	3.108	3.108
TRS	EUR 100.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Raffinerie Heide GmbH	Credit Suisse	20/4/2020	3.278	3.278
TRS	EUR 100.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Lecta SA	Credit Suisse	27/4/2020	3.725	3.725
TRS	EUR 100.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Luxembourg SA	Credit Suisse	2/5/2020	(591)	(591)
TRS	EUR 300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays LKQ European Holdings BV	Credit Suisse	18/5/2020	3.164	3.164
TRS	EUR 100.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Pro-Gest SpA	Credit Suisse	18/5/2020	1.589	1.589
TRS	EUR 300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Codere Finance 2 Luxembourg SA	Credit Suisse	24/5/2020	3.933	3.933
TRS	EUR 1.800.000	Fund receives 3 Month EURIBOR and pays iBoxx Euro Liquid High Yield Index	JP Morgan	20/6/2018	7.879	7.879
TRS	EUR 4.320.000	Fund receives iBoxx Euro Liquid High Yield Index and pays 3 Month EURIBOR	JP Morgan	20/6/2018	10.436	10.436
TRS	USD 1.400.000	Fund receives Fixed 0,250% and pays ARD Finance SA	JP Morgan	17/8/2018	86.277	86.277
TRS	USD 600.000	Fund receives Fixed 0,100% and pays Deutsche Bank AG	JP Morgan	3/12/2018	56.036	56.036
TRS	EUR 200.000	Fund receives Wind Tre SpA and pays Fixed 2,200%	JP Morgan	20/2/2019	23.860	23.860
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,500% and pays Vallourec SA	JP Morgan	26/3/2019	3.425	3.425
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,500% and pays Vallourec SA	JP Morgan	26/3/2019	3.475	3.475
TRS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,550% and pays Altice France SA	JP Morgan	27/3/2019	(3.639)	(3.639)
TRS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,650% and pays Altice France SA	JP Morgan	27/3/2019	(3.639)	(3.639)
TRS	EUR 120.000	Fund receives Fixed 2,150% and pays Vallourec SA	JP Morgan	27/3/2019	3.532	3.532
TRS	USD 200.000	Fund receives Fixed 0,500% and pays Deutsche Bank AG	JP Morgan	28/3/2019	19.143	19.143
TRS	EUR 100.000	Fund receives Tereos Finance Groupe I SA and pays Fixed 1,400%	JP Morgan	8/4/2019	3.987	3.987
TRS	USD 500.000	Fund receives Fixed 0,350% and pays Hertz Corp/The	JP Morgan	15/4/2019	12.791	12.791
TRS	USD 500.000	Fund receives Fixed 3,600% and pays Hertz Corp/The	JP Morgan	15/4/2019	26.194	26.194
TRS	USD 600.000	Fund receives Fixed 0,700% and pays Deutsche Bank AG	JP Morgan	26/4/2019	50.452	50.452
TRS	EUR 400.000	Fund receives Fixed 1,600% and pays Carlsberg Breweries A/S	JP Morgan	3/5/2019	8.989	8.989
TRS	EUR 600.000	Fund receives Fixed 0,600% and pays Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	JP Morgan	12/6/2019	35.122	35.122
TRS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 1,350% and pays Gestamp Automocion SA	JP Morgan	16/6/2019	2.046	2.046
TRS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,350% and pays Gestamp Automocion SA	JP Morgan	17/6/2019	2.959	2.959
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,350% and pays Vodafone Group Plc	JP Morgan	19/6/2019	(1.750)	(1.750)
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,350% and pays Vodafone Group Plc	JP Morgan	19/6/2019	(1.783)	(1.783)
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 2,000% and pays ProGroup AG	JP Morgan	20/6/2019	433	433
TRS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 2,250% and pays Gamenet Group SpA	JP Morgan	20/6/2019	2.908	2.908
TRS	EUR 200.000	Fund receives ProGroup AG and pays Fixed 2,000%	JP Morgan	20/6/2019	866	866
TRS	GBP 600.000	Fund receives Arrow Global Finance Plc and pays Fixed 1,800%	JP Morgan	25/6/2019	5.016	5.016
TRS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 0,680% and pays French Republic Government Bond OAT	JP Morgan	26/6/2019	15	15
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 2,100% and pays Naviera Armas SA	JP Morgan	26/6/2019	(602)	(602)
TRS	EUR 1.250.000	Fund receives Spain Government Bond and pays Fixed 0,750%	JP Morgan	26/6/2019	2.704	2.704
Total (exposition brute sous-jacente – 141.621.187 EUR)					(830.205)	(1.303.550)

CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance

TRS (total return swaps) : swaps sur rendement total

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
(48)	EUR	Euro BOBL	Juin 2018	5.223.504	(84.860)
(3)	EUR	Euro BTP	Juin 2018	345.894	24.990
(51)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	5.123.000	(170.230)
22	EUR	EURO STOXX 50 Index	Juin 2018	751.080	780
35	EUR	EURO STOXX Banks Index	Juin 2018	193.900	(27.300)
13	EUR	Euro-Bund Call Option (Goldman Sachs) strike price EUR 160,5	Juillet 2018	10.790	(1.950)
(27)	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	3.910.442	(47.438)
Total				15.558.610	(306.008)

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
8	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.500,00	15/6/2018	3.408	5.976
45	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.475,00	15/6/2018	(10.072)	33.750
6	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.640,00	15/6/2018	(21.588)	4.274
3	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.720,00	15/6/2018	(1.060)	6.957
51	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.750,00	17/8/2018	(4.162)	1.020
2	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.725,00	17/8/2018	(203)	9.698
7	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.850,00	17/8/2018	(733)	4.686
22	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.350,00	17/8/2018	(2.684)	15.181
Total (exposition brute sous-jacente – 2.658.240 EUR)						(37.094)	81.542

Options vendues au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values latentes EUR	Valeur de marché EUR
(6)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.550,00	15/6/2018	12.310	(1.545)
(2)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.800,00	17/8/2018	1.173	(3.407)
(22)	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.250,00	17/8/2018	2.024	(10.076)
Total (exposition brute sous-jacente – 417.793 EUR)						15.507	(15.028)

Swaptions achetées au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values latentes EUR	Valeur de marché EUR
7.560.000	Put	Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 from 20/6/2018; and provides 1% Fixed quarterly from 20/6/2018	Morgan Stanley & Co. International Plc	EUR 60,00	20/6/2018	25.585	37.681
Total (exposition brute sous-jacente – 6.625.148 EUR)						25.585	37.681

Swaptions vendues au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	(Moins-value) non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
(3.800.000)	Put	Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2018; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 from 20/6/2018	Citibank	EUR 70,00	20/6/2018	(4.501)	(8.092)
Total (exposition brute sous-jacente – 2.074.074 EUR)						(4.501)	(8.092)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Credit Strategies Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	63.940	AUD	100.000	HSBC	21/6/2018	(999)
EUR	11.401	GBP	10.000	Barclays Bank	21/6/2018	(3)
EUR	14.460.106	GBP	12.680.000	BNP Paribas	21/6/2018	308
EUR	22.818	GBP	20.000	HSBC	21/6/2018	11
EUR	17.055	USD	20.000	Barclays Bank	21/6/2018	(89)
EUR	14.904.371	USD	17.530.000	BNP Paribas	21/6/2018	(121.844)
EUR	324.122	USD	380.000	State Street Bank & Trust Company	21/6/2018	(1.602)
						(124.218)

Catégorie d'Actions couverte en francs suisses

CHF	3.331.429	EUR	2.801.495	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	99.522
EUR	171.307	CHF	198.579	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1.617)
						97.905

Catégorie d'Actions couverte en livres sterling

EUR	23.294.559	GBP	20.357.791	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	73.938
GBP	41.115.149	EUR	46.928.673	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(31.674)
						42.264

Catégorie d'Actions couverte en dollars US

EUR	1.920.775	USD	2.253.610	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(12.226)
USD	22.288.584	EUR	18.731.321	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	386.380
						374.154
Total (exposition brute sous-jacente – 124.170.292 EUR)						390.105

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	31,05
Communications	21,01
Biens de consommation cyclique	11,02
Organismes de placement collectif	9,36
Énergie	4,52
Biens de consommation non cyclique	2,8
Matériaux de base	2,62
Valeurs industrielles	2,46
Titres adossés à des actifs	2,13
Services aux collectivités	0,29
Portefeuille de titres à la valeur de marché	87,26
Autres éléments de l'actif net	12,74
	100,00

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS				France suite			
EUR 23.000.000	Pays-Bas Cooperatieve Rabobank UA FRN 19/3/2019			EUR 7.000.000	Matchpoint Finance Plc 15/8/2018 (Zero Coupon)	7.004.674	2,76
		23.089.240	9,09	EUR 11.000.000	UBS AG 29/8/2018 (Zero Coupon)	11.010.489	4,33
		23.089.240	9,09			25.016.890	9,85
Total des obligations		23.089.240	9,09	Luxembourg			
CERTIFICATS DE DÉPÔT				EUR 2.000.000	Albion Capital Corp SA Regs 27/6/2018 (Zero Coupon)	2.000.578	0,79
EUR 10.000.000	Belgique Sumitomo Mitsui Banking Corp 18/6/2018 (Zero Coupon)			EUR 3.000.000	Antalis SA 29/6/2018 (Zero Coupon)	3.000.864	1,18
		10.002.320	3,94	EUR 1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1/8/2018 (Zero Coupon)	1.000.594	0,39
		10.002.320	3,94	EUR 8.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 21/9/2018 (Zero Coupon)	8.008.727	3,15
EUR 5.000.000	Canada Toronto Dominion Bank/The 13/9/2018 (Zero Coupon)			EUR 6.000.000	Colgate-Palmolive Co 28/6/2018 (Zero Coupon)	6.002.026	2,36
		5.004.400	1,97	EUR 8.000.000	Collateralized Commercial Paper II 6/9/2018 (Zero Coupon)	8.007.991	3,15
		5.004.400	1,97	EUR 5.500.000	Honeywell International Inc 7/6/2018 (Zero Coupon)	5.500.303	2,17
EUR 10.000.000	France Banque Federative du Credit Mutuel SA 13/8/2018 (Zero Coupon)			EUR 4.500.000	Honeywell International Inc 10/9/2018 (Zero Coupon)	4.504.235	1,77
		10.006.350	3,94	EUR 5.000.000	LMA SA 6/6/2018 (Zero Coupon)	5.000.264	1,97
		4.005.272	1,57	EUR 3.000.000	Matchpoint Finance Plc 30/11/2018 (Zero Coupon)	3.004.557	1,18
		14.011.622	5,51	EUR 1.000.000	OP Corporate Bank Plc 13/8/2018 (Zero Coupon)	1.000.832	0,40
EUR 6.000.000	Japon Mizuho Bank Ltd 26/7/2018 (Zero Coupon)			EUR 10.000.000	OP Corporate Bank Plc 10/9/2018 (Zero Coupon)	10.011.527	3,94
		6.003.858	2,36	EUR 13.000.000	Procter & Gamble Co/The Regs 17/8/2018 (Zero Coupon)	13.010.855	5,12
		6.000.438	2,36	EUR 4.000.000	Svenska Handelsbanken AB Regs 7/8/2018 (Zero Coupon)	4.002.871	1,58
EUR 6.000.000	Norinchukin Bank 5/6/2018 (Zero Coupon)	12.004.296	4,72	EUR 6.500.000	Svenska Handelsbanken AB Regs 28/9/2018 (Zero Coupon)	6.508.288	2,56
EUR 15.000.000	Suisse Zuercher Kantonalbank Regs 13/8/2018 (Zero Coupon)					80.564.512	31,71
		15.013.500	5,91	Total des billets de trésorerie		109.583.272	43,13
		15.013.500	5,91	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		199.710.830	78,60
EUR 5.000.000	Royaume-Uni Mizuho Bank Ltd 5/7/2018 (Zero Coupon)			Organismes de placement collectif			
		5.002.180	1,97	20.814.010	Irlande Institutional Cash Series Plc - Institutional Euro Assets Liquidity Fund Agency Dis¹	20.814.010	8,19
		6.000.000	2,36			20.814.010	8,19
EUR 6.000.000	Toronto Dominion Bank/The 4/6/2018 (Zero Coupon)	11.002.180	4,33	Total des organismes de placement collectif			
Total des certificats de dépôt		67.038.318	26,38	Portefeuille de titres à la valeur de marché			
BILLET DE TRÉSORERIE				Autres éléments de l'actif net			
EUR 4.000.000	Danemark DekaBank 12/7/2018 (Zero Coupon)			Total de l'actif net (EUR)			
		4.001.870	1,57	254.103.460			
		4.001.870	1,57	100,00			
EUR 7.000.000	France Antalis SA Regs 25/6/2018 (Zero Coupon)						
		7.001.727	2,76				

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes				Plus-values/ (moins-values) latentes			
Nombre	Description	Contrepartie	EUR	Nombre	Description	Contrepartie	EUR
Autriche				Autriche suite			
(346)	Agrana Beteiligungs AG	Barclays Bank	784	(1.699)	Wienerberger AG	Barclays Bank	578
(50)	Agrana Beteiligungs AG	HSBC	135	(44.111)	Zumtobel Group AG	Goldman Sachs	20.291
(1.020)	Agrana Beteiligungs AG	Goldman Sachs	3.557				20.963
(137.177)	Andritz AG	Goldman Sachs	123.639				
(13.533)	Andritz AG	Barclays Bank	4.663				
(3.115)	Andritz AG	HSBC	(316)				
8.019	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	Goldman Sachs	(15.396)	(2.318)	Aedifica SA (Reit)	Goldman Sachs	(5.100)
43.983	Atrium European Real Estate Ltd	Barclays Bank	440	(3.873)	Ageas	Goldman Sachs	6.699
79.980	Atrium European Real Estate Ltd	Goldman Sachs	2.399	(4.341)	Ageas	Barclays Bank	8.563
33.015	Atrium European Real Estate Ltd	Morgan Stanley	2.311	(8.746)	Ageas	HSBC	16.880
67.410	Atrium European Real Estate Ltd	HSBC	5.393	(14.447)	AGFA-Gevaert NV	HSBC	530
18.909	Atrium European Real Estate Ltd	JP Morgan	1.513	(18.676)	AGFA-Gevaert NV	Goldman Sachs	(287)
(2.284)	BAWAG Group AG '144A'	HSBC	(913)	(33.844)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	Goldman Sachs	(35.845)
(509)	Erste Group Bank AG	Barclays Bank	1.099	(16.610)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	Barclays Bank	2.911
(3.615)	Erste Group Bank AG	Goldman Sachs	8.314	(6.927)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	HSBC	(630)
(5.171)	Erste Group Bank AG	HSBC	11.982	666	Barco NV	JP Morgan	(1.865)
4.488	FACC AG	HSBC	(20.151)	2.138	Barco NV	Goldman Sachs	(3.421)
17.404	FACC AG	Goldman Sachs	(76.404)	707	Barco NV	HSBC	(1.980)
4.400	FACC AG	Barclays Bank	(8.448)	(4.126)	Befimmo SA (Reit)	Goldman Sachs	-
(73.473)	Immofinanz AG	Goldman Sachs	4.045	2.784	Bekaert SA	Citibank	(2.942)
(18.222)	Immofinanz AG	Barclays Bank	729	2.088	Bekaert SA	HSBC	(4.427)
(12.222)	Immofinanz AG	HSBC	481	4.711	Bekaert SA	JP Morgan	(7.822)
(5.786)	Lenzing AG	HSBC	(5.959)	7.749	Bekaert SA	Barclays Bank	(8.692)
(1.406)	Lenzing AG	Barclays Bank	2.446	51.391	Bekaert SA	Goldman Sachs	(53.255)
(208)	Lenzing AG	Goldman Sachs	-	(8.161)	Biocartis NV '144A'	HSBC	2.541
1.375	Oesterreichische Post AG	JP Morgan	431	(446)	Biocartis NV '144A'	JP Morgan	134
30.287	Oesterreichische Post AG	Goldman Sachs	18.785	(103.728)	bpost SA	Goldman Sachs	70.535
12.719	Oesterreichische Post AG	HSBC	15.263	(34.388)	bpost SA	Barclays Bank	23.384
16.908	Oesterreichische Post AG	Morgan Stanley	5.072	(1.314)	bpost SA	HSBC	2.054
2.665	OMV AG	Goldman Sachs	(2.944)	(1.420)	Cofinimmo SA (Reit)	Barclays Bank	(426)
212	OMV AG	Morgan Stanley	(822)	(6.050)	Cofinimmo SA (Reit)	Goldman Sachs	(4.235)
1.667	OMV AG	Citibank	(3.620)	(12.554)	Colruyt SA	Goldman Sachs	7.620
7.156	OMV AG	JP Morgan	(31.907)	(2.780)	Colruyt SA	Barclays Bank	(3.462)
2.470	OMV AG	Barclays Bank	(7.722)	(14.103)	Colruyt SA	HSBC	(3)
7.578	OMV AG	HSBC	(19.135)	2.181	D'ieteren SA/NV	HSBC	2.162
(7.291)	Palfinger AG	HSBC	10.179	2.442	D'ieteren SA/NV	JP Morgan	2.637
(9.070)	Palfinger AG	Barclays Bank	10.263	3.427	D'ieteren SA/NV	Barclays Bank	754
(21.351)	Palfinger AG	Goldman Sachs	23.310	24.081	D'ieteren SA/NV	Goldman Sachs	9.632
3.932	POLYTEC Holding AG	HSBC	(6.606)	(102.604)	Econocom Group SA/NV	Goldman Sachs	4.957
956	Raiffeisen Bank International AG	HSBC	255	(15.846)	Econocom Group SA/NV	HSBC	417
26.940	Raiffeisen Bank International AG	JP Morgan	(28.426)	(11.866)	Econocom Group SA/NV	Barclays Bank	814
1.295	Raiffeisen Bank International AG	Barclays Bank	(1.516)	2.150	Elia System Operator SA/NV	JP Morgan	364
10.407	Raiffeisen Bank International AG	Goldman Sachs	(14.311)	2.079	Elia System Operator SA/NV	Goldman Sachs	2.381
3.836	Raiffeisen Bank International AG	Citibank	(5.606)	2.777	Elia System Operator SA/NV	Barclays Bank	1.602
1.371	S IMMO AG	JP Morgan	454	2.332	Elia System Operator SA/NV	HSBC	1.072
8.214	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	Goldman Sachs	21.356	1.587	Elia System Operator SA/NV	Morgan Stanley	794
83	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	Barclays Bank	(58)	(4.074)	Euronav NV	Barclays Bank	(2.343)
1.285	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	HSBC	7.921	(12.572)	Fagron	HSBC	1.886
16.846	UNIQA Insurance Group AG	JP Morgan	842	(1.088)	KBC Group NV	HSBC	4.866
5.253	UNIQA Insurance Group AG	HSBC	263	(652)	Kinepolis Group NV	Goldman Sachs	196
12.775	UNIQA Insurance Group AG	Barclays Bank	(4.471)	920	Melexis NV	HSBC	(232)
84.339	UNIQA Insurance Group AG	Goldman Sachs	(1.687)	977	Melexis NV	Barclays Bank	184
67.453	UNIQA Insurance Group AG	Morgan Stanley	(23.608)	233	Melexis NV	JP Morgan	6
21.687	voestalpine AG	HSBC	25.374	706	Melexis NV	Goldman Sachs	424
17.695	voestalpine AG	Goldman Sachs	(2.654)	(12.043)	Mithra Pharmaceuticals	Morgan Stanley	(17.952)
(84.387)	Wienerberger AG	Goldman Sachs	(11.814)	(4.040)	Mithra Pharmaceuticals	JP Morgan	(26.866)
(20.772)	Wienerberger AG	HSBC	(19.110)	(384)	Nyrstar NV	Morgan Stanley	136
				(4.282)	Nyrstar NV	HSBC	644
				(68.776)	Nyrstar NV	JP Morgan	22.283
				(225.972)	Ontex Group NV	Goldman Sachs	(276.924)
				(69.557)	Ontex Group NV	Barclays Bank	74.591
				(58.552)	Ontex Group NV	HSBC	(123.658)
				2.427	Orange Belgium SA	Morgan Stanley	41
				1.030	Orange Belgium SA	HSBC	366
				4.198	Orange Belgium SA	Barclays Bank	531
				67.973	Orange Belgium SA	Goldman Sachs	43.444
				1.612	Orange Belgium SA	JP Morgan	54
				3.635	Proximus SADP	Barclays Bank	(263)
				2.004	Proximus SADP	Citibank	174
				45.011	Proximus SADP	Goldman Sachs	(22.360)
				671	Proximus SADP	Morgan Stanley	(410)

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes				Plus-values/ (moins-values) latentes			
Nombre	Description	Contrepartie	EUR	Nombre	Description	Contrepartie	EUR
Belgique suite				Danemark suite			
11.215	Proximus SADP	HSBC	(4.272)	(67)	H Lundbeck A/S	Barclays Bank	(226)
6.541	Proximus SADP	JP Morgan	(743)	30.096	H Lundbeck A/S	Citibank	101.485
10.125	Recticel SA	Goldman Sachs	(3.645)	2.732	H Lundbeck A/S	JP Morgan	14.418
5.973	Recticel SA	Morgan Stanley	(597)	(6.081)	H Lundbeck A/S	Citibank	(20.164)
3.198	Recticel SA	Barclays Bank	(271)	(4.508)	H Lundbeck A/S	JP Morgan	(18.674)
4.344	Recticel SA	HSBC	(348)	48.464	H Lundbeck A/S	Goldman Sachs	259.784
1.073	Recticel SA	JP Morgan	(86)	(16.295)	H Lundbeck A/S	HSBC	(82.647)
(2.307)	Solvay SA	HSBC	(1.502)	(4.242)	ISS A/S	Citibank	(412)
4.342	Telenet Group Holding NV	HSBC	(22.665)	7.240	ISS A/S	Goldman Sachs	5.739
338	UCB SA	Citibank	237	1.159	ISS A/S	JP Morgan	836
2.796	UCB SA	JP Morgan	10.081	6.461	Jyske Bank A/S Reg	Barclays Bank	(6.444)
14.929	UCB SA	Barclays Bank	10.450	13.976	Jyske Bank A/S Reg	JP Morgan	(28.662)
46.453	UCB SA	Goldman Sachs	141.217	999	Jyske Bank A/S Reg	Citibank	(1.854)
16.230	UCB SA	HSBC	65.620	4.477	Jyske Bank A/S Reg	HSBC	(3.696)
(10.147)	UCB SA	Goldman Sachs	(30.847)	(3.367)	Nilfisk Holding A/S	Citibank	6.559
2.472	Umicore SA	Citibank	977	(13.032)	Nilfisk Holding A/S	Barclays Bank	25.386
2.575	Umicore SA	Goldman Sachs	1.558	(6.763)	Nilfisk Holding A/S	JP Morgan	21.351
735	Umicore SA	Morgan Stanley	481	(20.324)	NKT A/S	Citibank	(26.758)
1.751	Umicore SA	HSBC	1.216	20.927	Novo Nordisk A/S 'B'	HSBC	(10.253)
2.812	Umicore SA	JP Morgan	2.981	18.689	Novo Nordisk A/S 'B'	Goldman Sachs	(4.690)
(25.724)	Umicore SA	Goldman Sachs	(15.434)	(19.231)	Novo Nordisk A/S 'B'	Citibank	13.047
2.454	Warehouses De Pauw CVA (Reit)	HSBC	3.601	(5.976)	Novozymes A/S 'B'	Citibank	1.363
4.091	Warehouses De Pauw CVA (Reit)	Goldman Sachs	4.525	(2.739)	Novozymes A/S 'B'	JP Morgan	191
			(123.603)	(19.409)	Orsted A/S '144A'	Barclays Bank	75.878
				(18.875)	Orsted A/S '144A'	JP Morgan	37.126
				(1.911)	Orsted A/S '144A'	HSBC	988
				(100.571)	Orsted A/S '144A'	Citibank	337.106
				(1.243)	OW Bunker A/S*	Goldman Sachs	13.359
				(139)	Pandora A/S	Barclays Bank	90
(6.659)	ALK-Abello A/S	HSBC	(17.892)	(21.725)	Pandora A/S	Citibank	(5.296)
(5.236)	ALK-Abello A/S	JP Morgan	(14.069)	(3.150)	Pandora A/S	HSBC	(1.662)
85.643	Alm Brand A/S	Goldman Sachs	(5.753)	(2.570)	Pandora A/S	JP Morgan	7.007
(34.332)	Ambu A/S 'B'	Citibank	(62.381)	6.302	Per Aarsleff Holding A/S	HSBC	(16.509)
(8.883)	Ambu A/S 'B'	JP Morgan	(597)	6.797	Per Aarsleff Holding A/S	JP Morgan	(17.806)
121	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Morgan Stanley	3.899	8.670	Per Aarsleff Holding A/S	Barclays Bank	(21.548)
(104)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	HSBC	(3.530)	15.138	Per Aarsleff Holding A/S	Goldman Sachs	(32.539)
(918)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	JP Morgan	4.713	12.104	Per Aarsleff Holding A/S	Morgan Stanley	(30.083)
(447)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Citibank	(6.554)	46	Ringkjoebing Landbobank A/S	Morgan Stanley	(3)
572	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Goldman Sachs	4.662	4.509	Ringkjoebing Landbobank A/S	Goldman Sachs	606
(1.997)	Bang & Olufsen A/S	Citibank	2.654	3.717	Ringkjoebing Landbobank A/S	HSBC	(1.748)
8.619	Carlsberg A/S 'B'	Goldman Sachs	4.400	1.155	Ringkjoebing Landbobank A/S	JP Morgan	(543)
(4.141)	Carlsberg A/S 'B'	JP Morgan	75	1.669	Ringkjoebing Landbobank A/S	Barclays Bank	(112)
(4.062)	Carlsberg A/S 'B'	HSBC	365	1.613	Rockwool International A/S 'B'	HSBC	24.723
(2.046)	Carlsberg A/S 'B'	Citibank	(796)	800	Rockwool International A/S 'B'	JP Morgan	11.922
(95.582)	Chr Hansen Holding A/S	Citibank	(310.750)	3.865	Rockwool International A/S 'B'	Barclays Bank	23.171
(2.336)	Coloplast A/S 'B'	Citibank	438	6.223	Rockwool International A/S 'B'	Goldman Sachs	80.116
(1.595)	Coloplast A/S 'B'	Barclays Bank	471	4.885	Royal Unibrew A/S	JP Morgan	32.026
(9.253)	Coloplast A/S 'B'	HSBC	(24.278)	135	Royal Unibrew A/S	Barclays Bank	932
(15.809)	Coloplast A/S 'B'	JP Morgan	(41.972)	3.720	Royal Unibrew A/S	Goldman Sachs	21.990
25.693	Danske Bank A/S	Goldman Sachs	(11.172)	(13.685)	Scandinavian Tobacco Group A/S '144A'	Citibank	9.560
833	Danske Bank A/S	Citibank	(98)	(9.646)	Schouw & Co A/S	Citibank	19.438
7.042	Danske Bank A/S	JP Morgan	1.243	(5.056)	SimCorp A/S	HSBC	(43.368)
3.023	Danske Bank A/S	HSBC	663	(6.083)	SimCorp A/S	JP Morgan	(52.046)
424	Dfds A/S	Morgan Stanley	(296)	(6.008)	SimCorp A/S	Citibank	(10.493)
5.898	Dfds A/S	HSBC	(7.659)	2.295	Spar Nord Bank A/S	JP Morgan	113
1.871	Dfds A/S	Citibank	(1.371)	3.021	Spar Nord Bank A/S	Goldman Sachs	65
8.215	Dfds A/S	Barclays Bank	(6.087)	(23.736)	Sydbank A/S	Citibank	46.556
21.621	Dfds A/S	Goldman Sachs	(29.780)	(8.624)	Sydbank A/S	JP Morgan	19.464
5.210	Dfds A/S	JP Morgan	(6.448)	(14.315)	Topdanmark A/S	Citibank	3.462
(4.185)	DSV A/S	Citibank	(2.699)	3.373	Tryg A/S	Barclays Bank	1.156
(1.704)	DSV A/S	JP Morgan	(5.311)	22.086	Tryg A/S	Goldman Sachs	10.237
(2.714)	DSV A/S	HSBC	(8.459)	5.844	Tryg A/S	Citibank	1.754
(13.205)	FLSmidth & Co A/S	Barclays Bank	13.308	1.249	Tryg A/S	HSBC	360
(4.970)	FLSmidth & Co A/S	JP Morgan	(162)	7.842	Tryg A/S	JP Morgan	3.513
(4.647)	FLSmidth & Co A/S	HSBC	(857)	1.184	Vestas Wind Systems A/S	Citibank	(3.326)
18.354	GN Store Nord A/S	Barclays Bank	13.562	3.497	Vestas Wind Systems A/S	Barclays Bank	(6.674)
23.785	GN Store Nord A/S	Goldman Sachs	639	8.063	Vestas Wind Systems A/S	Goldman Sachs	(22.531)
14.704	GN Store Nord A/S	Citibank	10.865	1.385	Vestas Wind Systems A/S	Morgan Stanley	(4.839)
18.369	GN Store Nord A/S	HSBC	5.410	3.637	Vestas Wind Systems A/S	HSBC	(12.035)
8.714	GN Store Nord A/S	JP Morgan	2.458				
1.247	GN Store Nord A/S	Morgan Stanley	921				

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

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Danemark suite				Finlande suite			
1.821	Vestas Wind Systems A/S	JP Morgan	849	5.701	Metso OYJ	Goldman Sachs	(3.298)
(3.677)	William Demant Holding A/S	HSBC	—	1.718	Metso OYJ	JP Morgan	(902)
(1.727)	William Demant Holding A/S	JP Morgan	(479)	1.432	Neste OYJ	Barclays Bank	(1.317)
(9.289)	William Demant Holding A/S	Citibank	(6.339)	11.830	Neste OYJ	Goldman Sachs	14.367
4.391	William Demant Holding A/S	Barclays Bank	3.539	461	Neste OYJ	Citibank	1.061
			244.581	2.924	Neste OYJ	HSBC	11.111
Finlande				3.799	Neste OYJ	JP Morgan	12.347
(3.787)	Ahlstrom-Munksjo OYJ	Goldman Sachs	5.142	43.366	Nokia OYJ	Citibank	(11.162)
(2.210)	Ahlstrom-Munksjo OYJ	HSBC	1.345	11.050	Nokia OYJ	Morgan Stanley	(3.514)
(2.955)	Ahlstrom-Munksjo OYJ	JP Morgan	2.314	60.986	Nokia OYJ	JP Morgan	(15.707)
(3.547)	Amer Sports OYJ	HSBC	(3.834)	144.284	Nokia OYJ	HSBC	(36.788)
(9.175)	Amer Sports OYJ	JP Morgan	(15.065)	34.951	Nokia OYJ	Barclays Bank	(7.325)
(5.399)	Amer Sports OYJ	Barclays Bank	(4.245)	40.788	Nokia OYJ	Goldman Sachs	(12.652)
(7.090)	Cargotec OYJ 'B'	Goldman Sachs	8.479	(68.875)	Nokian Renkaat OYJ	JP Morgan	12.437
(6.607)	Cargotec OYJ 'B'	Barclays Bank	12.157	(21.550)	Nokian Renkaat OYJ	Barclays Bank	14.718
(3.145)	Cargotec OYJ 'B'	HSBC	3.513	(168.454)	Nokian Renkaat OYJ	Goldman Sachs	(35.204)
(28.295)	Cargotec OYJ 'B'	JP Morgan	18.443	(10.693)	Orion OYJ 'B'	Goldman Sachs	(268)
(296.529)	Caverion OYJ	Goldman Sachs	5.931	(15.811)	Orion OYJ 'B'	Barclays Bank	79
(33.435)	Caverion OYJ	Morgan Stanley	(15.659)	(1.485)	Orion OYJ 'B'	Goldman Sachs	1.689
(19.333)	Caverion OYJ	JP Morgan	(1.160)	(9.254)	Orion OYJ 'B'	JP Morgan	7.425
(224.090)	Citycon OYJ	Barclays Bank	7.843	(11.867)	Orion OYJ 'B'	HSBC	(3.369)
(201.050)	Citycon OYJ	Goldman Sachs	5.428	(5.762)	Outokumpu OYJ	Goldman Sachs	2.720
3.427	Cramo OYJ	HSBC	(2.254)	(14.849)	Outotec OYJ	Citibank	4.811
2.209	Cramo OYJ	JP Morgan	(2.070)	19.937	Outotec OYJ	JP Morgan	(3.236)
7.917	Cramo OYJ	Barclays Bank	(8.665)	(64.252)	Outotec OYJ	Goldman Sachs	13.909
9.196	Cramo OYJ	Goldman Sachs	(10.854)	32.295	Outotec OYJ	Barclays Bank	(10.464)
434	Cramo OYJ	Morgan Stanley	(625)	9.671	Outotec OYJ	Citibank	(2.109)
8.659	DNA OYJ	Barclays Bank	(1.212)	2.862	Outotec OYJ	Goldman Sachs	(609)
7.770	DNA OYJ	HSBC	(2.176)	8.222	Outotec OYJ	HSBC	(921)
2.927	DNA OYJ	JP Morgan	1.164	6.399	Ramirent OYJ	Barclays Bank	1.953
42.186	DNA OYJ	Goldman Sachs	20.671	249.115	Ramirent OYJ	Goldman Sachs	58.181
5.080	DNA OYJ	Morgan Stanley	149	10.002	Ramirent OYJ	Morgan Stanley	1.366
3.062	Elisa OYJ	Citibank	92	9.674	Ramirent OYJ	HSBC	623
8.897	Elisa OYJ	HSBC	11.833	6.105	Rovio Entertainment Oyj		
14.692	Elisa OYJ	JP Morgan	18.524		'144A'	Goldman Sachs	4.298
(99.363)	Elisa OYJ	Goldman Sachs	(126.191)	162	Sampo OYJ 'A'	Goldman Sachs	(218)
2.104	Elisa OYJ	Barclays Bank	63	800	Sampo OYJ 'A'	Barclays Bank	188
12.139	Elisa OYJ	Goldman Sachs	14.285	1.450	Sampo OYJ 'A'	JP Morgan	(882)
51.802	Finnair OYJ	Goldman Sachs	(47.658)	24.105	Sanoma OYJ	Goldman Sachs	(8.075)
6.732	Finnair OYJ	HSBC	(8.213)	29.808	Sanoma OYJ	Morgan Stanley	(26.976)
7.212	Finnair OYJ	Barclays Bank	(7.356)	7.319	Stora Enso OYJ 'R'	JP Morgan	2.008
12.943	Finnair OYJ	Morgan Stanley	(15.273)	(43.396)	Stora Enso OYJ 'R'	JP Morgan	(26.175)
2.508	Finnair OYJ	JP Morgan	(3.060)	(18.963)	Stora Enso OYJ 'R'	HSBC	(12.136)
(19.291)	Fortum OYJ	JP Morgan	(8.589)	1.883	Tieto OYJ	Citibank	(1.582)
(100.054)	Fortum OYJ	Goldman Sachs	4.357	(184.301)	Tikkurila OYJ	Barclays Bank	153.107
(1.050)	Fortum OYJ	Barclays Bank	(59)	(1.514)	Tikkurila OYJ	HSBC	(23)
(5.891)	Fortum OYJ	HSBC	(293)	(3.100)	Tikkurila OYJ	JP Morgan	331
(18.769)	Huhtamaki OYJ	JP Morgan	(4.659)	(1.157)	Tikkurila OYJ	Goldman Sachs	69
(190.051)	Huhtamaki OYJ	Goldman Sachs	15.204	2.182	Tokmanni Group Corp	HSBC	224
475	Kemira OYJ	Barclays Bank	(109)	814	Tokmanni Group Corp	Morgan Stanley	67
3.233	Kemira OYJ	Goldman Sachs	(949)	14.788	UPM-Kymmene OYJ	Barclays Bank	7.263
(21.958)	Kesko OYJ 'B'	JP Morgan	(20.099)	61.934	UPM-Kymmene OYJ	Goldman Sachs	4.172
(17.202)	Kesko OYJ 'B'	Goldman Sachs	(11.009)	4.118	UPM-Kymmene OYJ	Citibank	(331)
(2.545)	Kesko OYJ 'B'	HSBC	(2.507)	3.661	UPM-Kymmene OYJ	HSBC	2.142
(1.038)	Kone OYJ 'B'	JP Morgan	169	2.787	UPM-Kymmene OYJ	JP Morgan	2.098
(6.588)	Kone OYJ 'B'	HSBC	239	4.206	Uponor OYJ	Goldman Sachs	(45)
(35.445)	Konecranes OYJ	Barclays Bank	53.168	218	Uponor OYJ	JP Morgan	(139)
(41.588)	Konecranes OYJ	Goldman Sachs	(38.964)	3.180	Uponor OYJ	HSBC	(269)
(44.426)	Konecranes OYJ	JP Morgan	(52.657)	(10.383)	Valmet OYJ	Goldman Sachs	(104)
(7.566)	Konecranes OYJ	HSBC	(4.345)	132.312	Valmet OYJ	Goldman Sachs	1.323
(564)	Lehto Group OYJ	Barclays Bank	372	1.195	Wartsila OYJ Abp	HSBC	(654)
(14.779)	Lehto Group OYJ	Goldman Sachs	6.071	(42.670)	Wartsila OYJ Abp	Goldman Sachs	(8.169)
(7.658)	Metsa Board OYJ	Barclays Bank	526	5.400	Wartsila OYJ Abp	Goldman Sachs	1.944
(111.493)	Metsa Board OYJ	Goldman Sachs	(28.988)	(1.760)	Wartsila OYJ Abp	Barclays Bank	689
(63.222)	Metsa Board OYJ	JP Morgan	(9.826)	(6.508)	Wartsila OYJ Abp	JP Morgan	2.604
(26.180)	Metsa Board OYJ	HSBC	(3.223)	(221.688)	YIT OYJ	Goldman Sachs	29.476
3.757	Metso OYJ	Barclays Bank	(2.477)	3.540	YIT OYJ	JP Morgan	(442)
8.374	Metso OYJ	HSBC	(6.800)	(225.428)	YIT OYJ	JP Morgan	19.668
				3.420	YIT OYJ	HSBC	(511)
				134.066	YIT OYJ	Goldman Sachs	(16.758)

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Finlande suite				France suite			
47.841	YIT OYJ	Barclays Bank	(9.807)	7.151	Bureau Veritas SA	Barclays Bank	990
10.539	YIT OYJ	Citibank	(2.160)	41.608	Bureau Veritas SA	Goldman Sachs	(13.471)
			(127.474)	25.239	Bureau Veritas SA	JP Morgan	445
France				169	Capgemini SE	Barclays Bank	(203)
(792)	Accor SA	Barclays Bank	502	20.945	Capgemini SE	Goldman Sachs	(43.567)
(580)	Accor SA	HSBC	610	2.168	Capgemini SE	HSBC	(4.143)
(3.878)	Aeroports de Paris	HSBC	16.650	1.558	Capgemini SE	JP Morgan	(2.622)
(6.167)	Aeroports de Paris	Barclays Bank	13.605	20.157	Carrefour SA	HSBC	(18.076)
(6.485)	Aeroports de Paris	Goldman Sachs	42.211	(84.292)	Carrefour SA	Goldman Sachs	62.798
(4.899)	Air France-KLM	HSBC	2.724	18.377	Carrefour SA	Barclays Bank	(18.285)
(466.019)	Air France-KLM	Goldman Sachs	169.010	13.955	Carrefour SA	Goldman Sachs	(5.066)
6.114	Air Liquide SA	HSBC	(9.898)	2.179	Carrefour SA	Morgan Stanley	(1.971)
3.650	Air Liquide SA	JP Morgan	(6.110)	45.905	Carrefour SA	JP Morgan	(44.531)
(6.686)	Airbus SE	Barclays Bank	18.453	8.953	Casino Guichard Perrachon SA	Goldman Sachs	(21.147)
(37.621)	Airbus SE	Goldman Sachs	(62.075)	443	Casino Guichard Perrachon SA	Morgan Stanley	(157)
3.254	Airbus SE	Goldman Sachs	4.409	(12.904)	Casino Guichard Perrachon SA	Goldman Sachs	47.261
60	Akka Technologies	JP Morgan	7	5.894	Casino Guichard Perrachon SA	Citibank	(13.969)
77	Akka Technologies	Barclays Bank	(23)	5.218	Casino Guichard Perrachon SA	HSBC	(18.937)
354	Akka Technologies	Goldman Sachs	(357)	5.144	Casino Guichard Perrachon SA	JP Morgan	(24.215)
1.583	Akka Technologies	HSBC	(777)	(7.677)	Casino Guichard Perrachon SA	HSBC	21.986
2.439	Albioma SA	Goldman Sachs	(1.151)	42.528	CGG SA	JP Morgan	(1.956)
359	Albioma SA	Morgan Stanley	(162)	18.293	CGG SA	HSBC	(238)
2.123	Albioma SA	Barclays Bank	(818)	(2.919)	Chargeurs SA	Goldman Sachs	4.311
1.249	Albioma SA	HSBC	(611)	(2.014)	Chargeurs SA	Barclays Bank	2.578
879	Albioma SA	JP Morgan	(659)	355	Christian Dior SE	HSBC	1.842
(1.940)	ALD SA '144A'	Barclays Bank	2.309	165	Christian Dior SE	Citibank	(154)
(5.469)	ALD SA '144A'	HSBC	1.032	551	Christian Dior SE	JP Morgan	898
(1.897)	ALD SA '144A'	Morgan Stanley	1.594	856	Christian Dior SE	Barclays Bank	976
(15.166)	ALD SA '144A'	Goldman Sachs	9.555	216	Christian Dior SE	Goldman Sachs	395
(53.724)	Alstom SA	Goldman Sachs	(95.629)	3.655	Cie de Saint-Gobain	JP Morgan	(6.748)
(12.433)	Alstom SA	HSBC	(9.502)	191.638	Cie de Saint-Gobain	Goldman Sachs	(357.405)
(22.669)	Alstom SA	Barclays Bank	6.023	4.550	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Barclays Bank	(17.402)
55.409	Altran Technologies SA	Goldman Sachs	16.402	25.519	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Goldman Sachs	(204.369)
1.031	Altran Technologies SA	JP Morgan	(97)	59	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Morgan Stanley	(327)
(304)	Altran Technologies SA	HSBC	88	4.028	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Citibank	(23.239)
4.412	Altran Technologies SA	Barclays Bank	(212)	8.138	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	JP Morgan	(43.403)
8.610	Altran Technologies SA**	HSBC	67	7.842	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	HSBC	(50.609)
(6.033)	Amundi SA '144A'	Goldman Sachs	51.160	(92.106)	Cie Plastic Omnium SA	Goldman Sachs	59.869
1.134	Arkema SA	Citibank	(5.170)	(42.348)	Cie Plastic Omnium SA	HSBC	10.587
1.119	Arkema SA	JP Morgan	(4.776)	21.253	CNP Assurances	Barclays Bank	(23.109)
2.363	Arkema SA	Barclays Bank	(13.392)	26.441	CNP Assurances	Goldman Sachs	(23.268)
75.120	Arkema SA	Goldman Sachs	(409.102)	52.367	CNP Assurances	HSBC	(34.837)
43	Arkema SA	HSBC	(235)	17.581	CNP Assurances	JP Morgan	(11.252)
(37.946)	Aroundtown SA	Morgan Stanley	(37.440)	29.292	Coface SA	Goldman Sachs	(45.972)
640	Atos SE	Barclays Bank	201	18.054	Coface SA	Morgan Stanley	(25.456)
1.772	Atos SE	Goldman Sachs	4.341	21.256	Coface SA	Barclays Bank	(29.971)
(4.675)	AXA SA	Barclays Bank	1.086	10.202	Coface SA	HSBC	(16.017)
(6.650)	AXA SA	HSBC	2.731	11.672	Coface SA	JP Morgan	(18.325)
18.369	Beneteau SA	Morgan Stanley	(1.470)	(9.657)	Credit Agricole SA	Barclays Bank	1.179
12.947	Beneteau SA	Goldman Sachs	(13.206)	(25.423)	Credit Agricole SA	Goldman Sachs	3.557
25.253	Beneteau SA	HSBC	(14.647)	(23.972)	Credit Agricole SA	HSBC	5.976
3.457	Beneteau SA	JP Morgan	(2.005)	18.815	Danone SA	Goldman Sachs	21.261
13.440	BioMerieux	Goldman Sachs	81.984	20	Dassault Aviation SA	Barclays Bank	(808)
15.054	BioMerieux	Barclays Bank	66.238	114	Dassault Aviation SA	Goldman Sachs	(4.139)
1.355	BioMerieux	Citibank	5.962	12	Dassault Aviation SA	HSBC	(574)
10.654	BioMerieux	HSBC	82.361	297	Dassault Aviation SA	JP Morgan	(6.138)
6.899	BioMerieux	JP Morgan	40.056	881	Dassault Systemes SE	JP Morgan	8.067
2.956	BNP Paribas SA	Barclays Bank	(22.915)	9.318	Derichebourg SA	Barclays Bank	(19.009)
362	BNP Paribas SA	Citibank	(3.385)	63.037	Derichebourg SA	Goldman Sachs	(91.719)
14.455	BNP Paribas SA	Goldman Sachs	(142.237)	575	Derichebourg SA	Morgan Stanley	(1.173)
3.222	BNP Paribas SA	HSBC	(26.076)	285	Devoteam SA	Barclays Bank	1.940
3.363	BNP Paribas SA	JP Morgan	(17.818)	106	Devoteam SA	Goldman Sachs	744
(3.703)	Bollere SA	Barclays Bank	961	312	Devoteam SA	JP Morgan	1.580
(2.006)	Bollere SA	Goldman Sachs	437	(8.744)	Edenred	Barclays Bank	(3.519)
(792.915)	Bollere SA	Goldman Sachs	158.577				
(219.361)	Bollere SA	Barclays Bank	51.292				
(13.978)	Bouygues SA	Barclays Bank	30.179				
(9.012)	Bouygues SA	Goldman Sachs	21.088				
(30.317)	Bouygues SA	HSBC	87.938				

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
France suite				France suite			
(9.981)	Edenred	HSBC	14.572	(148.782)	Getlink	Goldman Sachs	29.702
7.194	Eiffage SA	Goldman Sachs	(7.414)	(18.029)	Guerbet	Morgan Stanley	25.241
1.239	Eiffage SA	JP Morgan	(1.682)	(4.502)	Guerbet	Barclays Bank	6.303
(24.418)	Electricite de France SA	Barclays Bank	982	(2.254)	Guerbet	HSBC	(6.086)
(40.445)	Electricite de France SA	Goldman Sachs	37.816	139	Hermes International	JP Morgan	790
(53.960)	Electricite de France SA	HSBC	14.844	40	Hermes International	Goldman Sachs	196
(41.099)	Elior Group SA '144A'	Barclays Bank	1.348	(12.533)	ICADE (Reit)	Barclays Bank	5.118
(71.430)	Elior Group SA '144A'	Goldman Sachs	17.370	(9.798)	ICADE (Reit)	Goldman Sachs	9.208
(61.215)	Elis SA	Barclays Bank	60.142	(9.673)	ICADE (Reit)	HSBC	5.750
8.791	Elis SA	Goldman Sachs	(8.351)	(13.380)	Iliad SA	Barclays Bank	(24.655)
3.062	Elis SA	HSBC	(771)	(40.225)	Iliad SA	Goldman Sachs	(366.285)
3.775	Elis SA	Citibank	147	(3.384)	Iliad SA	HSBC	10.323
1.439	Elis SA	Barclays Bank	(1.468)	3.976	Imerys SA	Goldman Sachs	2.982
18.984	Elis SA	JP Morgan	(9.254)	1.833	Imerys SA	HSBC	1.110
(386.573)	Elis SA	Goldman Sachs	349.628	2.999	Imerys SA	JP Morgan	(609)
(5.034)	Elis SA	HSBC	2.346	(23.728)	Ingenico Group SA	Barclays Bank	29.423
226.085	Engie SA	Barclays Bank	(129.519)	(11.811)	Ingenico Group SA	Goldman Sachs	2.027
322.927	Engie SA	Goldman Sachs	(375.778)	(8.066)	Ingenico Group SA	HSBC	19.147
(9.054)	Engie SA	Barclays Bank	5.767	(43)	Interparfums SA	Goldman Sachs	(86)
63.035	Engie SA	Citibank	(43.179)	2.605	Ipsen SA	HSBC	11.071
12.376	Engie SA	JP Morgan	(10.195)	213	Ipsen SA	Barclays Bank	660
73	Eramet	Barclays Bank	(533)	2.831	Ipsen SA	Goldman Sachs	15.854
(561)	Essilor International Cie			(4.217)	IPSOS	Goldman Sachs	4.301
	Generale d'Optique SA	Barclays Bank	1.196	(1.172)	IPSOS	HSBC	2.297
(10.270)	Essilor International Cie			8.454	Jacquet Metal Service SA	Goldman Sachs	(16.063)
	Generale d'Optique SA	Goldman Sachs	(1.125)	3.690	Jacquet Metal Service SA	HSBC	(7.380)
(9.816)	Essilor International Cie			5.426	Jacquet Metal Service SA	JP Morgan	(10.852)
	Generale d'Optique SA	HSBC	(13.674)	5.003	Jacquet Metal Service SA	Morgan Stanley	(8.505)
7.511	Etablissements Maurel et Prom			5.321	Jacquet Metal Service SA	Barclays Bank	(9.046)
		Barclays Bank	698	9.558	JCDcaux SA	HSBC	(21.724)
4.888	Etablissements Maurel et Prom			13.163	JCDcaux SA	JP Morgan	(34.706)
		HSBC	1.451	11.515	JCDcaux SA	Barclays Bank	(3.224)
3.604	Etablissements Maurel et Prom			8.105	JCDcaux SA	Goldman Sachs	(6.484)
		JP Morgan	217	1.673	Kaufman & Broad SA	Goldman Sachs	(3.313)
14.172	Etablissements Maurel et Prom			73	Kaufman & Broad SA	JP Morgan	(165)
		Goldman Sachs	(976)	2.067	Kaufman & Broad SA	HSBC	(5.953)
13.621	Etablissements Maurel et Prom			4.017	Kaufman & Broad SA	Morgan Stanley	(10.203)
		Morgan Stanley	(218)	783	Kering SA	Goldman Sachs	17.774
(637)	Eurofins Scientific SE	Goldman Sachs	(500)	1.597	Kering SA	HSBC	17.973
(214)	Eurofins Scientific SE	HSBC	175	399	Kering SA	JP Morgan	1.576
572	Eurofins Scientific SE	Goldman Sachs	(449)	(3.907)	Klepierre SA (Reit)	Goldman Sachs	604
39	Eurofins Scientific SE	Citibank	(269)	(7.796)	Klepierre SA (Reit)	HSBC	7.378
(240)	Eurofins Scientific SE	Barclays Bank	2.064	12.721	Korian SA	Goldman Sachs	(10.177)
305	Eurofins Scientific SE	Barclays Bank	(1.684)	(1.678)	L'Oreal SA	HSBC	(11.322)
334	Eurofins Scientific SE	HSBC	236	(818)	Lagardere SCA	Barclays Bank	(78)
359	Eurofins Scientific SE	JP Morgan	(506)	(21.682)	Lagardere SCA	Goldman Sachs	3.332
729	Euronext NV '144A'	Barclays Bank	(693)	(15.970)	Lectra	Goldman Sachs	14.373
2.553	Euronext NV '144A'	Citibank	(2.425)	(2.649)	Lectra	Barclays Bank	2.517
9.889	Euronext NV '144A'	HSBC	(13.878)	2.194	Legrand SA	Barclays Bank	(1.589)
2.359	Euronext NV '144A'	JP Morgan	(4.733)	332	Legrand SA	Morgan Stanley	(503)
(296.018)	Europcar Groupe SA '144A'	Goldman Sachs	2.874	9.281	Legrand SA	JP Morgan	(11.988)
(26.529)	Eutelsat Communications SA	Barclays Bank	192	26.877	Legrand SA	Goldman Sachs	(28.408)
(10.695)	Eutelsat Communications SA	Goldman Sachs	(339)	5.749	Legrand SA	HSBC	(7.915)
(27.172)	Eutelsat Communications SA	HSBC	2.479	(1.173)	LISI	Barclays Bank	(1.114)
477	Faurecia SA	HSBC	(182)	(14.958)	LISI	Goldman Sachs	(25.429)
(8.777)	Faurecia SA	HSBC	8.887	(2.098)	LISI	HSBC	(1.619)
2.538	Faurecia SA	JP Morgan	5.082	57	LNA Sante SA	JP Morgan	89
11.137	Faurecia SA	Barclays Bank	(16.699)	367	LNA Sante SA	HSBC	363
96.841	Faurecia SA	Goldman Sachs	240.166	438	LNA Sante SA	Barclays Bank	394
1.012	Faurecia SA	Morgan Stanley	(346)	1.797	LVMH Moet Hennessy		
(2.698)	Faurecia SA	Barclays Bank	1.385		Louis Vuitton SE	Barclays Bank	(10.509)
(2.361)	Faurecia SA	Goldman Sachs	(1.060)	486	LVMH Moet Hennessy Louis		
(2.075)	Fnac Darty SA	HSBC	3.839		Vuitton SE	Goldman Sachs	(572)
(3.846)	Fnac Darty SA	Goldman Sachs	(4.038)	1.129	LVMH Moet Hennessy Louis		
681	Fonciere Des Regions (Reit)	Barclays Bank	25		Vuitton SE	JP Morgan	1.344
1.024	Fonciere Des Regions (Reit)	JP Morgan	(1.673)	918	LVMH Moet Hennessy Louis		
806	Fonciere Des Regions (Reit)	Morgan Stanley	(713)		Vuitton SE	HSBC	167
263	Gaztransport Et Technigaz SA	Goldman Sachs	(763)	64	Maisons du Monde SA '144A'	Morgan Stanley	(21)
2.108	Gecina SA (Reit)	Goldman Sachs	1.221	222	Maisons du Monde SA '144A'	Barclays Bank	(203)
(102.969)	Getlink	Barclays Bank	(450)	349	Maisons du Monde SA '144A'	HSBC	59
(127.826)	Getlink	HSBC	19.983	1.287	Manitou BF SA	Goldman Sachs	(1.930)

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes				Plus-values/ (moins-values) latentes			
Nombre	Description	Contrepartie	EUR	Nombre	Description	Contrepartie	EUR
France suite				France suite			
12.019	Mersen SA	Goldman Sachs	(39.663)	2.238	SMCP SA '144A'	Barclays Bank	5.819
1.694	Mersen SA	HSBC	(4.997)	7.037	SMCP SA '144A'	Goldman Sachs	20.879
4.883	Mersen SA	Barclays Bank	(5.615)	3.568	SMCP SA '144A'	HSBC	9.929
8.286	Mersen SA	Morgan Stanley	(9.529)	2.384	SMCP SA '144A'	JP Morgan	6.656
9.241	Metropole Television SA	Morgan Stanley	(10.165)	3.579	SMCP SA '144A'	Morgan Stanley	9.506
31.424	Metropole Television SA	Goldman Sachs	(59.706)	159	Societe BIC SA	Morgan Stanley	(843)
6.207	Metropole Television SA	HSBC	(10.862)	460	Societe BIC SA	Citibank	(2.438)
10.938	Metropole Television SA	JP Morgan	(19.141)	2.432	Societe BIC SA	HSBC	(9.254)
(7.380)	MGI Coutier	Goldman Sachs	10.701	808	Societe BIC SA	JP Morgan	1.127
(114.118)	Natixis SA	HSBC	72.364	1.945	Societe BIC SA	Barclays Bank	(6.624)
(22.515)	Neopost SA	Goldman Sachs	(18.462)	1.539	Societe BIC SA	Goldman Sachs	(4.155)
(15.938)	Nexans SA	Goldman Sachs	24.719	(5.067)	Societe BIC SA	Goldman Sachs	13.681
(8.462)	Nexans SA	Barclays Bank	10.764	(87)	Societe Generale SA	Barclays Bank	404
(2.851)	Nexans SA	HSBC	6.678	(40.209)	Societe Generale SA	Goldman Sachs	224.366
1.464	Nexity SA	Barclays Bank	(3.030)	(10.672)	Societe Generale SA	HSBC	55.453
550	Nexity SA	HSBC	35	(94)	Sodexo SA	Barclays Bank	232
7.588	Nexity SA	JP Morgan	(7.902)	(63.848)	Sodexo SA	Goldman Sachs	19.154
9.315	Nexity SA	Goldman Sachs	(14.660)	(7.838)	Sodexo SA	HSBC	482
4.118	Nexity SA	Citibank	1.742	(9.124)	Soitec	Goldman Sachs	895
(87.131)	Orange SA	HSBC	5.922	(450)	Soitec	HSBC	462
(89.724)	Orange SA	Barclays Bank	21.334	(1.385.871)	Solocal Group	Morgan Stanley	(33.352)
(71.142)	Orange SA	Goldman Sachs	11.745	(1.244)	Solutions 30 SE	Citibank	(2.177)
(69.812)	Orpea	Goldman Sachs	(232.910)	(4.748)	Solutions 30 SE	Morgan Stanley	(1.662)
(6.158)	Orpea	Barclays Bank	(23.093)	(1.879)	Solutions 30 SE	Barclays Bank	(3.288)
804	Pernod Ricard SA	Barclays Bank	3.055	681	Sopra Steria Group	Barclays Bank	477
1.554	Pernod Ricard SA	Goldman Sachs	8.780	2.673	Sopra Steria Group	Goldman Sachs	(6.415)
1.145	Pernod Ricard SA	HSBC	7.083	1.434	Sopra Steria Group	JP Morgan	(6.023)
2.123	Pernod Ricard SA	JP Morgan	13.568	(126.414)	SPIE SA	Goldman Sachs	202.947
12.182	Peugeot SA	HSBC	(5.254)	(55.660)	SPIE SA	HSBC	81.559
1.016	Publicis Groupe SA	Barclays Bank	(2.056)	(69.672)	SPIE SA	Barclays Bank	66.679
1.389	Publicis Groupe SA	Goldman Sachs	(2.247)	15.911	Ste Industrielle d'Aviation		
1.620	Publicis Groupe SA	Citibank	(2.804)		Latecoere SA	Morgan Stanley	(7.475)
1.918	Publicis Groupe SA	JP Morgan	(3.749)	1.258	Ste Industrielle d'Aviation		
1.906	Publicis Groupe SA	HSBC	(4.982)		Latecoere SA	HSBC	(402)
(19.020)	Rallye SA	Citibank	40.703	38.215	Ste Industrielle d'Aviation		
(18.623)	Rallye SA	HSBC	30.169		Latecoere SA	JP Morgan	(17.650)
(13.351)	Rallye SA	Morgan Stanley	28.571	22.640	Ste Industrielle d'Aviation		
485	Remy Cointreau SA	Barclays Bank	225		Latecoere SA	Barclays Bank	(7.811)
38	Remy Cointreau SA	Morgan Stanley	11	(6.674)	STMicrelectronics NV	Barclays Bank	(478)
5.837	Remy Cointreau SA	HSBC	63.691	(20.740)	STMicrelectronics NV	HSBC	(3.772)
1.680	Renault SA	JP Morgan	(10.433)	(32.920)	Suez	Barclays Bank	7.110
(2.082)	Renault SA	Barclays Bank	12.311	(336.502)	Suez	Goldman Sachs	41.446
(2.132)	Renault SA	Goldman Sachs	17.558	(58.366)	Suez	HSBC	57.491
(1.773)	Renault SA	HSBC	4.644	(7.449)	Tarkett SA	Barclays Bank	12.663
(604)	Rexel SA	Barclays Bank	335	(83.196)	Tarkett SA	Goldman Sachs	117.205
(1.432)	Rexel SA	Goldman Sachs	222	(14.606)	Tarkett SA	HSBC	14.455
(11.490)	Rexel SA	HSBC	5.102	(695.941)	Technicolor SA Reg	Goldman Sachs	(54.979)
(1.603)	Rubis SCA	HSBC	378	(5.954)	Teleperformance	Barclays Bank	(5.359)
(704)	Rubis SCA	Barclays Bank	(276)	(15.691)	Teleperformance	Goldman Sachs	3.224
(19.875)	Rubis SCA	Goldman Sachs	35.866	(4.595)	Teleperformance	HSBC	11.807
1.199	Safran SA	HSBC	1.844	33.310	Television Francaise 1	Barclays Bank	(22.817)
3.771	Safran SA	JP Morgan	5.719	2.064	Thales SA	HSBC	(523)
1.944	Safran SA	Goldman Sachs	972	224	Thales SA	Barclays Bank	185
20.310	Sanofi	JP Morgan	(3.946)	257	Thales SA	Goldman Sachs	187
4.542	Sanofi	HSBC	(685)	310	Thales SA	JP Morgan	233
6.132	Sanofi	Barclays Bank	(3.557)	83	Total SA	HSBC	(184)
28.864	Sanofi	Goldman Sachs	(1.471)	(6.222)	Total SA	Barclays Bank	(1.436)
13.307	Sanofi	Citibank	(6.875)	228	Trigano SA	Morgan Stanley	(456)
(3.219)	Sartorius Stedim Biotech	Barclays Bank	378	43	Trigano SA	JP Morgan	671
(2.643)	Sartorius Stedim Biotech	Goldman Sachs	(2.379)	333	Trigano SA	HSBC	5.195
(2.999)	Sartorius Stedim Biotech	HSBC	(4.779)	1.692	Trigano SA	Goldman Sachs	3.553
84.177	Schneider Electric SE	Goldman Sachs	(149.355)	189	Trigano SA	Barclays Bank	(378)
10.317	Schneider Electric SE	Citibank	(42.300)	7.622	Ubisoft Entertainment SA	Barclays Bank	40.092
9.486	Schneider Electric SE	HSBC	(26.688)	11.819	Ubisoft Entertainment SA	Goldman Sachs	87.770
11.991	Schneider Electric SE	Barclays Bank	(49.163)	6.888	Ubisoft Entertainment SA	JP Morgan	47.389
12.100	Schneider Electric SE	JP Morgan	(23.031)	7.660	Ubisoft Entertainment SA	HSBC	49.222
18.057	SCOR SE	Goldman Sachs	(25.641)	9.387	Ubisoft Entertainment SA	Citibank	49.376
(8.968)	SEB SA	HSBC	39.489	(45.324)	Valeo SA	Barclays Bank	193.080
(10.310)	SEB SA	Barclays Bank	46.127	(31.791)	Valeo SA	Goldman Sachs	102.367
(19.099)	SEB SA	Goldman Sachs	93.162	477	Vallourec SA	HSBC	168
(83.641)	SES SA	Goldman Sachs	(103.412)	964	Veolia Environnement SA	Citibank	(22)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

suite

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
France suite				Allemagne suite			
12.370	Veolia Environnement SA	Barclays Bank	(7.546)	3.317	Befesa SA	JP Morgan	(2.156)
9.662	Veolia Environnement SA	HSBC	(1.415)	3.138	Befesa SA	Morgan Stanley	(2.354)
9.124	Veolia Environnement SA	Goldman Sachs	(3.569)	(5.610)	Beiersdorf AG	Goldman Sachs	(7.854)
(820)	Vilmorin & Cie SA	Goldman Sachs	180	41	bet-at-home.com AG	Barclays Bank	(461)
(332)	Vilmorin & Cie SA	HSBC	33	6.151	bet-at-home.com AG	Goldman Sachs	(64.893)
(5.681)	Vinci SA	Goldman Sachs	14.749	648	bet-at-home.com AG	HSBC	(4.147)
(8.278)	Virbac SA	Morgan Stanley	6.622	(25.961)	Bilfinger SE	JP Morgan	(1.558)
28.676	Vivendi SA	Goldman Sachs	(44.181)	318	Bilfinger SE	JP Morgan	33
22.939	Vivendi SA	HSBC	(32.044)	19.305	Brenntag AG	Goldman Sachs	(579)
(5.568)	Worldline SA/France '144A'	HSBC	2.161	980	Brenntag AG	Citibank	(681)
(4.909)	Worldline SA/France '144A'	Barclays Bank	(775)	3.336	Brenntag AG	HSBC	1.317
(1.962)	Worldline SA/France '144A'	Goldman Sachs	(9.528)	10.321	Brenntag AG	JP Morgan	3.010
			(218.584)	(7.701)	Cancom SE	Goldman Sachs	2.966
				6.076	Cancom SE	Goldman Sachs	(13.975)
				(135)	Cancom SE	Morgan Stanley	(250)
				1.765	Cancom SE	Barclays Bank	3.265
356	1&1 Drillisch AG	JP Morgan	(937)	5.838	Cancom SE	Citibank	10.800
11.179	1&1 Drillisch AG	Goldman Sachs	(22.358)	5.471	Cancom SE	HSBC	(21.884)
78	1&1 Drillisch AG	Citibank	(105)	6.278	Cancom SE	JP Morgan	(27.416)
372	1&1 Drillisch AG	HSBC	(942)	(49.598)	Carl Zeiss Meditec AG	Goldman Sachs	(90.598)
(10.977)	Aareal Bank AG	Barclays Bank	47.495	(12.699)	Carl Zeiss Meditec AG	Barclays Bank	(13.959)
(30.568)	Aareal Bank AG	Goldman Sachs	146.976	(2.383)	Carl Zeiss Meditec AG	HSBC	(4.409)
468	adidas AG	Barclays Bank	842	27.100	Ceconomy AG	Goldman Sachs	(12.474)
1.390	adidas AG	Goldman Sachs	(881)	20.077	Ceconomy AG	Citibank	(5.913)
462	adidas AG	Citibank	(254)	22.468	Ceconomy AG	HSBC	(9.661)
399	adidas AG	HSBC	720	16.175	Ceconomy AG	Barclays Bank	(3.180)
407	adidas AG	JP Morgan	569	1.005	Ceconomy AG	Morgan Stanley	(432)
(9.397)	ADO Properties SA '144A'	Goldman Sachs	11.088	547	Ceconomy AG	JP Morgan	129
17.231	ADVA Optical Networking SE	Goldman Sachs	8.443	23.852	Cewe Stiftung & Co KGAA	Goldman Sachs	(62.015)
444	AIXTRON SE	Citibank	(191)	(19.109)	Commerzbank AG	HSBC	3.185
7.644	AIXTRON SE	Goldman Sachs	(5.198)	(6.278)	Commerzbank AG	Barclays Bank	1.040
396	Allianz SE Reg	Citibank	(668)	(13.206)	CompuGroup Medical SE	Goldman Sachs	54.937
2.034	Allianz SE Reg	HSBC	(20.603)	(2.549)	CompuGroup Medical SE	Barclays Bank	9.737
3.371	Allianz SE Reg	Goldman Sachs	(38.635)	1.774	Continental AG	HSBC	(6.148)
4.117	alstria office AG (Reit)	Morgan Stanley	(267)	1.144	Continental AG	JP Morgan	(7.474)
7.257	alstria office AG (Reit)	Barclays Bank	508	259	Covestro AG '144A'	Barclays Bank	(332)
36.648	alstria office AG (Reit)	Goldman Sachs	3.270	54.016	Covestro AG '144A'	Goldman Sachs	(41.198)
13.361	alstria office AG (Reit)	Citibank	807	5.593	Covestro AG '144A'	JP Morgan	6.712
3.484	alstria office AG (Reit)	HSBC	120	5.528	Covestro AG '144A'	Citibank	(7.076)
3.627	Amadeus Fire AG	Goldman Sachs	(13.057)	31.190	CropEnergies AG	Goldman Sachs	24.640
3.060	Amadeus Fire AG	JP Morgan	(11.934)	3.875	CropEnergies AG	HSBC	749
2.491	Amadeus Fire AG	Morgan Stanley	(8.220)	4.554	CropEnergies AG	JP Morgan	390
1.291	Amadeus Fire AG	Barclays Bank	(4.260)	(782)	CTS Eventim AG & Co KGaA	Goldman Sachs	(2.064)
4.903	Amadeus Fire AG	HSBC	(19.122)	(947)	Daimler AG Reg	Barclays Bank	639
(13.919)	Aroundtown SA	Goldman Sachs	(602)	(10.477)	Daimler AG Reg	Goldman Sachs	43.017

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Allemagne suite				Allemagne suite			
(12.208)	Deutsche Wohnen SE	Barclays Bank	(10.760)	(7.695)	Grand City Properties SA	Barclays Bank	1.560
(22.564)	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs	(13.547)	(23.557)	Grand City Properties SA	Goldman Sachs	2.560
317.537	Deutz AG	Barclays Bank	(306.423)	(829)	Hamborner REIT AG (Reit)	Goldman Sachs	(103)
8.127	Dialog Semiconductor Plc	Barclays Bank	(4.470)	511	Hamburger Hafen und		
19.079	Dialog Semiconductor Plc	Goldman Sachs	1.145		Logistik AG	Barclays Bank	(521)
9.221	Dialog Semiconductor Plc	JP Morgan	(298)	31.962	Hamburger Hafen und		
90.742	DIC Asset AG	Goldman Sachs	(6.352)		Logistik AG	Goldman Sachs	(38.354)
(2.096)	Diebold Nixdorf AG	Goldman Sachs	3.820	(5.834)	Hannover Rueck SE	Barclays Bank	31.814
(325)	Diebold Nixdorf AG	HSBC	1.124	(27.929)	Hannover Rueck SE	Goldman Sachs	119.984
(223)	Diebold Nixdorf AG	JP Morgan	959	(10.426)	Hannover Rueck SE	HSBC	49.700
1.127	DMG Mori AG	Barclays Bank	—	(6.984)	HeidelbergCement AG	Barclays Bank	24.541
542	DMG Mori AG	JP Morgan	569	(10.718)	HeidelbergCement AG	Goldman Sachs	40.217
2.007	DMG Mori AG	Morgan Stanley	—	(12.433)	Heidelberger		
501	DMG Mori AG	Goldman Sachs	175		Druckmaschinen AG	JP Morgan	2.313
4.050	Draegerwerk AG & Co			(40.253)	Heidelberger		
	KGaA (Pref)	Morgan Stanley	(114.413)		Druckmaschinen AG	Goldman Sachs	4.428
(1.514)	Duerr AG	JP Morgan	10.250	(36.978)	Heidelberger		
(4.019)	DWS Group Gmbh & Co KGaA	Citibank	9.927		Druckmaschinen AG	Morgan Stanley	592
(3.017)	DWS Group Gmbh & Co KGaA	HSBC	9.861	(16.908)	Heidelberger		
(8.788)	DWS Group Gmbh & Co KGaA	JP Morgan	19.726		Druckmaschinen AG	HSBC	3.145
3.174	E.ON SE	Citibank	(276)	19.126	Hella GmbH & Co KGaA	Citibank	(31.558)
112.778	E.ON SE	HSBC	(50.876)	60.247	Hella GmbH & Co KGaA	Goldman Sachs	(5.297)
91.174	E.ON SE	Goldman Sachs	(21.152)	48.448	Hella GmbH & Co KGaA	JP Morgan	28.629
1.362	E.ON SE	JP Morgan	14	179	Hella GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	(295)
865	Elmos Semiconductor AG	Morgan Stanley	(1.427)	10.233	Hella GmbH & Co KGaA	Barclays Bank	(13.176)
5.582	Elmos Semiconductor AG	HSBC	(6.419)	8.678	Hella GmbH & Co KGaA	HSBC	(1.383)
1.837	Elmos Semiconductor AG	Barclays Bank	(3.031)	(19.020)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Goldman Sachs	(20.244)
5.870	Elmos Semiconductor AG	Goldman Sachs	(7.044)	1.638	Hochtief AG	Morgan Stanley	3.637
3.681	Elmos Semiconductor AG	JP Morgan	(4.233)	11.183	Hochtief AG	Citibank	23.473
3.612	Evonik Industries AG	Barclays Bank	(4.000)	38.133	Hochtief AG	Barclays Bank	83.893
2.046	Evonik Industries AG	Goldman Sachs	(1.250)	4.844	Hochtief AG	Goldman Sachs	18.407
6.434	Evonik Industries AG	HSBC	(8.170)	7.479	Hochtief AG	HSBC	17.553
2.152	Evonik Industries AG	Citibank	(3.529)	6.097	Hochtief AG	JP Morgan	20.070
15.342	Evonik Industries AG	JP Morgan	(18.257)	1.805	Hornbach Holding AG		
4.292	Evotec AG	Goldman Sachs	10.771		& Co KGaA	Goldman Sachs	(542)
4.946	Fielmann AG	JP Morgan	(5.527)	5.004	Hugo Boss AG	Goldman Sachs	8.816
6.199	Fielmann AG	Barclays Bank	335	1.738	Hugo Boss AG	Citibank	2.289
1.157	Fielmann AG	Citibank	(1.562)	11.396	Hugo Boss AG	HSBC	20.880
10.323	Fielmann AG	Goldman Sachs	(729)	1.049	Hugo Boss AG	JP Morgan	(286)
13.204	Fielmann AG	HSBC	(1.417)	3.329	Hugo Boss AG	Barclays Bank	(2.131)
86	FinTech Group AG	Citibank	(378)	183	Hypoport AG	HSBC	(1.505)
334	Fraport AG Frankfurt Airport			373	Hypoport AG	Barclays Bank	406
	Services Worldwide	Goldman Sachs	(399)	304	Hypoport AG	Goldman Sachs	228
624	Fraport AG Frankfurt Airport			387	Hypoport AG	Morgan Stanley	(697)
	Services Worldwide	Barclays Bank	(944)	20.253	Infineon Technologies AG	Barclays Bank	798
5.503	Fraport AG Frankfurt Airport			1.792	Infineon Technologies AG	Citibank	(264)
	Services Worldwide	HSBC	(10.114)	15.207	Infineon Technologies AG	Goldman Sachs	(3.598)
4.067	Fraport AG Frankfurt Airport			12.990	Infineon Technologies AG	HSBC	688
	Services Worldwide	JP Morgan	(7.517)	23.958	Infineon Technologies AG	JP Morgan	(2.315)
(36.110)	Freenet AG	Morgan Stanley	35.827	(21.882)	Jenoptik AG	Barclays Bank	35.443
(86.616)	Freenet AG	Goldman Sachs	124.727	5.565	Jenoptik AG	HSBC	14.580
(2.344)	Freenet AG	JP Morgan	(68)	3.713	Jenoptik AG	JP Morgan	9.728
(3.666)	Freenet AG	Barclays Bank	1.576	5.372	Jenoptik AG	Barclays Bank	(9.132)
2.321	Fresenius Medical Care AG			31.829	Jenoptik AG	Goldman Sachs	(15.278)
	& Co KGaA	Barclays Bank	(238)	5.401	Jenoptik AG	Morgan Stanley	(9.182)
20.171	Fresenius Medical Care AG			3.809	JOST Werke AG	Barclays Bank	(6.856)
	& Co KGaA	Goldman Sachs	14.919	4.462	JOST Werke AG	Goldman Sachs	(2.454)
11.359	Fresenius Medical Care AG			3.067	JOST Werke AG	JP Morgan	(307)
	& Co KGaA	JP Morgan	10.530	2.439	JOST Werke AG	Morgan Stanley	(4.390)
352	Fresenius Medical Care AG			(1.242)	Jungheinrich AG (Pref)	Barclays Bank	3.155
	& Co KGaA	Citibank	(35)	(59.001)	Jungheinrich AG (Pref)	Goldman Sachs	109.323
3.593	Fresenius Medical Care AG			(46.001)	Jungheinrich AG (Pref)	HSBC	68.451
	& Co KGaA	HSBC	3.358	4.897	KION Group AG	Goldman Sachs	(9.327)
(8.815)	Fresenius SE & Co KGaA	Goldman Sachs	17.165	648	KION Group AG	Barclays Bank	(1.861)
(51.246)	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Goldman Sachs	2.721	168	KION Group AG	Morgan Stanley	(300)
(13.529)	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Barclays Bank	5.725	949	KION Group AG	JP Morgan	(3.130)
1.664	GEA Group AG	HSBC	(422)	8.413	KION Group AG	HSBC	(11.659)
(172.818)	GEA Group AG	Goldman Sachs	67.399	(1.158)	KION Group AG	HSBC	2.076
2.460	GEA Group AG	JP Morgan	177	464	Kloekner & Co SE	HSBC	23
1.236	Gerresheimer AG	JP Morgan	(1.092)	23.083	Kloekner & Co SE	JP Morgan	1.154
(723)	Grammer AG	Goldman Sachs	(9.688)	(379)	KUKA AG	Goldman Sachs	2.577

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Allemagne suite				Allemagne suite			
(2.687)	KWS Saat SE	Goldman Sachs	(28.214)	18.426	Qiagen NV	Goldman Sachs	29.113
(1.193)	Lanxess AG	Goldman Sachs	1.193	7.750	Qiagen NV	HSBC	14.850
1.860	Lanxess AG	Citibank	(4.762)	176.621	QSC AG	Goldman Sachs	(24.020)
3.159	LEG Immobilien AG	Barclays Bank	5.525	2.844	QSC AG	HSBC	(267)
4.184	LEG Immobilien AG	Goldman Sachs	3.712	8.260	Rheinmetall AG	Goldman Sachs	(16.648)
1.501	LEG Immobilien AG	Citibank	2.345	(3.147)	Rhoen-Klinikum AG	Barclays Bank	755
1.938	LEG Immobilien AG	JP Morgan	3.595	(54.057)	Rhoen-Klinikum AG	Goldman Sachs	21.623
163	LEG Immobilien AG	Morgan Stanley	206	1.844	RIB Software SE	Morgan Stanley	(616)
1.604	Leoni AG	Barclays Bank	(4.618)	3.271	RIB Software SE	Citibank	(2.290)
10.002	Leoni AG	Goldman Sachs	(6.658)	12.092	RIB Software SE	Goldman Sachs	(8.598)
2.033	Leoni AG	Citibank	(9.049)	8.696	RIB Software SE	HSBC	(15.817)
618	Leoni AG	HSBC	(567)	6.354	RIB Software SE	JP Morgan	(12.200)
1.466	Linde AG	Citibank	(4.498)	2.247	Rocket Internet SE '144A'	Barclays Bank	(1.573)
120	Linde AG	HSBC	59	23.720	Rocket Internet SE '144A'	Goldman Sachs	(7.361)
2.235	Linde AG	JP Morgan	776	4.414	Rocket Internet SE '144A'	Morgan Stanley	(362)
1.218	Linde AG	Barclays Bank	(5.846)	18.215	Rocket Internet SE '144A'	HSBC	7.089
3.655	Linde AG	Goldman Sachs	(12.244)	11.680	Rocket Internet SE '144A'	JP Morgan	(514)
(4.033)	Merck KGaA	HSBC	(24.324)	4.889	Rocket Internet SE '144A'	Citibank	(3.422)
(16.885)	Merck KGaA	Barclays Bank	(53.460)	(1.145)	RTL Group	Barclays Bank	1.117
(110.224)	Merck KGaA	Goldman Sachs	(465.045)	(3.330)	RTL Group	HSBC	19.612
(17.556)	Metro AG	Goldman Sachs	1.373	(18.216)	RTL Group	Goldman Sachs	111.901
1.078	MorphoSys AG	HSBC	278	(22.594)	RWE AG	Goldman Sachs	9.573
112	MorphoSys AG	JP Morgan	126	6.552	RWE AG	Goldman Sachs	(3.779)
(13.059)	MTU Aero Engines AG	Goldman Sachs	(78.858)	1.910	RWE AG	Barclays Bank	(754)
1.647	MTU Aero Engines AG	Barclays Bank	8.564	(33.414)	RWE AG	HSBC	9.764
4.002	MTU Aero Engines AG	Citibank	20.810	5.419	RWE AG	HSBC	(1.956)
2.917	MTU Aero Engines AG	Goldman Sachs	27.177	(160)	S&T AG	Morgan Stanley	6
2.142	MTU Aero Engines AG	HSBC	19.035	(3.053)	S&T AG	Barclays Bank	122
(479)	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG			4.886	S&T AG	Barclays Bank	510
	in Muenchen Reg	Barclays Bank	4.575	9.546	S&T AG	Citibank	2.275
(762)	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG			2.755	S&T AG	Morgan Stanley	1.262
	in Muenchen Reg	Goldman Sachs	6.295	544	S&T AG	HSBC	(317)
850	Nemetschek SE	Goldman Sachs	(7.055)	4.998	S&T AG	JP Morgan	(705)
487	Nemetschek SE	Barclays Bank	(2.532)	2.158	Salzgitter AG	Citibank	(4.819)
2.410	Nemetschek SE	Citibank	(12.532)	22.689	Salzgitter AG	Goldman Sachs	(50.944)
912	Nemetschek SE	JP Morgan	(5.563)	1.209	Salzgitter AG	HSBC	(4.956)
(1.443)	Nemetschek SE	Barclays Bank	6.687	20.951	Salzgitter AG	JP Morgan	(39.212)
(414)	Nemetschek SE	Goldman Sachs	1.092	124	Salzgitter AG	Barclays Bank	(240)
(18.049)	Norma Group SE	Goldman Sachs	52.342	1.054	SAP SE	Citibank	(567)
1.527	OSRAM Licht AG	Goldman Sachs	(2.790)	776	SAP SE	Barclays Bank	660
1.813	OSRAM Licht AG	Barclays Bank	(3.060)	1.580	SAP SE	HSBC	1.964
13.441	OSRAM Licht AG	JP Morgan	(3.158)	5.658	SAP SE	JP Morgan	1.096
(1.783)	OSRAM Licht AG	HSBC	308	570	Sartorius AG (Pref)	Goldman Sachs	(171)
12.460	PATRIZIA Immobilien AG	Goldman Sachs	6.230	(24.211)	Schaeffler AG (Pref)	Goldman Sachs	15.495
5.263	PATRIZIA Immobilien AG	JP Morgan	4.316	6.195	Schaeffler AG (Pref)	HSBC	(2.540)
4.896	PATRIZIA Immobilien AG	Barclays Bank	(4.113)	128.025	Schaeffler AG (Pref)	Goldman Sachs	(81.936)
3.961	PATRIZIA Immobilien AG	HSBC	3.248	(910)	Scout24 AG	Barclays Bank	(497)
(437)	Pfeiffer Vacuum Technology AG	JP Morgan	699	6.703	Scout24 AG '144A'	Citibank	(134)
(609)	Pfeiffer Vacuum Technology AG	Barclays Bank	(244)	14.738	Scout24 AG '144A'	Goldman Sachs	590
6.128	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Goldman Sachs	(26.371)	2.871	Siemens AG Reg	JP Morgan	(3.427)
1.118	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	HSBC	(3.011)	12.281	Siemens Healthineers AG	HSBC	4.058
2.523	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	JP Morgan	(11.852)	14.367	Siemens Healthineers AG	Barclays Bank	(3.808)
(13.034)	ProSiebenSat.1 Media SE	Citibank	18.639	2.072	Siemens Healthineers AG	Citibank	(10)
(6.464)	ProSiebenSat.1 Media SE	JP Morgan	4.170	24.060	Siemens Healthineers AG	JP Morgan	(4.574)
(7.760)	ProSiebenSat.1 Media SE	Goldman Sachs	35.688	25.890	Siemens Healthineers AG	Goldman Sachs	(11.611)
8	Puma SE	Citibank	4.072	572	Siltronic AG	Barclays Bank	(2.231)
197	Puma SE	Barclays Bank	4.329	1.743	Siltronic AG	Goldman Sachs	(11.242)
675	Puma SE	Goldman Sachs	56.779	(18.495)	Sixt Leasing SE	Goldman Sachs	14.124
517	Puma SE	HSBC	66.641	982	Software AG	Goldman Sachs	87
731	Puma SE	JP Morgan	58.563	414	Software AG	HSBC	(16)
13.946	Qiagen NV	Barclays Bank	12.591	(5.009)	Software AG	Goldman Sachs	8.465
2.980	Qiagen NV	Citibank	2.801	(29.762)	STRATEC Biomedical AG	Goldman Sachs	202.382
3.427	Qiagen NV	JP Morgan	7.052	(6.668)	Symrise AG	Barclays Bank	6.268
903	Qiagen NV	Morgan Stanley	849	(49.106)	Symrise AG	Goldman Sachs	61.874
				(2.228)	Symrise AG	HSBC	2.588
				(6.171)	TAG Immobilien AG	Barclays Bank	433
				(4.245)	TAG Immobilien AG	Goldman Sachs	(312)
				(3.806)	Takkt AG	Barclays Bank	(413)
				(9.948)	Takkt AG	Goldman Sachs	(6.765)
				(2.960)	Talanx AG	Barclays Bank	1.289
				(33.504)	Talanx AG	Goldman Sachs	50.998

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Allemagne suite				Allemagne suite			
1	Talanx AG	JP Morgan	(4)	444	Wirecard AG	Morgan Stanley	1.109
(1.614)	Technotrans AG	Goldman Sachs	968	(4.330)	Wirecard AG	Goldman Sachs	(24.316)
(97)	Technotrans AG	JP Morgan	199	135	XING SE	Barclays Bank	(945)
(137)	Tele Columbus AG	Barclays Bank	42	2.570	XING SE	Goldman Sachs	(8.995)
(38.787)	Tele Columbus AG	Morgan Stanley	3.641	927	XING SE	HSBC	3.244
(981)	Tele Columbus AG	Goldman Sachs	1.089	28	XING SE	Morgan Stanley	(69)
(9.630)	Tele Columbus AG	Citibank	2.985	(40.236)	Zalando SE '144A'	JP Morgan	(16.917)
2.783	Telefonica Deutschland Holding AG	Barclays Bank	(209)	29.040	Zeal Network SE	Goldman Sachs	1.873
1.205.612	Telefonica Deutschland Holding AG	Goldman Sachs	(377.357)	714	Zeal Network SE	Morgan Stanley	294
(44.410)	Telefonica Deutschland Holding AG	Barclays Bank	1.539	128	Zeal Network SE	Barclays Bank	51
(10.669)	Telefonica Deutschland Holding AG	Goldman Sachs	289	2.271	Zeal Network SE	HSBC	876
164.466	Telefonica Deutschland Holding AG	Citibank	(12.335)	(7.342)	zooplus AG	HSBC	62.407
26.366	Telefonica Deutschland Holding AG	HSBC	(9.738)				(642.808)
1.304	Telefonica Deutschland Holding AG	JP Morgan	(632)	Irlande			
(28.284)	Telefonica Deutschland Holding AG	HSBC	165	22.514	AIB GROUP Plc	Barclays Bank	(5.583)
(7.763)	thyssenkrupp AG	HSBC	1.239	22.073	AIB GROUP Plc	Citibank	(5.300)
(16.264)	thyssenkrupp AG	Barclays Bank	(312)	3.307	AIB GROUP Plc	Goldman Sachs	(688)
(42.053)	thyssenkrupp AG	Goldman Sachs	(1.878)	40.989	AIB GROUP Plc	HSBC	(12.452)
2.268	thyssenkrupp AG	JP Morgan	726	25.669	AIB GROUP Plc	JP Morgan	(2.732)
(82)	TLG Immobilien AG	HSBC	46	6.837	AIB GROUP Plc	Morgan Stanley	(1.308)
(8.202)	TLG Immobilien AG	Barclays Bank	8.202	(92.093)	Bank of Ireland Group Plc	Goldman Sachs	19.800
9.982	Tom Tailor Holding SE	JP Morgan	(7.237)	6.425	Dalata Hotel Group Plc	HSBC	(1.131)
24.271	Tom Tailor Holding SE	Barclays Bank	(16.262)	16.339	Dalata Hotel Group Plc	Barclays Bank	(2.287)
43.698	Tom Tailor Holding SE	Goldman Sachs	(26.219)	19.166	Dalata Hotel Group Plc	Goldman Sachs	(3.703)
20.758	Uniper SE	Citibank	(11.209)	29.860	Dalata Hotel Group Plc	Morgan Stanley	(4.180)
666	Uniper SE	JP Morgan	(109)	(194.075)	Glanbia Plc	Goldman Sachs	(317.017)
16.901	Uniper SE	HSBC	(7.098)	(36.850)	HIBERNIA Plc (Reit)	Goldman Sachs	1.930
2.240	United Internet AG Reg	Citibank	(602)	(19.711)	Irish Continental Group Plc (Unit)	Morgan Stanley	464
17.318	United Internet AG Reg	JP Morgan	(25.141)	6.351	Kerry Group Plc 'A'	Barclays Bank	10.092
3.603	United Internet AG Reg	Barclays Bank	(3.315)	10.426	Kerry Group Plc 'A'	Goldman Sachs	14.250
9.237	United Internet AG Reg	Goldman Sachs	(6.345)	788	Kerry Group Plc 'A'	Citibank	1.300
11.246	United Internet AG Reg	HSBC	(2.714)	5.225	Kerry Group Plc 'A'	JP Morgan	3.564
87	Varta AG	Goldman Sachs	(92)	2.297	Kerry Group Plc 'A'	HSBC	1.512
(2.405)	Volkswagen AG (Pref)	Goldman Sachs	27.880	(121.657)	Kingspan Group Plc	Goldman Sachs	72.994
(12.964)	Voltabox AG	Barclays Bank	12.453	2.546	Origin Enterprises Plc	Barclays Bank	357
(6.453)	Voltabox AG	Citibank	6.294	994	Origin Enterprises Plc	Goldman Sachs	229
(3.855)	Voltabox AG	JP Morgan	771	2.991	Origin Enterprises Plc	HSBC	649
(385)	Voltabox AG	Morgan Stanley	377	1.691	Origin Enterprises Plc	JP Morgan	271
34.522	Vonovia SE	Goldman Sachs	43.498	3.551	Paddy Power Betfair Plc	HSBC	88.420
1.085	Vonovia SE	Citibank	1.908	(22.152)	Paddy Power Betfair Plc	Goldman Sachs	(306.584)
5.043	Vonovia SE	HSBC	5.301	(11.530)	Ryanair Holdings Plc	Goldman Sachs	4.494
5.363	Vonovia SE	JP Morgan	7.628	3.713	Ryanair Holdings Plc	Barclays Bank	(1.671)
(20.358)	Vossloh AG	Goldman Sachs	(7.125)	10.452	Ryanair Holdings Plc	Goldman Sachs	7.818
(20.006)	Vossloh AG	HSBC	14.004	15.658	Ryanair Holdings Plc	Citibank	(7.046)
(12.225)	Vossloh AG	Morgan Stanley	4.890	15.293	Ryanair Holdings Plc	JP Morgan	9.108
5.769	Wacker Chemie AG	Goldman Sachs	(68.280)	10.744	Ryanair Holdings Plc	HSBC	7.831
123	Wacker Chemie AG	Morgan Stanley	(1.105)	4.304	Smurfit Kappa Group Plc	Barclays Bank	2.152
2.728	Wacker Chemie AG	Barclays Bank	(37.544)	6.731	Smurfit Kappa Group Plc	Goldman Sachs	(1.976)
1.129	Wacker Chemie AG	Citibank	(15.369)	3.436	Smurfit Kappa Group Plc	JP Morgan	147
4.520	Wacker Chemie AG	HSBC	(59.039)	4.398	Smurfit Kappa Group Plc	HSBC	(537)
890	Wacker Chemie AG	JP Morgan	(9.780)				(426.813)
22.067	Wacker Neuson SE	Goldman Sachs	(5.737)	Italie			
10.793	Wacker Neuson SE	HSBC	(12.736)	(235.605)	A2A SpA	HSBC	33.032
1.492	Washtec AG	Barclays Bank	(298)	(146.275)	A2A SpA	Barclays Bank	10.807
694	Washtec AG	Goldman Sachs	278	(184.459)	A2A SpA	Goldman Sachs	33.940
919	Washtec AG	HSBC	368	(2.141)	ACEA SpA	Barclays Bank	1.525
395	Washtec AG	JP Morgan	158	(1.693)	ACEA SpA	HSBC	1.452
68	Washtec AG	Morgan Stanley	(14)	(4.029)	ACEA SpA	Goldman Sachs	2.644
3.371	Wirecard AG	Citibank	14.190	(15.670)	Amplifon SpA	Goldman Sachs	16.767
396	Wirecard AG	JP Morgan	4.111	185	Amplifon SpA	HSBC	(165)
633	Wirecard AG	HSBC	3.062	19.096	Amplifon SpA	JP Morgan	(16.995)
1.052	Wirecard AG	Barclays Bank	6.470	12.401	Amplifon SpA	Barclays Bank	(1.984)
228	Wirecard AG	Goldman Sachs	1.892	255.315	Amplifon SpA	Goldman Sachs	(273.187)
				(6.537)	Amplifon SpA	Barclays Bank	1.046
				15.112	Amplifon SpA	Citibank	(2.418)
				(14.678)	Amplifon SpA	HSBC	13.063
				8.685	Anima Holding SpA '144A'	Citibank	(7.226)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Italie suite				Italie suite			
18.462	Anima Holding SpA '144A'	Barclays Bank	(15.360)	40.600	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	Goldman Sachs	(64.960)
25.709	Anima Holding SpA '144A'	Goldman Sachs	(32.445)	14.226	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	HSBC	(26.318)
1.912	Anima Holding SpA '144A'	Morgan Stanley	(2.206)	16.709	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	Morgan Stanley	(34.253)
82.551	Anima Holding SpA '144A'	HSBC	(107.481)	(13.960)	Datalogic SpA	Goldman Sachs	9.772
31.000	Anima Holding SpA '144A'	JP Morgan	(39.669)	(920)	Datalogic SpA	Barclays Bank	(368)
(210.366)	Ansaldo STS SpA	Goldman Sachs	(8.415)	(1.265)	Davide Campari-Milano SpA	Barclays Bank	(70)
(21.401)	Arnoldo Mondadori Editore SpA	Barclays Bank	2.785	(19.853)	Davide Campari-Milano SpA	HSBC	(353)
(353.640)	Arnoldo Mondadori Editore SpA	Goldman Sachs	110.509	(824.024)	Davide Campari-Milano SpA	Goldman Sachs	(27.127)
(46.592)	Arnoldo Mondadori Editore SpA	HSBC	14.841	(7.594)	DiaSorin SpA	Goldman Sachs	(11.771)
12.720	Assicurazioni Generali SpA	Barclays Bank	(11.384)	(14.933)	DiaSorin SpA	Barclays Bank	(7.518)
65.049	Assicurazioni Generali SpA	Goldman Sachs	(139.530)	(3.610)	DiaSorin SpA	HSBC	(15.343)
7.159	Atlantia SpA	HSBC	1.743	63	El.En. SpA	Barclays Bank	(39)
11.887	Autogrill SpA	Citibank	1.257	1.323	El.En. SpA	Morgan Stanley	(820)
2.655	Autogrill SpA	JP Morgan	123	483	El.En. SpA	HSBC	(2.009)
15.730	Autogrill SpA	Barclays Bank	(3.253)	3.139	Enel SpA	Goldman Sachs	88
(27.295)	Azimut Holding SpA	Goldman Sachs	20.853	104.422	Enel SpA	Barclays Bank	(113)
(45.490)	Azimut Holding SpA	Citibank	2.458	47.424	Eni SpA	Goldman Sachs	(53.772)
(24.860)	Azimut Holding SpA	JP Morgan	34.224	10.526	Eni SpA	HSBC	6.289
(16.779)	Azimut Holding SpA	Barclays Bank	14.050	31.205	Eni SpA	JP Morgan	(10.921)
(40.947)	Azimut Holding SpA	HSBC	73.001	1.397	ERG SpA	HSBC	(4.111)
(25.999)	Azimut Holding SpA	Morgan Stanley	18.423	2.094	ERG SpA	Barclays Bank	(2.282)
(393)	Banca Farmafactoring SpA '144A'	HSBC	(11)	(28.329)	ERG SpA	Barclays Bank	27.826
(88.994)	Banca Farmafactoring SpA '144A'	Goldman Sachs	(4.991)	(21.482)	ERG SpA	Goldman Sachs	40.511
10.433	Banca Generali SpA	Goldman Sachs	(57.382)	(44.381)	ERG SpA	HSBC	91.295
(6.298)	Banca Generali SpA	Goldman Sachs	34.639	17.355	Esprinet SpA	Barclays Bank	(7.376)
15.768	Banca Generali SpA	JP Morgan	(96.185)	1.097	Esprinet SpA	Goldman Sachs	(516)
(4.227)	Banca Generali SpA	Barclays Bank	12.596	1.815	Esprinet SpA	Morgan Stanley	(771)
(2.827)	Banca IFIS SpA	Goldman Sachs	25.669	8.111	Esprinet SpA	JP Morgan	(5.151)
(4.804)	Banca IFIS SpA	HSBC	47.881	62.772	Falck Renewables SpA	Barclays Bank	(16.007)
(6.055)	Banca IFIS SpA	Barclays Bank	30.033	128.789	Falck Renewables SpA	Goldman Sachs	(41.856)
(373.835)	Banca Mediolanum SpA	Barclays Bank	31.481	65.832	Falck Renewables SpA	HSBC	(8.558)
(193.006)	Banca Mediolanum SpA	Goldman Sachs	79.786	63.071	Falck Renewables SpA	JP Morgan	(8.199)
(155.527)	Banca Mediolanum SpA	HSBC	100.507	40.480	Falck Renewables SpA	Morgan Stanley	(10.322)
(121.501)	Banco BPM SpA	Goldman Sachs	101.453	2.178	Ferrari NV	Barclays Bank	(2.769)
87.317	Banco BPM SpA	HSBC	(14.267)	3.934	Ferrari NV	Citibank	(1.720)
29.585	Banco BPM SpA	Barclays Bank	(11.050)	2.974	Ferrari NV	Goldman Sachs	(2.457)
(52.712)	Banco BPM SpA	JP Morgan	40.904	3.150	Ferrari NV	HSBC	(5.887)
2.842	Biesse SpA	Goldman Sachs	(7.670)	454	Ferrari NV	JP Morgan	(899)
5.424	Biesse SpA	Morgan Stanley	(16.489)	68.326	Fiat Chrysler Automobiles NV	Goldman Sachs	52.053
4.145	Biesse SpA	JP Morgan	(24.663)	(2.832)	Fiat Chrysler Automobiles NV	Goldman Sachs	(1.518)
(1.000)	Bio On SpA	Barclays Bank	(2.200)	14.664	Fiat Chrysler Automobiles NV	HSBC	9.686
(250)	Bio On SpA	Goldman Sachs	(400)	(17.129)	Fila SpA	HSBC	29.566
(2.500)	Bio On SpA	HSBC	(5.557)	(32.955)	Fila SpA	Citibank	27.682
(12.750)	Bio On SpA	Morgan Stanley	(28.050)	(39.168)	Fila SpA	Goldman Sachs	57.969
24.661	BPER Banca	Barclays Bank	(1.153)	(18.026)	Fila SpA	Morgan Stanley	15.142
6.176	BPER Banca	HSBC	(142)	(11.608)	Fila SpA	JP Morgan	22.795
(4.384)	Brembo SpA	Goldman Sachs	(745)	(52.699)	Fincantieri SpA	HSBC	2.246
(48.816)	Brembo SpA	HSBC	9.583	66.832	Fincantieri SpA	Goldman Sachs	(2.540)
(12.402)	Brembo SpA	Barclays Bank	(1.862)	8.250	Fincantieri SpA	JP Morgan	(270)
971	Brunello Cucinelli SpA	Barclays Bank	1.411	31.734	Fincantieri SpA	Morgan Stanley	(857)
1.542	Brunello Cucinelli SpA	Goldman Sachs	4.580	(19.303)	Fincantieri SpA	Goldman Sachs	25
1.783	Brunello Cucinelli SpA	HSBC	5.724	52.876	FinecoBank Banca Fineco SpA	Goldman Sachs	(63.451)
2.157	Brunello Cucinelli SpA	Morgan Stanley	6.013	12.514	FinecoBank Banca Fineco SpA	JP Morgan	(16.018)
(28.145)	Buzzi Unicem SpA	Goldman Sachs	47.002	734	Gima TT SpA '144A'	Barclays Bank	110
(1.068)	Buzzi Unicem SpA	HSBC	1.784	1.918	Gima TT SpA '144A'	Morgan Stanley	288
(20.947)	Cairo Communication SpA	Morgan Stanley	3.770	7.160	Gima TT SpA '144A'	Goldman Sachs	(6.408)
(6.702)	Cairo Communication SpA	Citibank	1.206	1.657	Gima TT SpA '144A'	HSBC	(1.408)
(9.413)	Cairo Communication SpA	Goldman Sachs	3.765	2.948	Gima TT SpA '144A'	JP Morgan	(2.506)
(739)	Cairo Communication SpA	HSBC	395	165.076	Hera SpA	Barclays Bank	(36.647)
(27.191)	Cairo Communication SpA	JP Morgan	9.857	1.602.444	Hera SpA	Goldman Sachs	(535.216)
4.082	Cementir Holding SpA	JP Morgan	(2.817)	70.426	Hera SpA	JP Morgan	(29.156)
3.404	Cementir Holding SpA	Barclays Bank	(613)	151	IMA Industria Macchine Automatiche SpA	Citibank	219
10.144	Cementir Holding SpA	Goldman Sachs	(5.072)	847	IMA Industria Macchine Automatiche SpA	Barclays Bank	1.228
(60.161)	CNH Industrial NV	Goldman Sachs	27.336	1.847	IMA Industria Macchine Automatiche SpA	Goldman Sachs	(5.356)
(13.868)	CNH Industrial NV	Barclays Bank	11.336				
(2.807)	CNH Industrial NV	HSBC	1.284				
5.106	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	Barclays Bank	(9.957)				

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Italie suite				Italie suite			
5.222	IMA Industria Macchine Automatiche SpA	HSBC	(6.005)	(245.025)	Salini Impregilo SpA	Goldman Sachs	53.415
2.636	IMA Industria Macchine Automatiche SpA	JP Morgan	(3.031)	46.571	Saras SpA	Barclays Bank	(419)
(5.072)	Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA (Reit)	JP Morgan	3.302	38.761	Saras SpA	Citibank	(349)
(5.373)	Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA (Reit)	Goldman Sachs	3.981	15.437	Saras SpA	HSBC	(2.223)
(7.720)	Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA (Reit)	HSBC	5.026	103.042	Saras SpA	JP Morgan	(14.838)
24.227	Interpump Group SpA	Goldman Sachs	(30.526)	(7.141)	Snam SpA	Barclays Bank	110
117.590	Intesa Sanpaolo SpA	JP Morgan	(74.736)	(35.127)	Snam SpA	HSBC	(2.576)
314.982	Intesa Sanpaolo SpA	Goldman Sachs	(214.188)	14.719	Societa Cattolica di Assicurazioni SC	Goldman Sachs	(18.031)
367.252	Intesa Sanpaolo SpA	HSBC	(1.690)	16.446	Societa Cattolica di Assicurazioni SC	HSBC	(20.738)
29.657	Iren SpA	Goldman Sachs	(9.253)	38.748	Societa Cattolica di Assicurazioni SC	JP Morgan	(47.959)
(108.556)	Italgas SpA	Goldman Sachs	69.042	20.660	Societa Cattolica di Assicurazioni SC	Citibank	(14.359)
(12.886)	Italgas SpA	HSBC	8.943	136.551	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	Goldman Sachs	(461.542)
(76.247)	Juventus Football Club SpA	HSBC	3.850	(27.548)	Sogefi SpA	Morgan Stanley	7.273
32.945	La Doria SpA	Goldman Sachs	(19.767)	(19.767)	Sogefi SpA	Goldman Sachs	5.574
(4.541)	Leonardo SpA	Barclays Bank	183	(68.530)	Tamburi Investment Partners SpA	Goldman Sachs	30.153
(22.461)	Leonardo SpA	Goldman Sachs	10.919	44.656	Tamburi Investment Partners SpA (Wts 30/6/2020)	Barclays Bank	(5.564)
1.753	Maire Tecnimont SpA	Barclays Bank	(6)	57.913	Tamburi Investment Partners SpA (Wts 30/6/2020)	Goldman Sachs	(15.324)
8.839	Maire Tecnimont SpA	Goldman Sachs	(4.207)	42.843	Tamburi Investment Partners SpA (Wts 30/6/2020)	Morgan Stanley	(5.338)
35.222	Maire Tecnimont SpA	HSBC	(20.358)	10.490	Technogym SpA '144A'	JP Morgan	(5.840)
42.434	Maire Tecnimont SpA	JP Morgan	(24.527)	16.997	Technogym SpA '144A'	Barclays Bank	(8.499)
4.483	MARR SpA	Barclays Bank	33	19.488	Technogym SpA '144A'	Goldman Sachs	(9.744)
2.336	MARR SpA	Goldman Sachs	(80)	19.191	Technogym SpA '144A'	HSBC	(10.555)
1.611	MARR SpA	Morgan Stanley	(764)	9.618	Technogym SpA '144A'	Morgan Stanley	(4.809)
3.266	MARR SpA	JP Morgan	(3.940)	(567.586)	Telecom Italia SpA/Milano	Barclays Bank	22.136
(75.557)	Mediaset SpA	Goldman Sachs	36.645	(167.905)	Telecom Italia SpA/Milano	HSBC	19.201
(38.678)	Mediaset SpA	HSBC	17.985	(917.220)	Telecom Italia SpA/Milano	Goldman Sachs	85.668
79.889	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	JP Morgan	(136.521)	274.908	Telecom Italia SpA/Milano	Goldman Sachs	(25.676)
777.637	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Goldman Sachs	(1.103.059)	(93.804)	Telecom Italia SpA/Milano	JP Morgan	11.613
2.764	Mediobanca SpA	Citibank	98	428.278	Telecom Italia SpA/Milano	HSBC	(24.639)
118.568	Mediobanca SpA	HSBC	(145.684)	(36.453)	Tenaris SA	Goldman Sachs	19.685
57.602	Mediobanca SpA	Barclays Bank	(46.855)	(7.159)	Tenaris SA	Barclays Bank	8.841
84.549	Moncler SpA	Goldman Sachs	139.022	(13.186)	Tenaris SA	HSBC	4.252
38.819	Moncler SpA	Citibank	55.511	(112.745)	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Goldman Sachs	40.250
20.324	Moncler SpA	JP Morgan	23.233	(179.657)	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Barclays Bank	48.328
23.855	Moncler SpA	Barclays Bank	28.919	(5.818)	Tod's SpA	Morgan Stanley	6.982
275	Moncler SpA	Morgan Stanley	393	(6.126)	Tod's SpA	HSBC	4.420
15.784	Moncler SpA	HSBC	34.580	35.279	UniCredit SpA	Goldman Sachs	(103.364)
(417.623)	OVS SpA '144A'	Goldman Sachs	290.341	28.472	UniCredit SpA	JP Morgan	(83.068)
(60.478)	OVS SpA '144A'	HSBC	38.799	12.363	Unieuro SpA '144A'	Goldman Sachs	(16.443)
(12.320)	OVS SpA '144A'	Barclays Bank	5.667	6.161	Unieuro SpA '144A'	JP Morgan	(7.024)
18.429	Piaggio & C SpA	Goldman Sachs	(1.990)	6.682	Unieuro SpA '144A'	HSBC	(7.617)
20.146	Pirelli & C SpA	JP Morgan	(1.498)	(1.072.847)	Unione di Banche Italiane SpA	Goldman Sachs	1.285.979
21.681	Pirelli & C SpA '144A'	Goldman Sachs	(2.590)	99.488	Unipol Gruppo SpA	Barclays Bank	(17.701)
(19.644)	Poste Italiane SpA '144A'	Goldman Sachs	15.558	2.786	Unipol Gruppo SpA	Morgan Stanley	(1.025)
(59.566)	Poste Italiane SpA '144A'	HSBC	9.445	55.766	Unipol Gruppo SpA	Citibank	(16.409)
5.641	Prysmian SpA	JP Morgan	(10.097)	77.163	Unipol Gruppo SpA	HSBC	(31.650)
4.280	Prysmian SpA	Barclays Bank	(6.934)	111.884	Unipol Gruppo SpA	JP Morgan	(43.460)
11.551	Prysmian SpA	Goldman Sachs	(27.953)	151.746	Unipol Gruppo SpA	Goldman Sachs	(77.759)
2.772	Prysmian SpA	Citibank	(4.491)	(61.130)	UnipolSai Assicurazioni SpA	JP Morgan	9.295
18.710	Prysmian SpA	HSBC	(33.491)	(237.215)	UnipolSai Assicurazioni SpA	HSBC	47.826
5.538	RAI Way SpA '144A'	Goldman Sachs	(2.547)	(16.170)	UnipolSai Assicurazioni SpA	Barclays Bank	(384)
1.167	RAI Way SpA '144A'	Barclays Bank	61				(975.611)
588	RAI Way SpA '144A'	HSBC	(318)	Pays-Bas			
1.853	RAI Way SpA '144A'	Morgan Stanley	46	(4.510)	Aalberts Industries NV	Goldman Sachs	(1.353)
(12.453)	Recordati SpA	Goldman Sachs	(10.167)	42.592	Aalberts Industries NV	Goldman Sachs	12.778
(8.667)	Recordati SpA	Barclays Bank	1.905	(42.312)	ABN AMRO Group NV- CVA '144A'	Barclays Bank	77.535
(12.638)	Recordati SpA	HSBC	658				
208	Reply SpA	HSBC	501				
(86.509)	Rizzoli Corriere Della Sera Mediagroup SpA	Goldman Sachs	4.498				
(29.200)	Safilo Group SpA	Morgan Stanley	5.986				
(305.605)	Saipem SpA	Goldman Sachs	58.177				
(40.642)	Saipem SpA	HSBC	(2.582)				
(147.941)	Salini Impregilo SpA	HSBC	29.060				

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Pays-Bas suite				Pays-Bas suite			
(7.916)	ABN AMRO Group NV- CVA '144A'	HSBC	6.007	(337)	Fugro NV - CVA	JP Morgan	(263)
(18.920)	ABN AMRO Group NV- CVA '144A'	Goldman Sachs	34.749	(1.729)	Fugro NV - CVA	Morgan Stanley	622
(41.470)	Accell Group	Goldman Sachs	(261)	(146)	Galapagos NV	Goldman Sachs	(1.104)
(1.939)	Accell Group	HSBC	185	(7.979)	GrandVision NV '144A'	Barclays Bank	4.149
(474)	Accell Group	Barclays Bank	161	(47.825)	GrandVision NV '144A'	Goldman Sachs	30.608
(44.526)	Aegon NV	Goldman Sachs	23.248	(30.845)	Heineken NV	Goldman Sachs	27.144
(30.379)	Aegon NV	Barclays Bank	1.280	1.800	Heineken NV	Citibank	(345)
(15.677)	Aegon NV	HSBC	7.130	9.593	Heineken NV	HSBC	1.136
(1.026)	Akzo Nobel NV	Barclays Bank	1.389	4.787	Heineken NV	Barclays Bank	2.585
(46.119)	Akzo Nobel NV	Goldman Sachs	(115.576)	8.261	Heineken NV	Goldman Sachs	(3.707)
(1.607)	Akzo Nobel NV	HSBC	2.184	(4.658)	IMCD NV	Barclays Bank	5.124
4.210	Altice NV	Goldman Sachs	24.721	(9.434)	IMCD NV	Goldman Sachs	6.132
(16.364)	Altice NV	Goldman Sachs	(96.089)	73.656	ING Groep NV	Goldman Sachs	(68.500)
(126.928)	Altice NV	HSBC	(745.321)	(47.424)	Intertrust NV '144A'	Goldman Sachs	151
(16.364)	Altice NV 'A'	Goldman Sachs	78.662	(7.800)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Barclays Bank	474
(126.928)	Altice NV 'A'	HSBC	586.730	(64.307)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Goldman Sachs	5.659
136	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Citibank	103	(47.486)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	HSBC	(7.607)
(1.875)	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Barclays Bank	4.256	9.428	Koninklijke BAM Groep NV	Goldman Sachs	(1.141)
1.934	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Barclays Bank	2.540	18.212	Koninklijke BAM Groep NV	HSBC	(226)
4.385	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Goldman Sachs	9.999	15.975	Koninklijke BAM Groep NV	JP Morgan	(34)
751	AMG Advanced Metallurgical Group NV	JP Morgan	1.090	5.213	Koninklijke DSM NV	Barclays Bank	(13.237)
(4.712)	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Goldman Sachs	(11.026)	42.015	Koninklijke DSM NV	Goldman Sachs	(60.502)
744	Aperam SA	Citibank	(764)	594	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	215
1.452	Aperam SA	Barclays Bank	(517)	2.654	Koninklijke DSM NV	HSBC	1.593
5.031	Aperam SA	Goldman Sachs	(10.547)	7.620	Koninklijke DSM NV	JP Morgan	457
16.318	Aperam SA	JP Morgan	(14.569)	28.418	Koninklijke DSM NV	Citibank	(78.434)
(48.833)	Arcadis NV	Goldman Sachs	(23.033)	408.595	Koninklijke KPN NV	Goldman Sachs	(39.218)
(712)	Arcadis NV	Barclays Bank	(411)	43.009	Koninklijke KPN NV	Citibank	(3.327)
(487)	Arcadis NV	HSBC	(385)	366.548	Koninklijke KPN NV	HSBC	(47.785)
(4.215)	ArcelorMittal	Barclays Bank	4.467	88.583	Koninklijke KPN NV	JP Morgan	(6.634)
(27.560)	ArcelorMittal	Goldman Sachs	61.441	6.768	Koninklijke KPN NV	Morgan Stanley	(602)
(7.017)	ArcelorMittal	HSBC	11.943	264.292	Koninklijke KPN NV	Barclays Bank	(23.522)
(1.239)	ASM International NV	Goldman Sachs	2.130	6.652	Koninklijke Philips NV	Citibank	(7.184)
(5.874)	ASM International NV	HSBC	9.074	32.579	Koninklijke Philips NV	JP Morgan	(11.714)
(11.052)	ASM International NV	Barclays Bank	25.921	21.939	Koninklijke Philips NV	Goldman Sachs	(3.338)
769	ASML Holding NV	JP Morgan	5.575	35.880	Koninklijke Philips NV	HSBC	(5.905)
3.178	ASML Holding NV	Goldman Sachs	3.019	7.150	Koninklijke Philips NV	Barclays Bank	(3.938)
2.993	ASML Holding NV	HSBC	16.023	1.069	Koninklijke Volkerwessels NV	JP Morgan	(1.695)
(10.989)	ASR Nederland NV	HSBC	13.399	645	Koninklijke Volkerwessels NV	Barclays Bank	(100)
(42.566)	ASR Nederland NV	Barclays Bank	87.961	3.961	Koninklijke Volkerwessels NV	Goldman Sachs	(6.179)
(38.494)	ASR Nederland NV	Goldman Sachs	82.068	(1.362)	Koninklijke Vopak NV	HSBC	(639)
(56.014)	Basic-Fit NV '144A'	Goldman Sachs	(117.629)	818	NN Group NV	Citibank	(103)
(4.420)	BE Semiconductor Industries NV	Barclays Bank	9.110	7.639	NN Group NV	Goldman Sachs	(12.628)
(2.535)	BE Semiconductor Industries NV	Goldman Sachs	7.104	2.996	NN Group NV	HSBC	(1.818)
(3.723)	BE Semiconductor Industries NV	HSBC	6.102	830	NSI NV (Reit)	Barclays Bank	(747)
1.711	BE Semiconductor Industries NV	JP Morgan	(4.277)	894	NSI NV (Reit)	Morgan Stanley	(894)
(235.770)	BinckBank NV	Goldman Sachs	47.154	(17.900)	OCI NV	Goldman Sachs	34
1.165	Boskalis Westminster	Barclays Bank	338	5.024	OCI NV	HSBC	1.337
(279.696)	Boskalis Westminster	Goldman Sachs	33.564	89.679	PostNL NV	JP Morgan	(12.274)
(3.172)	Boskalis Westminster	Barclays Bank	1.110	63.873	PostNL NV	Goldman Sachs	(5.981)
(728)	Flow Traders '144A'	Goldman Sachs	(1.896)	(29.429)	Randstad NV	Goldman Sachs	62.978
(2.507)	Flow Traders '144A'	Barclays Bank	(6.420)	(7.598)	Randstad NV	Barclays Bank	21.274
17.935	ForFarmers NV	Barclays Bank	(6.815)	(2.821)	RELX NV	Barclays Bank	(762)
5.724	ForFarmers NV	HSBC	(1.510)	(11.213)	SBM Offshore NV	HSBC	4.710
106.327	ForFarmers NV	Goldman Sachs	(36.151)	(17.658)	SBM Offshore NV	Goldman Sachs	12.184
15.913	ForFarmers NV	JP Morgan	(4.117)	(2.280)	SBM Offshore NV	Barclays Bank	2.383
2.131	ForFarmers NV	Morgan Stanley	(810)	(24.659)	Signify NV '144A'	Barclays Bank	17.991
(87.573)	Fugro NV - CVA	HSBC	(68.307)	(94.798)	Signify NV '144A'	Goldman Sachs	87.074
(101.862)	Fugro NV - CVA	Goldman Sachs	(45.050)	(17.773)	Signify NV '144A'	HSBC	16.237
				(10.089)	Takeaway.com NV '144A'	Goldman Sachs	(26.736)
				10.216	TKH Group NV - CVA	Goldman Sachs	511
				26.271	TomTom NV	Barclays Bank	(370)
				188.399	TomTom NV	Goldman Sachs	(37.528)
				6.590	TomTom NV	Citibank	(2.267)
				17.514	TomTom NV	HSBC	2.213
				7.203	TomTom NV	JP Morgan	1.022
				(1.477)	Unibail-Rodamco SE (Reit)	Goldman Sachs	6.203
				2.891	Unilever NV - CVA	Citibank	(296)
				2.315	Unilever NV - CVA	Goldman Sachs	(397)
				1.952	Vastned Retail NV (Reit)	Morgan Stanley	(976)
				5.436	Vastned Retail NV (Reit)	Goldman Sachs	1.631

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes				Plus-values/ (moins-values) latentes			
Nombre	Description	Contrepartie	EUR	Nombre	Description	Contrepartie	EUR
Pays-Bas suite				Norvège suite			
2.186	Vastned Retail NV (Reit)	HSBC	–	48.401	Marine Harvest ASA	Goldman Sachs	(25.365)
892	Volkerwessels NV	HSBC	(1.588)	34.642	Marine Harvest ASA	JP Morgan	(38.797)
2.170	Volkerwessels NV	Morgan Stanley	(1.996)	1.011	Nordic Semiconductor ASA	Goldman Sachs	(125)
(10.994)	Wereldhave NV (Reit)	Goldman Sachs	3.535	(15.235)	Norsk Hydro ASA	JP Morgan	(3.227)
(1.190)	Wereldhave NV (Reit)	HSBC	585	(16.369)	Norsk Hydro ASA	Citibank	(2.121)
(6.501)	Wereldhave NV (Reit)	Barclays Bank	1.569	1.113	Norway Royal Salmon ASA	HSBC	(161)
(30.125)	Wessanen	Barclays Bank	(13.016)	(112.475)	Norwegian Finance Holding AS	Goldman Sachs	(1.768)
(22.937)	Wessanen	Goldman Sachs	(10.697)	(63.990)	Ocean Yield ASA	Morgan Stanley	(10.731)
(14.039)	Wessanen	HSBC	(4.606)	(48.768)	Ocean Yield ASA	Goldman Sachs	(6.645)
1.834	Wolters Kluwer NV	Barclays Bank	2.237	(3.427)	Ocean Yield ASA	Citibank	359
16.849	Wolters Kluwer NV	Goldman Sachs	23.961	(17.740)	Ocean Yield ASA	JP Morgan	(4.462)
1.096	Wolters Kluwer NV	Citibank	1.699	(16.024)	Orkla ASA	Barclays Bank	(504)
			(185.727)	(249.983)	Orkla ASA	Goldman Sachs	(4.788)
Norvège				(78.221)	Orkla ASA	Citibank	269
14.089	Aker BP ASA	Goldman Sachs	(1.181)	(29.624)	Orkla ASA	HSBC	(1.959)
9.030	Aker BP ASA	JP Morgan	15.711	(9.454)	Orkla ASA	JP Morgan	(308)
30.501	Aker Solutions ASA	Barclays Bank	(2.409)	(2.228)	Petroleum Geo-Services ASA	Morgan Stanley	390
122.653	Aker Solutions ASA	Goldman Sachs	(25.490)	(8.119)	Petroleum Geo-Services ASA	JP Morgan	1.999
3.712	Aker Solutions ASA	Morgan Stanley	562	(17.133)	Protector Forsikring ASA	Barclays Bank	3.609
10.429	Aker Solutions ASA	Citibank	(1.315)	(303.675)	REC Silicon ASA	Goldman Sachs	3.563
40.273	Aker Solutions ASA	JP Morgan	7.214	(17.811)	Salmar ASA	Goldman Sachs	35.515
19.837	Aker Solutions ASA	HSBC	(3.378)	(1.256)	Salmar ASA	HSBC	2.990
(226)	Asetek A/S	Goldman Sachs	88	(6.273)	Salmar ASA	Citibank	(2.705)
(2.534)	Asetek A/S	Barclays Bank	1.062	(9.104)	Sbanken ASA	Citibank	(3.435)
(41.360)	Asetek A/S	Citibank	17.340	(2.082)	Schibsted ASA 'A'	Citibank	(660)
38.121	Atea ASA	Goldman Sachs	(3.196)	(1.093)	Schibsted ASA 'A'	JP Morgan	317
4.215	Austevoll Seafood ASA	JP Morgan	(500)	(1.179)	SpareBank 1 SMN	Citibank	27
2.476	B2 Holding ASA	Barclays Bank	(101)	29.984	Stolt-Nielsen Ltd	Goldman Sachs	11.313
1.230	B2 Holding ASA	HSBC	(97)	97.526	Storebrand ASA	Citibank	(15.128)
29.504	B2 Holding ASA	Goldman Sachs	(1.979)	6.019	Storebrand ASA	Barclays Bank	(318)
15.070	B2 Holding ASA	Morgan Stanley	132	323.425	Storebrand ASA	Goldman Sachs	(43.390)
(3.567)	Bakkafrost P/F	Citibank	(301)	82.959	Storebrand ASA	JP Morgan	(14.220)
(2.177)	Bakkafrost P/F	JP Morgan	4.871	(13.258)	Subsea 7 SA	HSBC	4.559
(52.532)	Borregaard ASA	Citibank	(12.664)	(42.197)	Subsea 7 SA	JP Morgan	6.134
(21.573)	BW LPG Ltd '144A'	Barclays Bank	(9.384)	(108.617)	Subsea 7 SA	Citibank	31.002
(135.372)	BW LPG Ltd '144A'	Morgan Stanley	(49.943)	43.835	Telenor ASA	Barclays Bank	(4.742)
30.788	BW Offshore Ltd	JP Morgan	(3.388)	13.628	Telenor ASA	Citibank	1.283
29.687	BW Offshore Ltd	Goldman Sachs	(19.291)	40.738	Telenor ASA	Goldman Sachs	2.944
(11.161)	DNB ASA	Citibank	9.885	20.838	Telenor ASA	HSBC	(3.111)
(8.105)	DNB ASA	JP Morgan	6.675	21.012	Telenor ASA	JP Morgan	1.510
(11.159)	DNO ASA	Goldman Sachs	443	1.865	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Goldman Sachs	39
(179.896)	DNO ASA	Morgan Stanley	(3.192)	15.785	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Citibank	(6.614)
7.242	Elkem ASA '144A'	Barclays Bank	(1.236)	5.459	TGS Nopec Geophysical Co ASA	JP Morgan	3.824
3.197	Elkem ASA '144A'	Morgan Stanley	(506)	1.985	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Morgan Stanley	357
3.524	Entra ASA	Goldman Sachs	74	(8.747)	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Goldman Sachs	(183)
(3.373)	Equinor ASA	Citibank	(3.507)	6.550	TGS Nopec Geophysical Co ASA	HSBC	8.444
(3.749)	Equinor ASA	Goldman Sachs	2.515	(14.706)	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Barclays Bank	8.323
(8.497)	Equinor ASA	JP Morgan	882	(12.478)	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Citibank	7.062
(4.009)	Equinor ASA	HSBC	962	(8.041)	TGS Nopec Geophysical Co ASA	JP Morgan	(10.366)
13.773	Europris ASA '144A'	Goldman Sachs	(1.018)	(65.898)	Veidekke ASA	Goldman Sachs	(16.606)
10.583	Europris ASA '144A'	JP Morgan	(240)	(171.458)	Veidekke ASA	Barclays Bank	(46.724)
(4.403)	Gjensidige Forsikring ASA	Barclays Bank	(277)	(14.221)	Veidekke ASA	Citibank	(3.647)
(420.262)	Gjensidige Forsikring ASA	Citibank	(25.280)	(6.334)	Veidekke ASA	JP Morgan	(2.456)
(10.238)	Gjensidige Forsikring ASA	HSBC	1.180	(104.398)	XXL ASA	Goldman Sachs	(2.188)
(77.717)	Gjensidige Forsikring ASA	JP Morgan	8.960	(52.857)	XXL ASA	Citibank	6.094
5.052	Golden Ocean Group Ltd	Barclays Bank	1.956	(68.183)	Yara International ASA	Citibank	3.991
4.200	Golden Ocean Group Ltd	Goldman Sachs	1.289	(32.781)	Yara International ASA	JP Morgan	25.537
8.941	Kongsberg Gruppen ASA	Goldman Sachs	(11.320)	(550)	Yara International ASA	HSBC	354
3.590	Kongsberg Gruppen ASA	HSBC	(10.208)	(18.909)	Yara International ASA	Goldman Sachs	12.287
2.385	Kongsberg Gruppen ASA	JP Morgan	(7.574)				(267.002)
427	Kongsberg Gruppen ASA	Morgan Stanley	(1.224)				
5.050	Kongsberg Gruppen ASA	Barclays Bank	318				
103.808	Kvaerner ASA	Barclays Bank	(11.315)				
295.286	Kvaerner ASA	Goldman Sachs	(25.997)				
19.149	Kvaerner ASA	Morgan Stanley	923				
92.971	Kvaerner ASA	HSBC	7.411				
11.424	Leroy Seafood Group ASA	Barclays Bank	(1.772)				
72.837	Leroy Seafood Group ASA	Goldman Sachs	(19.085)				
15.956	Leroy Seafood Group ASA	HSBC	(5.728)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Portugal				Espagne suite			
165.512	Altri SGPS SA	Goldman Sachs	184.747	(3.446)	Applus Services SA	HSBC	468
(2.125.747)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	Barclays Bank	39.331	(40.341)	Applus Services SA	Goldman Sachs	4.375
(755.449)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	Goldman Sachs	21.544	(3.025)	Applus Services SA	JP Morgan	1.930
(3.929.501)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	HSBC	127.440	(51.275)	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	Morgan Stanley	23.586
(48.473)	Corticeira Amorim SGPS SA	Goldman Sachs	(3.878)	(2.764)	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	HSBC	1.189
(114.346)	Corticeira Amorim SGPS SA	Barclays Bank	64.034	220.727	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Barclays Bank	(168.856)
(60.648)	Corticeira Amorim SGPS SA	HSBC	(13.343)	1.326.797	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Goldman Sachs	(1.018.369)
(49.214)	CTT-Correios de Portugal SA	Barclays Bank	6.102	225.060	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Citibank	(172.171)
(59.057)	CTT-Correios de Portugal SA	HSBC	18.190	32.300	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	JP Morgan	(18.330)
(426.981)	CTT-Correios de Portugal SA	Goldman Sachs	174.208	(293.946)	Banco de Sabadell SA	Goldman Sachs	67.815
(386.416)	EDP - Energias de Portugal SA	Goldman Sachs	26.663	(567.543)	Banco de Sabadell SA	HSBC	121.223
28.713	Galp Energia SGPS SA	Barclays Bank	(34.635)	(990.224)	Banco de Sabadell SA	JP Morgan	139.481
42.511	Galp Energia SGPS SA	Goldman Sachs	(49.195)	(253.166)	Banco Santander SA	Goldman Sachs	215.571
41.004	Galp Energia SGPS SA	HSBC	(23.511)	85.361	Banco Santander SA	HSBC	(65.600)
40.475	Galp Energia SGPS SA	JP Morgan	(23.573)	199.361	Banco Santander SA	Goldman Sachs	(163.027)
13.978	Galp Energia SGPS SA	Citibank	(1.771)	(99.551)	Banco Santander SA	Barclays Bank	63.961
(11.474)	Jeronimo Martins SGPS SA	Barclays Bank	3.765	28.304	Banco Santander SA	JP Morgan	(2.795)
(4.574)	Jeronimo Martins SGPS SA	Goldman Sachs	1.941	(21.531)	Bankia SA	Barclays Bank	8.871
(1.940)	Mota-Engil SGPS SA	HSBC	36	(239.605)	Bankia SA	Goldman Sachs	111.896
(26.554)	Mota-Engil SGPS SA	Goldman Sachs	6.865	(126.543)	Bankia SA	HSBC	33.433
108.326	Navigator Co SA/The	Goldman Sachs	13.541	(393.128)	Bankia SA	JP Morgan	106.985
(52.611)	NOS SGPS SA	Goldman Sachs	12.837	22.169	Bankinter SA	Barclays Bank	2.103
(34.389)	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	Barclays Bank	842	68.691	Bankinter SA	Goldman Sachs	(564)
(143.908)	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	Goldman Sachs	37.159	18.797	Bankinter SA	HSBC	(529)
(39.572)	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	HSBC	9.260	3.779	Bankinter SA	Morgan Stanley	(2.115)
53.641	Semapa-Sociedade de Investimento e Gestao	Goldman Sachs	115.865	60.293	CaixaBank SA	Barclays Bank	(30.693)
30.291	Semapa-Sociedade de Investimento e Gestao	Morgan Stanley	16.660	114.685	CaixaBank SA	Goldman Sachs	(46.657)
1.334.552	Sonae SGPS SA	Goldman Sachs	(92.084)	107.092	CaixaBank SA	Citibank	(53.214)
			639.040	118.799	CaixaBank SA	HSBC	(9.492)
				168.187	CaixaBank SA	JP Morgan	(37.121)
				(358.131)	Cellnex Telecom SA '144A'	Goldman Sachs	623.408
				11.106	Cellnex Telecom SA '144A'	HSBC	(7.527)
				(39.295)	Cellnex Telecom SA '144A'	HSBC	1.853
				4.283	CIE Automotive SA	HSBC	1.759
1.446	Abengoa SA 'B'***	Morgan Stanley	-	4.764	CIE Automotive SA	JP Morgan	1.174
2.948.898	Abengoa SA 'B'***	Barclays Bank	-	2.442	CIE Automotive SA	Barclays Bank	(2.614)
1.323.848	Abengoa SA 'B'***	HSBC	-	2.709	CIE Automotive SA	Goldman Sachs	(271)
589	Acciona SA	HSBC	(1.331)	338	CIE Automotive SA	Morgan Stanley	(352)
(1.681)	Acciona SA	HSBC	3.416	236	Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA	Goldman Sachs	(71)
7.084	Acciona SA	Goldman Sachs	(15.160)	8.024	Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA	Morgan Stanley	(4.814)
6.332	Acciona SA	JP Morgan	(15.192)	(7.401)	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	JP Morgan	258
9.132	Acerinox SA	Barclays Bank	(2.648)	77.665	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	Goldman Sachs	(28.037)
1.320	Acerinox SA	Citibank	(254)	(1.765)	Ebro Foods SA	JP Morgan	(985)
17.727	Acerinox SA	HSBC	(3.074)	(1.881)	Ebro Foods SA	Barclays Bank	(714)
1.880	Acerinox SA	JP Morgan	(368)	(1.718)	Ebro Foods SA	HSBC	(1.205)
8.631	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Citibank	(7.854)	(51.035)	Ebro Foods SA	Goldman Sachs	(37.765)
18.182	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	JP Morgan	(11.273)	2.749	eDreams ODIGEO SA	Goldman Sachs	742
11.036	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Barclays Bank	(9.609)	11.147	Enagas SA	Barclays Bank	(12.760)
19.269	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	HSBC	(11.383)	28.817	Enagas SA	Goldman Sachs	(38.990)

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Espagne suite				Espagne suite			
4.637	Endesa SA	Barclays Bank	(5.500)	158.324	Mediaset Espana		
7.214	Endesa SA	Goldman Sachs	(7.884)		Comunicacion SA	Goldman Sachs	(76.629)
1.885	Endesa SA	Morgan Stanley	(510)	88.297	Mediaset Espana		
(7.994)	Euskaltel SA '144A'	Barclays Bank	120		Comunicacion SA	Citibank	(47.539)
(68.161)	Euskaltel SA '144A'	Goldman Sachs	(11.247)	1.076	Melia Hotels International SA	Citibank	22
(1.397)	Euskaltel SA '144A'	HSBC	77	10.087	Melia Hotels International SA	HSBC	(6.657)
51.718	Faes Farma SA	Barclays Bank	(5.172)	305.555	Melia Hotels International SA	Goldman Sachs	(9.167)
168.276	Faes Farma SA	Goldman Sachs	(3.366)	28.641	Merlin Properties Socimi		
14.863	Faes Farma SA	HSBC	297		SA (Reit)	JP Morgan	(30.216)
(20.678)	Ferrovial SA	Barclays Bank	64	42.308	Merlin Properties Socimi		
(253.257)	Ferrovial SA	Goldman Sachs	(79.244)		SA (Reit)	Goldman Sachs	(31.519)
(46.443)	Ferrovial SA	HSBC	(14.532)	20.103	Merlin Properties Socimi		
(258.236)	Ferrovial SA	Goldman Sachs	37.206		SA (Reit)	HSBC	(18.037)
(51.821)	Ferrovial SA	HSBC	24.170	(50.200)	Neinor Homes SA '144A'	Goldman Sachs	31.124
(20.678)	Ferrovial SA	Barclays Bank	3.929	(25.476)	Neinor Homes SA '144A'	HSBC	8.314
(29.996)	Ferrovial SA	JP Morgan	13.048	(16.619)	Neinor Homes SA '144A'	Barclays Bank	11.477
(51.782)	Ferrovial SA (Right)	JP Morgan	(16.203)	(9.202)	Neinor Homes SA '144A'	JP Morgan	(184)
(20.592)	Fluidra SA	Goldman Sachs	20.592	(47.230)	NH Hotel Group SA	Goldman Sachs	(8.008)
(3.165)	Fluidra SA	HSBC	570	66.196	NH Hotel Group SA	Goldman Sachs	16.549
(8.252)	Fluidra SA	JP Morgan	1.485	(18.837)	NH Hotel Group SA	JP Morgan	2.231
(20.303)	Fomento de Construcciones			(79.758)	Obrascon Huarte Lain SA	Goldman Sachs	43.265
	y Contratas SA	Goldman Sachs	498	(942)	Obrascon Huarte Lain SA	JP Morgan	644
(545)	Fomento de Construcciones			(6.061)	Obrascon Huarte Lain SA	Morgan Stanley	(701)
	y Contratas SA	JP Morgan	44	12.325	Papeles y Cartones		
(72.027)	Gas Natural SDG SA	HSBC	32.412		de Europa SA	Barclays Bank	3.204
(129.720)	Gas Natural SDG SA	Goldman Sachs	131.017	68.837	Papeles y Cartones		
(28.101)	Gas Natural SDG SA	Barclays Bank	31.754		de Europa SA	Goldman Sachs	(2.753)
(49.260)	Gas Natural SDG SA	JP Morgan	22.521	45.040	Papeles y Cartones		
(3.310)	Gestamp Automocion SA '144A'	Goldman Sachs	(232)		de Europa SA	HSBC	(32.429)
828	Grupo Catalana Occidente SA	JP Morgan	(992)	18.261	Papeles y Cartones		
412	Grupo Catalana Occidente SA	Morgan Stanley	(494)		de Europa SA	JP Morgan	(13.148)
1.194	Grupo Catalana Occidente SA	Barclays Bank	(1.109)	(1.557)	Promotora de		
7.240	Grupo Catalana Occidente SA	Goldman Sachs	(3.687)		Informaciones SA	Citibank	31
5.659	Grupo Catalana Occidente SA	HSBC	(6.384)	(9.243)	Promotora de		
112.487	Iberdrola SA	Goldman Sachs	(50.298)		Informaciones SA	HSBC	1.344
19.170	Iberdrola SA	JP Morgan	(8.550)	(10.050)	Prosegur Cash SA '144A'	Barclays Bank	(201)
4.690	Iberdrola SA	Citibank	(264)	(7.030)	Prosegur Cash SA '144A'	HSBC	(35)
(15.512)	Indra Sistemas SA	Morgan Stanley	5.895	(328.492)	Prosegur Cash SA '144A'	Goldman Sachs	(17.979)
(3.864)	Indra Sistemas SA	HSBC	2.318	(31.743)	Prosegur Cash SA '144A'	JP Morgan	131
16.249	Industria de Diseno Textil SA	JP Morgan	(3.209)	(8.022)	Prosegur Cia de Seguridad SA	JP Morgan	967
(28.695)	Industria de Diseno Textil SA	Goldman Sachs	(16.069)	(88.463)	Red Electrica Corp SA	Barclays Bank	48.217
(35.262)	Inmobiliaria Colonial Socimi			(38.332)	Red Electrica Corp SA	Goldman Sachs	18.591
	SA (Reit)	Goldman Sachs	21.333	(154.273)	Red Electrica Corp SA	JP Morgan	109.830
(3.708)	Lar Espana Real Estate			68.613	Repsol SA	JP Morgan	(8.778)
	Socimi SA (Reit)	Barclays Bank	1.446	85.734	Sacyr SA	JP Morgan	(9.814)
(17.339)	Lar Espana Real Estate			(239.178)	Sacyr SA	JP Morgan	52.388
	Socimi SA (Reit)	Goldman Sachs	7.976	(162.097)	Sacyr SA	Morgan Stanley	24.137
(3.809)	Lar Espana Real Estate			38.503	Sacyr SA	Barclays Bank	(9.857)
	Socimi SA (Reit)	HSBC	2.819	48.112	Sacyr SA	Citibank	(12.317)
(10.899)	Lar Espana Real Estate			(12.759)	Siemens Gamesa Renewable		
	Socimi SA (Reit)	JP Morgan	8.065		Energy SA	Goldman Sachs	9.496
57.960	Liberbank SA	Goldman Sachs	(3.315)	(29.340)	Talgo SA '144A'	Morgan Stanley	21.125
8.396	Liberbank SA	JP Morgan	(359)	39.824	Telefonica SA	Citibank	(17.164)
118.948	Mapfre SA	Goldman Sachs	(22.721)	41.411	Telefonica SA	Barclays Bank	(17.848)
2.631	Mapfre SA	Citibank	(768)	199.075	Telefonica SA	Goldman Sachs	(105.931)
4.287	Mapfre SA	HSBC	(959)	48.906	Telefonica SA	HSBC	(39.538)
16.106	Mapfre SA	JP Morgan	(618)	78.069	Telefonica SA	JP Morgan	(54.049)
2.500	Mapfre SA	Morgan Stanley	(730)	4.091	Telepizza Group SA '144A'	Barclays Bank	(157)
1.025	Masmovil Ibercom SA	HSBC	4.051	5.024	Telepizza Group SA '144A'	HSBC	(330)
275	Masmovil Ibercom SA	Morgan Stanley	889	1.929	Telepizza Group SA '144A'	JP Morgan	(245)
1.365	Masmovil Ibercom SA	Goldman Sachs	(407)	1.233	Telepizza Group SA '144A'	Morgan Stanley	(140)
557	Masmovil Ibercom SA	JP Morgan	795	(12.572)	Tubacex SA	Citibank	4.212
11.651	Mediaset Espana			(209.716)	Tubacex SA	HSBC	140.510
	Comunicacion SA	Morgan Stanley	(6.664)	(86.771)	Tubacex SA	Goldman Sachs	30.370
163.854	Mediaset Espana			(189.003)	Tubacex SA	Morgan Stanley	63.316
	Comunicacion SA	HSBC	(77.339)	(1.767)	Tubacex SA	Barclays Bank	592
129.646	Mediaset Espana			(258.811)	Unicaja Banco SA '144A'	Goldman Sachs	35.716
	Comunicacion SA	JP Morgan	(59.164)	327	Vidrala SA	Barclays Bank	(752)
143.912	Mediaset Espana			1.904	Vidrala SA	Goldman Sachs	(3.998)
	Comunicacion SA	Barclays Bank	(82.318)	1.490	Vidrala SA	Morgan Stanley	(3.427)

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Espagne suite				Suède suite			
2.000	Vidrala SA	HSBC	(7.600)	632	Boliden AB	Goldman Sachs	(151)
2.479	Vidrala SA	JP Morgan	(9.420)	6.258	Boliden AB	HSBC	(4.718)
(9.819)	Viscofan SA	Barclays Bank	9.416	4.450	Boliden AB	JP Morgan	(3.282)
(30.409)	Viscofan SA	JP Morgan	9.050	409	Boliden AB	HSBC	(283)
(20.443)	Viscofan SA	Goldman Sachs	11.274	(4.450)	Boliden AB	JP Morgan	2.567
(18.300)	Viscofan SA	HSBC	5.018	(97.469)	Bonava AB 'B'	Goldman Sachs	948
(4.151)	Zardoya Otis SA	HSBC	386	(89.508)	Bonava AB 'B'	Citibank	13.252
(13.200)	Zardoya Otis SA	Goldman Sachs	4.884	(10.907)	Boozt AB '144A'	Citibank	4.351
			(820.156)	(97.152)	Boozt AB '144A'	Goldman Sachs	13.234
				(22.057)	Boozt AB '144A'	JP Morgan	11.804
Suède				189.525	Bravida Holding AB '144A'	Goldman Sachs	50.714
18.598	AcadeMedia AB '144A'	Barclays Bank	(724)	19.611	Bravida Holding AB '144A'	Morgan Stanley	3.149
91.294	AcadeMedia AB '144A'	Goldman Sachs	1.777	(90.472)	Bufab AB	Goldman Sachs	12.325
62.055	AcadeMedia AB '144A'	Morgan Stanley	(2.415)	(11.228)	Byggmax Group AB	Goldman Sachs	(2.786)
19.648	AcadeMedia AB '144A'	HSBC	2.868	(452.501)	Byggmax Group AB	JP Morgan	(13.209)
4.505	AcadeMedia AB '144A'	JP Morgan	658	(3.384)	Byggmax Group AB	Barclays Bank	(445)
19.640	AF AB 'B'	Goldman Sachs	6.067	(66.976)	Byggmax Group AB	Citibank	(8.798)
4.167	AF AB 'B'	Barclays Bank	(2.068)	(31.298)	Byggmax Group AB	Morgan Stanley	(4.111)
3.239	AF AB 'B'	Morgan Stanley	(1.607)	158.953	Capio AB '144A'	Goldman Sachs	(9.280)
2.916	AF AB 'B'	HSBC	2.601	801	Castellum AB	Morgan Stanley	(8)
8.051	AF AB 'B'	JP Morgan	7.521	53.587	Castellum AB	Barclays Bank	(421)
847	Ahlsell AB '144A'	Citibank	42	79.264	Castellum AB	Goldman Sachs	(378)
47.961	Ahlsell AB '144A'	Barclays Bank	(481)	18.104	Castellum AB	Citibank	1.166
3.452	Ahlsell AB '144A'	Morgan Stanley	(151)	23.807	Castellum AB	HSBC	(73)
116.179	Ahlsell AB '144A'	Goldman Sachs	1.696	11.479	Castellum AB	JP Morgan	(1.931)
19.069	Ahlsell AB '144A'	JP Morgan	(66)	1.637	Catena Media Plc	Morgan Stanley	(1.788)
864	Alfa Laval AB	Barclays Bank	(530)	1.362	Catena Media Plc	Goldman Sachs	108
25.499	Alfa Laval AB	Goldman Sachs	(19.537)	324	Catena Media Plc	HSBC	627
1.713	Alfa Laval AB	JP Morgan	(112)	3.163	Catena Media Plc	JP Morgan	(1.996)
(9.731)	Alimak Group AB '144A'	Citibank	3.030	1.348	Catena Media Plc	Barclays Bank	(1.019)
(8.370)	Alimak Group AB '144A'	HSBC	2.117	2.739	Cellavision AB	Barclays Bank	1.466
(30.840)	Alimak Group AB '144A'	Barclays Bank	9.603	8.310	Cellavision AB	Goldman Sachs	5.671
(92.999)	Alimak Group AB '144A'	Morgan Stanley	28.957	221	Cellavision AB	HSBC	52
16.897	Arjo AB	Barclays Bank	(1.398)	2.242	Cellavision AB	JP Morgan	524
356.483	Arjo AB	Goldman Sachs	(34.687)	(103.613)	Cloetta AB 'B'	Goldman Sachs	23.390
59.994	Arjo AB	HSBC	292	2.289	D Carnegie & CO AB	Barclays Bank	57
6.002	Assa Abloy AB 'B'	Barclays Bank	(1.956)	4.450	D Carnegie & CO AB	Morgan Stanley	30
36.735	Assa Abloy AB 'B'	Goldman Sachs	877	4.960	D Carnegie & CO AB	Goldman Sachs	(755)
32.558	Assa Abloy AB 'B'	HSBC	(1.712)	63.517	Dios Fastigheter AB	Goldman Sachs	(6.489)
44.457	Assa Abloy AB 'B'	JP Morgan	(2.379)	28.415	Dios Fastigheter AB	Barclays Bank	(1.935)
32.500	Atlas Copco AB	HSBC	(3.944)	68.801	Dometic Group AB '144A'	HSBC	40.502
1.234	Atlas Copco AB 'A'	JP Morgan	(796)	45.752	Dometic Group AB '144A'	JP Morgan	26.934
10.212	Attendo AB '144A'	JP Morgan	(7.204)	17.737	Dometic Group AB '144A'	Goldman Sachs	9.061
(5.288)	Avanza Bank Holding AB	Morgan Stanley	(24)	12.861	Dustin Group AB '144A'	JP Morgan	5.424
(18.415)	Axfood AB	Citibank	(627)	4.608	Dustin Group AB '144A'	Barclays Bank	1.405
(22.433)	Axfood AB	Goldman Sachs	(982)	7.448	Dustin Group AB '144A'	Goldman Sachs	4.783
(31.463)	Axfood AB	HSBC	(4.745)	91.455	Electrolux AB 'B'	Goldman Sachs	(78.317)
(67.602)	Axfood AB	JP Morgan	(10.196)	3.875	Electrolux AB 'B'	HSBC	(3.514)
793	Betsson AB	JP Morgan	218	54.106	Elekta AB 'B'	Barclays Bank	11.576
(41.874)	Betsson AB	Barclays Bank	11.379	21.014	Elekta AB 'B'	Citibank	5.112
(5.328)	Betsson AB	Citibank	1.786	217.583	Elekta AB 'B'	Goldman Sachs	121.793
(31.579)	Betsson AB	HSBC	13.817	1.355	Elekta AB 'B'	JP Morgan	(298)
(14.893)	Betsson AB	JP Morgan	5.387	49.212	Elekta AB 'B'	HSBC	26.471
(2.338)	Betsson AB	Citibank	(643)	(10.230)	Essity AB 'B'	Citibank	10.883
(31.579)	Betsson AB	HSBC	(8.685)	(3.609)	Essity AB 'B'	JP Morgan	3.329
(10.120)	Betsson AB	JP Morgan	(2.783)	(7.758)	Essity AB 'B'	Barclays Bank	7.032
793	Betsson AB	JP Morgan	(333)	(10.196)	Essity AB 'B'	Goldman Sachs	11.092
1.552	Bilia AB 'A'	Goldman Sachs	(378)	(1.842)	Evolution Gaming Group AB '144A'	Goldman Sachs	(4.660)
(18.791)	BillerudKorsnas AB	Goldman Sachs	(1.920)	(10.985)	Evolution Gaming Group AB '144A'	Citibank	(29.929)
(38.191)	BillerudKorsnas AB	Citibank	(1.868)	10.246	Fabege AB	Citibank	1.668
(42.554)	BillerudKorsnas AB	JP Morgan	(2.102)	1.608	Fabege AB	HSBC	266
8.490	Biotage AB	JP Morgan	1.258	20.000	Fabege AB	JP Morgan	4.724
8.058	Biotage AB	Barclays Bank	(89)	706	Fabege AB	Morgan Stanley	(29)
9.704	Biotage AB	Goldman Sachs	3.588	158.988	Fabege AB	Barclays Bank	27.607
18.375	Biotage AB	HSBC	3.255	247.106	Fabege AB	Goldman Sachs	55.750
(2.155)	Boliden AB	Citibank	2.988	16.024	Fastighets AB Balder 'B'	Barclays Bank	3.970
(10.540)	Boliden AB	Citibank	(9)	36.831	Fastighets AB Balder 'B'	Goldman Sachs	(5.547)
(4.966)	Boliden AB	Goldman Sachs	(2.769)	1.451	Fastighets AB Balder 'B'	Morgan Stanley	395
(2.828)	Boliden AB	JP Morgan	(1.577)				
6.721	Boliden AB	Citibank	(7.279)				

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Suède suite				Suède suite			
24.234	Fastighets AB Balder 'B'	Citibank	6.482	(78.606)	Kindred Group Plc SDR	JP Morgan	40.155
6.329	Fastighets AB Balder 'B'	HSBC	518	14.724	Kindred Group Plc SDR	Citibank	(7.951)
17.981	Fastighets AB Balder 'B'	JP Morgan	(680)	(473)	LeoVegas AB '144A'	Citibank	209
(2.686)	Fastighets AB Balder 'B'	Citibank	(681)	37.623	Lifco AB 'B'	Goldman Sachs	(31.117)
(5.907)	Fastighets AB Balder 'B'	HSBC	(754)	4.150	Lindab International AB	Barclays Bank	(1.615)
637	G5 Entertainment AB	Barclays Bank	2.107	37.686	Lindab International AB	Goldman Sachs	(15.035)
214	G5 Entertainment AB	HSBC	1.110	4.588	Lindab International AB	JP Morgan	(1.295)
149	G5 Entertainment AB	JP Morgan	(123)	3.858	Lindab International AB	Morgan Stanley	(1.502)
585	G5 Entertainment AB	Morgan Stanley	381	3.696	Loomis AB 'B'	HSBC	2.077
109.500	Getinge AB 'B'	Goldman Sachs	7.047	14.018	Loomis AB 'B'	Citibank	(546)
1.947	Granges AB	Morgan Stanley	(720)	13.765	Loomis AB 'B'	Barclays Bank	(449)
1.443	Haldex AB	HSBC	(421)	39.943	Loomis AB 'B'	Goldman Sachs	15.690
979	Haldex AB	Morgan Stanley	(114)	20.812	Loomis AB 'B'	JP Morgan	8.745
1.842	Hemfosa Fastigheter AB	HSBC	(137)	(2.581)	Lundin Petroleum AB	Barclays Bank	(2.215)
12.951	Hemfosa Fastigheter AB	JP Morgan	(1.470)	(26.594)	Lundin Petroleum AB	Citibank	8.452
4.891	Hemfosa Fastigheter AB	Barclays Bank	48	(17.767)	Lundin Petroleum AB	JP Morgan	(13.078)
28.225	Hemfosa Fastigheter AB	Goldman Sachs	(3.296)	(7.119)	Lundin Petroleum AB	HSBC	(7.969)
10.649	Hemfosa Fastigheter AB	Morgan Stanley	29	(126.629)	Mekonomen AB	Goldman Sachs	(54.214)
51.515	Hennes & Mauritz AB 'B'	Goldman Sachs	(28.051)	(863)	Mekonomen AB	Morgan Stanley	302
16.484	Hennes & Mauritz AB 'B'	Citibank	(15.629)	(1.412)	Mekonomen AB	JP Morgan	(160)
78.225	Hennes & Mauritz AB 'B'	JP Morgan	(61.722)	5.260	Millicom International Cellular SA SDR	Barclays Bank	(1.024)
22.254	Hennes & Mauritz AB 'B'	HSBC	(25.294)	12.526	Millicom International Cellular SA SDR	Goldman Sachs	(3.047)
11.695	Hexagon AB 'B'	Goldman Sachs	11.835	10.483	Millicom International Cellular SA SDR	Citibank	(2.040)
6.146	Hexagon AB 'B'	JP Morgan	7.112	9.625	Millicom International Cellular SA SDR	HSBC	(8.429)
1.561	Hexagon AB 'B'	Barclays Bank	699	9.470	Millicom International Cellular SA SDR	JP Morgan	(8.293)
(20.569)	Hexpol AB	HSBC	758	1.599	Modern Times Group MTG AB 'B'	Barclays Bank	(4.481)
(16.861)	Hexpol AB	Citibank	1.689	20.459	Modern Times Group MTG AB 'B'	Goldman Sachs	(17.917)
(44.256)	Hexpol AB	JP Morgan	127	11.265	Modern Times Group MTG AB 'B'	JP Morgan	(12.934)
1.868	Hexpol AB	JP Morgan	(182)	(277.706)	Munters Group AB '144A'	Goldman Sachs	56.746
3.292	HIQ International AB	Barclays Bank	(654)	(180.642)	Munters Group AB '144A'	JP Morgan	56.247
396	HIQ International AB	Goldman Sachs	(244)	(703)	Munters Group AB '144A'	Citibank	55
1.595	HIQ International AB	JP Morgan	(501)	(4.325)	NCC AB 'B'	Citibank	799
469	HIQ International AB	Morgan Stanley	(152)	143.450	NCC AB 'B'	Goldman Sachs	34.197
(11.567)	Hoist Finance AB '144A'	Citibank	5.402	(1.196)	NCC AB 'B'	HSBC	190
(13.521)	Hoist Finance AB '144A'	HSBC	8.552	15.580	NetEnt AB	Barclays Bank	(3.257)
(4.396)	Hoist Finance AB '144A'	JP Morgan	2.780	93.571	NetEnt AB	Goldman Sachs	(4.734)
(17.913)	Holmen AB 'B'	Citibank	3.337	55.911	NetEnt AB	HSBC	(1.596)
(28.245)	Holmen AB 'B'	JP Morgan	3.700	27.669	NetEnt AB	JP Morgan	(2.109)
2.306	Holmen AB 'B'	Barclays Bank	(864)	12.865	NetEnt AB	Morgan Stanley	(2.825)
44.490	Holmen AB 'B'	Goldman Sachs	(7.792)	45.988	NetEnt AB	HSBC	10.062
270	Holmen AB 'B'	HSBC	(50)	54.287	New Wave Group AB 'B'	Goldman Sachs	-
1.398	Holmen AB 'B'	JP Morgan	(258)	11.575	New Wave Group AB 'B'	JP Morgan	-
(13.040)	Holmen AB 'B'	Goldman Sachs	2.284	63.580	New Wave Group AB 'B'	Morgan Stanley	6.805
(44.509)	Holmen AB 'B'	Barclays Bank	15.444	(26.286)	Nibe Industrier AB 'B'	Goldman Sachs	8.236
(3.347)	Holmen AB 'B'	HSBC	266	(524.316)	Nibe Industrier AB 'B'	Citibank	117.341
(18.079)	Hufvudstaden AB 'A'	Citibank	1.055	(24.936)	Nibe Industrier AB 'B'	JP Morgan	7.085
(14.504)	Husqvarna AB 'B'	Barclays Bank	883	(12.112)	Nibe Industrier AB 'B'	HSBC	3.441
(70.419)	Husqvarna AB 'B'	Citibank	2.721	13.981	Nobia AB	Goldman Sachs	340
(115.250)	Husqvarna AB 'B'	JP Morgan	(1.007)	47.330	Nobia AB	HSBC	9.863
(42.934)	Husqvarna AB 'B'	HSBC	1.426	884	Nobia AB	JP Morgan	11
(8.730)	ICA Gruppen AB	Citibank	3.313	353.580	Nobina AB '144A'	Goldman Sachs	(72.249)
(38.099)	ICA Gruppen AB	Goldman Sachs	24.864	13.523	Nobina AB '144A'	Morgan Stanley	(987)
(8.019)	ICA Gruppen AB	HSBC	5.072	9.751	Nolato AB 'B'	Goldman Sachs	46.491
(27.564)	ICA Gruppen AB	JP Morgan	15.649	8.522	Nolato AB 'B'	Morgan Stanley	11.609
(3.814)	International Petroleum Corp/Sweden	Barclays Bank	482	(163.805)	Nordea Bank AB	Citibank	74.030
(7.165)	International Petroleum Corp/Sweden	Citibank	906	(32.145)	Nordea Bank AB	JP Morgan	15.265
(407)	International Petroleum Corp/Sweden	Goldman Sachs	(285)	(76.133)	Nordea Bank AB	HSBC	40.108
15.626	Intrum AB	JP Morgan	(29.021)	(122.661)	Nordea Bank AB	Goldman Sachs	75.909
54.114	Intrum AB	Goldman Sachs	(67.614)	9.701	Pandox AB	Goldman Sachs	(1.699)
4.063	Intrum AB	Citibank	(5.967)	10.669	Peab AB	HSBC	(3.867)
1.985	Intrum AB	Barclays Bank	(3.844)	27.631	Peab AB	Barclays Bank	(7.259)
15.188	Intrum AB	HSBC	(25.294)	81.499	Peab AB	Goldman Sachs	(35.686)
5.370	Intrum AB	Morgan Stanley	(8.501)	(23.006)	RaySearch Laboratories AB	Barclays Bank	4.477
(3.304)	JM AB	JP Morgan	6.886				
(21.946)	JM AB	Citibank	29.379				
66.044	KappAhl AB	Goldman Sachs	(4.306)				
8.060	Kindred Group Plc SDR	Barclays Bank	(4.353)				
122.754	Kindred Group Plc SDR	Goldman Sachs	(78.236)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Suède suite				Suède suite			
(37.112)	RaySearch Laboratories AB	Goldman Sachs	(28.528)	(12.279)	Telia Co AB	Barclays Bank	2.330
(1.184)	RaySearch Laboratories AB	HSBC	1.567	(1.385.525)	Telia Co AB	Citibank	261.044
(2.826)	RaySearch Laboratories AB	Morgan Stanley	550	(27.027)	Telia Co AB	HSBC	(155)
882	Resurs Holding AB '144A'	JP Morgan	—	(129.674)	Telia Co AB	Goldman Sachs	22.081
706	Resurs Holding AB '144A'	Barclays Bank	(31)	(142.887)	Telia Co AB	JP Morgan	32.477
2.556	Resurs Holding AB '144A'	Goldman Sachs	—	10.610	Tethys Oil AB	Barclays Bank	3.084
33.772	Saab AB 'B'	Goldman Sachs	79.853	21.928	Tethys Oil AB	Goldman Sachs	22.724
(5.377)	Saab AB 'B'	Citibank	(1.526)	14.295	Tethys Oil AB	HSBC	21.073
(7.069)	Sandvik AB	Citibank	6.775	25.086	Tethys Oil AB	JP Morgan	36.980
60.335	Sandvik AB	JP Morgan	(20.053)	22.989	Tethys Oil AB	Morgan Stanley	24.941
156.437	Sandvik AB	Barclays Bank	(143.745)	3.593	Thule Group AB '144A'	Barclays Bank	703
342.919	Sandvik AB	Goldman Sachs	(167.153)	30.622	Thule Group AB '144A'	Goldman Sachs	31.584
(28.747)	Sandvik AB	Goldman Sachs	24.666	3.035	Thule Group AB '144A'	Morgan Stanley	314
(4.767)	Sandvik AB	HSBC	4.415	10.933	Thule Group AB '144A'	JP Morgan	7.872
787	Sandvik AB	HSBC	(449)	3.835	Thule Group AB '144A'	HSBC	2.603
(8.077)	Sandvik AB	JP Morgan	7.559	(24.870)	Trelleborg AB 'B'	Citibank	34.726
17.574	Scandic Hotels Group AB	Goldman Sachs	(684)	(7.332)	Trelleborg AB 'B'	JP Morgan	9.990
	'144A'			(5.495)	Trelleborg AB 'B'	HSBC	8.292
373	Scandic Hotels Group AB	Morgan Stanley	(76)	312.618	Volvo AB 'B'	Goldman Sachs	(168.824)
	'144A'			(6.269)	Volvo AB 'B'	Citibank	5.429
240.505	Securitas AB 'B'	Goldman Sachs	76.056	(32.658)	Volvo AB 'B'	JP Morgan	14.193
(78.637)	Skandinaviska Enskilda	Goldman Sachs	32.596	(65.917)	Volvo AB 'B'	Goldman Sachs	35.597
	Banken AB 'A'			(5.365)	Volvo AB 'B'	Barclays Bank	3.665
(22.856)	Skandinaviska Enskilda	Citibank	11.209	82.464	Wihlborgs Fastigheter AB	Goldman Sachs	(61.384)
	Banken AB 'A'			411	Wihlborgs Fastigheter AB	HSBC	(120)
(29.234)	Skandinaviska Enskilda	HSBC	12.459	42.857	Wihlborgs Fastigheter AB	JP Morgan	(27.210)
	Banken AB 'A'			2.072	Wihlborgs Fastigheter AB	Morgan Stanley	(1.159)
(39.799)	Skandinaviska Enskilda	JP Morgan	16.329				
	Banken AB 'A'						
(382.312)	Skanska AB 'B'	Citibank	277.142	Suisse			
(9.071)	Skanska AB 'B'	Goldman Sachs	3.928	(21.674)	ABB Ltd Reg	HSBC	27.364
(3.086)	Skanska AB 'B'	HSBC	3.093	(32.767)	ABB Ltd Reg	Barclays Bank	57.632
(31.896)	Skanska AB 'B'	JP Morgan	31.967	(125.023)	ABB Ltd Reg	Goldman Sachs	146.553
8.938	SKF AB 'B'	Goldman Sachs	(11.871)	(8.888)	Adecco Group AG Reg	Goldman Sachs	32.039
2.279	SKF AB 'B'	Citibank	(3.548)	(2.002)	Adecco Group AG Reg	HSBC	7.213
1.336	SkiStar AB	Barclays Bank	1.040	830	Allreal Holding AG Reg	JP Morgan	(545)
1.423	SkiStar AB	Goldman Sachs	1.064	434	Allreal Holding AG Reg	HSBC	(1.021)
2.145	SkiStar AB	HSBC	1.897	501	ALSO Holding AG Reg	Morgan Stanley	(550)
3.020	SkiStar AB	Morgan Stanley	866	423	ALSO Holding AG Reg	HSBC	(643)
4.350	SkiStar AB	JP Morgan	3.922	(32.376)	ams AG	Goldman Sachs	180.535
23.024	SSAB AB 'B'	Barclays Bank	(5.753)	(4.839)	ams AG	HSBC	27.087
8.315	SSAB AB 'B'	Morgan Stanley	(2.314)	385	APG SGA SA	Goldman Sachs	(6.034)
5.739	SSAB AB 'B'	JP Morgan	(91)	(58.351)	Arbonia AG	HSBC	10.161
2.337	SSAB AB 'B'	HSBC	(567)	(3.580)	Arbonia AG	Goldman Sachs	(62)
185.818	SSAB AB 'B'	Goldman Sachs	(39.934)	(19.449)	Aryzta AG	Citibank	76.483
355.528	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Goldman Sachs	(107.933)	(2.624)	Aryzta AG	Morgan Stanley	(746)
(3.024)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	JP Morgan	71	(2.121)	Aryzta AG	JP Morgan	(438)
(8.859)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Citibank	729	(37.345)	Ascom Holding AG Reg	Goldman Sachs	(1.626)
2.257	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Morgan Stanley	5	16	Autoneum Holding AG	HSBC	(27)
18.042	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Barclays Bank	(1.174)	(9.002)	Bachem Holding AG Reg 'B'	Goldman Sachs	12.541
37.313	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Goldman Sachs	(10.674)	(52)	Bachem Holding AG Reg 'B'	Barclays Bank	15
34.393	Svenska Handelsbanken AB 'A'	HSBC	(7.813)	(4.454)	Baloise Holding AG Reg	HSBC	39.557
73.030	Svenska Handelsbanken AB 'A'	JP Morgan	(20.289)	80	Baloise Holding AG Reg	Morgan Stanley	(697)
(1.766)	Sweco AB 'B'	Goldman Sachs	(911)	(419)	Banque Cantonale	Goldman Sachs	8.733
(121)	Sweco AB 'B'	Citibank	(7)		Vaudoise Reg		
4.751	Swedbank AB 'A'	Barclays Bank	(4.091)	228	Barry Callebaut AG Reg	Barclays Bank	(6.750)
37.122	Swedbank AB 'A'	Goldman Sachs	(32.464)	2.904	Barry Callebaut AG Reg	Goldman Sachs	(154.241)
23.268	Swedbank AB 'A'	JP Morgan	(7.067)	(5)	Barry Callebaut AG Reg	Barclays Bank	148
7.062	Swedbank AB 'A'	Citibank	705	(180)	Barry Callebaut AG Reg	Goldman Sachs	9.560
35.187	Swedbank AB 'A'	HSBC	(22.679)	346	Barry Callebaut AG Reg	Citibank	(10.243)
16.520	Swedish Match AB	Barclays Bank	(1.286)	(212)	Barry Callebaut AG Reg	HSBC	17.423
88.752	Swedish Match AB	Goldman Sachs	15.545	11	Belimo Holding AG Reg	JP Morgan	239
6.851	Swedish Orphan Biovitrum AB	Barclays Bank	(900)	131	Belimo Holding AG Reg	Morgan Stanley	8.555
43.653	Tele2 AB 'B'	HSBC	(13.968)	233	Belimo Holding AG Reg	Goldman Sachs	16.230
15.308	Tele2 AB 'B'	JP Morgan	(3.243)	47	Belimo Holding AG Reg	HSBC	1.023
8.009	Tele2 AB 'B'	Morgan Stanley	(1.065)	49	Belimo Holding AG Reg	Barclays Bank	(4.053)
38.591	Tele2 AB 'B'	Barclays Bank	(6.208)	931	Bell Food Group AG	Goldman Sachs	25.900
55.434	Tele2 AB 'B'	Goldman Sachs	(28.231)	931	Bell Food Group AG Reg	Goldman Sachs	(48.638)
435	Tele2 AB 'B'	Citibank	(70)	29.744	BKW AG	Goldman Sachs	(145.031)
(42.403)	Telefonaktiebolaget LM	Citibank	8.830	11.613	Bobst Group SA Reg	Goldman Sachs	(20.223)
	Ericsson 'B'						

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Suisse suite				Suisse suite			
795	Bossard Holding AG Reg 'A'	Goldman Sachs	(5.261)	158	Georg Fischer AG Reg	Barclays Bank	(11.556)
262	Bossard Holding AG Reg 'A'	Morgan Stanley	(2.144)	6.977	Georg Fischer AG Reg	Goldman Sachs	30.375
5.018	Bucher Industries AG Reg	Barclays Bank	(106.609)	(127)	Givaudan SA Reg	Barclays Bank	345
10.422	Bucher Industries AG Reg	Goldman Sachs	(192.380)	(1.367)	Givaudan SA Reg	Goldman Sachs	64.557
989	Bucher Industries AG Reg	HSBC	(19.634)	(534)	Givaudan SA Reg	HSBC	10.308
(2.996)	Burckhardt Compression Holding AG	Morgan Stanley	(139.302)	(69)	Gurit Holding AG	Barclays Bank	391
(772)	Burckhardt Compression Holding AG	Citibank	(17.477)	(84)	Gurit Holding AG	Goldman Sachs	385
(4.073)	Burkhalter Holding AG	Morgan Stanley	20.067	4.462	HBM Healthcare Investments AG 'A'	Goldman Sachs	3.885
(5.198)	Burkhalter Holding AG	Goldman Sachs	39.759	(172)	Helvetia Holding AG Reg	Barclays Bank	5.616
(6.692)	Burkhalter Holding AG	HSBC	36.576	(710)	Helvetia Holding AG Reg	Goldman Sachs	24.110
(4.198)	Burkhalter Holding AG	Barclays Bank	32.532	(385)	Helvetia Holding AG Reg	HSBC	7.082
5.531	Cembra Money Bank AG	Goldman Sachs	(20.468)	(31.212)	Huber + Suhner AG Reg	Goldman Sachs	(116.859)
2.428	Cembra Money Bank AG	HSBC	(9.725)	3.338	Implenla AG Reg	JP Morgan	(10.173)
2.442	Cembra Money Bank AG	JP Morgan	(9.781)	131	Implenla AG Reg	Morgan Stanley	(319)
(19)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Barclays Bank	910	18.209	Implenla AG Reg	Goldman Sachs	(45.979)
(37)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Goldman Sachs	1.773	2.087	Implenla AG Reg	HSBC	(6.360)
(10)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	HSBC	690	3.585	Implenla AG Reg	Barclays Bank	(8.740)
2.436	Cie Financiere Richemont SA Reg	Goldman Sachs	(5.109)	1.395	Inficon Holding AG Reg	Barclays Bank	(29.151)
(30.836)	Clariant AG Reg	Goldman Sachs	11.746	867	Inficon Holding AG Reg	JP Morgan	(29.064)
(36.090)	Clariant AG Reg	HSBC	18.140	781	Inficon Holding AG Reg	Goldman Sachs	(28.221)
2.086	Conzzeta AG Reg	Goldman Sachs	(185.263)	495	Inficon Holding AG Reg	HSBC	(16.594)
(2.920)	Cosmo Pharmaceuticals NV	Morgan Stanley	95.597	88	Interroll Holding AG Reg	Barclays Bank	(6.436)
(4.575)	Cosmo Pharmaceuticals NV	Goldman Sachs	14.341	72	Interroll Holding AG Reg	HSBC	2.508
(2.138)	Cosmo Pharmaceuticals NV	Citibank	34.067	77	Interroll Holding AG Reg	JP Morgan	2.682
(309.564)	Credit Suisse Group AG Reg	Goldman Sachs	501.396	96	Interroll Holding AG Reg	Goldman Sachs	(3.009)
(27.088)	Credit Suisse Group AG Reg	HSBC	36.794	86	Interroll Holding AG Reg	Morgan Stanley	(6.290)
(181.602)	Credit Suisse Group AG Reg	Barclays Bank	203.531	(68)	Intershop Holding AG	Goldman Sachs	118
6.523	Daetwyler Holding AG	Goldman Sachs	(12.495)	(66)	Intershop Holding AG	Barclays Bank	(115)
544	Daetwyler Holding AG	HSBC	(2.084)	(2.913)	Julius Baer Group Ltd	HSBC	6.638
954	DKSH Holding AG	Barclays Bank	157	(11.579)	Julius Baer Group Ltd	Goldman Sachs	49.200
3.067	DKSH Holding AG	Citibank	(1.647)	4.596	Kardex AG Reg	Goldman Sachs	10.405
5.328	DKSH Holding AG	Goldman Sachs	(2.721)	2.490	Kardex AG Reg	HSBC	12.141
5.889	DKSH Holding AG	HSBC	(5.062)	1.493	Kardex AG Reg	JP Morgan	7.280
1.569	DKSH Holding AG	JP Morgan	145	3.522	Kardex AG Reg	Morgan Stanley	1.840
(740)	Dormakaba Holding AG	HSBC	19.771	278	Kardex AG Reg	Barclays Bank	145
(1.134)	Dormakaba Holding AG	Goldman Sachs	16.331	(346)	Komax Holding AG Reg	HSBC	8
(629)	dormakaba Holding AG Reg 'B'	Barclays Bank	6.713	(418)	Komax Holding AG Reg	Barclays Bank	1.591
670	Dufry AG Reg	Goldman Sachs	(5.892)	(5.626)	Komax Holding AG Reg	Goldman Sachs	227
(258.021)	EFG International AG	Goldman Sachs	74.138	942	Kuehne + Nagel International AG Reg	Goldman Sachs	(3.732)
67	Emmi AG Reg	Barclays Bank	758	(21.397)	LafargeHolcim Ltd Reg	HSBC	29.647
304	Emmi AG Reg	Goldman Sachs	3.441	(42.473)	LafargeHolcim Ltd Reg	Goldman Sachs	67.270
1.414	EMS-Chemie Holding AG Reg	Barclays Bank	(26.809)	(10.705)	Landis+Gyr Group AG	Barclays Bank	25.633
82	EMS-Chemie Holding AG Reg	Citibank	(1.606)	(2.440)	Landis+Gyr Group AG	Goldman Sachs	3.824
1.597	EMS-Chemie Holding AG Reg	Goldman Sachs	(22.956)	(1.149)	Landis+Gyr Group AG	HSBC	1.050
1.713	EMS-Chemie Holding AG Reg	HSBC	(19.004)	102	LEM Holding SA Reg	JP Morgan	1.954
1.098	EMS-Chemie Holding AG Reg	JP Morgan	(12.572)	166	LEM Holding SA Reg	Morgan Stanley	(3.359)
(1.273)	Flughafen Zuerich AG Reg	Barclays Bank	5.320	116	LEM Holding SA Reg	Barclays Bank	(4.351)
3.789	Flughafen Zuerich AG Reg	Citibank	(14.688)	363	LEM Holding SA Reg	Goldman Sachs	4.766
4.388	Flughafen Zuerich AG Reg	JP Morgan	(2.739)	181	LEM Holding SA Reg	HSBC	2.815
4.692	Flughafen Zuerich AG Reg	Goldman Sachs	(26.146)	22.944	Logitech International SA Reg	Barclays Bank	(5.194)
510	Flughafen Zuerich AG Reg	Morgan Stanley	(1.155)	43.482	Logitech International SA Reg	Goldman Sachs	(4.922)
(3.012)	Flughafen Zuerich AG Reg	HSBC	1.574	(5.377)	Logitech International SA Reg	HSBC	(170)
5.713	Galenica AG	Barclays Bank	(995)	(166)	Logitech International SA Reg	Barclays Bank	37
58.989	Galenica AG	Goldman Sachs	(23.113)	(1.388)	Logitech International SA Reg	Goldman Sachs	376
(1.885)	Galenica AG	Barclays Bank	439	54.615	Logitech International SA Reg	Citibank	(12.364)
(18.875)	Galenica AG	Goldman Sachs	7.282	16.386	Logitech International SA Reg	HSBC	(856)
(15.244)	Galenica AG	HSBC	11.946	(24.360)	Lonza Group AG	Goldman Sachs	(46.663)
311	GAM Holding AG	Barclays Bank	(366)	5.606	Lonza Group AG	Goldman Sachs	10.739
594	GAM Holding AG	Goldman Sachs	(874)	(11.819)	Meyer Burger Technology AG	JP Morgan	(1.327)
(3.180)	GAM Holding AG	Barclays Bank	3.738	(95.351)	Meyer Burger Technology AG	Goldman Sachs	(4.317)
(9.551)	GAM Holding AG	HSBC	10.811	(206.267)	Meyer Burger Technology AG	HSBC	5.029
191	Geberit AG Reg	HSBC	(2.362)	(32.049)	Meyer Burger Technology AG	Morgan Stanley	(1.005)
2.620	Geberit AG Reg	Goldman Sachs	(29.428)	(110.459)	Mobilezone Holding AG Reg	HSBC	53.860
339	Georg Fischer AG Reg	HSBC	6.494	9.952	Nestle SA Reg	HSBC	(15.305)
278	Georg Fischer AG Reg	JP Morgan	5.077	2.106	Nestle SA Reg	JP Morgan	(3.386)
				13.740	Nestle SA Reg	Goldman Sachs	(21.426)
				279	Novartis AG	Barclays Bank	(88)
				2.281	Novartis AG	Goldman Sachs	(3.294)
				2.166	Novartis AG	Morgan Stanley	(2.558)

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Suisse suite				Suisse suite			
3.582	Novartis AG Reg	JP Morgan	(1.055)	(2.121)	Swisscom AG Reg	HSBC	31.580
20.990	OC Oerlikon Corp AG Reg	Barclays Bank	(17.911)	2.128	Swissquote Group Holding SA	Goldman Sachs	9.768
41.619	OC Oerlikon Corp AG Reg	Citibank	(35.513)	415	Swissquote Group Holding SA	HSBC	1.529
62.266	OC Oerlikon Corp AG Reg	HSBC	(30.411)	1.296	Swissquote Group Holding SA	JP Morgan	6.453
31.955	OC Oerlikon Corp AG Reg	JP Morgan	(17.394)	1.543	Swissquote Group Holding SA	Morgan Stanley	8.483
96.874	OC Oerlikon Corp AG Reg	Goldman Sachs	(69.170)	316	Swissquote Group Holding		
10.409	Orior AG	Goldman Sachs	36.253		SA Reg	Barclays Bank	(7)
4.286	Orior AG	Morgan Stanley	14.181	367	Tecan Group AG Reg	HSBC	1.135
2.782	Orior AG	HSBC	10.174	96	Tecan Group AG Reg	JP Morgan	394
816	Orior AG	JP Morgan	2.984	207	Tecan Group AG Reg	Barclays Bank	757
(4.922)	Panalpina Welttransport			3.720	Tecan Group AG Reg	Goldman Sachs	14.252
	Holding AG Reg	Citibank	17.571	317	Tecan Group AG Reg	Morgan Stanley	1.159
(2.853)	Panalpina Welttransport			(17.321)	Temenos AG	Goldman Sachs	(23.565)
	Holding AG Reg	HSBC	12.476	(146)	u-blox Holding AG	Goldman Sachs	432
145	Partners Group Holding AG	Barclays Bank	168	(1.350)	u-blox Holding AG	HSBC	1.121
2.567	Partners Group Holding AG	Goldman Sachs	(54.760)	(7.373)	UBS Group AG Reg	Goldman Sachs	8.618
2.468	PSP Swiss Property AG Reg	Citibank	302	(32.811)	UBS Group AG Reg	HSBC	29.102
3.204	PSP Swiss Property AG Reg	HSBC	(7.443)	(24.601)	UBS Group AG Reg	Barclays Bank	13.501
1.052	PSP Swiss Property AG Reg	JP Morgan	260	(578)	Valora Holding AG Reg	Goldman Sachs	6.077
4.928	PSP Swiss Property AG Reg	Barclays Bank	(425)	(317)	Valora Holding AG Reg	Barclays Bank	3.559
7.817	PSP Swiss Property AG Reg	Goldman Sachs	(5.117)	(79)	Valora Holding AG Reg	HSBC	959
187	PSP Swiss Property AG Reg	Morgan Stanley	46	(2.925)	VAT Group AG '144A'	HSBC	626
(305)	Rieter Holding AG Reg	HSBC	1.965	(987)	VAT Group AG '144A'	Barclays Bank	724
(4.770)	Rieter Holding AG Reg	Goldman Sachs	64.706	(1.970)	VAT Group AG '144A'	Goldman Sachs	1.963
45.089	Roche Holding AG	Goldman Sachs	(482.891)	(37.617)	Vifor Pharma AG	Goldman Sachs	250.564
5.122	Schindler Holding AG	HSBC	(20.515)	(6.409)	Vifor Pharma AG	HSBC	44.643
1.470	Schindler Holding AG	Goldman Sachs	(3.072)	4.743	Vontobel Holding AG Reg	JP Morgan	(3.377)
12.603	Schmolz + Bickenbach AG Reg	JP Morgan	40	1.479	Vontobel Holding AG Reg	Goldman Sachs	(958)
(12)	Schweizerische Nationalbank	Citibank	(836)	338	Vontobel Holding AG Reg	Morgan Stanley	(353)
(13)	Schweizerische Nationalbank	HSBC	1.196	3.840	Vontobel Holding AG Reg	Barclays Bank	(3.849)
56	SFS Group AG	Barclays Bank	(317)	459	Vontobel Holding AG Reg	HSBC	(807)
3.500	SFS Group AG	Goldman Sachs	(19.199)	219	VP Bank REG	Morgan Stanley	618
397	SFS Group AG	JP Morgan	(1.728)	205	VP Bank REG	Barclays Bank	(366)
1.869	SFS Group AG	Morgan Stanley	(10.578)	(129)	VZ Holding AG	Barclays Bank	247
(163)	SGS SA Reg	Barclays Bank	1.363	(128)	VZ Holding AG	Goldman Sachs	(1.120)
(101)	SGS SA Reg	Goldman Sachs	1.417	(13)	VZ Holding AG	HSBC	(130)
(359)	SGS SA Reg	HSBC	(3.255)	92	Ypsomed Holding AG	JP Morgan	(1.626)
751	Sika AG - BR	Goldman Sachs	(140.589)	1.037	Ypsomed Holding AG Reg	Morgan Stanley	(17.246)
(3.183)	Sonova Holding AG Reg	Barclays Bank	(6.900)	(20)	Zur Rose AG	JP Morgan	(25)
(12.571)	Sonova Holding AG Reg	Goldman Sachs	(58.702)	(546)	Zur Rose AG	Goldman Sachs	1.426
(6.363)	Sonova Holding AG Reg	HSBC	(34.853)	(3.927)	Zur Rose AG	HSBC	(2.666)
16	St Galler Kantonalbank AG Reg	HSBC	(348)	1.501	Zurich Insurance Group AG	Goldman Sachs	(15.095)
33	St Galler Kantonalbank AG Reg	JP Morgan	(718)	87	Zurich Insurance Group AG	HSBC	(1.553)
120	St Galler Kantonalbank AG Reg	Goldman Sachs	(2.508)	1.295	Zurich Insurance Group AG	JP Morgan	(9.253)
16	St Galler Kantonalbank AG Reg	Barclays Bank	(237)				
201	Straumann Holding AG Reg	Citibank	(1.319)				(281.275)
2.485	Straumann Holding AG Reg	HSBC	(66.691)	Royaume-Uni			
441	Straumann Holding AG Reg	JP Morgan	(11.126)	57.197	888 Holdings Plc	Goldman Sachs	(6.526)
79	Straumann Holding AG Reg	Barclays Bank	(720)	20.397	888 Holdings Plc	Morgan Stanley	(4.375)
1.592	Straumann Holding AG Reg	Goldman Sachs	(43.079)	63.201	888 Holdings Plc	Barclays Bank	(13.556)
(2.982)	Sulzer AG Reg	Barclays Bank	11.684	(7.176)	Acacia Mining Plc	Barclays Bank	665
(5.819)	Sulzer AG Reg	HSBC	4.159	(254.767)	Acacia Mining Plc	Goldman Sachs	26.653
(24.174)	Sulzer AG Reg	Goldman Sachs	6.636	(442)	Accesso Technology Group Plc	Goldman Sachs	(1.322)
(141)	Sunrise Communications			(14.682)	Accesso Technology Group Plc	Morgan Stanley	(33.734)
	Group	Barclays Bank	6	(4.185)	Accesso Technology Group Plc	HSBC	(14.500)
(1.207)	Sunrise Communications			(1.417)	Accesso Technology Group Plc	JP Morgan	(4.948)
	Group	HSBC	74	(13.535)	Accesso Technology Group Plc	Citibank	(19.302)
(256)	Sunrise Communications			(8.119)	Admiral Group Plc	Goldman Sachs	312
	Group AG '144A'	Goldman Sachs	(10)	(28.892)	Admiral Group Plc	JP Morgan	4.875
(130)	Swatch Group AG/The	HSBC	(349)	(7.977)	Admiral Group Plc	HSBC	1.101
(1.474)	Swatch Group AG/The	Barclays Bank	(8.314)	38.401	Advanced Medical Solutions		
1.735	Swiss Life Holding AG Reg	Citibank	(16.494)		Group Plc	Goldman Sachs	5.914
2.034	Swiss Life Holding AG Reg	Barclays Bank	(36.483)	4.415	Advanced Medical Solutions		
14.753	Swiss Life Holding AG Reg	Goldman Sachs	(253.519)		Group Plc	JP Morgan	378
1.131	Swiss Life Holding AG Reg	HSBC	(10.372)	3.066	AG Barr Plc	Morgan Stanley	(112)
2.567	Swiss Life Holding AG Reg	JP Morgan	(40.131)	16.306	AG Barr Plc	Barclays Bank	483
621	Swiss Life Holding AG Reg	Morgan Stanley	(11.139)	37.184	AG Barr Plc	Goldman Sachs	3.050
(5.031)	Swiss Re AG	Goldman Sachs	36.534	11.717	AG Barr Plc	HSBC	(1.139)
(3.622)	Swiss Re AG	HSBC	22.596	18.315	AG Barr Plc	JP Morgan	(1.375)
(680)	Swisscom AG Reg	Barclays Bank	8.171	68.085	Aggreko Plc	Barclays Bank	(31.738)
(3.269)	Swisscom AG Reg	Goldman Sachs	38.995				

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
71.265	Aggreko Plc	Goldman Sachs	(17.237)	20.875	BAE Systems Plc	Barclays Bank	732
57.706	Aggreko Plc	JP Morgan	(16.267)	119.264	BAE Systems Plc	Goldman Sachs	11.029
56.493	Aggreko Plc	HSBC	(14.959)	16.793	BAE Systems Plc	Citibank	68
54.378	Aggreko Plc	Citibank	(24.111)	48.078	BAE Systems Plc	JP Morgan	5.355
23.598	Aggreko Plc	Morgan Stanley	(10.407)	(31.407)	Bakkavor Group Plc '144A'	Morgan Stanley	584
(223.397)	Alfa Financial Software Holdings Plc '144A'			(7)	Bakkavor Group Plc '144A'	HSBC	(1)
		Goldman Sachs	59.894	(289.102)	Balfour Beatty Plc	Goldman Sachs	-
(5.207)	Anglo American Plc	Goldman Sachs	(2.281)	16.160	Balfour Beatty Plc	Citibank	42
(32.063)	Anglo American Plc	JP Morgan	8.669	42.535	Balfour Beatty Plc	Barclays Bank	(69)
(42.676)	Antofagasta Plc	Goldman Sachs	(2.921)	1.950	Balfour Beatty Plc	JP Morgan	(29)
20.289	AO World Plc	Barclays Bank	(2.558)	29.670	Balfour Beatty Plc	Goldman Sachs	783
70.946	AO World Plc	Goldman Sachs	(3.873)	271	Bank of Georgia Group Plc	Barclays Bank	(5.482)
7.771	AO World Plc	JP Morgan	(700)	153.016	Barclays Plc	Goldman Sachs	(19.352)
42.600	AO World Plc	Morgan Stanley	(4.813)	65.036	Barclays Plc	HSBC	(9.850)
105.898	AO World Plc	HSBC	11.233	27.287	Barclays Plc	Citibank	(4.246)
(31.764)	Arrow Global Group Plc	HSBC	21.311	4.617	Barratt Developments Plc	Barclays Bank	(630)
(76.777)	Arrow Global Group Plc	Goldman Sachs	29.858	52.101	Barratt Developments Plc	Goldman Sachs	(11.769)
(57.968)	Arrow Global Group Plc	JP Morgan	47.763	16.061	Barratt Developments Plc	Citibank	(107)
96.534	Ashmore Group Plc	Barclays Bank	(30.198)	14.310	Barratt Developments Plc	JP Morgan	122
516.304	Ashmore Group Plc	Goldman Sachs	(154.050)	4.937	Barratt Developments Plc	HSBC	(280)
185.257	Ashmore Group Plc	JP Morgan	(44.900)	(180.230)	BBA Aviation Plc	Goldman Sachs	(5.346)
186.133	Ashmore Group Plc	Citibank	(61.164)	(11.492)	BBA Aviation Plc	JP Morgan	(139)
181.073	Ashmore Group Plc	HSBC	(49.343)	(187.906)	BCA Marketplace Plc	Morgan Stanley	11.148
24.109	Ashtead Group Plc	Goldman Sachs	22.651	(24.978)	BCA Marketplace Plc	Citibank	1.482
13.649	Ashtead Group Plc	JP Morgan	27.874	(44.385)	BCA Marketplace Plc	HSBC	1.823
45.202	ASOS Plc	Goldman Sachs	187.858	4.573	Beazley Plc	HSBC	(414)
3.897	ASOS Plc	Barclays Bank	711	52.692	Beazley Plc	JP Morgan	(11.743)
6.165	ASOS Plc	Citibank	1.125	14.827	Beazley Plc	Barclays Bank	(930)
4.930	ASOS Plc	JP Morgan	17.248	79.680	Beazley Plc	Goldman Sachs	(6.877)
10.097	Associated British Foods Plc	Barclays Bank	(1.495)	20.338	Beazley Plc	Morgan Stanley	(3.364)
11.960	Associated British Foods Plc	Goldman Sachs	(1.631)	226	Bellway Plc	Barclays Bank	(348)
6.971	Associated British Foods Plc	HSBC	(3.642)	1.462	Bellway Plc	JP Morgan	(760)
3.445	Associated British Foods Plc	JP Morgan	(1.536)	(33.172)	Berkeley Group Holdings Plc	Goldman Sachs	(21.950)
(2.867.877)	Assura Plc (Reit)	Goldman Sachs	52.294	58.445	Berkeley Group Holdings Plc	Goldman Sachs	38.674
(138.794)	Assura Plc (Reit)	JP Morgan	5.542	(8.224)	Berkeley Group Holdings Plc	HSBC	(12.583)
(55.339)	Assura Plc (Reit)	Barclays Bank	1.452	(18.809)	Berkeley Group Holdings Plc	JP Morgan	(27.790)
(368.718)	Assura Plc (Reit)	HSBC	(1.817)	12.623	Berkeley Group Holdings Plc	Citibank	864
(27.681)	AstraZeneca Plc	Goldman Sachs	(59.458)	(23.850)	BHP Billiton Plc	Goldman Sachs	3.596
(1.115)	AstraZeneca Plc	HSBC	(356)	2.049	Big Yellow Group Plc (Reit)	Barclays Bank	(240)
(9.485)	AstraZeneca Plc	JP Morgan	(5.758)	61.417	Big Yellow Group Plc (Reit)	Goldman Sachs	(14.500)
9.398	Auto Trader Group Plc '144A'	HSBC	(2.127)	19.375	Bodycote Plc	HSBC	14.734
31.850	Auto Trader Group Plc '144A'	JP Morgan	(7.887)	184.368	Bodycote Plc	Goldman Sachs	155.539
2.233	Auto Trader Group Plc '144A'	Citibank	(471)	6.414	Bodycote Plc	Morgan Stanley	4.133
29.506	Auto Trader Group Plc '144A'	Morgan Stanley	(8.449)	5.035	Bodycote Plc	Citibank	2.872
4.090	Auto Trader Group Plc '144A'	Barclays Bank	(716)	4.005	Bodycote Plc	Barclays Bank	2.597
47.441	Auto Trader Group Plc '144A'	Goldman Sachs	(8.609)	4.192	Bodycote Plc	JP Morgan	4.137
(35.557)	Aviva Plc	HSBC	11.196	(5.064)	boohoo.com Plc	Barclays Bank	27
(28.648)	Aviva Plc	Goldman Sachs	10.524	(3.706)	boohoo.com Plc	Goldman Sachs	(54)
(37.303)	Aviva Plc	JP Morgan	11.746	72.117	boohoo.com Plc	Goldman Sachs	5.060
515	Avon Rubber Plc	HSBC	(1)	(18.875)	boohoo.com Plc	HSBC	750
1.393	Avon Rubber Plc	JP Morgan	(130)	(48.227)	boohoo.com Plc	JP Morgan	(44)
(1.570)	B&M European Value Retail SA			24.181	Bovis Homes Group Plc	Barclays Bank	(5.235)
		Barclays Bank	(302)	27.394	Bovis Homes Group Plc	Citibank	(9.312)
(1.559.349)	B&M European Value Retail SA			36.492	Bovis Homes Group Plc	Goldman Sachs	(10.500)
		Goldman Sachs	(382.493)	19.942	Bovis Homes Group Plc	JP Morgan	(384)
21.369	B&M European Value Retail SA			20.005	Bovis Homes Group Plc	HSBC	(324)
		Barclays Bank	4.535	(23.616)	BP Plc	HSBC	(5.606)
176.980	B&M European Value Retail SA			(37.865)	BP Plc	Barclays Bank	6.134
		Goldman Sachs	43.411	(86.072)	BP Plc	Goldman Sachs	2.437
8.086	B&M European Value Retail SA			(28.460)	BP Plc	JP Morgan	(359)
		JP Morgan	1.884	(1.002.189)	Breedon Group Plc	Goldman Sachs	8.575
(387.893)	B&M European Value Retail SA			2.233	Brewin Dolphin Holdings Plc	HSBC	(388)
		JP Morgan	(94.701)	9.709	British American Tobacco Plc	Goldman Sachs	7.018
(54.826)	B&M European Value Retail SA			(121.813)	British American Tobacco Plc	Goldman Sachs	(34.744)
		HSBC	(17.555)	4.454	British American Tobacco Plc	HSBC	3.288
(121.828)	Babcock International Group Plc			14.398	British American Tobacco Plc	JP Morgan	991
		Goldman Sachs	(76.528)	(20.993)	British Land Co Plc/The (Reit)	HSBC	2.555
(40.566)	Babcock International Group Plc			(4.998)	British Land Co Plc/The (Reit)	JP Morgan	(75)
		HSBC	(9.726)	(12.889)	Britvic Plc	Barclays Bank	(7.499)
(132.365)	Babcock International Group Plc			(91.848)	Britvic Plc	Goldman Sachs	(61.973)
		JP Morgan	(62.740)	(39.676)	Britvic Plc	HSBC	(17.595)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(220.031)	Britvic Plc	JP Morgan	(163.441)	27.064	Chemring Group Plc	Goldman Sachs	689
(858.531)	BT Group Plc	Barclays Bank	21.549	2.318	Chemring Group Plc	HSBC	(12)
(2.625.600)	BT Group Plc	Goldman Sachs	40.129	18.026	Cineworld Group Plc	Barclays Bank	709
(195.630)	BT Group Plc	HSBC	808	673.777	Cineworld Group Plc	Goldman Sachs	(127.083)
(72.609)	BT Group Plc	JP Morgan	3.726	(31.748)	Clarkson Plc	Goldman Sachs	(22.077)
(14.705)	BTG Plc	Goldman Sachs	(2.349)	(12.051)	Clarkson Plc	HSBC	(1.772)
(3.295)	Bunzl Plc	Goldman Sachs	(3.195)	(6.041)	Clarkson Plc	JP Morgan	(3.191)
(39.987)	Bunzl Plc	JP Morgan	(48.826)	(843)	Clarkson Plc	Barclays Bank	21
65.353	Burberry Group Plc	Goldman Sachs	188.985	(676)	Clinigen Healthcare Ltd	Goldman Sachs	35
23.691	Burberry Group Plc	JP Morgan	51.561	(3.523)	Clinigen Healthcare Ltd	JP Morgan	187
21.788	Burberry Group Plc	Citibank	15.660	(2.774)	Close Brothers Group Plc	Barclays Bank	3.089
27.504	Burberry Group Plc	HSBC	70.057	(16.933)	Close Brothers Group Plc	Goldman Sachs	19.705
82.626	Cairn Energy Plc	Barclays Bank	(28.936)	(39.866)	Close Brothers Group Plc	JP Morgan	43.589
145.018	Cairn Energy Plc	Goldman Sachs	(20.506)	1.905	Close Brothers Group Plc	Barclays Bank	(3.151)
16.135	Cairn Energy Plc	Morgan Stanley	(5.249)	2.341	Close Brothers Group Plc	Morgan Stanley	(103)
(119.445)	Cairn Energy Plc	Barclays Bank	49.058	979	Close Brothers Group Plc	JP Morgan	(1.396)
(69.484)	Cairn Energy Plc	Goldman Sachs	15.696	909	Close Brothers Group Plc	Citibank	(1.504)
(184.555)	Cairn Energy Plc	JP Morgan	7.159	7.871	Close Brothers Group Plc	HSBC	(8.284)
43.339	Cairn Energy Plc	Citibank	(1.324)	(13.897)	Close Brothers Group Plc	HSBC	14.231
21.980	Cairn Energy Plc	HSBC	(5.887)	117.241	CMC Markets Plc '144A'	Goldman Sachs	(4.280)
81.526	Cairn Energy Plc	JP Morgan	(2.057)	811	CMC Markets Plc '144A'	Barclays Bank	(43)
(213.127)	Cairn Homes Plc	Goldman Sachs	9.378	(355.099)	Coats Group Plc	Goldman Sachs	9.631
(336)	Cairn Homes Plc	JP Morgan	11	(76.420)	Coats Group Plc	JP Morgan	(462)
78.171	Capita Plc	Goldman Sachs	(2.953)	(39.270)	Cobham Plc	Goldman Sachs	(2.666)
(206.297)	Capita Plc	HSBC	(23.393)	23.246	Coca-Cola HBC AG	Barclays Bank	(6.368)
(23.824)	Capita Plc	JP Morgan	(18.075)	41.714	Coca-Cola HBC AG	Goldman Sachs	(1.677)
(61.734)	Capita Plc	Goldman Sachs	(3.346)	8.744	Coca-Cola HBC AG	Citibank	(2.796)
22.477	Capita Plc	HSBC	1.263	25.655	Coca-Cola HBC AG	JP Morgan	5.860
81.633	Capita Plc	JP Morgan	(1.679)	37.265	Coca-Cola HBC AG	HSBC	20.370
(2.048)	Capital & Counties Properties Plc	JP Morgan	24	(12.582)	Compass Group Plc	HSBC	(1.539)
(69.386)	Capital & Counties Properties Plc	HSBC	(4.725)	14.438	Compass Group Plc	Goldman Sachs	12.787
(531.289)	Capital & Counties Properties Plc	Citibank	(36.399)	15.068	Computacenter Plc	Morgan Stanley	(4.206)
25	Capital & Counties Properties Plc	Morgan Stanley	4	2.007	Computacenter Plc	JP Morgan	801
197.748	Card Factory Plc	Barclays Bank	(40.023)	2.639	Computacenter Plc	Barclays Bank	(994)
656.851	Card Factory Plc	Goldman Sachs	(77.487)	150.926	Computacenter Plc	Goldman Sachs	(52.242)
52.407	Card Factory Plc	Morgan Stanley	(16.825)	770	Computacenter Plc	HSBC	244
92.147	Carnival Plc	Goldman Sachs	(62.409)	(7.772)	ContourGlobal Plc '144A'	Barclays Bank	975
(6.304)	Carnival Plc	Goldman Sachs	4.243	(20.592)	ContourGlobal Plc '144A'	Goldman Sachs	2.097
(4.712)	Carnival Plc	JP Morgan	2.898	(6.985)	ContourGlobal Plc '144A'	HSBC	431
(751)	Carnival Plc	HSBC	790	(13.485)	ContourGlobal Plc '144A'	JP Morgan	2.611
27.817	Carnival Plc	Barclays Bank	(30.467)	11.556	ConvaTec Group Plc '144A'	Citibank	810
32.103	Carnival Plc	Citibank	(30.095)	144.025	ConvaTec Group Plc '144A'	Goldman Sachs	2.465
2.078	Carnival Plc	HSBC	(1.087)	6.430	ConvaTec Group Plc '144A'	JP Morgan	416
166.642	Centamin Plc	Goldman Sachs	(63.266)	10.168	Conviviality Plc*	Barclays Bank	(11.740)
118.423	Centamin Plc	Barclays Bank	(44.585)	13.011	Conviviality Plc*	Goldman Sachs	(15.022)
48.397	Centamin Plc	Morgan Stanley	(18.038)	39.946	Conviviality Plc*	HSBC	(46.120)
131.452	Centamin Plc	HSBC	(19.617)	10.248	Conviviality Plc*	Morgan Stanley	(11.832)
(6.755)	Centamin Plc	HSBC	2.715	960	Costain Group Plc	Barclays Bank	(137)
192.692	Centamin Plc	JP Morgan	(65.512)	249.767	Costain Group Plc	Goldman Sachs	(32.662)
224.013	Centamin Plc	Citibank	(84.339)	4.275	Costain Group Plc	JP Morgan	(436)
(28.358)	Centamin Plc	JP Morgan	10.594	5.791	Costain Group Plc	Morgan Stanley	(371)
(1.167)	Central Asia Metals Plc	Barclays Bank	33	3.939	Countryside Properties Plc '144A'	HSBC	34
(10.810)	Central Asia Metals Plc	Goldman Sachs	111	36.243	Countryside Properties Plc '144A'	JP Morgan	(707)
(5.052)	Central Asia Metals Plc	JP Morgan	214	13.864	Countryside Properties Plc '144A'	Barclays Bank	(443)
1.567.279	Centrica Plc	Goldman Sachs	(68.841)	131.115	Countryside Properties Plc '144A'	Goldman Sachs	(7.528)
(155.855)	Centrica Plc	Barclays Bank	2.293	2.717	Countryside Properties Plc '144A'	Morgan Stanley	(87)
(88.508)	Centrica Plc	Goldman Sachs	2.048	7.289	Cranswick Plc	Goldman Sachs	5.250
(22.824)	Centrica Plc	HSBC	(175)	1.571	Cranswick Plc	HSBC	(347)
(463.128)	Centrica Plc	JP Morgan	4.642	(66.983)	Crest Nicholson Holdings Plc	Barclays Bank	3.399
10.990	Charter Court Financial Services Group Plc '144A'	Goldman Sachs	(901)	(746.445)	Crest Nicholson Holdings Plc	Goldman Sachs	443.899
8.748	Charter Court Financial Services Group Plc '144A'	HSBC	(100)	(55.443)	Crest Nicholson Holdings Plc	JP Morgan	(5.558)
23.891	Charter Court Financial Services Group Plc '144A'	JP Morgan	(273)	(55.312)	Crest Nicholson Holdings Plc	HSBC	81
4.502	Charter Court Financial Services Group Plc '144A'	Barclays Bank	(1.130)	10.202	CRH Plc	Barclays Bank	1.006
				9.425	CRH Plc	Goldman Sachs	6.019
				6.659	CRH Plc	HSBC	6.444
				2.705	CRH Plc	JP Morgan	97

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

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
10.909	Croda International Plc	Barclays Bank	(6.596)	8.269	Dunelm Group Plc	Barclays Bank	(6.089)
4.492	Croda International Plc	Goldman Sachs	7.072	156.006	Dunelm Group Plc	Goldman Sachs	(121.469)
7.511	Croda International Plc	Citibank	(4.542)	2.921	Dunelm Group Plc	Morgan Stanley	(2.366)
15.038	Croda International Plc	HSBC	22.961	(19.441)	easyJet Plc	Goldman Sachs	7.319
19.987	Croda International Plc	JP Morgan	29.834	320.530	El Group Plc	HSBC	57.779
(6.306)	Custodian Plc (Reit)	Morgan Stanley	(72)	50.584	El Group Plc	Barclays Bank	3.232
3.848	CYBG Plc	Goldman Sachs	(249)	513.556	Electrocomponents Plc	Goldman Sachs	558.519
10.311	CYBG Plc	HSBC	(59)	89.867	Electrocomponents Plc	HSBC	93.915
72.228	CYBG Plc	JP Morgan	(19.520)	168.633	Electrocomponents Plc	Barclays Bank	143.968
(327.342)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	JP Morgan	100.256	82.804	Electrocomponents Plc	JP Morgan	85.270
(402.235)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	Barclays Bank	369.468	(4.323)	Elementis Plc	Barclays Bank	414
(293.335)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	Goldman Sachs	189.083	(10.358)	Elementis Plc	Goldman Sachs	(473)
(2.748)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	HSBC	2.033	(8.234)	Elementis Plc	JP Morgan	116
(171.072)	Dairy Crest Group Plc	Goldman Sachs	76.659	(12.303)	Elementis Plc	HSBC	445
(10.265)	Dairy Crest Group Plc	JP Morgan	5.551	688	EMIS Group Plc	Barclays Bank	94
13.951	Dart Group Plc	HSBC	(8.674)	2.732	EMIS Group Plc	Goldman Sachs	322
5.389	Dart Group Plc	Barclays Bank	(1.168)	3.638	EMIS Group Plc	HSBC	1.411
54.449	Dart Group Plc	Goldman Sachs	(20.810)	363	EMIS Group Plc	Morgan Stanley	50
4.004	DCC Plc	JP Morgan	(439)	(1.897.157)	Empiric Student Property Plc (Reit)	Goldman Sachs	75.755
376	DCC Plc	Barclays Bank	387	(1.370.434)	EnQuest Plc	Goldman Sachs	68.989
7.351	DCC Plc	Goldman Sachs	3.508	(618.568)	EnQuest Plc	Morgan Stanley	(17.996)
900	DCC Plc	HSBC	(1.626)	(50.195)	EnQuest Plc	Barclays Bank	5.698
(623.559)	Debenhams Plc	Goldman Sachs	12.521	(87.466)	Evrax Plc	JP Morgan	(14.093)
2.457	Dechra Pharmaceuticals Plc	Citibank	1.093	(123.612)	Evrax Plc	HSBC	(20.217)
430	Dechra Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	167	14.020	Experian Plc	Goldman Sachs	6.873
3.202	Dechra Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs	1.155	238.513	Faroe Petroleum Plc	Goldman Sachs	21.358
8.031	Dechra Pharmaceuticals Plc	HSBC	5.717	24.798	Faroe Petroleum Plc	Barclays Bank	283
897	Dechra Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	297	73.286	Faroe Petroleum Plc	HSBC	13.491
512	Dechra Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	409	73.938	Faroe Petroleum Plc	JP Morgan	8.609
6.880	Derwent London Plc (Reit)	Barclays Bank	(4.239)	95.586	Faroe Petroleum Plc	Morgan Stanley	8.253
42.350	Derwent London Plc (Reit)	Goldman Sachs	(35.754)	3.853	FDM Group Holdings Plc	Barclays Bank	296
41.245	Derwent London Plc (Reit)	HSBC	(58.349)	30.663	FDM Group Holdings Plc	Goldman Sachs	(140)
7.759	Derwent London Plc (Reit)	JP Morgan	(10.977)	4.106	FDM Group Holdings Plc	HSBC	25
27.378	DFS Furniture Plc	Goldman Sachs	(1.718)	1.220	FDM Group Holdings Plc	JP Morgan	(117)
39.880	DFS Furniture Plc	HSBC	(2.806)	11.554	FDM Group Holdings Plc	Morgan Stanley	(121)
25.618	DFS Furniture Plc	JP Morgan	(1.978)	(9.029)	Ferguson Plc	Goldman Sachs	(20.602)
9.760	DFS Furniture Plc	Morgan Stanley	(891)	(1.277)	Ferguson Plc	HSBC	(568)
23.475	Diageo Plc	Goldman Sachs	14.493	(4.857)	Ferguson Plc	JP Morgan	(2.542)
10.168	Diageo Plc	Barclays Bank	3.932	99.181	Ferrexpo Plc	Goldman Sachs	(17.765)
431	Diageo Plc	Citibank	119	35.869	Ferrexpo Plc	HSBC	(6.425)
14.102	Diageo Plc	HSBC	7.194	75.745	Ferrexpo Plc	JP Morgan	(16.192)
6.319	Diageo Plc	JP Morgan	6.313	6.823	Fevertree Drinks Plc	Barclays Bank	7.642
22.632	Diploma Plc	Goldman Sachs	5.681	1.581	Fevertree Drinks Plc	Citibank	2.273
405.940	Direct Line Insurance Group Plc	Goldman Sachs	(56.502)	6.562	Fevertree Drinks Plc	HSBC	10.081
(183.632)	Dixons Carphone Plc	Goldman Sachs	80.554	16.510	Fevertree Drinks Plc	JP Morgan	36.810
1.927	Dixons Carphone Plc	Citibank	(78)	23.048	Fevertree Drinks Plc	Goldman Sachs	23.544
38.475	Dixons Carphone Plc	Barclays Bank	1.639	(1.412)	First Derivatives Plc	Barclays Bank	(5.284)
(220.355)	Dixons Carphone Plc	JP Morgan	79.865	(7.986)	First Derivatives Plc	Goldman Sachs	(67.240)
(77.991)	Dixons Carphone Plc	HSBC	8.249	(4.514)	First Derivatives Plc	HSBC	(40.582)
37.351	Domino's Pizza Group Plc	Goldman Sachs	6.387	(4.934)	First Derivatives Plc	JP Morgan	(44.357)
6.526	Domino's Pizza Group Plc	Barclays Bank	506	154.928	Firstgroup Plc	Barclays Bank	(40.333)
52.797	Domino's Pizza Group Plc	Citibank	4.096	127.939	Firstgroup Plc	Goldman Sachs	(30.794)
180.403	Domino's Pizza Group Plc	HSBC	37.437	41.789	Firstgroup Plc	Morgan Stanley	(7.596)
134.730	Domino's Pizza Group Plc	JP Morgan	28.449	60.930	Firstgroup Plc	HSBC	(12.368)
377.551	Drax Group Plc	Barclays Bank	(117.162)	24.878	Firstgroup Plc	JP Morgan	(6.488)
217.003	Drax Group Plc	Goldman Sachs	(41.097)	54.094	Forterra Plc '144A'	HSBC	(13.577)
84.991	Drax Group Plc	Citibank	(26.374)	99.354	Forterra Plc '144A'	JP Morgan	(24.937)
4.589	Drax Group Plc	HSBC	670	153.270	Forterra Plc '144A'	Barclays Bank	(44.590)
1.244	Drax Group Plc	JP Morgan	(236)	116.007	Forterra Plc '144A'	Goldman Sachs	(27.132)
66.433	DS Smith Plc	Citibank	(6.367)	85.343	Forterra Plc '144A'	Morgan Stanley	(24.828)
71.513	DS Smith Plc	JP Morgan	12.228	25.263	Fresnillo Plc	Goldman Sachs	31.128
278.261	DS Smith Plc	Goldman Sachs	34.921	54.342	Fresnillo Plc	JP Morgan	47.571
11.292	DS Smith Plc	Morgan Stanley	(1.082)	(72.821)	Fresnillo Plc	Goldman Sachs	(89.727)
81.907	DS Smith Plc	HSBC	14.391	(3.996)	Frontier Developments Plc	Goldman Sachs	(7.956)
25.523	Dunelm Group Plc	HSBC	(7.814)	(3.069)	Frontier Developments Plc	HSBC	(9.902)
10.797	Dunelm Group Plc	JP Morgan	(2.772)	(1.844)	Frontier Developments Plc	JP Morgan	(6.342)
				(50.458)	G4S Plc	JP Morgan	(6.617)
				(103.839)	G4S Plc	Goldman Sachs	(13.861)
				(40.003)	G4S Plc	HSBC	(3.717)
				8.653	Galliford Try Plc	HSBC	3.192

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
12.723	Galliford Try Plc	JP Morgan	1.579	(59.641)	Hammerson Plc (Reit)	JP Morgan	1.871
213	Galliford Try Plc	Barclays Bank	(21)	(248.685)	Hansteen Holdings Plc (Reit)	Barclays Bank	(4.823)
55.280	Galliford Try Plc	Goldman Sachs	12.264	(184.001)	Hansteen Holdings Plc (Reit)	Goldman Sachs	(3.779)
2.334	Galliford Try Plc	Morgan Stanley	(228)	(155.482)	Hansteen Holdings Plc (Reit)	HSBC	(5.499)
(50.779)	GAME Digital Plc	Goldman Sachs	3.622	(280)	Hansteen Holdings Plc (Reit)	JP Morgan	(10)
(157.715)	GAME Digital Plc	Morgan Stanley	2.793	(24.120)	Hargreaves Lansdown Plc	Barclays Bank	9.356
(375)	GAME Digital Plc	Barclays Bank	7	(307.921)	Hargreaves Lansdown Plc	Goldman Sachs	(15.809)
(41.717)	GAME Digital Plc	HSBC	1.500	(7.790)	Hargreaves Lansdown Plc	HSBC	(5.951)
119	Games Workshop Group Plc	JP Morgan	498	(39.617)	Hargreaves Lansdown Plc	JP Morgan	(38.275)
599	Games Workshop Group Plc	Morgan Stanley	581	(87.685)	Hastings Group Holdings Ltd		
2.189	Games Workshop Group Plc	Barclays Bank	1.546		'144A'	HSBC	10.266
55.926	Games Workshop Group Plc	Goldman Sachs	236.079	(48.597)	Hastings Group Holdings Ltd		
1.642	Games Workshop Group Plc	HSBC	2.340		'144A'	Barclays Bank	6.716
(410.030)	GCP Student Living Plc (Reit)	Goldman Sachs	(12.163)	(61.432)	Hastings Group Holdings Ltd		
(2.077)	GCP Student Living Plc (Reit)	HSBC	(142)		'144A'	JP Morgan	7.528
(12.697)	GCP Student Living Plc (Reit)	JP Morgan	(869)	(29.174)	Hays Plc	Barclays Bank	440
(10.517)	GCP Student Living Plc (Reit)	Morgan Stanley	240	(118.691)	Hays Plc	Goldman Sachs	(1.083)
271	Georgia Capital Plc	Barclays Bank	3.092	(75.627)	Hays Plc	JP Morgan	1.258
(25.578)	GlaxoSmithKline Plc	Goldman Sachs	(17.334)	(7.011)	Hays Plc	HSBC	111
(9.751)	GlaxoSmithKline Plc	JP Morgan	(3.969)	35.303	Hill & Smith Holdings Plc	Goldman Sachs	(16.565)
(13.391)	Glencore Plc	Barclays Bank	1.728	4.733	Hill & Smith Holdings Plc	HSBC	789
(20.174)	Glencore Plc	Goldman Sachs	3.817	10.410	Hill & Smith Holdings Plc	JP Morgan	2.613
(35.469)	Glencore Plc	JP Morgan	1.423	13.925	Hill & Smith Holdings Plc	Morgan Stanley	(3.544)
(25.560)	Glencore Plc	HSBC	(210)	12.246	Hill & Smith Holdings Plc	Barclays Bank	(3.271)
12.263	Go-Ahead Group Plc	Morgan Stanley	(11.892)	2.180	Hiscox Ltd	Barclays Bank	(69)
19.934	Go-Ahead Group Plc	HSBC	(12.281)	251	Hiscox Ltd	Goldman Sachs	(3)
9.742	Go-Ahead Group Plc	JP Morgan	(6.002)	(24.185)	Hiscox Ltd	Barclays Bank	1.320
18.323	Go-Ahead Group Plc	Barclays Bank	(36.165)	(1.122)	Hiscox Ltd	Goldman Sachs	(26)
30.262	Go-Ahead Group Plc	Goldman Sachs	(53.169)	(21.620)	Hiscox Ltd	JP Morgan	1.012
1.602.925	Gocompare.Com Group Plc	Goldman Sachs	(95.095)	6.777	Hiscox Ltd	JP Morgan	(334)
85.743	Gocompare.Com Group Plc	Morgan Stanley	(4.109)	(66.747)	Hochschild Mining Plc	Goldman Sachs	(5.635)
18.883	Grafton Group Plc (Unit)	HSBC	(8.294)	(16.003)	Hochschild Mining Plc	Barclays Bank	603
4.520	Grafton Group Plc (Unit)	JP Morgan	(1.836)	(26.619)	Hochschild Mining Plc	JP Morgan	577
12.270	Grafton Group Plc (Unit)	Barclays Bank	(1.330)	(97.927)	HomeServe Plc	Goldman Sachs	(128.693)
143.205	Grafton Group Plc (Unit)	Goldman Sachs	(6.535)	12.918	Howden Joinery Group Plc	Goldman Sachs	(389)
7.445	Grafton Group Plc (Unit)	Morgan Stanley	(807)	7.642	Howden Joinery Group Plc	Morgan Stanley	(598)
18.398	Grainger Plc	Barclays Bank	260	18.865	Howden Joinery Group Plc	JP Morgan	(1.486)
39.175	Grainger Plc	Goldman Sachs	(2.451)	11.239	Howden Joinery Group Plc	Citibank	(348)
7.583	Grainger Plc	Morgan Stanley	(225)	(9.987)	HSBC Holdings Plc	Barclays Bank	847
2.943	Grainger Plc	HSBC	(389)	(191.657)	HSBC Holdings Plc	Goldman Sachs	30.795
10.527	Grainger Plc	JP Morgan	(298)	(54.641)	HSBC Holdings Plc	JP Morgan	5.631
(1.391)	Great Portland Estates Plc (Reit)			13.225	Hunting Plc	Goldman Sachs	1.332
(133.487)	Great Portland Estates Plc (Reit)	Barclays Bank	117	7.942	Hunting Plc	HSBC	2.750
(63.342)	Great Portland Estates Plc (Reit)	Goldman Sachs	1.523	28.492	Hunting Plc	JP Morgan	6.438
(55.269)	Great Portland Estates Plc (Reit)	HSBC	11.346	1.390	Hunting Plc	Barclays Bank	(662)
(1.506.317)	Greencore Group Plc	JP Morgan	8.592	(63.960)	Hurricane Energy Plc	JP Morgan	(83)
(295.374)	Greencore Group Plc	Goldman Sachs	(363.469)	(7.515)	Hurricane Energy Plc	HSBC	(10)
(106.151)	Greene King Plc	JP Morgan	(75.371)	490	lbstock Plc '144A'	Barclays Bank	(82)
35.811	Greene King Plc	Goldman Sachs	(28.073)	7.047	lbstock Plc '144A'	HSBC	(324)
48.723	Greene King Plc	Goldman Sachs	9.470	62.149	IG Group Holdings Plc	JP Morgan	16.663
44.516	Greene King Plc	HSBC	23.084	27.003	IG Group Holdings Plc	Citibank	(5.545)
8.150	Greene King Plc	JP Morgan	19.589	52.939	IG Group Holdings Plc	HSBC	1.876
57.654	Greggs PLC	Citibank	(913)	6.231	IG Group Holdings Plc	Morgan Stanley	(1.280)
23.224	Gulf Keystone Petroleum Ltd	Goldman Sachs	28.942	62.880	IG Group Holdings Plc	Barclays Bank	(10.479)
83.374	Gulf Keystone Petroleum Ltd	Barclays Bank	(5.723)	222.086	IG Group Holdings Plc	Goldman Sachs	7.642
40.041	Gulf Keystone Petroleum Ltd	HSBC	5.971	(4.715)	IMI Plc	Goldman Sachs	191
15.046	Gulf Keystone Petroleum Ltd	JP Morgan	2.781	(83.787)	IMI Plc	JP Morgan	(47.288)
16.339	Gulf Keystone Petroleum Ltd	Morgan Stanley	(4.026)	21.906	Imperial Brands Plc	Goldman Sachs	(8.435)
45.942	GVC Holdings Plc	Goldman Sachs	52.152	6.519	Imperial Brands Plc	JP Morgan	(4.217)
953	Halfords Group Plc	JP Morgan	(34)	581.072	Inchcape Plc	Goldman Sachs	(106.070)
(7.966)	Halma Plc	Barclays Bank	(316)	71.454	Inchcape Plc	Citibank	(2.853)
27.389	Halma Plc	Goldman Sachs	20.623	73.833	Inchcape Plc	HSBC	(1.664)
17.553	Halma Plc	HSBC	16.421	55.971	Inchcape Plc	JP Morgan	(3.618)
25.140	Halma Plc	JP Morgan	23.519	251.936	Inchcape Plc	Barclays Bank	(8.061)
(1.862)	Halma Plc	JP Morgan	(183)	5.496	Indivior Plc	Morgan Stanley	581
(31.008)	Hammerson Plc (Reit)	Goldman Sachs	825	(34.262)	Indivior Plc	JP Morgan	(3.518)
(69.209)	Hammerson Plc (Reit)	HSBC	903	5.240	Indivior Plc	Barclays Bank	544
				99.983	Indivior Plc	Goldman Sachs	25.323
				6.452	Indivior Plc	HSBC	711
				28.452	Informa Plc	Barclays Bank	5.973
				17.180	Informa Plc	Goldman Sachs	6.743

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
26.735	Informa Plc	HSBC	9.177	35.043	Keller Group Plc	HSBC	(4.633)
16.568	Informa Plc	Citibank	3.478	(397)	Keywords Studios Plc	Barclays Bank	167
213.678	Informa Plc	JP Morgan	68.949	(711)	Keywords Studios Plc	JP Morgan	436
218.510	Inmarsat Plc	Goldman Sachs	(19.445)	(48.283)	Keywords Studios Plc	Goldman Sachs	70.509
2.022	Inmarsat Plc	Citibank	456	(284)	Keywords Studios Plc	HSBC	426
(7.776)	InterContinental Hotels Group Plc	JP Morgan	1.266	(1.801.958)	Kingfisher Plc	Goldman Sachs	(330.988)
(1.711)	InterContinental Hotels Group Plc	Barclays Bank	750	9.780	Land Securities Group Plc (Reit)	Barclays Bank	(2.710)
(3.882)	InterContinental Hotels Group Plc	HSBC	(3.741)	59.059	Land Securities Group Plc (Reit)	Citibank	(14.074)
(42.632)	International Consolidated Airlines Group SA	Goldman Sachs	2.702	254.368	Land Securities Group Plc (Reit)	Goldman Sachs	(48.146)
697.631	International Consolidated Airlines Group SA	Goldman Sachs	(25.469)	40.325	Land Securities Group Plc (Reit)	HSBC	(16.777)
(21.728)	International Consolidated Airlines Group SA	Barclays Bank	3.708	4.690	Land Securities Group Plc (Reit)	JP Morgan	(828)
(47.224)	International Consolidated Airlines Group SA	JP Morgan	2.662	(28.631)	Learning Technologies Group Plc	JP Morgan	(3.054)
161.027	Intertek Group Plc	Goldman Sachs	763.387	(822.684)	Learning Technologies Group Plc	Goldman Sachs	(40.191)
5.813	Intertek Group Plc	JP Morgan	24.371	472.167	Legal & General Group Plc	Goldman Sachs	(64.215)
45.535	Investec Plc	Barclays Bank	(15.377)	142.828	Legal & General Group Plc	Barclays Bank	(23.072)
10.787	Investec Plc	JP Morgan	(1.863)	10.794	Legal & General Group Plc	Morgan Stanley	(1.933)
6.798	IQE Plc	Morgan Stanley	(1.419)	96.703	Legal & General Group Plc	JP Morgan	(6.195)
124.032	IQE Plc	HSBC	(15.641)	273.503	Legal & General Group Plc	Citibank	(46.465)
50.257	IQE Plc	Barclays Bank	(9.157)	142.673	Legal & General Group Plc	HSBC	(5.886)
108.801	IQE Plc	Citibank	(4.793)	(218.761)	Lloyds Banking Group Plc	JP Morgan	1.349
160.070	IQE Plc	Goldman Sachs	(12.337)	3.411	London Stock Exchange Group Plc	Barclays Bank	(839)
98.212	IQE Plc	JP Morgan	(13.120)	2.363	London Stock Exchange Group Plc	JP Morgan	811
(86.473)	ITV Plc	Barclays Bank	5.815	2.443	London Stock Exchange Group Plc	Citibank	(1.331)
(47.209)	ITV Plc	Goldman Sachs	2.037	8.520	London Stock Exchange Group Plc	HSBC	(3.127)
(18.926)	ITV Plc	HSBC	543	1.949	London Stock Exchange Group Plc	Goldman Sachs	156
(121.466)	ITV Plc	JP Morgan	1.999	399.931	Lookers Plc	Goldman Sachs	(25.551)
12.974	J D Wetherspoon Plc	Barclays Bank	(444)	20.644	Lookers Plc	HSBC	722
31.532	J D Wetherspoon Plc	Goldman Sachs	9.713	5.684	Lookers Plc	JP Morgan	4
11.600	J D Wetherspoon Plc	Morgan Stanley	(397)	39.861	Majestic Wine Plc	Barclays Bank	(2.274)
11.575	J D Wetherspoon Plc	HSBC	5.546	187.579	Majestic Wine Plc	Goldman Sachs	(9.630)
9.635	J D Wetherspoon Plc	JP Morgan	4.617	86.389	Majestic Wine Plc	HSBC	19.712
(289.532)	J Sainsbury Plc	Goldman Sachs	(50.799)	44.850	Man Group Plc	Barclays Bank	(2.372)
(12.188)	J Sainsbury Plc	Barclays Bank	(354)	23.394	Man Group Plc	Goldman Sachs	(4.089)
(350.963)	J Sainsbury Plc	JP Morgan	(94.493)	28.238	Man Group Plc	JP Morgan	(2.702)
21.209	JD Sports Fashion Plc	Barclays Bank	(225)	87.197	Man Group Plc	Citibank	(2.043)
141.677	JD Sports Fashion Plc	Goldman Sachs	(13.806)	(203.303)	Marks & Spencer Group Plc	Barclays Bank	17.392
(67.871)	JD Sports Fashion Plc	Goldman Sachs	7.976	(965.899)	Marks & Spencer Group Plc	Goldman Sachs	93.139
(79.158)	JD Sports Fashion Plc	JP Morgan	10.506	(507.835)	Marks & Spencer Group Plc	HSBC	48.179
8.889	JD Sports Fashion Plc	Morgan Stanley	(140)	(566.928)	Marks & Spencer Group Plc	JP Morgan	56.370
30.651	JD Sports Fashion Plc	JP Morgan	1.802	32.150	Marshall's Plc	Goldman Sachs	1.100
13.373	JD Sports Fashion Plc	HSBC	50	27.004	Marshall's Plc	Barclays Bank	(1.540)
(60.945)	John Wood Group Plc	JP Morgan	(8.517)	(40.003)	Marston's Plc	HSBC	4.793
(17.539)	John Wood Group Plc	Barclays Bank	2.801	(61.350)	Marston's Plc	JP Morgan	301
(5.141)	John Wood Group Plc	Goldman Sachs	(620)	(636.947)	Marston's Plc	Goldman Sachs	59.481
27.256	John Wood Group Plc	Barclays Bank	(1.762)	(392.152)	McCarthy & Stone Plc '144A'	Goldman Sachs	36.687
84.395	John Wood Group Plc	Goldman Sachs	(7.446)	116.015	Mediclinic International Plc	Goldman Sachs	(84.247)
(1.897)	Johnson Matthey Plc	HSBC	(1.923)	4.671	Mediclinic International Plc	Barclays Bank	(3.475)
(7.975)	Johnson Matthey Plc	Goldman Sachs	(4.445)	(52.907)	Mediclinic International Plc	HSBC	47.202
(3.619)	Johnson Matthey Plc	JP Morgan	(161)	101.847	Mediclinic International Plc	JP Morgan	(80.873)
54.381	Johnson Service Group Plc	Barclays Bank	248	13.882	Meggitt Plc	Goldman Sachs	(733)
68.400	Johnson Service Group Plc	Morgan Stanley	(9.052)	27.849	Merlin Entertainments Plc '144A'	Goldman Sachs	(36)
189.264	Johnson Service Group Plc	Goldman Sachs	(17.706)	(86.752)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Barclays Bank	13.955
167.241	Johnson Service Group Plc	HSBC	(10.685)	(314.227)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Goldman Sachs	11.472
83.738	Johnson Service Group Plc	JP Morgan	(5.350)	(64.675)	Merlin Entertainments Plc '144A'	JP Morgan	2.435
(98.182)	Jupiter Fund Management Plc	JP Morgan	12.801	(1.267)	Metro Bank Plc	Barclays Bank	(148)
(18.737)	Jupiter Fund Management Plc	HSBC	2.746				
(12.486)	Just Eat Plc	JP Morgan	186				
4.694	KAZ Minerals Plc	Barclays Bank	1.413				
10.167	KAZ Minerals Plc	Citibank	2.086				
2.182	KAZ Minerals Plc	HSBC	236				
713	KAZ Minerals Plc	JP Morgan	230				
35.301	Keller Group Plc	JP Morgan	(8.844)				
18.876	Keller Group Plc	Barclays Bank	(908)				
51.649	Keller Group Plc	Goldman Sachs	(9.754)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
7.877	Micro Focus International Plc	JP Morgan	633	(654.509)	Old Mutual Plc	JP Morgan	129.529
8.417	Micro Focus International Plc	Barclays Bank	(5.041)	(10.964)	Old Mutual Plc	HSBC	90
1.874	Micro Focus International Plc	Citibank	(129)	(61.046)	On the Beach Group Plc '144A'	Goldman Sachs	(8.771)
(128.371)	Micro Focus International Plc	Goldman Sachs	(94.464)	(14.374)	On the Beach Group Plc '144A'	HSBC	(2.179)
(724.152)	Mitchells & Butlers Plc	Goldman Sachs	77.660	46.075	OneSavings Bank Plc	Goldman Sachs	(4.636)
(40.076)	Mitchells & Butlers Plc	Barclays Bank	5.487	19.300	OneSavings Bank Plc	Morgan Stanley	(1.368)
45.716	Mondi Plc	Goldman Sachs	43.946	14.801	OneSavings Bank Plc	HSBC	(2.704)
34.176	Mondi Plc	Citibank	(9.748)	13.341	OneSavings Bank Plc	JP Morgan	683
21.301	Mondi Plc	JP Morgan	25.164	62.683	Ophir Energy Plc	Barclays Bank	(2.204)
33.573	Mondi Plc	Barclays Bank	(3.682)	35.826	Ophir Energy Plc	JP Morgan	(3.447)
48.697	Mondi Plc	HSBC	62.653	31.495	Ophir Energy Plc	Morgan Stanley	(1.514)
19.244	Moneysupermarket.com Group Plc	Morgan Stanley	227	121.315	Ophir Energy Plc	Goldman Sachs	(9.177)
357.498	Moneysupermarket.com Group Plc	Citibank	1.015	6.012	P2P Global Investments Plc/Fund	Barclays Bank	(1.097)
60.842	Moneysupermarket.com Group Plc	HSBC	967	5.680	P2P Global Investments Plc/Fund	JP Morgan	(563)
224.560	Moneysupermarket.com Group Plc	JP Morgan	2.151	642	P2P Global Investments Plc/Fund	Goldman Sachs	(117)
265.224	Moneysupermarket.com Group Plc	Barclays Bank	1.038	729	P2P Global Investments Plc/Fund	HSBC	(83)
526.028	Moneysupermarket.com Group Plc	Goldman Sachs	14.947	1.927	P2P Global Investments Plc/Fund	Morgan Stanley	(352)
784	Morgan Sindall Group Plc	HSBC	1.288	2.058	Pagegroup Plc	Morgan Stanley	(178)
99.651	Morgan Sindall Group Plc	Goldman Sachs	38.655	(4.458)	Pagegroup Plc	JP Morgan	178
3.879	Morgan Sindall Group Plc	JP Morgan	6.373	3.433	Pagegroup Plc	Goldman Sachs	(128)
6.745	Morgan Sindall Group Plc	Morgan Stanley	(1.385)	(50.861)	Pagegroup Plc	Goldman Sachs	8.994
(724.550)	Mothercare Plc	Goldman Sachs	(114.306)	(8.924)	Pagegroup Plc	HSBC	356
(201.571)	Mothercare Plc	Morgan Stanley	7.295	1.042	Pagegroup Plc	Citibank	(190)
(108.728)	Mothercare Plc	HSBC	(17.488)	4.934	Pagegroup Plc	HSBC	(514)
(147.697)	Mothercare Plc	JP Morgan	(23.756)	(218.190)	Paragon Banking Group Plc	JP Morgan	138.320
338.830	N Brown Group Plc	Goldman Sachs	3.093	(54.901)	Paragon Banking Group Plc	Barclays Bank	41.026
35.142	N Brown Group Plc	HSBC	5.212	(313.337)	Paragon Banking Group Plc	Goldman Sachs	224.203
58.809	N Brown Group Plc	Morgan Stanley	6.709	(75.472)	Paragon Banking Group Plc	HSBC	52.232
40.411	National Express Group Plc	Goldman Sachs	(1.107)	(124.988)	Patisserie Holdings Plc	Barclays Bank	6.417
19.995	National Grid Plc	Barclays Bank	(9.573)	(163.660)	Patisserie Holdings Plc	Goldman Sachs	(56.015)
687	National Grid Plc	Citibank	(372)	33.094	PayPoint Plc	Barclays Bank	21.899
2.938	National Grid Plc	Morgan Stanley	(1.592)	45.397	PayPoint Plc	Goldman Sachs	54.382
16.849	National Grid Plc	Goldman Sachs	(4.571)	35.644	PayPoint Plc	Morgan Stanley	23.586
27.382	National Grid Plc	HSBC	(5.025)	15.546	PayPoint Plc	HSBC	22.348
8.928	National Grid Plc	JP Morgan	(229)	20.543	PayPoint Plc	JP Morgan	29.531
(132.637)	NCC Group Plc	Goldman Sachs	(303)	(22.328)	Pearson Plc	Goldman Sachs	764
(114.980)	NewRiver Plc (Reit)	Morgan Stanley	(11.806)	(109.741)	Pearson Plc	JP Morgan	6.952
(21.398)	NewRiver Plc (Reit)	HSBC	(2.319)	(19.186)	Pearson Plc	HSBC	3.222
(47.170)	NewRiver Plc (Reit)	JP Morgan	(5.112)	7.597	Pendragon Plc	Morgan Stanley	(61)
(142.454)	NewRiver Plc (Reit)	Goldman Sachs	(25.191)	36.813	Pendragon Plc	HSBC	(630)
(25.203)	NEX Group Plc	Goldman Sachs	(4.313)	96.061	Pendragon Plc	JP Morgan	(1.644)
(6.386)	Next Plc	Barclays Bank	(437)	41.273	Pendragon Plc	Barclays Bank	(330)
(18.833)	Next Plc	Goldman Sachs	(17.853)	35.308	Pendragon Plc	Goldman Sachs	(645)
(13.929)	Next Plc	JP Morgan	(3.207)	1.361	Pennon Group Plc	Citibank	426
(16.611)	Next Plc	HSBC	(1.543)	2.159	Pennon Group Plc	Barclays Bank	419
462	NMC Health Plc	Morgan Stanley	(114)	147.979	Pennon Group Plc	Goldman Sachs	72.258
377	NMC Health Plc	JP Morgan	(671)	1.154	Pennon Group Plc	JP Morgan	255
507	NMC Health Plc	Barclays Bank	(523)	4.770	Persimmon Plc	Morgan Stanley	587
5.360	NMC Health Plc	Citibank	(10.354)	6.020	Persimmon Plc	Citibank	292
13.860	NMC Health Plc	Goldman Sachs	(6.182)	4.999	Persimmon Plc	HSBC	1.729
(643)	NMC Health Plc	HSBC	640	24.551	Persimmon Plc	JP Morgan	18.074
(339)	NMC Health Plc	JP Morgan	413	11.444	Persimmon Plc	Barclays Bank	2.023
(21.655)	Northgate Plc	Goldman Sachs	(1.433)	1.709	Persimmon Plc	Goldman Sachs	526
(4.887)	Northgate Plc	JP Morgan	(2.096)	(1.476.369)	Petra Diamonds Ltd	Goldman Sachs	273.709
(85.860)	Nostrum Oil & Gas Plc	Goldman Sachs	52.081	112.966	Petrofac Ltd	Barclays Bank	(21.394)
(834)	Nostrum Oil & Gas Plc	HSBC	438	181.420	Petrofac Ltd	Goldman Sachs	(107.488)
519	Numis Corp Plc	Goldman Sachs	(181)	18.496	Petrofac Ltd	Morgan Stanley	(3.477)
14.999	Numis Corp Plc	Morgan Stanley	(2.163)	126.566	Petrofac Ltd	Citibank	(12.784)
3.360	Numis Corp Plc	Barclays Bank	(206)	23.381	Petrofac Ltd	HSBC	(4.009)
15.594	Numis Corp Plc	HSBC	(1.220)	12.101	Petrofac Ltd	JP Morgan	(3.792)
(267.135)	Ocado Group Plc	Morgan Stanley	(77.778)	154.961	Pets at Home Group Plc	Barclays Bank	(21.806)
(8.622)	Ocado Group Plc	HSBC	(9.934)	201.588	Pets at Home Group Plc	Goldman Sachs	(65.855)
(101.750)	Ocado Group Plc	JP Morgan	(139.390)	153.541	Pets at Home Group Plc	Morgan Stanley	(21.606)
(116.913)	Old Mutual Plc	Barclays Bank	16.006	5.024	Phoenix Group Holdings	Citibank	(559)
(333.812)	Old Mutual Plc	Goldman Sachs	46.463	(34.720)	Phoenix Group Holdings	Barclays Bank	8.794
				29.038	Phoenix Group Holdings	Barclays Bank	(3.934)

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes				Plus-values/ (moins-values) latentes			
Nombre	Description	Contrepartie	EUR	Nombre	Description	Contrepartie	EUR
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
30.802	Phoenix Group Holdings	Goldman Sachs	(4.203)	19.133	Rolls-Royce Holdings Plc	JP Morgan	(3.093)
(45.052)	Phoenix Group Holdings	Goldman Sachs	4.472	10.304	Rolls-Royce Holdings Plc	Citibank	(4.467)
(56.374)	Phoenix Group Holdings	HSBC	129	(39.754)	Rolls-Royce Holdings Plc	JP Morgan	2.722
80.717	Picton Property Income Ltd/The	Morgan Stanley	(795)	31.229	Rotork Plc	Barclays Bank	(6.449)
42.806	Picton Property Income Ltd/The	Barclays Bank	(421)	132.613	Rotork Plc	HSBC	(20.341)
10.740	Playtech Plc	Citibank	(3.828)	52.818	Rotork Plc	JP Morgan	(6.440)
30.113	Playtech Plc	JP Morgan	668	10.201	Rotork Plc	Morgan Stanley	(1.343)
39.012	Playtech Plc	HSBC	2.307	18.345	Rotork Plc	Citibank	(457)
38.738	Playtech Plc	Barclays Bank	(16.392)	4.845	Rotork Plc	Goldman Sachs	(744)
92.426	Playtech Plc	Goldman Sachs	(31.895)	(18.862)	Royal Bank of Scotland Group Plc	Barclays Bank	4.455
(38.008)	Polypipe Group Plc	Goldman Sachs	16.261	(603.844)	Royal Bank of Scotland Group Plc	Goldman Sachs	122.779
(4.753)	Provident Financial Plc	Barclays Bank	779	(431.745)	Royal Bank of Scotland Group Plc	JP Morgan	23.964
(8.103)	Provident Financial Plc	Citibank	3.864	(156.484)	Royal Bank of Scotland Group Plc	HSBC	11.706
(80.901)	Prudential Plc	Barclays Bank	89.643	(44.164)	Royal Dutch Shell Plc 'B'	Goldman Sachs	42.576
(304.358)	Prudential Plc	Goldman Sachs	349.096	(42.668)	Royal Dutch Shell Plc 'B'	HSBC	(23.698)
(34.552)	Prudential Plc	HSBC	36.266	(11.545)	Royal Mail Plc	Barclays Bank	1.159
(29.314)	Prudential Plc	JP Morgan	29.050	(204.071)	Royal Mail Plc	Goldman Sachs	175.012
(200.847)	PZ Cussons Plc	Barclays Bank	5.041	177.950	Royal Mail Plc	Goldman Sachs	(195.711)
(828.954)	PZ Cussons Plc	Goldman Sachs	39.721	(46.770)	Royal Mail Plc	JP Morgan	7.398
(14.453)	PZ Cussons Plc	JP Morgan	1.121	45.338	RPC Group Plc	Barclays Bank	(10.523)
(217.727)	QinetiQ Group Plc	Goldman Sachs	(74.244)	47.530	RPC Group Plc	Goldman Sachs	7.809
(19.680)	QinetiQ Group Plc	JP Morgan	(4.742)	17.386	RPC Group Plc	HSBC	(655)
(9.305)	Randgold Resources Ltd	JP Morgan	(21.451)	20.692	RPC Group Plc	JP Morgan	2.471
(3.577)	Randgold Resources Ltd	Barclays Bank	(5.893)	(16.987)	RPS Group Plc	Goldman Sachs	872
(1.141)	Randgold Resources Ltd	HSBC	(3.171)	5.651	RSA Insurance Group Plc	Goldman Sachs	(59)
2.731	Rathbone Brothers Plc	Barclays Bank	(2.306)	(146.904)	RWS Holdings Plc	Goldman Sachs	(24.302)
5.835	Rathbone Brothers Plc	Morgan Stanley	(4.926)	(181.116)	RWS Holdings Plc	Barclays Bank	(38.227)
3.159	Rathbone Brothers Plc	Goldman Sachs	(3.460)	(45.815)	RWS Holdings Plc	HSBC	-
172	Rathbone Brothers Plc	JP Morgan	39	(29.140)	RWS Holdings Plc	JP Morgan	-
1.990	Rathbone Brothers Plc	HSBC	454	(5.831)	Sabre Insurance Group Plc '144A'	Barclays Bank	606
(953.998)	RDI Plc (Reit)	JP Morgan	(10.503)	(7.909)	Sabre Insurance Group Plc '144A'	JP Morgan	(300)
6.569	Reckitt Benckiser Group Plc	HSBC	12.278	(81.976)	Sabre Insurance Group Plc '144A'	Goldman Sachs	17.770
(109.557)	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldman Sachs	(109.993)	55.923	Safestore Holdings Plc (Reit)	Goldman Sachs	20.417
10.344	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldman Sachs	8.084	556.319	Saga Plc	HSBC	(49.473)
(6.632)	Reckitt Benckiser Group Plc	JP Morgan	(12.787)	63.437	Saga Plc	JP Morgan	(5.317)
2.233	Redde Plc	Barclays Bank	(220)	678.470	Saga Plc	Goldman Sachs	(57.280)
3.099	Redde Plc	HSBC	(192)	(99.359)	Sage Group Plc/The	HSBC	3.634
3.247	Redde Plc	Morgan Stanley	(66)	(362.695)	Sage Group Plc/The	JP Morgan	(14.437)
29.119	Redde Plc	Goldman Sachs	(2.259)	(205.947)	Sage Group Plc/The	Barclays Bank	28.244
10.406	Redde Plc	JP Morgan	(13)	(516.147)	Sage Group Plc/The	Goldman Sachs	(18.785)
(121.515)	Redrow Plc	Goldman Sachs	51.295	(806)	Sanne Group Plc	Barclays Bank	276
(21.845)	Redrow Plc	Barclays Bank	4.735	(19.082)	Sanne Group Plc	JP Morgan	(1.959)
(188.540)	Redrow Plc	JP Morgan	41.119	(210.418)	Sanne Group Plc	Goldman Sachs	(7.202)
(70.786)	Redrow Plc	HSBC	19.017	7.721	Savills Plc	Barclays Bank	573
(5.207)	Regional Ltd (Reit) '144A'	JP Morgan	107	32.817	Savills Plc	Goldman Sachs	9.734
(9.846)	Regional Ltd (Reit) '144A'	Goldman Sachs	382	7.011	Savills Plc	HSBC	360
(1.146.029)	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	Morgan Stanley	(2.615)	18.966	Savills Plc	JP Morgan	974
(124.843)	Renewi Plc	Barclays Bank	(8.403)	(50.070)	Scapa Group Plc	Goldman Sachs	(2.742)
(12.120)	Renewi Plc	HSBC	(650)	(11.445)	Schroders Plc	Goldman Sachs	21.806
(28.945)	Renewi Plc	JP Morgan	(1.552)	1.253	Schroders Plc	Goldman Sachs	(1.652)
(6.392)	Renishaw Plc	Goldman Sachs	4.376	608	Schroders Plc	Morgan Stanley	(780)
(12.200)	Renishaw Plc	JP Morgan	(64.151)	(13.099)	Schroders Plc	JP Morgan	18.681
(2.404)	Renishaw Plc	HSBC	(14.619)	117.964	Segro Plc (Reit)	Goldman Sachs	4.037
(195.256)	Rentokil Initial Plc	Goldman Sachs	(56.805)	95.470	Segro Plc (Reit)	HSBC	7.353
(43.875)	Restaurant Group Plc/The	Barclays Bank	1.191	589	Segro Plc (Reit)	Barclays Bank	18
(304.768)	Restaurant Group Plc/The	Goldman Sachs	(13.978)	45.627	Senior Plc	Goldman Sachs	648
(3.777)	Rhi Magnesita NV	Goldman Sachs	3.016	33.945	Senior Plc	JP Morgan	(154)
(1.210)	Rhi Magnesita NV	HSBC	(1.449)	52.928	Senior Plc	Barclays Bank	(1.328)
(330)	Rhi Magnesita NV	JP Morgan	(395)	120.178	Senior Plc	HSBC	(5.859)
(777)	Rightmove Plc	Barclays Bank	56	104.643	Senior Plc	Morgan Stanley	19.121
(6.400)	Rightmove Plc	JP Morgan	1.122	(1.906.267)	Serco Group Plc	Goldman Sachs	75.032
(3.891)	Rio Tinto Plc	HSBC	(1.002)	65.049	Severn Trent Plc	Goldman Sachs	12.353
(2.710)	Rio Tinto Plc	Barclays Bank	(215)	266	Severn Trent Plc	Barclays Bank	(201)
(24.823)	Rio Tinto Plc	Goldman Sachs	(6.149)	2.524	Severn Trent Plc	HSBC	(483)
(12.512)	Rio Tinto Plc	JP Morgan	(12.716)				
15.775	Rolls Royce Holdings Plc	Barclays Bank	(6.839)				
31.160	Rolls Royce Holdings Plc	Goldman Sachs	(4.906)				
(2.424.224)	Rolls Royce Holdings Plc	Goldman Sachs	-				

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes				Plus-values/ (moins-values) latentes			
Nombre	Description	Contrepartie	EUR	Nombre	Description	Contrepartie	EUR
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
16.327	Severn Trent Plc	JP Morgan	(3.131)	6.052	Synthomer Plc	Morgan Stanley	621
14.099	Severn Trent Plc	Citibank	(9.316)	(173.258)	TalkTalk Telecom Group Plc	HSBC	44.673
16.602	Shaftesbury Plc (Reit)	Goldman Sachs	(8.702)	(589.530)	TalkTalk Telecom Group Plc	JP Morgan	109.683
2.744	Shaftesbury Plc (Reit)	Morgan Stanley	(317)	(86.037)	TalkTalk Telecom Group Plc	Citibank	11.975
107.447	Shaftesbury Plc (Reit)	Citibank	(75.038)	328.943	Tate & Lyle Plc	Barclays Bank	325.765
1.769	Shaftesbury Plc (Reit)	HSBC	(1.158)	746.295	Tate & Lyle Plc	Goldman Sachs	751.468
(109.181)	Smart Metering Systems Plc	Goldman Sachs	(7.455)	79.766	Tate & Lyle Plc	JP Morgan	82.276
(1.998)	Smart Metering Systems Plc	JP Morgan	(128)	252.079	Tate & Lyle Plc	Citibank	250.206
(19.548)	Smith & Nephew Plc	Barclays Bank	(9.855)	9.829	Tate & Lyle Plc	HSBC	4.623
(27.319)	Smith & Nephew Plc	Goldman Sachs	(16.862)	1.103.888	Taylor Wimpey Plc	Goldman Sachs	(146.485)
(48.885)	Smith & Nephew Plc	JP Morgan	(28.063)	45.041	Taylor Wimpey Plc	Barclays Bank	(7.374)
(45.998)	Smith & Nephew Plc	HSBC	(28.142)	34.617	Taylor Wimpey Plc	Morgan Stanley	(5.412)
12.779	Smiths Group Plc	Goldman Sachs	14.274	246.143	Taylor Wimpey Plc	JP Morgan	(32.650)
237.281	Softcat Plc	Goldman Sachs	102.870	35.136	Taylor Wimpey Plc	Citibank	(5.752)
(451.703)	SolGold Plc	Goldman Sachs	10.199	41.885	Taylor Wimpey Plc	HSBC	(6.100)
(46.227)	SolGold Plc	HSBC	780	(5.432)	Ted Baker Plc	Barclays Bank	4.808
21.524	Sophos Group Plc '144A'	JP Morgan	3.889	(21.264)	Ted Baker Plc	Goldman Sachs	45.958
(3.447)	Spectris Plc	Goldman Sachs	(1.744)	(880)	Ted Baker Plc	JP Morgan	842
(3.476)	Spectris Plc	JP Morgan	(35)	(1.535)	Ted Baker Plc	HSBC	4.000
6.923	Spirax-Sarco Engineering Plc	Goldman Sachs	14.239	(87.286)	Telecom Plus Plc	Barclays Bank	15.933
44.600	Spire Healthcare Group Plc '144A'	Barclays Bank	(1.527)	(8.853)	Telecom Plus Plc	JP Morgan	1.757
21.703	Spire Healthcare Group Plc '144A'	Goldman Sachs	1.733	(69.218)	Telecom Plus Plc	Goldman Sachs	16.133
7.256	Spire Healthcare Group Plc '144A'	HSBC	2.219	(4.820)	Telford Homes Plc	HSBC	(742)
519.935	Spirent Communications Plc	Goldman Sachs	(49.828)	77.498	Tesco Plc	Barclays Bank	1.508
52.823	Spirent Communications Plc	Morgan Stanley	723	70.586	Tesco Plc	Citibank	1.349
(249.337)	Sports Direct International Plc	Goldman Sachs	15.634	282.510	Tesco Plc	Goldman Sachs	4.595
7.615	Sports Direct International Plc	Goldman Sachs	(952)	92.918	Tesco Plc	HSBC	7.190
7.627	Sports Direct International Plc	Citibank	(78)	22.387	Thomas Cook Group Plc	Goldman Sachs	(73)
10.281	Sports Direct International Plc	JP Morgan	(1.297)	33.065	Thomas Cook Group Plc	Morgan Stanley	(180)
(75.903)	Sports Direct International Plc	Barclays Bank	11.344	147.934	Thomas Cook Group Plc	HSBC	(2.470)
8.483	Sports Direct International Plc	Morgan Stanley	(1.253)	229.524	Thomas Cook Group Plc	JP Morgan	(4.438)
45.600	Sports Direct International Plc	HSBC	(3.572)	(50.873)	TI Fluid Systems Plc '144A'	Goldman Sachs	-
(254.078)	Sports Direct International Plc	Citibank	37.973	(37.807)	TI Fluid Systems Plc '144A'	Barclays Bank	(863)
(209.441)	Sports Direct International Plc	HSBC	15.920	(5.364)	TI Fluid Systems Plc '144A'	HSBC	(367)
(173.688)	Sports Direct International Plc	JP Morgan	9.683	(7.856)	TI Fluid Systems Plc '144A'	JP Morgan	(538)
2.854	SSE Plc	Citibank	(1.834)	85.839	Topps Tiles Plc	JP Morgan	3.116
51.119	SSE Plc	Goldman Sachs	(12.878)	81.024	Topps Tiles Plc	HSBC	2.941
1.291	SSE Plc	JP Morgan	(422)	549.430	Topps Tiles Plc	Goldman Sachs	19.946
1.857	SSE Plc	Barclays Bank	(810)	(374.144)	TP ICAP Plc	Goldman Sachs	93.054
9.118	SSE Plc	HSBC	(517)	17.367	TP ICAP Plc	Morgan Stanley	(3.507)
16.121	SSP Group Plc	Morgan Stanley	1.678	90.071	TP ICAP Plc	Citibank	(18.189)
159.266	SSP Group Plc	Barclays Bank	715	28.623	TP ICAP Plc	Goldman Sachs	(6.894)
92.434	SSP Group Plc	Citibank	2.263	105.437	TP ICAP Plc	HSBC	(39.389)
453.789	SSP Group Plc	Goldman Sachs	44.227	21.417	TP ICAP Plc	JP Morgan	(11.712)
119.486	SSP Group Plc	HSBC	24.514	(155.931)	TP ICAP Plc	Barclays Bank	31.488
134.025	SSP Group Plc	JP Morgan	1.560	(356.536)	TP ICAP Plc	JP Morgan	218.380
57.532	St James's Place Plc	HSBC	14.106	(4.419)	Travis Perkins Plc	Barclays Bank	(187)
6.846	St James's Place Plc	Barclays Bank	(2.031)	(6.596)	Travis Perkins Plc	Goldman Sachs	1.521
35.277	St James's Place Plc	Goldman Sachs	6.238	(51.714)	Travis Perkins Plc	JP Morgan	2.357
5.624	St James's Place Plc	JP Morgan	927	(29)	Tritax Big Box Plc (Reit)***	Goldman Sachs	-
(445.172)	Stagecoach Group Plc	Goldman Sachs	3.555	7.561	TUI AG	Citibank	(379)
(74.107)	Standard Chartered Plc	Goldman Sachs	16.571	2.405	TUI AG	HSBC	500
(106.004)	Standard Chartered Plc	JP Morgan	8.106	1.939	TUI AG	Barclays Bank	(5)
(18.088)	Standard Chartered Plc	HSBC	(666)	1.354	TUI AG	Goldman Sachs	(990)
15.258	Standard Life Aberdeen Plc	Goldman Sachs	(1.688)	920	TUI AG	Morgan Stanley	(231)
9.285	Standard Life Aberdeen Plc	Citibank	(2.034)	(226.447)	Tullow Oil Plc	JP Morgan	41.728
70.339	Standard Life Aberdeen Plc	Barclays Bank	847	(127.779)	Tullow Oil Plc	Goldman Sachs	15.974
(191.402)	Stobart Group Ltd	Goldman Sachs	34.939	(36.369)	Tyman Plc	HSBC	(2.490)
(30.312)	Stobart Group Ltd	HSBC	7.608	(53.740)	Tyman Plc	Goldman Sachs	(7.970)
(54.846)	Stobart Group Ltd	JP Morgan	13.766	(70.461)	Tyman Plc	JP Morgan	(4.823)
274.292	Stock Spirits Group Plc	Goldman Sachs	(38.335)	(53.104)	UDG Healthcare Plc	Goldman Sachs	17.267
41.304	Stock Spirits Group Plc	HSBC	(6.008)	(77.308)	UK Commercial Property Trust Ltd/Fund	Goldman Sachs	1.676
154.643	Stock Spirits Group Plc	JP Morgan	(22.495)	(12.534)	Ultra Electronics Holdings Plc	JP Morgan	(15.549)
295.170	Strix Group Plc	Goldman Sachs	13.672	(4.398)	Ultra Electronics Holdings Plc	Barclays Bank	(593)
30.376	Strix Group Plc	HSBC	1.060	(14.872)	Ultra Electronics Holdings Plc	Goldman Sachs	(21.888)
(67.279)	SuperGroup Plc	Goldman Sachs	5.270	(3.211)	UNITE Group Plc/The (Reit)	Goldman Sachs	126
(20.857)	SuperGroup Plc	JP Morgan	6.846	32.970	United Utilities Group Plc	JP Morgan	2.934
1.928	Synthomer Plc	Goldman Sachs	196	11.361	United Utilities Group Plc	Citibank	(2.644)
				59.266	United Utilities Group Plc	Barclays Bank	(13.794)
				100.251	United Utilities Group Plc	Goldman Sachs	10.705

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

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

« *Contracts for difference* » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
65.521	United Utilities Group Plc	HSBC	1.202	1.054	WH Smith Plc	Morgan Stanley	(637)
(469.710)	Vectura Group Plc	Goldman Sachs	4.073	(26.198)	Whitbread Plc	Barclays Bank	2.382
39.511	Vedanta Resources Plc	Goldman Sachs	(34.259)	(108.695)	Whitbread Plc	Goldman Sachs	(56.815)
(7.595)	Vedanta Resources Plc	Goldman Sachs	1.494	(11.041)	Whitbread Plc	HSBC	1.391
(18.975)	Vedanta Resources Plc	JP Morgan	10.622	(26.863)	Whitbread Plc	JP Morgan	1.235
2.865	Vesuvius Plc	Goldman Sachs	245	(60.834)	William Hill Plc	Goldman Sachs	6.082
(3.363)	Victoria Plc	HSBC	(71)	196.951	William Hill Plc	Barclays Bank	(23.563)
(15.718)	Victoria Plc	Barclays Bank	700	210.331	William Hill Plc	Goldman Sachs	(16.094)
(154.609)	Victoria Plc	Goldman Sachs	8.784	(78.261)	William Hill Plc	JP Morgan	(19.470)
(18.858)	Victoria Plc	JP Morgan	(182)	(64.169)	William Hill Plc	HSBC	(9.683)
1.204	Victrex Plc	Barclays Bank	522	(2.466)	William Hill Plc	Barclays Bank	304
1.022	Victrex Plc	Goldman Sachs	403	130.955	William Hill Plc	JP Morgan	20.533
2.920	Victrex Plc	Citibank	1.600	86.111	William Hill Plc	HSBC	(7.722)
913	Victrex Plc	Morgan Stanley	396	82.798	William Hill Plc	Morgan Stanley	(10.202)
(11.604)	Victrex Plc	HSBC	(3.879)	(1.049)	Wizz Air Holdings Plc '144A'	Goldman Sachs	(149)
(5.501)	Victrex Plc	JP Morgan	(1.658)	(22.260)	Wizz Air Holdings Plc '144A'	JP Morgan	(7.440)
(36.989)	Virgin Money Holdings UK Plc	Barclays Bank	(42)	(1.460)	Wizz Air Holdings Plc '144A'	HSBC	10
(38.594)	Virgin Money Holdings UK Plc	JP Morgan	(484)	723.690	Wm Morrison		
211.957	Vodafone Group Plc	Citibank	(16.444)		Supermarkets Plc	Barclays Bank	(1.547)
64.686	Vodafone Group Plc	Barclays Bank	(5.018)	2.701.149	Wm Morrison		
2.181.518	Vodafone Group Plc	Goldman Sachs	(138.088)		Supermarkets Plc	Goldman Sachs	(132.378)
288.488	Vodafone Group Plc	HSBC	(44.466)	350.136	Wm Morrison		
84.156	Vodafone Group Plc	JP Morgan	(14.935)		Supermarkets Plc	HSBC	(16.236)
17.780	Weir Group Plc/The	Barclays Bank	(17.675)	490.192	Wm Morrison		
8.150	Weir Group Plc/The	HSBC	(5.574)		Supermarkets Plc	JP Morgan	(5.555)
301	Weir Group Plc/The	Morgan Stanley	(453)	38.752	Wm Morrison		
(741)	Weir Group Plc/The	Barclays Bank	1.116		Supermarkets Plc	Citibank	(3.802)
(29.073)	Weir Group Plc/The	Goldman Sachs	31.241	40.831	Workspace Group Plc (Reit)	Barclays Bank	2.912
23.151	Weir Group Plc/The	JP Morgan	(26.726)	52.426	Workspace Group Plc (Reit)	Goldman Sachs	16.851
(97)	Weir Group Plc/The	JP Morgan	41	4.516	Workspace Group Plc (Reit)	Morgan Stanley	258
(25.114)	Weir Group Plc/The	HSBC	16.357	11.112	Workspace Group Plc (Reit)	HSBC	3.699
7.844	Weir Group Plc/The	Citibank	(10.544)	(45.342)	WPP Plc	Barclays Bank	63.886
29.871	Weir Group Plc/The	Goldman Sachs	(16.546)	(96.736)	WPP Plc	Goldman Sachs	45.249
9.321	WH Smith Plc	Citibank	(2.170)	(12.019)	WPP Plc	JP Morgan	3.154
15.027	WH Smith Plc	HSBC	(3.853)	(33.882)	WPP Plc	HSBC	21.487
1.629	WH Smith Plc	JP Morgan	(431)				
5.720	WH Smith Plc	Barclays Bank	(3.459)				2.452.261
6.145	WH Smith Plc	Goldman Sachs	(3.135)				
				Total (exposition brute sous-jacente – 1.814.890.795 EUR)			
				(19.364)			

BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund

suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	293.577	EUR	246.951	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	8.696
EUR	5.706	CHF	6.698	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(126)
						8.570
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
EUR	16.015	GBP	14.033	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	8
GBP	760.988	EUR	868.544	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(541)
						(533)
Catégorie d'Actions couverte en couronnes suédoises						
EUR	2.695.082	SEK	27.646.692	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	4.871
SEK	1.152.888.242	EUR	111.082.807	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	1.101.043
						1.105.914
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
EUR	65.705	USD	77.028	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(364)
USD	5.668.753	EUR	4.764.912	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	97.376
						97.012
Total (exposition brute sous-jacente – 120.947.907 EUR)						1.210.963

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	63,24
Organismes de placement collectif	8,19
Biens de consommation non cyclique	7,48
Biens de consommation cyclique	3,94
Valeurs industrielles	3,94
Portefeuille de titres à la valeur de marché	86,79
Autres éléments de l'actif net	13,21
	100,00

BlackRock European Opportunities Extension Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES							
Belgique				Suisse			
243.192	KBC Group NV	16.036.080	1,43	305.170	Cie Financiere Richemont SA Reg	24.254.430	2,16
674.767	Kinepolis Group NV	37.921.905	3,37	320.991	Julius Baer Group Ltd*	16.204.837	1,44
263.971	Telenet Group Holding NV	11.572.489	1,03	56.712	Kuehne + Nagel International AG Reg*	7.382.267	0,66
		65.530.474	5,83	217.209	Lonza Group AG Reg	50.345.363	4,48
Danemark				33.563	Partners Group Holding AG	20.880.294	1,86
766.280	Ambu A/S 'B'*	19.611.099	1,74	37.828	Schindler Holding AG	6.910.230	0,61
536.066	Danske Bank A/S	15.238.892	1,36	30.404	Schindler Holding AG Reg	5.395.212	0,48
589.869	DSV A/S	42.222.044	3,75	3.851	Sika AG	26.673.949	2,37
96.078	Genmab A/S	12.548.709	1,12	65.830	Straumann Holding AG Reg	37.429.209	3,33
1.162.933	Novo Nordisk A/S 'B'	47.377.809	4,21	100.997	Tecan Group	20.384.287	1,81
549.856	Royal Unibrew A/S	33.684.746	3,00			215.860.078	19,20
		170.683.299	15,18	Royaume-Uni			
Finlande				776.914	Shield Therapeutics Plc	234.888	0,02
534.586	Konecranes OYJ	19.154.216	1,70			234.888	0,02
1.251.786	Wartsila OYJ Abp	22.832.577	2,03	Total des actions ordinaires		911.788.678	81,09
		41.986.793	3,73	OBLIGATIONS			
France				Pays-Bas			
313.268	Alten SA*	26.894.058	2,39	EUR 7.500.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 19/3/2019	7.529.100	0,67
93.741	Ipsen SA	12.809.707	1,14			7.529.100	0,67
38.160	Teleperformance	5.163.048	0,46	Etats-Unis			
108.986	Thales SA	11.879.474	1,06	EUR 5.000.000	Toyota Motor Credit Corp RegS FRN 20/7/2018	5.001.825	0,45
		56.746.287	5,05			5.001.825	0,45
Allemagne				Total des obligations		12.530.925	1,12
287.798	Aumann AG	17.181.541	1,53	CERTIFICATS DE DÉPÔT			
135.283	Continental AG	29.586.392	2,63	France			
218.208	SAP SE	21.081.075	1,87	EUR 2.500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 13/8/2018 (Zero Coupon)	2.501.588	0,22
		67.849.008	6,03	EUR 15.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 12/10/2018 (Zero Coupon)	15.019.770	1,34
Irlande						17.521.358	1,56
1.184.849	Bank of Ireland Group Plc	8.584.231	0,76	Royaume-Uni			
160.136	DCC Plc	13.190.685	1,17	EUR 8.000.000	Mizhuo Corporate Bank/London 8/6/2018 (Zero Coupon)	8.000.888	0,71
3.550.937	Irish Continental Group Plc	19.175.060	1,71			8.000.888	0,71
109.466	Origin Enterprises Plc	591.116	0,05	Total des certificats de dépôt		25.522.246	2,27
		41.541.092	3,69	BILLET DE TRÉSORERIE			
Luxembourg				France			
500.743	Stabilus SA	42.112.486	3,75	EUR 5.000.000	Matchpoint Finance Plc 13/8/2018 (Zero Coupon)	5.003.250	0,44
		42.112.486	3,75			5.003.250	0,44
Pays-Bas				Luxembourg			
40.181	ASML Holding NV	6.832.779	0,61	EUR 4.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel 20/9/2018 (Zero Coupon)	4.004.448	0,36
126.626	IMCD NV	6.755.497	0,60	EUR 4.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1/8/2018 (Zero Coupon)	4.002.376	0,36
86.408	Koninklijke DSM NV	7.436.272	0,66	EUR 15.000.000	Honeywell International Inc 25/7/2018 (Zero Coupon)	15.008.109	1,33
1.333.483	RELX NV	24.996.139	2,22	EUR 4.000.000	Nordea Bank AB 6/6/2018 (Zero Coupon)	4.000.228	0,36
333.667	TKH Group NV*	19.352.686	1,72				
		65.373.373	5,81				
Suède							
372.570	AddLife AB	6.869.810	0,61				
1.245.157	AddTech AB 'B'	23.020.001	2,05				
443.506	Alimak Group AB '144A'	5.843.133	0,52				
1.556.505	Assa Abloy AB 'B'	28.791.233	2,56				
73.168	Avanza Bank Holding AB	3.082.739	0,27				
543.006	Hexagon AB 'B'	26.069.422	2,32				
657.218	Loomis AB 'B'	21.730.036	1,93				
811.752	Thule Group AB/The '144A'	17.266.374	1,54				
393.453	Troax Group AB	11.198.152	1,00				
		143.870.900	12,80				

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Opportunities Extension Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Organismes de placement collectif			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Luxembourg suite				Irlande			
EUR 8.000.000	Procter & Gamble Co/The RegS 29/8/2018 (Zero Coupon)	8.007.721	0,71	100.707.036	Institutional Cash Series Plc - Institutional Euro Assets Liquidity Fund Agency Dis ¹	100.707.036	8,96
EUR 5.500.000	Svenska Handelsbanken AB 'A' 10/8/2018 (Zero Coupon)	5.503.912	0,49			100.707.036	8,96
EUR 18.000.000	Svenska Handelsbanken AB 'A' Regs 7/8/2018 (Zero Coupon)	18.012.922	1,60	Total des organismes de placement collectif		100.707.036	8,96
EUR 8.000.000	Svenska Handelsbanken AB 'A' Regs 17/9/2018 (Zero Coupon)	8.009.378	0,71	Portefeuille de titres à la valeur de marché		1.132.111.012	100,69
EUR 10.000.000	UBS AG 29/8/2018 (Zero Coupon)	10.009.783	0,89	Autres éléments du passif net		(7.732.081)	(0,69)
		76.558.877	6,81	Total de l'actif net (EUR)		1.124.378.931	100,00
Total des billets de trésorerie		81.562.127	7,25				
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		1.031.403.976	91,73				

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock European Opportunities Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Autriche				Grèce			
(96.584)	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	JP Morgan	283.957	(68.857)	FF Group	Deutsche Bank	161.814
			283.957				161.814
Danemark				Irlande			
(118.225)	H Lundbeck A/S	Citibank	(398.660)	(160.740)	Glanbia Plc	Bank of America Merrill Lynch	(271.651)
(130.530)	Novozymes A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(208.678)	1.656.404	Irish Continental Group Plc (Unit)	Citibank	(115.948)
			(607.338)				(387.599)
Finlande				Italie			
(75.208)	Huhtamaki OYJ	JP Morgan	(29.331)	(171.114)	Fiat Chrysler Automobiles NV	JP Morgan	(52.703)
			(29.331)	(25.698)	Gima TT SpA '144A'	JP Morgan	22.308
				660.415	Tenaris SA	Citibank	(815.613)
							(846.008)
France				Pays-Bas			
(265.508)	Air France-KLM	Deutsche Bank	104.079	(15.945)	Boskalis Westminster	Citibank	5.581
175.183	Alten SA	Deutsche Bank	183.942	(37.801)	Brunel International NV	Deutsche Bank	23.815
(193.933)	Carrefour SA	JP Morgan	219.144	(133.397)	Koninklijke Vopak NV	JP Morgan	(114.722)
(88.480)	Casino Guichard Perrachon SA	JP Morgan	523.802	(7.241)	SNS REAAL NV***	Deutsche Bank	-
(12.550)	Eurofins Scientific SE	Bank of America Merrill Lynch	5.020				(85.326)
(46.109)	Imerys SA	Citibank	116.521				
(42.557)	Ingenico Group SA	JP Morgan	200.018				
41.300	Kering SA	Bank of America Merrill Lynch	958.160				
(145.831)	Korian SA	JP Morgan	113.748	(126.220)	Yara International ASA	JP Morgan	(27.491)
(49.271)	Sodexo SA	JP Morgan	-				(27.491)
(200.030)	TechnipFMC Plc	Bank of America Merrill Lynch	30.004				
60.932	Teleperformance	JP Morgan	(188.889)	(1.135.318)	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	Deutsche Bank	409.850
29.042	Thales SA	Bank of America Merrill Lynch	(47.919)	1.513.771	Industria de Diseno Textil SA	Deutsche Bank	847.712
(801.553)	Vallourec SA	Citibank	580.324	(323.382)	Mediaset Espana Comunicacion SA	Citibank	184.974
284.269	Vinci SA	Deutsche Bank	(301.325)				1.442.536
			2.496.629				
Allemagne				Suède			
(450.969)	ADVA Optical Networking SE	Bank of America Merrill Lynch	(220.975)	(407.278)	Arjo AB	Citibank	33.685
(82.466)	Bayerische Motoren Werke AG	Deutsche Bank	543.451	(48.005)	Autoliv Inc SDR	Bank of America Merrill Lynch	(164.654)
(127.852)	Ceconomy AG	Citibank	54.976	(526.217)	Dometic Group AB '144A'	Citibank	186.890
(25.884)	Ceconomy AG	JP Morgan	21.536	(407.278)	Getinge AB 'B'	Citibank	31.703
(55.647)	Covestro AG '144A'	JP Morgan	(66.776)	(142.576)	Millicom International Cellular SA SDR	Citibank	27.746
(271.719)	Deutsche Bank AG Reg	JP Morgan	592.891				115.370
(144.268)	Deutsche EuroShop AG	Citibank	5.771				
(163.835)	Deutsche Lufthansa AG Reg	JP Morgan	303.652				
(156.064)	Dialog Semiconductor Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.364)				
(339.544)	ElringKlinger AG	Citibank	27.164	(239.511)	ABB Ltd Reg	Bank of America Merrill Lynch	277.364
(157.001)	Evonik Industries AG	Bank of America Merrill Lynch	199.391	(3.379)	Barry Callebaut AG Reg	JP Morgan	285.387
(301.949)	Gerry Weber International AG	Deutsche Bank	138.897	(59.098)	BB Biotech AG Reg	JP Morgan	(33.447)
(321.716)	Metro AG	Bank of America Merrill Lynch	(152.815)	(41.501)	Dufry AG Reg	Citibank	281.856
3.441	Puma SE	Bank of America Merrill Lynch	316.572	(7.697)	Dufry AG Reg	Deutsche Bank	67.689
(77.032)	RIB Software SE	Bank of America Merrill Lynch	42.890	(393.921)	GAM Holding AG	Citibank	463.038
(166.365)	Rocket Internet SE '144A'	Deutsche Bank	66.546	(83.768)	Landis+Gyr Group AG	JP Morgan	76.584
(4.436)	Sartorius AG (Pref)	JP Morgan	2.662	81.426	Medartis Holding AG	Citibank	(35.449)
(85.390)	SLM Solutions Group AG	JP Morgan	(133.374)	(17.921)	Panalpina Welttransport Holding AG Reg	JP Morgan	70.218
(83.786)	Software AG	JP Morgan	171.761	(10.281)	Sonova Holding AG Reg	Citibank	(124.877)
(223.029)	Suedzucker AG	Citibank	(73.600)	(74.465)	Swiss Prime Site AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	90.772
(18.469)	Volkswagen AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	223.106	(26.087)	u-blox Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	77.228
(12.352)	zooplus AG	JP Morgan	104.992	(41.886)	VAT Group AG '144A'	Bank of America Merrill Lynch	539.764
			2.159.354				2.036.127

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

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

BlackRock European Opportunities Extension Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Royaume-Uni				Royaume-Uni suite			
(2.532.035)	AA Plc	Bank of America Merrill Lynch	268.654	(1.946.601)	Kingfisher Plc	Bank of America Merrill Lynch	(357.556)
(537.720)	Aggreko Plc	Bank of America Merrill Lynch	130.057	507.626	London Stock Exchange Group Plc	JP Morgan	758.676
1.076.887	Associated British Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	(614.301)	(821.101)	Meggitt Plc	Bank of America Merrill Lynch	(68.385)
1.561.571	Auto Trader Group Plc '144A'	JP Morgan	(361.659)	6.018.296	Melrose Industries Plc	Deutsche Bank	247.182
1.674.099	Beazley Plc	Citibank	(105.047)	(1.456.222)	Mitie Group Plc	JP Morgan	119.619
952.450	British American Tobacco Plc	JP Morgan	461.819	(1.396.225)	N Brown Group Plc	Deutsche Bank	(12.743)
5.602.325	Cairn Homes Plc	Bank of America Merrill Lynch	(246.502)	(183.197)	Ocado Group Plc	JP Morgan	(704.351)
(4.342.748)	Cobham Plc	Deutsche Bank	(294.797)	(461.103)	Pearson Plc	Deutsche Bank	15.782
(736.219)	ConvaTec Group Plc '144A'	JP Morgan	(298.883)	(171.660)	Persimmon Plc	Citibank	9.792
350.106	DCC Plc	JP Morgan	(539.231)	(629.002)	RPC Group Plc	JP Morgan	(103.253)
(11.568.723)	Debenhams Plc	Citibank	184.780	659.422	Ryanair Holdings Plc	Deutsche Bank	524.240
3.607.667	Domino's Pizza Group Plc	JP Morgan	769.678	277.537	Shire Plc	JP Morgan	254.893
4.148.611	Elementis Plc	Citibank	(397.579)	236.157	Spirax-Sarco Engineering Plc	Bank of America Merrill Lynch	606.212
(2.224.929)	Flybe Group Plc	JP Morgan	3.808	(1.923.385)	Vodafone Group Plc	JP Morgan	274.709
908.295	Hargreaves Lansdown Plc	Deutsche Bank	46.632	883.548	Weir Group Plc/The	JP Morgan	(372.969)
670.566	Hiscox Ltd	Citibank	(153.007)				110.930
(422.736)	Inchcape Plc	Citibank	16.880				
(139.599)	Johnson Matthey Plc	Citibank	47.780				
				Total (exposition brute sous-jacente – 719.119.832 EUR)			
				6.823.624			

BlackRock European Opportunities Extension Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values latentes EUR
GBP	233.993.288	EUR	264.995.060	State Street Bank & Trust Company	15/6/2018	1.888.316
NOK	56.112.980	EUR	5.852.936	State Street Bank & Trust Company	15/6/2018	26.090
Total (exposition brute sous-jacente – 272.762.402 EUR)						1.914.406

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Valeurs industrielles	29,77
Biens de consommation non cyclique	26,37
Finance	15,27
Biens de consommation cyclique	12,8
Organismes de placement collectif	8,96
Technologie	4,66
Énergie	1,17
Communications	1,03
Matériaux de base	0,66
Portefeuille de titres à la valeur de marché	100,69
Autres éléments du passif net	(0,69)
	100,00

BlackRock European Select Strategies Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	
ACTIONS ORDINAIRES								
18.440	Belgique Solvay SA			92.007	Suède suite Loomis AB 'B' Telia Co AB*	3.042.089	0,53	
		2.129.820	0,37	725.061		2.920.804	0,51	
		2.129.820	0,37			13.585.328	2,37	
78.518	Bermudes Hiscox Ltd			64.621	Suisse Novartis AG Reg Zurich Insurance Group AG	4.180.576	0,73	
		1.343.698	0,23	6.781		1.737.631	0,30	
		1.343.698	0,23			5.918.207	1,03	
171.543 87.165	Danemark Danske Bank A/S Novo Nordisk A/S 'B'	4.876.499	0,85	Royaume-Uni AstraZeneca Plc British American Tobacco Plc Direct Line Insurance Group Plc DS Smith Plc* IG Group Holdings Plc Royal Dutch Shell Plc 'B' Spirax-Sarco Engineering Plc TP ICAP Plc Unilever Plc	3.097.834	0,54		
		3.551.096	0,62		49.369	5.904.324	1,03	
		8.427.595	1,47		134.369	2.229.912	0,39	
68.004 149.366 160.072	Finlande Kone OYJ 'B' Sampo OYJ 'A' Wartsila OYJ Abp*	2.879.289	0,51	545.811	2.229.912	0,39		
		6.304.739	1,10	607.815	3.847.238	0,67		
		2.919.713	0,51	240.509	2.380.356	0,42		
		12.103.741	2,12	195.991	6.010.444	1,05		
101.471 366.450 3.323 83.216 102.557 63.956 45.913	France Bouygues* Engie SA Renault SA Sanofi	4.031.443	0,70	34.365	2.434.721	0,43		
		4.981.888	0,87	281.223	1.346.576	0,23		
		275.543	0,05	94.873	4.526.555	0,79		
83.216 102.557 63.956 45.913	France SCOR SE Total SA Vinci SA	5.474.781	0,96	Total des actions ordinaires			31.777.960	5,55
		3.242.852	0,57				149.108.737	26,05
		3.319.316	0,58					
45.913	France Vinci SA	3.859.447	0,67	OBLIGATIONS				
		25.185.270	4,40					
33.022 29.276 101.944 26.017	Allemagne Allianz SE Deutsche Boerse AG Deutsche Post AG Reg	5.877.916	1,03	USD 145.000	Argentine Argentine Republic Government International Bond 4,625% 11/1/2023	114.118	0,02	
		3.359.421	0,59	EUR 230.000		Argentine Republic Government International Bond 3,375% 15/1/2023	217.235	0,04
		3.331.530	0,58	USD 870.000		Argentine Republic Government International Bond 5,875% 11/1/2028	657.457	0,11
26.017 25.209 15.702 40.323	Allemagne Fresenius Medical Care AG & Co KGaA LEG Immobilien AG* Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft in Muenchen	2.243.186	0,39	EUR 585.000	Argentine Republic Government International Bond 5,25% 15/1/2028	536.006	0,09	
		2.361.579	0,41	USD 308.000	Argentine Republic Government International Bond 7,625% 18/4/2037	257.678	0,05	
		2.801.237	0,49	USD 242.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875% 11/1/2048	172.390	0,03	
40.323	Allemagne SAP SE	3.895.605	0,68	EUR 100.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 3,875% 15/1/2022	98.400	0,02	
		23.870.474	4,17	EUR 711.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 5,00% 15/1/2027	651.454	0,11	
				USD 380.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 7,125% 28/6/2117	274.282	0,05	
217.095 1.044.971 345.662	Italie Atlantia SpA Enel SpA* FinecoBank Banca Fineco SpA	5.420.862	0,95				2.979.020	0,52
		4.888.374	0,85					
		2.947.806	0,52					
345.662	Italie FinecoBank Banca Fineco SpA	13.257.042	2,32					
18.383	Pays-Bas ASML Holding NV	3.126.029	0,55	Australie				
		3.126.029	0,55	EUR 100.000	Westpac Banking Corp 0,75% 22/7/2021	102.283	0,02	
				EUR 425.000	Westpac Banking Corp 0,50% 17/5/2024	425.693	0,07	
120.241 91.468 440.374	Espagne Cia de Distribucion Integral Logista Holdings Industria de Diseno Textil SA	2.580.372	0,45				527.976	0,09
		2.491.588	0,44					
		3.311.613	0,58					
440.374	Espagne Telefonica SA	8.383.573	1,47					
145.387 149.132 49.542	Suède Atlas Copco AB 'A' Atlas Copco AB 'A*' Hexagon AB 'B'	112.848	0,02	Autriche				
		5.131.103	0,90	EUR 100.000	Erste Group Bank 0,625% 19/1/2023	102.183	0,02	
		2.378.484	0,41	GBP 100.000	Oesterreichische Kontrollbank AG RegS 0,75% 7/3/2022	112.601	0,02	

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

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Autriche suite				Chypre suite			
EUR 200.000	Raiffeisen Bank International AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	175.105	0,03	EUR 524.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023	559.496	0,10
EUR 2.540.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0,50% 20/4/2027	2.533.955	0,44	EUR 917.000	Cyprus Government International Bond RegS 2,75% 27/6/2024	922.612	0,16
EUR 90.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 1,50% 20/2/2047	92.171	0,02	EUR 724.000	Cyprus Government International Bond RegS 4,25% 4/11/2025	782.405	0,14
EUR 86.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 3,80% 26/1/2062	148.450	0,03			2.550.351	0,45
EUR 374.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 2,10% 20/9/2117	423.228	0,07	République tchèque			
		3.587.693	0,63	CZK 15.110.000	Czech Republic Government Bond 0,75% 23/2/2021	581.269	0,10
Belgique				CZK 90.000.000	Czech Republic Government Bond RegS 4,70% 12/9/2022	3.999.245	0,70
EUR 700.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2,25% 24/9/2020	737.383	0,13			4.580.514	0,80
GBP 700.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 1,75% 7/3/2025	785.126	0,14	Danemark			
EUR 100.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV RegS 2,00% 23/1/2035	96.752	0,02	EUR 700.000	Danske Bank 0,25% 28/11/2022	695.282	0,12
EUR 340.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV RegS 2,75% 17/3/2036	361.211	0,06	EUR 100.000	Danske Bank A/S RegS 0,875% 22/5/2023	100.286	0,02
EUR 400.000	Belfius Bank SA/NV Variable (Contingent Convertible Bond) FRN 31/12/2099	347.144	0,06	DKK 599.000	Denmark Government Bond 4,00% 15/11/2019	85.962	0,02
EUR 300.000	BNP Paribas Fortis 24/10/2023 (Zero Coupon)	295.494	0,05	DKK 6.724.000	Denmark Government Bond 1,75% 15/11/2025	1.014.744	0,18
EUR 800.000	BNP Paribas Fortis SA RegS 0,875% 22/3/2028	799.264	0,14	DKK 3.292.000	Denmark Government Bond 4,50% 15/11/2039	764.421	0,13
EUR 400.000	Fluxys Belgium 1,75% 5/10/2027	394.564	0,07	EUR 100.000	Kommunekredit 0,875% 3/11/2036	91.678	0,02
EUR 400.000	KBC Group NV 0,75% 18/10/2023	394.352	0,07	DKK 6.900.000	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,00% 1/4/2022	962.771	0,17
EUR 200.000	KBC Group NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	204.910	0,04	DKK 4.846.887	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab RegS 2,00% 1/10/2047	650.361	0,11
EUR 600.000	KBC Group NV Variable (Contingent Convertible Bond) FRN 31/12/2099	559.164	0,10	DKK 9.054.000	Nykredit Realkredit 1,00% 1/1/2022	1.262.308	0,22
EUR 1.000.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 4,25% 28/9/2021	1.155.860	0,20	DKK 366.000	Nykredit Realkredit A/S 1,00% 1/10/2020	50.640	0,01
EUR 610.000	Kingdom of Belgium Government Bond 2,25% 22/6/2023	683.246	0,12	DKK 8.835.180	Nykredit Realkredit A/S 1,50% 1/10/2047	1.172.037	0,20
EUR 73.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0,50% 22/10/2024	74.300	0,01	DKK 2.947.000	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/1/2021	408.552	0,07
EUR 2.796.758	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0,80% 22/6/2027	2.843.044	0,50	DKK 5.400.000	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/1/2023	754.137	0,13
EUR 1.720.000	Kingdom of Belgium Government Bond 1,25% 22/4/2033	1.746.780	0,30	DKK 2.424.878	Nykredit Realkredit A/S RegS 2,00% 1/10/2047	328.077	0,06
EUR 174.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1,90% 22/6/2038	189.589	0,03	DKK 13.503.813	Nykredit Realkredit A/S RegS 2,00% 1/10/2050	1.804.537	0,32
EUR 2.523.934	Kingdom of Belgium Government Bond RegS '144A' 1,60% 22/6/2047	2.508.639	0,44	GBP 300.000	Orsted 4,875% 12/1/2032	419.476	0,07
		14.176.822	2,48	DKK 12.608.000	Realkredit Danmark 1,00% 1/4/2022	1.759.144	0,31
Canada				DKK 7.500.000	Realkredit Danmark A/S 1,00% 1/1/2021	1.039.730	0,18
EUR 1.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 0,25% 24/1/2023	1.000.680	0,17	DKK 15.788.969	Realkredit Danmark A/S 2,00% 1/10/2047	2.136.113	0,37
EUR 514.000	CPPIB Capital Inc 0,375% 20/6/2024	513.239	0,09			15.500.256	2,71
EUR 317.000	CPPIB Capital Inc RegS 1,50% 4/3/2033	327.345	0,06	Estonie			
EUR 1.275.000	National Bank of Canada 0,75% 13/3/2025	1.289.739	0,23	EUR 150.000	Elering AS RegS 0,875% 3/5/2023	151.682	0,03
EUR 125.000	Toronto-Dominion Bank /The 0,375% 12/1/2021	126.481	0,02			151.682	0,03
EUR 342.000	Toronto-Dominion Bank /The 0,375% 27/4/2023	343.531	0,06	Finlande			
		3.601.015	0,63	EUR 900.000	CRH Finland Services OYJ 2,75% 15/10/2020	951.885	0,17
Chypre				EUR 805.000	Finland Government Bond '144A' 0,50% 15/9/2027	802.352	0,14
EUR 266.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,875% 6/5/2022	285.838	0,05	EUR 60.000	Finland Government Bond '144A' 1,375% 15/4/2047	62.311	0,01

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France				France suite			
EUR 1.100.000	Agence Francaise de Developpement 1,00% 31/1/2028	1.117.699	0,20	EUR 100.000	Credit Agricole Assurances Variable FRN 27/9/2048	111.144	0,02
EUR 800.000	Agence Francaise de Developpement 1,375% 5/7/2032	815.496	0,14	EUR 130.000	Credit Agricole Home Loan SFH 0,625% 11/9/2023	132.504	0,02
EUR 200.000	Air Liquide Finance SA RegS 0,125% 13/6/2020	200.874	0,04	EUR 100.000	Credit Agricole Home Loan SFH 0,25% 23/2/2024	99.603	0,02
EUR 500.000	Arkema Variable FRN 29/10/2049	539.775	0,09	EUR 300.000	Credit Agricole Home Loan SFH 1,375% 3/2/2032*	306.502	0,05
EUR 300.000	AXA Bank Europe SCF 0,125% 14/3/2022	301.035	0,05	EUR 100.000	Credit Agricole SA/London 0,875% 19/1/2022	102.133	0,02
EUR 675.000	AXA SA RegS FRN 28/5/2049	658.422	0,11	EUR 400.000	Credit Agricole SA/London RegS 1,375% 3/5/2027	403.582	0,07
EUR 100.000	AXA SA RegS FRN (Perpetual)	105.017	0,02	EUR 300.000	Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA RegS 1,00% 30/4/2028	301.930	0,05
EUR 50.000	AXA Variable FRN 16/4/2040	54.134	0,01	EUR 200.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 3,25% 1/6/2026	208.302	0,04
GBP 800.000	Banque Federative du Credit Mutuel 0,875% 8/6/2020	906.902	0,16	EUR 100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 3,50% 9/2/2029	102.046	0,02
EUR 1.200.000	Banque Federative du Credit Mutuel 2,625% 24/2/2021	1.283.604	0,22	EUR 100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS FRN 25/10/2029	95.552	0,02
EUR 700.000	Banque Federative du Credit Mutuel 0,75% 17/7/2025	686.784	0,12	EUR 100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS FRN 25/10/2029	95.552	0,02
EUR 200.000	Banque Federative du Credit Mutuel 3,00% 11/9/2025	213.013	0,04	EUR 300.000	Danone SA RegS 0,167% 3/11/2020	301.826	0,05
EUR 100.000	Banque Federative du Credit Mutuel 1,625% 19/1/2026	104.034	0,02	GBP 200.000	Dexia Credit Local 2,00% 17/6/2020	232.663	0,04
EUR 300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS FRN 3/6/2020	302.037	0,05	GBP 500.000	Dexia Credit Local 0,875% 7/9/2021	563.842	0,10
EUR 800.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 2,50% 25/5/2028	798.296	0,14	GBP 2.000.000	Dexia Credit Local SA RegS 1,125% 15/6/2022	2.266.923	0,40
GBP 495.000	BNP Paribas 1,125% 16/8/2022	554.436	0,10	GBP 2.900.000	Dexia Credit Local SA RegS 1,625% 8/12/2023	3.331.423	0,58
EUR 410.000	BNP Paribas 2,75% 27/1/2026	428.485	0,07	EUR 5.700.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	5.995.146	1,05
EUR 200.000	BNP Paribas Cardif SA RegS FRN (Perpetual)	210.130	0,04	EUR 600.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	629.220	0,11
EUR 531.000	BNP Paribas SA RegS 1,125% 15/1/2023	547.063	0,10	EUR 200.000	Engie 0,875% 27/3/2024	202.155	0,04
EUR 625.000	BNP Paribas SA RegS 1,125% 22/11/2023	625.225	0,11	EUR 100.000	Engie 2,375% 19/5/2026	109.930	0,02
EUR 100.000	BNP Paribas SA RegS 2,875% 1/10/2026	105.200	0,02	EUR 300.000	Engie SA RegS 2,00% 28/9/2037	298.244	0,05
GBP 200.000	Bouygues 5,50% 6/10/2026	277.084	0,05	GBP 300.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	347.596	0,06
EUR 1.000.000	BPCE 0,375% 5/10/2023	986.305	0,17	EUR 900.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	862.947	0,15
EUR 300.000	BPCE SA RegS 1,125% 18/1/2023	301.818	0,05	EUR 100.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	102.244	0,02
EUR 700.000	BPCE SA RegS 1,375% 23/3/2026	683.340	0,12	EUR 76.470	FCT SapphireOne Auto '2017-1 A' RegS FRN 24/1/2034	76.554	0,01
EUR 100.000	BPCE SFH 0,50% 11/10/2022	101.659	0,02	EUR 3.735.000	French Republic Government Bond OAT 1,00% 25/5/2019	3.791.398	0,66
EUR 100.000	BPCE SFH 0,375% 21/2/2024	100.107	0,02	EUR 190.000	French Republic Government Bond OAT 0,01% 25/2/2020	191.724	0,03
GBP 100.000	Caisse des Depots et Consignations RegS 1,00% 25/1/2021	114.100	0,02	EUR 381.000	French Republic Government Bond OAT 3,50% 25/4/2020	410.080	0,07
EUR 200.000	Caisse Francaise de Financement Local 0,625% 26/1/2023	204.460	0,04	EUR 710.698	French Republic Government Bond OAT 3,00% 25/4/2022	802.271	0,14
EUR 1.400.000	Caisse Francaise de Financement Local 0,375% 11/5/2024	1.401.155	0,24	EUR 1.524.000	French Republic Government Bond OAT 25/5/2022 (Zero Coupon)	1.538.668	0,27
EUR 200.000	Caisse Francaise de Financement Local 1,125% 9/9/2025	207.897	0,04	EUR 2.932.000	French Republic Government Bond OAT 25/3/2023 (Zero Coupon)*	2.946.293	0,51
EUR 1.000.000	Caisse Francaise de Financement Local RegS 1,00% 25/4/2028	1.008.440	0,18	EUR 1.520.000	French Republic Government Bond OAT 2,75% 25/10/2027	1.825.786	0,32
EUR 200.000	Cars Alliance Auto Loans France V '2018-1 A' RegS FRN 21/10/2029	201.058	0,03	EUR 14.873	French Republic Government Bond OAT 5,75% 25/10/2032	24.497	0,00
EUR 100.000	Cars Alliance Auto Loans France V '2018-1 B' RegS FRN 21/10/2029	101.109	0,02	EUR 32.168	French Republic Government Bond OAT 4,75% 25/4/2035	50.413	0,01
EUR 65.920	Cars Alliance Auto Loans Germany V 2016-1 - Class A FRN 18/5/2027	66.079	0,01	EUR 640.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 1,25% 25/5/2036	643.264	0,11
EUR 200.000	Cie de Financement Foncier 0,25% 16/3/2022	201.627	0,04	EUR 217.400	French Republic Government Bond OAT '144A' 1,75% 25/6/2039	234.168	0,04
EUR 2.700.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,25% 11/4/2023	2.703.213	0,47	EUR 338.967	French Republic Government Bond OAT 3,25% 25/5/2045	470.066	0,08
EUR 700.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026	700.651	0,12	EUR 217.000	French Republic Government Bond OAT 4,00% 25/4/2055	356.054	0,06
EUR 200.000	Cie de Saint-Gobain RegS 27/3/2020 (Zero Coupon)	200.034	0,03				
EUR 500.000	Cie de Saint-Gobain RegS 1,125% 23/3/2026	489.067	0,09				

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

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				Allemagne suite			
EUR 291.000	French Republic Government Bond OAT 4,00% 25/4/2060	490.268	0,09	EUR 75.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 3,25% 4/7/2042	113.154	0,02
EUR 926.000	French Republic Government Bond OAT '144A' 1,75% 25/5/2066	922.583	0,16	EUR 1.200.000	Bundesschatzanweisungen 14/6/2019 (Zero Coupon)	1.208.520	0,21
EUR 3.557.842	French Republic Government Bond OAT RegS '144A' 2,00% 25/5/2048	3.891.639	0,68	EUR 3.000.000	Bundesschatzanweisungen 0,01% 13/12/2019	3.033.090	0,53
EUR 1.000.000	HSBC France 0,60% 20/3/2023	1.005.950	0,18	EUR 295.000	Commerzbank 0,125% 23/2/2023	295.097	0,05
EUR 700.000	La Poste SA RegS FRN (Perpetual)	684.705	0,12	EUR 95.000	Commerzbank 0,50% 9/6/2026	94.303	0,02
GBP 130.000	Orange 8,125% 20/11/2028	222.806	0,04	EUR 200.000	Commerzbank AG RegS 4,00% 23/3/2026	215.679	0,04
EUR 600.000	Orange SA RegS 1,375% 20/3/2028	596.058	0,10	EUR 201.000	Commerzbank AG RegS 4,00% 30/3/2027	215.975	0,04
EUR 200.000	Orange Variable FRN 29/10/2049	217.750	0,04	EUR 300.000	Daimler 1,00% 15/11/2027	289.809	0,05
GBP 47.000	RCI Banque 3,00% 9/5/2019	54.557	0,01	EUR 340.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1,00% 17/12/2027	343.849	0,06
EUR 500.000	RCI Banque 0,625% 4/3/2020	505.837	0,09	EUR 250.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1,625% 16/8/2033	258.380	0,05
GBP 375.000	RCI Banque 1,875% 8/11/2022	430.668	0,08	EUR 400.000	Deutsche Bank AG RegS 0,375% 18/1/2021	394.400	0,07
EUR 600.000	RCI Banque SA RegS 0,25% 12/7/2021	599.400	0,10	EUR 1.000.000	Deutsche Bank AG RegS 1,75% 17/1/2028	915.120	0,16
EUR 600.000	RCI Banque SA RegS FRN 12/3/2025	593.130	0,10	EUR 300.000	Deutsche Bank Variable FRN 16/5/2022	296.609	0,05
EUR 500.000	RCI Banque Variable FRN 12/1/2023	496.075	0,09	EUR 400.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	381.760	0,07
EUR 300.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 1,625% 8/10/2024	316.147	0,06	EUR 300.000	Eurogrid GmbH 1,625% 3/11/2023	314.967	0,05
EUR 200.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 1,625% 27/11/2025	208.990	0,04	GBP 300.000	FMS Wertmanagement 1,25% 8/3/2019	343.930	0,06
EUR 71.372	SapphireOne Mortgages FCT '2016-3A' RegS FRN 27/6/2061	71.831	0,01	EUR 160.000	Fresenius SE & Co KGaA 2,375% 1/2/2019	162.579	0,03
EUR 200.000	Societe Generale SA RegS 0,50% 13/1/2023	195.270	0,03	EUR 700.000	Fresenius SE & Co KGaA 2,875% 15/7/2020	741.524	0,13
EUR 600.000	Societe Generale SA RegS FRN 23/2/2028	581.856	0,10	EUR 100.000	IHO Verwaltungs GmbH RegS (Pay-in-kind) 2,75% 15/9/2021	101.809	0,02
USD 400.000	Societe Generale SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	366.047	0,06	EUR 1.245.000	IHO Verwaltungs GmbH RegS (Pay-in-kind) 3,75% 15/9/2026	1.298.597	0,23
EUR 800.000	Societe Generale SFH 0,50% 2/6/2025	801.056	0,14	EUR 400.000	IKB Deutsche Industriebank AG RegS FRN 31/1/2028	398.272	0,07
EUR 600.000	Total SA RegS FRN (Perpetual)	629.520	0,11	EUR 200.000	ING-DiBa 0,25% 16/11/2026	194.772	0,03
EUR 500.000	Total SA RegS FRN (Perpetual)	514.575	0,09	EUR 1.090.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,01% 15/12/2022	1.093.014	0,19
		65.567.827	11,46	EUR 2.177.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125% 24/2/2023	2.193.240	0,38
Allemagne				EUR 2.716.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125% 4/10/2024	2.698.468	0,47
EUR 225.000	ADLER Real Estate AG RegS 1,50% 6/12/2021	225.377	0,04	EUR 1.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,50% 15/9/2027	989.690	0,17
EUR 300.000	ADLER Real Estate AG RegS 3,00% 27/4/2026	297.456	0,05	EUR 990.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625% 7/1/2028	987.159	0,17
EUR 150.000	BASF SE 0,875% 15/11/2027	145.469	0,03	EUR 875.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,125% 9/5/2033	883.321	0,15
EUR 168.000	Bayer AG RegS RegS FRN 1/7/2075	173.845	0,03	EUR 400.000	LANDBK HESSEN THUERINGEN 0,00% 12/1/2022	401.210	0,07
EUR 500.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	511.030	0,09	EUR 213.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg 0,05% 11/1/2021	214.216	0,04
EUR 1.000.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,25% 4/7/2021	1.119.490	0,20	GBP 100.000	NRW Bank RegS 1,00% 15/6/2022	113.486	0,02
EUR 883.382	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,50% 15/5/2024	969.503	0,17	EUR 91.956	Red & Black Auto Germany 5 UG haftungsbeschränkt 'A' RegS FRN 15/1/2027	92.501	0,02
EUR 1.000.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,25% 15/2/2027	1.003.200	0,18	EUR 100.000	SAP SE 1,375% 13/3/2030	101.606	0,02
EUR 21.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50% 15/2/2028	21.322	0,00	EUR 924.000	State of Lower Saxony 0,01% 1/3/2021	931.535	0,16
EUR 543.296	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 5,50% 4/1/2031	873.927	0,15	EUR 81.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0,625% 17/11/2023	83.159	0,01
EUR 674.751	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,00% 4/1/2037	1.052.989	0,18	EUR 10.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 1,625% 24/10/2030	10.629	0,00
EUR 161.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,75% 4/7/2040	287.659	0,05	EUR 100.000	Volkswagen Bank GmbH RegS FRN 15/6/2021	99.882	0,02
EUR 602.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50% 4/7/2044*	815.156	0,14				
EUR 1.015.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50% 15/8/2046	1.391.362	0,24				

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Allemagne suite				Italie suite			
EUR 375.000	Volkswagen Financial Services AG RegS 0,875% 12/4/2023	375.791	0,07	EUR 100.000	Assicurazioni Generali SpA RegS FRN 12/12/2042	120.663	0,02
EUR 300.000	Volkswagen Leasing GmbH 0,25% 5/10/2020	300.912	0,05	EUR 200.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,25% 20/1/2022	204.638	0,04
		32.069.799	5,60	EUR 400.000	Buzzi Unicem SpA RegS 2,125% 28/4/2023	410.106	0,07
Grèce				EUR 100.000	Driver Italia One SRL 'A' RegS FRN 21/4/2029	100.172	0,02
EUR 400.000	Alpha Bank AE RegS 2,50% 5/2/2023	398.620	0,07	EUR 1.018.000	Enel SpA RegS FRN 24/11/2081	975.560	0,17
EUR 562.000	Hellenic Republic Government Bond RegS '144A' 4,375% 1/8/2022	575.460	0,10	EUR 400.000	Enel SpA Variable FRN 15/1/2075	421.856	0,07
EUR 1.164.000	Hellenic Republic Government Bond RegS '144A' 3,375% 15/2/2025	1.106.382	0,19	EUR 200.000	Intesa Sanpaolo SpA 2,00% 18/6/2021	205.378	0,04
EUR 900.000	National Bank of Greece SA RegS 2,75% 19/10/2020	916.069	0,16	EUR 600.000	Intesa Sanpaolo SpA 1,125% 4/3/2022	594.165	0,10
		2.996.531	0,52	USD 200.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3,375% 12/1/2023	160.616	0,03
Islande				EUR 425.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,875% 27/6/2022	415.599	0,07
EUR 400.000	Iceland Government International Bond RegS 0,50% 20/12/2022	404.542	0,07	EUR 800.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,75% 20/3/2028	730.280	0,13
EUR 800.000	Islandsbanki HF RegS FRN 19/1/2024	798.080	0,14	EUR 700.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	733.250	0,13
EUR 375.000	Landsbankinn HF RegS 1,00% 30/5/2023	373.838	0,06	EUR 850.000	Iren SpA RegS 1,50% 24/10/2027	801.869	0,14
		1.576.460	0,27	EUR 238.565	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,70% 15/9/2018	241.170	0,04
Indonésie				EUR 941.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,30% 15/10/2018	941.480	0,16
EUR 400.000	Indonesia Government International Bond 1,75% 24/4/2025*	400.550	0,07	EUR 701.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,70% 1/5/2020	693.450	0,12
IDR 4.500.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,125% 15/5/2028	261.832	0,05	EUR 1.734.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 1/5/2021	1.842.687	0,32
		662.382	0,12	EUR 285.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 1/9/2021	313.222	0,05
Irlande				EUR 1.103.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,35% 1/11/2021	1.059.321	0,19
EUR 150.000	AIB Group Plc RegS 1,50% 29/3/2023	148.723	0,03	EUR 685.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,35% 15/4/2022	670.348	0,12
EUR 700.000	Allied Irish Banks Plc 1,375% 16/3/2020	716.254	0,12	EUR 768.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,45% 15/9/2022	751.066	0,13
EUR 700.000	Bank of Ireland Mortgage Bank 0,625% 14/3/2025	705.488	0,12	EUR 1.082.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 1/5/2023	1.198.131	0,21
SEK 1.990.000	Bluestep Mortgage Securities No 4 DAC 'B' RegS FRN 10/8/2066	194.030	0,03	EUR 1.430.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,65% 15/10/2023	1.322.736	0,23
EUR 100.000	ESB Finance DAC RegS 2,125% 8/6/2027	106.898	0,02	EUR 285.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 1/9/2024	307.090	0,05
EUR 209.878	Ireland Government Bond 5,40% 13/3/2025	279.070	0,05	EUR 470.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,45% 15/11/2024	443.553	0,08
EUR 253.000	Ireland Government Bond 2,40% 15/5/2030	287.970	0,05	EUR 300.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 1/3/2026	340.392	0,06
EUR 594.520	Ireland Government Bond 2,00% 18/2/2045	625.114	0,11	EUR 390.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,05% 1/8/2027	367.602	0,06
EUR 2.285.000	Ireland Government Bond RegS 18/10/2022 (Zero Coupon)	2.289.319	0,40	EUR 920.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4,75% 1/9/2028	1.063.538	0,19
EUR 4.061.726	Ireland Government Bond RegS 0,90% 15/5/2028	4.043.814	0,71	EUR 1.663.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,65% 1/3/2032	1.424.376	0,25
EUR 5.302.000	Ireland Government Bond RegS 1,30% 15/5/2033	5.208.632	0,91	EUR 65.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,45% 1/9/2033	60.218	0,01
EUR 453.416	Ireland Government Bond RegS 1,70% 15/5/2037	462.634	0,08	EUR 660.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,25% 1/9/2036	585.750	0,10
GBP 100.000	Taurus Dac '2017-UK2 A' RegS FRN 17/11/2027	114.659	0,02	EUR 150.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,70% 1/3/2047	135.582	0,02
		15.182.605	2,65	EUR 1.737.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3,45% 1/3/2048	1.767.120	0,31
Italie				EUR 65.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,80% 1/3/2067	57.107	0,01
EUR 100.000	Assicurazioni Generali SpA RegS 2,875% 14/1/2020	104.238	0,02	EUR 3.324.337	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 23/4/2020	3.370.878	0,59
EUR 300.000	Assicurazioni Generali SpA RegS 4,125% 4/5/2026	321.368	0,06	EUR 255.487	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,25% 27/10/2020	257.628	0,05

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Italie suite				Luxembourg suite			
EUR 240.788	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 1,30% 15/5/2028	230.198	0,04	EUR 2.300.000	European Financial Stability Facility RegS 0,40% 17/2/2025	2.302.300	0,40
EUR 3.353.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 2,95% 1/9/2038	3.217.405	0,56	EUR 374.000	European Financial Stability Facility RegS 0,875% 26/7/2027	379.139	0,07
EUR 350.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0,625% 27/9/2022	334.404	0,06	EUR 400.000	European Financial Stability Facility RegS 1,375% 31/5/2047	381.948	0,07
EUR 508.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,25% 24/11/2029	485.803	0,09	EUR 600.000	GELF Bond Issuer I SA RegS 1,625% 20/10/2026	599.952	0,10
EUR 34.534	Sunrise SPV FRN 31/7/2040	34.583	0,01	EUR 875.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,75% 24/4/2028	865.817	0,15
EUR 171.745	Sunrise SPV '2017-1 A1' RegS FRN 27/4/2041	171.995	0,03	EUR 200.000	Holcim Finance Luxembourg 1,75% 29/8/2029	191.295	0,03
EUR 100.000	Telecom Italia SpA/Milano 5,25% 17/3/2055	107.939	0,02	EUR 150.000	Prologis International Funding II SA RegS 1,75% 15/3/2028	150.466	0,03
EUR 500.000	UniCredit SpA RegS FRN 28/10/2025	534.200	0,09	EUR 575.000	Richemont International Holding SA RegS 1,50% 26/3/2030	580.529	0,10
EUR 400.000	UniCredit SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	362.792	0,06	EUR 400.000	SELP Finance Sarl 1,50% 20/11/2025	396.160	0,07
EUR 400.000	UniCredit SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	404.836	0,07	EUR 100.000	SELP Finance Sarl RegS 1,25% 25/10/2023	100.396	0,02
		31.398.358	5,49	EUR 844.000	SES SA RegS FRN (Perpetual)	879.693	0,15
Japon						15.616.557	2,73
EUR 700.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 0,934% 11/10/2024	700.042	0,12	Mexique			
		700.042	0,12	EUR 950.000	Petroleos Mexicanos RegS 3,625% 24/11/2025	940.077	0,17
Jersey				EUR 238.000	Petroleos Mexicanos RegS 4,75% 26/2/2029	240.847	0,04
EUR 1.000.000	Glencore Finance Europe Ltd RegS 1,25% 17/3/2021	1.022.010	0,18			1.180.924	0,21
EUR 250.000	Glencore Finance Europe Ltd RegS 1,75% 17/3/2025	251.989	0,04	Monténégro			
GBP 200.000	Heathrow Funding Ltd 2,75% 9/8/2049	208.850	0,04	EUR 350.000	Montenegro Government International Bond RegS 3,375% 21/4/2025	345.105	0,06
GBP 200.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP Variable FRN 29/11/2049	287.975	0,05			345.105	0,06
		1.770.824	0,31	Pays-Bas			
Luxembourg				EUR 400.000	ABN AMRO Bank NV 5,00% 9/2/2022	468.708	0,08
EUR 785.000	Allergan Funding SCS 1,25% 1/6/2024	767.899	0,13	EUR 500.000	ABN AMRO Bank NV 1,45% 12/4/2038	497.780	0,09
EUR 230.000	CNH Industrial Finance Europe 1,75% 12/9/2025	229.388	0,04	EUR 400.000	ABN AMRO Bank NV RegS 0,625% 31/5/2022	404.988	0,07
GBP 100.000	Compartment Driver UK Five 'B' RegS FRN 25/7/2025	114.074	0,02	EUR 925.000	ABN AMRO Bank NV RegS 0,875% 22/4/2025	926.216	0,16
GBP 126.513	Compartment Driver UK Four 'A' RegS FRN 25/3/2025	144.443	0,03	EUR 400.000	Aegon Bank NV 0,375% 21/11/2024	396.966	0,07
GBP 179.795	Compartment Driver UK Four 'B' RegS FRN 25/3/2025	205.885	0,04	EUR 167.000	Airbus Finance BV 0,875% 13/5/2026	165.337	0,03
GBP 93.753	Compartment Driver UK Six 'A' RegS FRN 25/2/2026	106.909	0,02	EUR 100.000	ASML Holding NV 3,375% 19/9/2023	114.688	0,02
EUR 78.383	Compartment VCL 24 'A' RegS FRN 21/8/2022	78.495	0,01	EUR 750.000	ASML Holding NV 1,375% 7/7/2026	763.252	0,13
EUR 86.669	Compartment VCL 24 'B' RegS FRN 21/8/2022	86.847	0,02	GBP 200.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV RegS 1,00% 17/6/2022	226.915	0,04
EUR 128.000	European Financial Stability Facility 1,50% 22/1/2020	131.981	0,02	EUR 450.000	BMW Finance NV 0,375% 10/7/2023	447.480	0,08
EUR 181.000	European Financial Stability Facility 1,75% 29/10/2020	189.987	0,03	EUR 175.000	BMW Finance NV RegS 0,50% 22/11/2022	175.704	0,03
EUR 80.000	European Financial Stability Facility 3,375% 5/7/2021	88.976	0,02	EUR 300.000	Brenntag Finance BV RegS 5,50% 19/7/2018	302.079	0,05
EUR 240.000	European Financial Stability Facility 0,20% 28/4/2025	236.765	0,04	EUR 600.000	Cooperatieve Rabobank UA 1,25% 23/3/2026	615.042	0,11
EUR 2.015.000	European Financial Stability Facility 0,40% 31/5/2026	1.991.928	0,35	EUR 900.000	Cooperatieve Rabobank UA 0,875% 8/2/2028	902.223	0,16
EUR 1.643.000	European Financial Stability Facility 0,75% 3/5/2027	1.651.264	0,29	EUR 100.000	CRH Finance BV RegS 5,00% 25/1/2019	103.369	0,02
EUR 2.759.000	European Financial Stability Facility 1,45% 5/9/2040	2.764.021	0,48	EUR 875.000	Daimler International Finance BV RegS 0,25% 11/5/2022	872.690	0,15
				EUR 800.000	Daimler International Finance BV RegS 1,00% 11/11/2025	794.864	0,14
				EUR 600.000	de Volksbank NV 1,00% 8/3/2028	605.028	0,11

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Norvège			
EUR 125.000	de Volksbank NV RegS 0,125% 28/9/2020	125.283	0,02	GBP 105.000	Kommunalbanken AS RegS 1,125% 30/11/2022	119.612	0,02
EUR 192.000	Deutsche Telekom International Finance BV 0,625% 3/4/2023	192.401	0,03	NOK 2.833.000	Norway Government Bond '144A' 1,75% 13/3/2025	301.889	0,05
GBP 200.000	Deutsche Telekom International Finance BV 8,875% 27/11/2028	356.825	0,06	NOK 4.665.000	Norway Government Bond RegS '144A' 1,75% 17/2/2027	492.546	0,09
EUR 515.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 2,00% 1/12/2029	526.469	0,09	NOK 7.985.000	Norway Government Bond RegS '144A' 2,00% 26/4/2028	856.770	0,15
USD 200.000	Enel Finance International NV RegS 3,50% 6/4/2028	154.257	0,03	EUR 325.000	Sbanken Boligkreditt 0,375% 26/4/2023	326.235	0,06
EUR 600.000	Enexis Holding NV 0,875% 28/4/2026	598.074	0,10	EUR 1.050.000	SpareBank 1 Boligkreditt 0,50% 30/1/2025	1.048.777	0,18
EUR 325.000	Ferrari NV RegS 0,25% 16/1/2021	323.356	0,06			3.145.829	0,55
EUR 375.000	Koninklijke Ahold Delhaize NV 1,125% 19/3/2026	370.909	0,07	Pologne			
EUR 300.000	Koninklijke KPN NV RegS FRN (Perpetual)	305.001	0,05	EUR 775.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 1,375% 1/6/2025	780.146	0,14
EUR 300.000	Nationale-Nederlanden Bank NV / The Netherlands 0,50% 10/10/2024	300.978	0,05	PLN 1.870.000	Republic of Poland Government Bond 1,75% 25/7/2021	430.377	0,07
EUR 1.081.000	Netherlands Government Bond '144A' 0,01% 15/1/2022	1.096.177	0,19	PLN 3.195.000	Republic of Poland Government Bond 2,25% 25/4/2022	741.634	0,13
EUR 468.000	Netherlands Government Bond '144A' 0,50% 15/7/2026	475.998	0,08	PLN 1.234.000	Republic of Poland Government Bond 3,25% 25/7/2025	291.008	0,05
EUR 200.000	NN Group NV 1,00% 18/3/2022	205.167	0,04	EUR 275.000	Republic of Poland Government International Bond 0,50% 20/12/2021	279.711	0,05
EUR 100.000	NN Group NV RegS 0,875% 13/1/2023	101.877	0,02	EUR 171.000	Republic of Poland Government International Bond 1,00% 25/10/2028	166.198	0,03
EUR 600.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	660.465	0,12			2.689.074	0,47
USD 1.470.000	Petrobras Global Finance BV 5,75% 1/2/2029	1.135.918	0,20	Portugal			
EUR 125.000	RELX Finance BV RegS 0,375% 22/3/2021	125.879	0,02	EUR 400.000	Banco Comercial Portugues 0,75% 31/5/2022	405.972	0,07
EUR 205.000	Schaeffler Finance BV 3,25% 15/5/2025	218.376	0,04	EUR 200.000	Banco Santander Totta 1,25% 26/9/2027	202.602	0,04
EUR 400.000	Shell International Finance BV RegS 1,25% 12/5/2028	403.302	0,07	EUR 300.000	Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria SA RegS 0,875% 17/10/2022	302.415	0,05
EUR 300.000	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,50% 29/12/2049	365.400	0,06	EUR 400.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 16/9/2075	437.588	0,08
EUR 500.000	Telefonica Europe BV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	479.570	0,08	USD 917.000	Portugal Government International Bond RegS 5,125% 15/10/2024	808.273	0,14
EUR 600.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	578.241	0,10	EUR 67	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 2,875% 21/7/2026	73	0,00
EUR 975.000	TenneT Holding BV RegS FRN (Perpetual)	980.596	0,17	EUR 178.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 4,125% 14/4/2027	211.779	0,04
GBP 200.000	Volkswagen Financial Services NV 2,25% 12/4/2025	227.365	0,04	EUR 49.800	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 4,10% 15/2/2045*	59.846	0,01
EUR 200.000	Vonovia Finance BV RegS FRN 22/12/2022	199.618	0,04	EUR 1.181.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 3,85% 15/4/2021	1.307.851	0,23
EUR 600.000	Vonovia Finance BV RegS 1,50% 22/3/2026	598.386	0,11	EUR 929.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 2,125% 17/10/2028	943.483	0,16
EUR 300.000	Vonovia Finance BV RegS 1,50% 14/1/2028	290.163	0,05	EUR 2.225.520	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 2,25% 18/4/2034	2.154.170	0,38
		20.179.380	3,53	EUR 343.937	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Via Volta IV 2,423% 12/2/2021	352.659	0,06
Nouvelle-Zélande				EUR 185.807	Volta Electricity Receivables RegS 0,85% 12/2/2022	186.734	0,03
EUR 400.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd/London 0,125% 22/9/2023	394.420	0,07			7.373.445	1,29
EUR 300.000	ASB Finance Ltd/London 0,625% 18/10/2024	301.035	0,05				
EUR 500.000	Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023	506.785	0,09				
EUR 325.000	Westpac Securities NZ Ltd/London 0,125% 16/6/2021	326.030	0,06				
		1.528.270	0,27				

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

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Qatar				Espagne suite			
USD 250.000	Qatar Government International Bond RegS 4,50% 23/4/2028	215.906	0,04	EUR 100.000	Santander Consumer Finance 1,50% 12/11/2020	103.135	0,02
USD 395.000	Qatar Government International Bond RegS 5,103% 23/4/2048	338.800	0,06	EUR 200.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,50% 4/10/2021	200.222	0,04
		554.706	0,10	EUR 1.000.000	Spain Government Bond 1,40% 31/1/2020	1.024.920	0,18
Russie				EUR 6.682.000	Spain Government Bond 1,15% 30/7/2020	6.864.886	1,20
USD 200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 5,25% 23/6/2047	163.498	0,03	EUR 1.800.000	Spain Government Bond 0,05% 31/1/2021	1.799.118	0,31
		163.498	0,03	EUR 791.000	Spain Government Bond '144A' 5,50% 30/4/2021	915.567	0,16
Arabie Saoudite				EUR 1.078.000	Spain Government Bond 0,75% 30/7/2021	1.100.029	0,19
USD 420.000	Saudi Government International Bond RegS 4,00% 17/4/2025	359.117	0,06	EUR 280.000	Spain Government Bond 0,40% 30/4/2022	280.798	0,05
USD 950.000	Saudi Government International Bond RegS 5,00% 17/4/2049	790.886	0,14	EUR 445.000	Spain Government Bond 0,45% 31/10/2022	445.894	0,08
		1.150.003	0,20	EUR 1.397.000	Spain Government Bond '144A' 5,40% 31/1/2023	1.714.007	0,30
Singapour				EUR 139.000	Spain Government Bond '144A' 4,80% 31/1/2024	170.137	0,03
EUR 1.200.000	DBS Group Holdings Ltd RegS FRN 11/4/2028	1.198.914	0,21	EUR 64.000	Spain Government Bond '144A' 1,50% 30/4/2027	64.867	0,01
EUR 1.375.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 0,625% 18/4/2025	1.346.263	0,23	EUR 3.361.000	Spain Government Bond '144A' 1,40% 30/4/2028	3.336.280	0,58
		2.545.177	0,44	EUR 300.000	Spain Government Bond '144A' 2,35% 30/7/2033	314.184	0,05
Afrique du Sud				EUR 127.000	Spain Government Bond '144A' 5,15% 31/10/2044	192.401	0,03
ZAR 20.053.727	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048	1.271.233	0,22	EUR 1.887.000	Spain Government Bond '144A' 2,90% 31/10/2046	2.021.581	0,35
		1.271.233	0,22	EUR 324.000	Spain Government Bond '144A' 3,45% 30/7/2066	372.888	0,07
Espagne				EUR 1.252.000	Spain Government Bond RegS '144A' 4,40% 31/10/2023	1.499.408	0,26
EUR 500.000	Adif - Alta Velocidad 1,25% 4/5/2026	493.060	0,09	EUR 841.000	Spain Government Bond RegS '144A' 1,95% 30/4/2026	888.239	0,16
EUR 1.100.000	Amadeus Capital Markets SAU RegS 0,125% 6/10/2020	1.103.652	0,19	EUR 1.473.000	Spain Government Bond RegS '144A' 2,70% 31/10/2048	1.505.789	0,26
EUR 182.379	Auto ABS Spanish Loans FT '2016-1 A' RegS FRN 31/12/2032	182.978	0,03	EUR 955.463	Spain Government Inflation Linked Bond RegS '144A' 0,55% 30/11/2019	985.150	0,17
EUR 1.100.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 5/3/2023	1.075.338	0,19	GBP 300.000	Telefonica Emisiones SAU RegS 5,375% 2/2/2026	402.334	0,07
EUR 100.000	Banco Popular Espanol 1,00% 7/4/2025	101.357	0,02			35.938.935	6,28
EUR 400.000	Banco Santander 1,375% 9/2/2022	406.878	0,07	Sri Lanka			
EUR 200.000	Banco Santander SA RegS 1,125% 17/1/2025	193.294	0,03	USD 200.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,75% 18/4/2023	169.946	0,03
EUR 300.000	Bankia 1,00% 14/3/2023	308.529	0,05	USD 725.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 6,75% 18/4/2028	617.649	0,11
EUR 1.200.000	Bankia SA RegS FRN 22/5/2024	1.232.628	0,22			787.595	0,14
EUR 600.000	Bankia SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	612.096	0,11	Supranational			
EUR 800.000	CaixaBank 1,125% 17/5/2024	783.240	0,14	GBP 235.000	Council Of Europe Development Bank RegS 0,625% 15/6/2022	263.357	0,05
EUR 400.000	Caja Rural de Navarra SCC 0,625% 1/12/2023	399.364	0,07	EUR 845.000	European Investment Bank 1,125% 13/4/2033	845.211	0,15
EUR 200.000	Caja Rural de Navarra SCC 0,875% 8/5/2025	200.075	0,04	EUR 44.000	European Investment Bank 2,625% 15/3/2035	53.816	0,01
EUR 91.173	Driver Espana Five FDT '5A' RegS FRN 21/12/2028	91.396	0,02	GBP 239.000	European Investment Bank 3,875% 8/6/2037	356.820	0,06
EUR 135.966	Driver Espana Four FT 'A' RegS FRN 21/4/2028	136.252	0,02	EUR 525.000	European Investment Bank 1,50% 15/11/2047	527.822	0,09
EUR 200.000	FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico 0,85% 17/9/2019	202.476	0,04	GBP 230.000	European Investment Bank RegS 0,875% 15/12/2023	256.315	0,04
EUR 800.000	FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico 0,031% 17/6/2020	799.856	0,14	EUR 2.793.000	European Investment Bank RegS 0,875% 14/1/2028	2.836.026	0,50
EUR 200.000	Ibercaja Banco 0,25% 18/10/2023	197.481	0,03				
EUR 600.000	Iberdrola Finanzas 1,00% 7/3/2025	596.133	0,10				
EUR 200.000	Iberdrola Finanzas 1,621% 29/11/2029	197.168	0,03				
EUR 100.000	NorteGas Energia Distribucion SAU RegS 0,918% 28/9/2022	100.426	0,02				
EUR 325.000	NorteGas Energia Distribucion SAU RegS 2,065% 28/9/2027	323.424	0,06				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Supranational suite				Suisse suite			
EUR 800.000	European Stability Mechanism RegS 18/10/2022 (Zero Coupon)	801.448	0,14	EUR 650.000	UBS Group Funding Switzerland Variable FRN 17/4/2025	647.153	0,11
EUR 1.550.000	European Union 0,50% 4/4/2025	1.570.235	0,27	EUR 400.000	Zuercher Kantonalbank RegS FRN 15/6/2027	414.636	0,07
EUR 66.000	European Union 0,75% 4/4/2031	64.493	0,01			15.635.785	2,73
EUR 385.000	European Union 1,25% 4/4/2033	395.699	0,07	Royaume-Uni			
GBP 700.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,75% 7/12/2021	793.100	0,14	GBP 100.000	Barclays Bank Plc 10,00% 21/5/2021	137.495	0,02
		8.764.342	1,53	EUR 600.000	Barclays Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	622.671	0,11
Suède				GBP 675.000	Barclays Plc RegS FRN 6/10/2023	761.644	0,13
SEK 6.000.000	Landshypotek Bank AB 0,75% 25/5/2023	583.966	0,10	GBP 325.000	Barclays Plc RegS 3,125% 17/1/2024	372.381	0,07
EUR 400.000	Nordea Bank AB 3,25% 5/7/2022	448.392	0,08	EUR 300.000	Barclays Plc RegS FRN 7/2/2028	290.232	0,05
GBP 720.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 1,25% 5/8/2022	813.714	0,14	EUR 700.000	BAT International Finance Plc 3,625% 9/11/2021*	776.727	0,14
EUR 145.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0,625% 30/1/2023	147.965	0,03	EUR 164.000	BAT International Finance Plc 2,75% 25/3/2025	179.670	0,03
SEK 18.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 1,50% 21/12/2022	1.827.491	0,32	EUR 386.000	BAT International Finance Plc RegS 2,25% 16/1/2030	386.291	0,07
SEK 14.000.000	Stadshypotek AB 4,50% 21/9/2022	1.596.103	0,28	GBP 100.000	Bavarian Sky UK 1 Plc 'A' RegS FRN 20/11/2025	113.966	0,02
EUR 450.000	Svenska Handelsbanken AB 0,25% 28/2/2022	450.423	0,08	EUR 100.000	BP Capital Markets Plc 0,83% 19/9/2024	99.986	0,02
EUR 100.000	Svenska Handelsbanken AB 1,125% 14/12/2022	103.452	0,02	EUR 400.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,117% 25/1/2024	409.870	0,07
SEK 10.000.000	Sveriges Sakerställda Obligationer AB RegS 1,00% 21/6/2023	988.665	0,17	EUR 200.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,953% 3/3/2025	212.928	0,04
EUR 800.000	Swedbank AB 0,30% 6/9/2022	798.832	0,14	EUR 350.000	British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024	344.719	0,06
SEK 6.200.000	Swedbank Hypotek AB RegS 1,00% 15/6/2022	618.435	0,11	GBP 630.000	British Telecommunications Plc RegS 5,75% 7/12/2028	891.765	0,16
SEK 4.770.000	Sweden Government Bond 5,00% 1/12/2020	529.288	0,09	GBP 400.000	BUPA Finance Plc RegS 5,00% 8/12/2026	502.792	0,09
SEK 8.825.000	Sweden Government Bond 2,50% 12/5/2025	1.000.662	0,17	GBP 525.000	Cadent Finance Plc 1,125% 22/9/2021	593.211	0,10
SEK 575.000	Sweden Government Bond 3,50% 30/3/2039	80.661	0,01	GBP 400.000	Cadent Finance Plc RegS 2,75% 22/9/2046	418.083	0,07
SEK 7.000.000	Volvo Treasury AB RegS FRN 24/8/2018	681.855	0,12	GBP 139.512	Castell Plc '2017-1 A' RegS FRN 25/10/2044	159.729	0,03
		10.669.904	1,86	GBP 90.000	Centrica Plc 7,00% 19/9/2018	104.467	0,02
Suisse				GBP 702.000	Centrica Plc RegS 4,375% 13/3/2029	918.732	0,16
EUR 100.000	Credit Suisse AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN 18/9/2025	110.143	0,02	EUR 125.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	128.049	0,02
EUR 100.000	Credit Suisse AG/London 1,00% 7/6/2023	101.914	0,02	EUR 200.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	210.700	0,04
EUR 600.000	Credit Suisse AG/London RegS 1,125% 15/9/2020	614.814	0,11	GBP 100.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	114.045	0,02
EUR 825.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 17/7/2025	810.158	0,14	GBP 151.000	Crh Finance UK Plc RegS 4,125% 2/12/2029	194.145	0,03
CHF 2.522.000	Swiss Confederation Government Bond 2,00% 28/4/2021	2.376.228	0,42	GBP 230.000	Delamare Cards MTN Issuer Plc FRN 19/5/2021	262.976	0,05
CHF 2.332.000	Swiss Confederation Government Bond 1,50% 24/7/2025	2.301.892	0,40	GBP 200.000	Delamare Cards MTN Issuer Plc '2017-1 A1' FRN 19/10/2022	228.491	0,04
CHF 293.000	Swiss Confederation Government Bond 1,25% 28/5/2026	286.737	0,05	GBP 132.313	Feldspar Plc '2016-1 A' RegS FRN 15/9/2045	151.833	0,03
CHF 999.000	Swiss Confederation Government Bond 4,00% 8/4/2028	1.223.003	0,21	GBP 123.081	Finsbury Square Plc '2016-2 A' RegS FRN 16/8/2058	141.117	0,02
CHF 721.000	Swiss Confederation Government Bond 1,50% 30/4/2042	776.227	0,14	EUR 100.000	G4S International Finance Plc 1,50% 9/1/2023	102.056	0,02
EUR 1.310.000	UBS AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN 12/2/2026	1.428.594	0,25	EUR 550.000	G4S International Finance Plc RegS 1,875% 24/5/2025	554.807	0,10
GBP 1.575.000	UBS AG/London 1,25% 10/12/2020	1.795.085	0,31	GBP 6.655	Gemgarto Plc '2015-2 A' RegS FRN 16/2/2054	7.618	0,00
EUR 625.000	UBS AG/London 0,625% 23/1/2023	626.800	0,11	GBP 100.000	Gemgarto Plc '2015-2 B' RegS FRN 16/2/2054	116.639	0,02
EUR 1.525.000	UBS AG/London RegS 0,25% 10/1/2022	1.518.443	0,27	EUR 400.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,25% 21/5/2026	405.680	0,07
EUR 300.000	UBS Group Funding Switzerland 1,50% 30/11/2024	303.765	0,05				
EUR 275.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	300.193	0,05				

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

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
EUR 375.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,75% 21/5/2030	383.919	0,07	EUR 100.000	Paragon Mortgages No 13 Plc '13X B1B' RegS FRN 15/1/2039	94.348	0,02
GBP 210.080	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2016-A A' RegS FRN 20/9/2024	239.721	0,04	EUR 150.000	Paragon Mortgages No 14 Plc '14X BB' RegS FRN 15/9/2039	136.156	0,02
GBP 100.000	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2017-A B' RegS FRN 20/6/2025	113.733	0,02	GBP 18.127	Paragon Mortgages No 23 Plc 'A2' RegS FRN 15/1/2043	20.738	0,00
GBP 100.000	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2018-AA A' RegS FRN 20/6/2026	114.212	0,02	GBP 36.713	Paragon Mortgages No 24 Plc 'A2' RegS FRN 15/7/2043	42.060	0,01
EUR 39.916	Gosforth Funding Plc '2016-2X A1A' RegS FRN 24/7/2058	39.993	0,01	GBP 100.000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'A' RegS FRN 15/6/2050	114.099	0,02
GBP 200.000	Gosforth Funding Plc '2017-1X A2' RegS FRN 19/12/2059	228.990	0,04	GBP 158.000	PCL Funding II Plc '2017-1 A' RegS FRN 15/6/2022	181.112	0,03
GBP 100.000	Hawksmoor Mortgages 2016-1 Plc - Class B FRN 25/5/2053	115.055	0,02	GBP 212.000	PCL Funding III Plc '2017-2 A' RegS FRN 15/6/2020	242.426	0,04
GBP 137.385	Hawksmoor Mortgages Plc '2016-1 A' RegS FRN 25/5/2053	158.196	0,03	GBP 200.000	Prs Finance Plc RegS 1,75% 24/11/2026	231.244	0,04
GBP 100.000	Holmes Master Issuer Plc '2018-1X A3' RegS FRN 15/10/2054	113.956	0,02	GBP 350.000	Prudential Plc 6,125% 19/12/2031	498.024	0,09
USD 515.000	HSBC Holdings Plc FRN 18/5/2024	441.263	0,08	GBP 100.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'B' RegS FRN 20/12/2046	115.643	0,02
GBP 100.000	HSBC Holdings Plc 5,75% 20/12/2027	134.661	0,02	GBP 100.000	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'B' RegS FRN 20/3/2050	115.016	0,02
GBP 850.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2026	940.367	0,16	GBP 263.135	Ripon Mortgages Plc '1X A1' RegS FRN 20/8/2056	301.810	0,05
EUR 209.000	Imperial Brands Finance Plc RegS 1,375% 27/1/2025	208.902	0,04	GBP 600.000	Ripon Mortgages Plc '1X B1' RegS FRN 20/8/2056	691.389	0,12
GBP 1.100.000	J Sainsbury Plc RegS 1,25% 21/11/2019	1.391.613	0,24	GBP 600.000	Ripon Mortgages Plc '1X C1' RegS FRN 20/8/2056	691.534	0,12
GBP 100.000	Lanark Master Issuer Plc '2014-2X 2A' RegS FRN 22/12/2054	114.532	0,02	GBP 700.000	Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 8/5/2026	803.717	0,14
GBP 10.000	Lanark Master Issuer Plc '2015-1X 1A' RegS FRN 22/12/2054	11.424	0,00	EUR 200.000	Santander UK Plc 0,875% 13/1/2020	202.816	0,04
GBP 200.000	Lanark Master Issuer Plc '2017-1X 1A' RegS FRN 22/12/2069	228.358	0,04	EUR 100.000	Santander UK Plc 1,625% 26/11/2020	104.326	0,02
GBP 300.000	Lanark Master Issuer Plc '2017-1X 2A' RegS FRN 22/12/2069	343.829	0,06	EUR 300.000	Sky Plc 1,50% 15/9/2021	311.235	0,05
GBP 297.000	LCR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028	431.095	0,08	EUR 100.000	Sky Plc RegS 2,25% 17/11/2025	107.012	0,02
EUR 100.000	Lloyds Bank Plc 0,625% 14/9/2022	101.911	0,02	GBP 100.000	SSE Plc RegS FRN (Perpetual)	116.695	0,02
GBP 230.000	Lloyds Bank Plc 7,50% 15/4/2024	341.696	0,06	GBP 200.000	SSE Plc Variable FRN 16/9/2077	232.737	0,04
EUR 725.000	Lloyds Bank Plc 0,625% 26/3/2025	726.769	0,13	GBP 48.656	Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040	65.370	0,01
GBP 250.000	Lloyds Banking Group Plc RegS 2,25% 16/10/2024	279.029	0,05	GBP 100.000	Tolkien Funding Sukuk No 1 Plc 'A' FRN 20/7/2052	114.375	0,02
GBP 200.000	Lloyds Banking Group Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	236.046	0,04	GBP 364.643	Towd Point Mortgage Funding Auburn 11 Plc '2017-A11X A1' RegS FRN 20/5/2045	417.432	0,07
GBP 11.490	Marketplace Originated Consumer Assets Plc '2016-1 A' RegS FRN 20/10/2024	13.130	0,00	GBP 100.000	Turbo Finance 6 Plc 'B' RegS FRN 20/2/2023	114.662	0,02
EUR 175.000	Mondi Finance Plc RegS 1,625% 27/4/2026	176.188	0,03	GBP 245.000	Turbo Finance 7 Plc 'B' RegS FRN 20/6/2023	281.780	0,05
GBP 100.000	Motor Plc '2016-1 C' RegS 3,75% 25/11/2025	115.770	0,02	GBP 5.035.000	United Kingdom Gilt 1,25% 22/7/2018	5.750.838	1,00
EUR 124.000	Nationwide Building Society 2,25% 25/6/2029	138.999	0,02	GBP 2.943.000	United Kingdom Gilt 3,75% 7/9/2019	3.495.365	0,61
GBP 1.244	Nationwide Building Society Variable FRN 31/12/2049	219.527	0,04	GBP 811.642	United Kingdom Gilt 5,00% 7/3/2025	1.165.135	0,20
EUR 1.150.000	Natwest Markets Plc RegS 0,625% 2/3/2022	1.148.827	0,20	GBP 640.728	United Kingdom Gilt 2,00% 7/9/2025*	778.390	0,14
GBP 200.000	Newday Funding Plc '2017-1 A' RegS FRN 15/7/2025	228.483	0,04	GBP 74.069	United Kingdom Gilt 4,25% 7/3/2036	118.373	0,02
GBP 100.000	Newday Funding Plc '2017-1 B' RegS FRN 15/7/2025	114.431	0,02	GBP 472.000	United Kingdom Gilt 4,25% 7/9/2039	784.138	0,14
GBP 285.825	Oat Hill No 1 Plc 'A' RegS FRN 25/2/2046	325.871	0,06	GBP 490.701	United Kingdom Gilt 3,25% 22/1/2044	736.353	0,13
EUR 200.000	Paragon Mortgages No 10 Plc '10X A2B' RegS FRN 15/6/2041	195.206	0,03	GBP 4.767.271	United Kingdom Gilt 3,50% 22/1/2045	7.500.133	1,31
EUR 50.000	Paragon Mortgages No 12 Plc '12X B1B' RegS FRN 15/11/2038	47.884	0,01	GBP 2.171.000	United Kingdom Gilt 4,25% 7/12/2046	3.893.744	0,68
USD 67.164	Paragon Mortgages No 13 Plc '144A' FRN 15/1/2039	55.345	0,01	GBP 716.000	United Kingdom Gilt 3,75% 22/7/2052	1.269.542	0,22

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

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Etats-Unis suite			
GBP 457.000	United Kingdom Gilt 4,25% 7/12/2055	913.998	0,16	EUR 100.000	JPMorgan Chase & Co 2,75% 1/2/2023	109.501	0,02
GBP 240.000	United Kingdom Gilt 1,75% 22/7/2057	288.659	0,05	USD 705.000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2029	601.009	0,10
GBP 906.620	United Kingdom Gilt 4,00% 22/1/2060	1.815.254	0,32	EUR 200.000	JPMorgan Chase & Co RegS 0,625% 25/1/2024	196.304	0,03
GBP 398.611	United Kingdom Gilt 3,50% 22/7/2068	772.690	0,13	EUR 700.000	Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027	709.324	0,12
GBP 193.433	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 10/8/2048	367.067	0,06	USD 470.000	Maple Escrow Subsidiary Inc '144A' 4,597% 25/5/2028	405.706	0,07
GBP 71.000	United Kingdom Gilt RegS 4,50% 7/9/2034	114.381	0,02	USD 385.000	McDonald's Corp 3,80% 1/4/2028	332.617	0,06
GBP 111.000	United Kingdom Gilt RegS 1,625% 22/10/2071	132.888	0,02	EUR 400.000	Morgan Stanley FRN 9/11/2021	398.828	0,07
GBP 775.000	University of Oxford RegS 2,544% 8/12/2117	894.662	0,16	EUR 200.000	Morgan Stanley Variable FRN 23/10/2026	195.139	0,03
GBP 200.000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'B' RegS FRN 21/9/2049	229.325	0,04	EUR 450.000	Nestle Holdings Inc 0,875% 18/7/2025	452.918	0,08
GBP 100.000	Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc 'C' RegS FRN 21/9/2049	115.456	0,02	EUR 200.000	Praxair Inc 1,50% 11/3/2020	205.797	0,04
GBP 200.000	WPP Finance 2013 2,875% 14/9/2046	187.216	0,03	EUR 625.000	PVH Corp RegS 3,125% 15/12/2027	616.663	0,11
EUR 650.000	WPP Finance 2013 RegS 0,75% 18/11/2019	657.404	0,11	EUR 500.000	RELX Capital Inc 1,30% 12/5/2025	505.255	0,09
EUR 100.000	Yorkshire Building Society 0,75% 10/11/2022	102.271	0,02	EUR 675.000	Thermo Fisher Scientific Inc 1,50% 1/12/2020	697.761	0,12
EUR 150.000	Yorkshire Building Society 0,375% 11/4/2023	150.491	0,03	EUR 200.000	Thermo Fisher Scientific Inc 1,40% 23/1/2026	199.997	0,03
		59.715.975	10,43	USD 4.268.964	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2022*	3.593.106	0,63
Etats-Unis				USD 421.966	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/4/2023	361.491	0,06
USD 359.000	Amazon.com Inc RegS 3,15% 22/8/2027	297.336	0,05	USD 3.013.751	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,50% 15/1/2028	2.524.070	0,44
EUR 139.000	Apple Inc 1,625% 10/11/2026	146.863	0,02	EUR 400.000	US Bancorp 0,85% 7/6/2024	397.700	0,07
EUR 100.000	Bank of America Corp 1,875% 10/1/2019	101.242	0,02	GBP 200.000	Verizon Communications Inc 3,125% 2/11/2035	219.850	0,04
EUR 200.000	Bank of America Corp RegS FRN 26/7/2019	200.937	0,03	GBP 875.000	Wells Fargo & Co 2,00% 28/7/2025	962.555	0,17
EUR 100.000	Bank of America Corp RegS FRN 21/9/2021	99.847	0,02			20.604.004	3,60
GBP 450.000	BAT Capital Corp 2,125% 15/8/2025	501.874	0,09	Total des obligations		413.065.284	72,18
EUR 150.000	BAT Capital Corp RegS FRN 16/8/2021	150.141	0,03	EXCHANGE TRADED FUNDS			
EUR 325.000	BAT Capital Corp RegS 1,125% 16/11/2023	327.615	0,06	Irlande			
USD 150.000	BAT Capital Corp RegS 3,557% 15/8/2027	121.567	0,02	9.157	iShares Core Euro Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	1.185.099	0,21
EUR 1.700.000	Becton Dickinson and Co 0,368% 6/6/2019	1.705.831	0,30	3.250	iShares JP Morgan \$ Emerging Markets Bond UCITS ETF (Dist)	299.129	0,05
USD 600.000	CRH America Finance Inc RegS 3,95% 4/4/2028	499.136	0,09			1.484.228	0,26
EUR 620.000	FedEx Corp 0,50% 9/4/2020	626.082	0,11	Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		1.484.228	0,26
EUR 175.000	GENERAL ELECTRIC Co 2,125% 17/5/2037	163.443	0,03	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		563.658.249	98,49
USD 640.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 15/5/2026	545.797	0,09	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
EUR 515.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS FRN 27/7/2021	523.276	0,09	OBLIGATIONS			
EUR 150.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS FRN 9/9/2022	149.853	0,03	Irlande			
EUR 300.000	JPMorgan Chase & Co 2,625% 23/4/2021	320.733	0,06	EUR 100.000	Taurus Ltd '2015-DE2 E' RegS FRN 1/2/2026**	100.440	0,02
EUR 400.000	JPMorgan Chase & Co 2,75% 24/8/2022	436.840	0,08			100.440	0,02
				Nouvelle-Zélande			
				NZD 1.908.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,50% 20/9/2040	1.278.805	0,22
						1.278.805	0,22

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

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				Organismes de placement collectif			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Espagne				Irlande			
EUR 88.816	SRF Fondo de Titulizacion 2017-1 'A' FRN 26/4/2063**	89.372	0,02	6.644.442	Institutional Cash Series Plc - Institutional Euro Assets Liquidity Fund Agency Dis ¹	6.644.442	1,16
		89.372	0,02			6.644.442	1,16
Royaume-Uni				Total des organismes de placement collectif			
GBP 70.547	Marketplace Originated Consumer Assets Plc '2017-1 A' RegS FRN 20/12/2027**	80.525	0,01	Portefeuille de titres à la valeur de marché			
GBP 100.000	Motor Plc '2016-1 A' RegS 1,30% 25/11/2025**	113.685	0,02			571.965.518	99,94
		194.210	0,03	Autres éléments de l'actif net			
Total des obligations		1.662.827	0,29			325.108	0,06
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		1.662.827	0,29	Total de l'actif net (EUR)			
						572.290.626	100,00

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

« *Contracts for difference* » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
France				Royaume-Uni			
(115.901)	Electricite de France SA	Bank of America Merrill Lynch	98.775	(13.513)	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	Bank of America Merrill Lynch	30.154
			98.775				30.154
Pays-Bas				Total (exposition brute sous-jacente – 2.486.103 EUR)			
(30)	Akzo Nobel NV	Bank of America Merrill Lynch	(18)				128.911
			(18)				

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCCDs	EUR 1.900.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2022	(16.704)	29.846
CCCDs	EUR 400.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	7.306	(35.504)
CCCDs	EUR 2.500.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	18.804	(39.327)
CCCDs	EUR 1.203.194	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 29 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(12.777)	9.668
CCILs	EUR 2.280.000	Fund receives Fixed 1,410% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2023	(9.798)	(9.764)
CCILs	GBP 733.114	Fund receives Fixed 3,273% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2023	8	23
CCILs	EUR 1.545.000	Fund receives Fixed 1,588% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(2.334)	(2.299)
CCILs	GBP 132.000	Fund receives Fixed 3,370% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2028	962	965
CCILs	EUR 1.213.750	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(8.497)	(8.469)
CCILs	EUR 210.000	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(1.470)	(1.465)
CCILs	EUR 215.000	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(1.505)	(1.500)
CCILs	EUR 1.218.750	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(8.532)	(8.504)
CCILs	EUR 1.216.250	Fund receives Fixed 1,592% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(2.644)	(2.617)
CCILs	EUR 1.216.250	Fund receives Fixed 1,598% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(1.991)	(1.963)
CCILs	EUR 401.000	Fund receives Fixed 1,598% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(656)	(647)
CCIRS	GBP 1.500.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,889%	Bank of America Merrill Lynch	10/12/2020	4.871	4.885
CCIRS	GBP 700.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,032%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2021	2.109	2.120
CCIRS	USD 16.400.000	Fund receives Fixed 3,044% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2022	41.067	41.201
CCIRS	USD 16.277.962	Fund receives Fixed 3,063% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2022	45.789	45.922
CCIRS	EUR 940.000	Fund receives Fixed 0,413% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2022	3.782	4.469
CCIRS	USD 1.120.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,088%	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2022	(6.223)	(5.781)
CCIRS	EUR 3.800.000	Fund receives Fixed 0,395% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2022	15.478	15.902
CCIRS	USD 4.790.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,101%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2022	(26.863)	(26.191)
CCIRS	EUR 3.800.000	Fund receives Fixed 0,408% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/5/2022	10.756	17.095
CCIRS	USD 4.820.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,108%	Bank of America Merrill Lynch	28/5/2022	(21.288)	(27.169)
CCIRS	EUR 2.800.000	Fund receives Fixed 0,222% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2022	(3.339)	(3.311)
CCIRS	USD 3.390.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,896%	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2022	(1.661)	(1.632)
CCIRS	GBP 225.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,078%	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2022	740	743
CCIRS	EUR 1.000.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,364%	Bank of America Merrill Lynch	7/10/2022	(7.611)	(7.598)
CCIRS	EUR 10.089.351	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,430%	Bank of America Merrill Lynch	7/10/2022	(105.646)	(105.514)
CCIRS	GBP 105.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,161%	Bank of America Merrill Lynch	30/11/2022	144	149
CCIRS	GBP 570.000	Fund receives Fixed 3,340% and pays Floating GBP 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/1/2023	3.407	3.417
CCIRS	EUR 972.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,412%	Bank of America Merrill Lynch	24/2/2023	(7.599)	(7.586)
CCIRS	PLN 3.600.000	Fund receives Fixed 2,426% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	1.514	1.526
CCIRS	PLN 4.600.000	Fund receives Fixed 2,592% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	10.248	10.263
CCIRS	JPY 642.500.000	Fund receives Fixed 0,142% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	2.037	2.108
CCIRS	JPY 642.500.000	Fund receives Fixed 0,143% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	2.215	2.286

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	JPY 446.000.000	Fund receives Fixed 0,158% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	4.150	4.198
CCIRS	GBP 100.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,424%	Bank of America Merrill Lynch	8/12/2023	(1.023)	(1.019)
CCIRS	USD 6.900.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,057%	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2025	(42.723)	(42.642)
CCIRS	USD 6.690.506	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,078%	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2025	(46.792)	(46.713)
CCIRS	CAD 3.170.000	Fund receives Floating CAD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,712%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(21.581)	(21.542)
CCIRS	CAD 1.900.672	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,821%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(22.968)	(22.944)
CCIRS	EUR 5.470.028	Fund receives Fixed 1,047% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2027	129.236	129.341
CCIRS	USD 1.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,972%	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2027	(7.764)	(7.748)
CCIRS	EUR 2.460.000	Fund receives Fixed 0,835% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/8/2027	(5.443)	(5.396)
CCIRS	EUR 356.000	Fund receives Fixed 1,380% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2027	(1.460)	(1.454)
CCIRS	EUR 334.000	Fund receives Fixed 1,586% and pays Floating EUR 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/1/2028	(550)	(542)
CCIRS	GBP 206.000	Fund receives Floating GBP 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,419%	Bank of America Merrill Lynch	4/1/2028	(2.787)	(2.781)
CCIRS	EUR 860.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,953%	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(6.955)	(6.939)
CCIRS	EUR 860.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,956%	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(7.200)	(7.183)
CCIRS	CHF 245.343	Fund receives Fixed 0,454% and pays Floating CHF 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2028	1.733	1.737
CCIRS	EUR 214.118	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,032%	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2028	(3.042)	(3.038)
CCIRS	CHF 245.343	Fund receives Fixed 0,422% and pays Floating CHF 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/3/2028	1.023	1.027
CCIRS	EUR 214.117	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,994%	Bank of America Merrill Lynch	27/3/2028	(2.221)	(2.217)
CCIRS	USD 564.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,860%	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2028	674	684
CCIRS	USD 785.751	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,871%	Bank of America Merrill Lynch	23/4/2028	384	396
CCIRS	USD 400.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,974%	Bank of America Merrill Lynch	3/5/2028	(2.911)	(2.904)
CCIRS	USD 200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,018%	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2028	(2.106)	(2.103)
CCIRS	NZD 838.500	Fund receives Floating NZD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,215%	Bank of America Merrill Lynch	18/5/2028	(5.067)	(5.058)
CCIRS	NZD 978.250	Fund receives Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate and pays Fixed 3,219%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2028	(6.102)	(6.091)
CCIRS	NZD 978.250	Fund receives Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate and pays Fixed 3,220%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2028	(6.155)	(6.144)
CCIRS	ZAR 7.420.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,710%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	9.151	9.161
CCIRS	ZAR 13.660.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,765%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	13.321	13.340
CCIRS	ZAR 7.425.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,790%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	6.370	6.380
CCIRS	JPY 231.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,340%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(2.525)	(2.489)
CCIRS	JPY 322.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,340%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(3.517)	(3.467)
CCIRS	JPY 57.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,341%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(661)	(652)
CCIRS	JPY 322.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,341%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(3.708)	(3.658)
CCIRS	JPY 228.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,357%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(5.541)	(5.506)
CCIRS	JPY 185.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,364%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(5.444)	(5.415)
CCIRS	SEK 14.560.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 1,368%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(18.623)	(18.595)
CCIRS	SEK 24.680.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 1,372%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(32.747)	(32.699)
CCIRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,076% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/6/2030	38	40

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 1,254% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2033	126	132
CCIRS	EUR 194.500	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,935%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2037	999	1.004
CCIRS	GBP 1.183.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,827%	Bank of America Merrill Lynch	2/5/2038	(9.107)	(9.072)
CCIRS	EUR 780.000	Fund receives Fixed 1,502% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	8.017	8.045
CCIRS	EUR 460.000	Fund receives Fixed 1,522% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	6.684	6.701
CCIRS	EUR 78.000	Fund receives Fixed 1,529% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	1.250	1.252
CCIRS	EUR 201.000	Fund receives Fixed 1,562% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	4.630	4.638
CCIRS	EUR 1.130.000	Fund receives Fixed 1,583% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	30.981	31.022
CCIRS	EUR 750.000	Fund receives Fixed 1,617% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	26.370	26.397
CCIRS	EUR 750.000	Fund receives Fixed 1,644% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	30.679	30.707
CCIRS	JPY 23.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,925%	Bank of America Merrill Lynch	20/2/2048	(3.149)	(3.143)
CCIRS	JPY 11.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,951%	Bank of America Merrill Lynch	22/2/2048	(2.134)	(2.131)
CCIRS	GBP 100.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,536%	Bank of America Merrill Lynch	27/3/2048	990	997
CCIRS	GBP 266.500	Fund receives Fixed 1,654% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2048	3.177	3.186
CCIRS	GBP 2.731.000	Fund receives Fixed 1,376% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2058	26.117	26.210
CCIRS	GBP 360.000	Fund receives Fixed 1,378% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2058	3.484	3.496
CCIRS	GBP 271.494	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,239%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2067	24.942	24.954
CDS	EUR 185.000	Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2021	334	(4.740)
CDS	EUR 185.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Air Liquide SA	Barclays Bank	20/6/2021	70	4.676
CDS	EUR 24.500	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas SA	Barclays Bank	20/6/2022	468	542
CDS	EUR 600.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Centrica Plc	Barclays Bank	20/12/2022	(1.027)	5.763
CDS	EUR 30.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on UniCredit SpA	Barclays Bank	20/12/2022	(1.201)	(631)
CDS	EUR 50.000	Fund receives default protection on Barclays Bank Plc and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2021	(3.565)	(214)
CDS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on ING Bank NV	BNP Paribas	20/6/2021	982	2.423
CDS	EUR 400.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	BNP Paribas	20/6/2022	(4.528)	6.283
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Centrica Plc	BNP Paribas	20/12/2022	(245)	1.921
CDS	EUR 92.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas SA	Citibank	20/6/2022	1.710	2.036
CDS	EUR 73.220	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas SA	Citibank	20/6/2022	1.398	1.620
CDS	EUR 85.887	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BNP Paribas SA	Citibank	20/6/2022	1.596	1.900
CDS	EUR 1.309.215	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	Citibank	20/6/2022	(10.782)	20.566
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Volvo AB and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/12/2021	(2.221)	(3.242)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Volvo AB and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/12/2021	(2.224)	(3.242)
CDS	USD 100.000	Fund receives default protection on Australia and New Zealand Banking Group Limited and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/12/2020	(1.068)	(1.508)
CDS	USD 100.000	Fund receives default protection on Commonwealth Bank of Australia and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/12/2020	(1.057)	(1.497)
CDS	USD 100.000	Fund receives default protection on National Australia Bank Ltd and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/12/2020	(800)	(1.509)
CDS	USD 100.000	Fund receives default protection on Westpac Banking Corp and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/12/2020	(1.050)	(1.493)
CDS	EUR 450.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 26 Version 1	Deutsche Bank	20/12/2021	2.767	9.126

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 7.000.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 26 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2022	(9.094)	(143.401)
CDS	EUR 1.320.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	JP Morgan	20/6/2022	(10.922)	20.735
CDS	EUR 2.000.000	Fund receives default protection on J Sainsbury Plc and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	5.784	10.730
ILS	GBP 679.000	Fund receives Fixed 3,580% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Barclays Bank	15/3/2022	10.648	10.648
ILS	GBP 547.000	Fund receives Fixed 3,395% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Barclays Bank	15/7/2022	3.675	3.675
ILS	EUR 190.000	Fund receives Fixed 1,412% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Barclays Bank	15/3/2027	(2.605)	(2.605)
ILS	EUR 48.000	Fund receives Fixed 1,412% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Barclays Bank	15/3/2027	(883)	(658)
ILS	GBP 313.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,552%	Barclays Bank	15/3/2027	(8.144)	(8.144)
ILS	GBP 252.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,355%	Barclays Bank	15/7/2027	(340)	(340)
ILS	EUR 890.000	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,172%	Citibank	15/7/2022	13.539	13.539
ILS	EUR 890.000	Fund receives Fixed 1,392% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Citibank	15/7/2027	(16.072)	(16.072)
ILS	GBP 297.000	Fund receives Fixed 3,440% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Citibank	15/7/2027	3.921	3.921
ILS	GBP 67.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,475%	Citibank	15/7/2047	(2.517)	(2.517)
ILS	EUR 882.000	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,210%	Goldman Sachs	15/7/2022	11.681	11.681
ILS	EUR 530.205	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,290%	Goldman Sachs	15/9/2022	6.058	6.058
ILS	EUR 882.000	Fund receives Fixed 1,405% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Goldman Sachs	15/7/2027	(14.747)	(14.747)
ILS	EUR 530.205	Fund receives Fixed 1,468% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Goldman Sachs	15/9/2027	(6.875)	(6.875)
ILS	GBP 488.000	Fund receives Fixed 3,408% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Goldman Sachs	15/11/2027	6.287	6.286
ILS	GBP 446.000	Fund receives Fixed 3,430% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Goldman Sachs	15/11/2027	7.141	7.141
ILS	USD 805.000	Fund receives Floating USD 12 Month USCPI and pays Fixed 2,152%	Goldman Sachs	30/11/2027	12.887	12.887
ILS	GBP 85.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,489%	Goldman Sachs	15/8/2047	(4.075)	(4.075)
ILS	GBP 101.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,504%	Goldman Sachs	15/11/2047	(6.571)	(6.571)
ILS	EUR 1.300.600	Fund receives Fixed 1,362% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Morgan Stanley	15/7/2027	(27.657)	(27.657)
IRS	GBP 100.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,064%	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	393	393
IRS	GBP 100.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,949%	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2022	938	938
IRS	GBP 1.665.623	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,949%	Bank of America Merrill Lynch	6/7/2022	15.670	15.670
IRS	EUR 1.850	Fund receives Fixed 1,438% and pays Floating EUR 12 Month LIBOR *	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2023	(7)	(7)
IRS	GBP 217.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,860%	Bank of America Merrill Lynch	31/8/2023	4.834	4.834
IRS	CNY 7.340.000	Fund receives Fixed 3,630% and pays Floating CNY 1 Month 7D China Fixing Repo Rates	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(351)	(351)
IRS	CNY 13.399.160	Fund receives Fixed 3,966% and pays Floating CNY 3 Month 7D China Fixing Repo Rates	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	26.616	26.616
IRS	INR 24.059.376	Fund receives Fixed 6,983% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(1.189)	(1.189)
IRS	INR 60.360.200	Fund receives Fixed 7,126% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	1.505	1.505
IRS	KRW 1.219.790.000	Fund receives Fixed 2,252% and pays Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(331)	(331)
IRS	BRL 667.730	Fund receives Fixed 10,040% and pays Floating BRL 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(4.657)	(4.657)
IRS	BRL 529.293	Fund receives Fixed 9,555% and pays Floating BRL One Day Brazil Interbank Deposit Overnight Rate	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(5.697)	(5.697)
IRS	BRL 1.070.000	Fund receives Fixed 9,650% and pays Floating BRL 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(10.767)	(10.767)
IRS	BRL 549.924	Fund receives Fixed 9,855% and pays Floating BRL One Day Brazil Interbank Deposit Overnight Rate	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(4.674)	(4.674)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
IRS	CAD 1.835.000	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,749%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(15.804)	(15.764)
IRS	CAD 1.900.672	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,817%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(22.565)	(22.541)
IRS	GBP 492.000	Fund receives Fixed 3,320% and pays Floating GBP 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2028	201	214
IRS	GBP 86.000	Fund receives Floating GBP 12 Month LIBOR and pays Fixed 3,422%	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2048	(1.177)	(1.172)
IRS	GBP 40.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,777%	Barclays Bank	7/3/2022	593	593
IRS	JPY 70.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,800%	Barclays Bank	31/5/2047	8.342	8.342
IRS	JPY 41.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,902%	Barclays Bank	12/7/2047	(4.160)	(4.160)
IRS	JPY 41.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,912%	Barclays Bank	12/7/2047	(5.059)	(5.059)
IRS	JPY 44.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,859%	Barclays Bank	30/9/2047	(30)	(30)
IRS	GBP 40.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,776%	Citibank	7/3/2022	595	595
IRS	GBP 37.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,776%	Citibank	7/3/2022	259	550
IRS	CNY 7.340.000	Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating CNY 1 Month 7D China Fixing Repo Rates	Citibank	19/9/2023	94	94
IRS	INR 65.221.200	Fund receives Fixed 7,128% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Citibank	19/9/2023	1.669	1.669
IRS	KRW 1.219.790.000	Fund receives Fixed 2,225% and pays Floating KRW 3 Month LIBOR	Citibank	19/9/2023	(1.587)	(1.587)
IRS	GBP 359.000	Fund receives Fixed 1,136% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Citibank	5/6/2027	(10.205)	(10.205)
IRS	GBP 32.000	Fund receives Fixed 1,136% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Citibank	5/6/2027	(201)	(910)
IRS	EUR 703.000	Fund receives Fixed 1,475% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Citibank	5/12/2027	617	617
IRS	EUR 240.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,231%	Citibank	6/1/2037	6.884	6.884
IRS	EUR 384.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,069%	Citibank	6/12/2037	(2.399)	(2.399)
IRS	GBP 56.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,495%	Citibank	8/11/2047	1.229	1.229
IRS	GBP 494.981	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,450%	Citibank	1/12/2067	585	585
IRS	INR 33.915.024	Fund receives Fixed 7,080% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	32	32
IRS	INR 60.360.200	Fund receives Fixed 7,170% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	2.876	2.876
IRS	INR 56.809.600	Fund receives Fixed 7,180% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	3.001	3.001
IRS	GBP 225.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,767%	Goldman Sachs	7/9/2022	4.336	4.336
IRS	INR 57.974.400	Fund receives Fixed 7,130% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	JP Morgan	19/9/2023	1.559	1.558
Total (exposition brute sous-jacente – 203.367.589 EUR)					(80.737)	(146.443)

CCDS : Centrally Cleared Credit Default Swaps ou swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale
 CCILS: Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)
 CCIRS: Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)
 CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance
 ILS (inflation linked swaps) : swaps liés à l'inflation
 IRS (interest rate swaps) : swaps sur taux d'intérêt

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
BRL	1.000.000	USD	280.828	Morgan Stanley	14/8/2018	(12.066)
CAD	2.680.000	EUR	1.732.743	Barclays Bank	20/6/2018	41.479
CAD	2.700.000	USD	2.093.914	Morgan Stanley	27/6/2018	(7.140)
CHF	410.000	EUR	342.680	Dominion Bank Toronto	4/6/2018	14.311
CHF	188.000	EUR	160.807	Barclays Bank	20/6/2018	2.918
CHF	210.000	EUR	182.509	JP Morgan	20/6/2018	375
CHF	4.010.000	EUR	3.427.559	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	64.662
CHF	280.000	EUR	234.060	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	9.786
CHF	10.474	EUR	8.945	Bank of America Merrill Lynch	27/6/2018	177
CHF	479.526	EUR	409.619	Barclays Bank	27/6/2018	8.026
CHF	1.490.000	EUR	1.267.314	Credit Suisse	27/6/2018	30.407
CZK	22.950.000	EUR	900.041	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(11.142)
DKK	2.360.000	EUR	316.947	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	119
DKK	5.130.000	EUR	688.926	HSBC	20/6/2018	290
DKK	20.450.000	EUR	2.746.035	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	1.424
EUR	46.380	CAD	70.000	HSBC	20/6/2018	39
EUR	1.755.183	CAD	2.800.000	Royal Bank of Canada	20/6/2018	(98.481)
EUR	6.208	CAD	10.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(412)
EUR	798.392	CHF	940.000	JP Morgan	4/6/2018	(20.076)
EUR	23.440.667	CHF	28.045.000	Dominion Bank Toronto	4/6/2018	(978.399)
EUR	4.428.824	CHF	5.290.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(178.121)
EUR	8.352	CHF	10.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(357)
EUR	8.352	CHF	10.000	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	(357)
EUR	928.985	CZK	23.716.000	HSBC	4/6/2018	10.204
EUR	4.227.902	CZK	107.190.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	76.222
EUR	593.000	CZK	15.080.000	Citibank	20/6/2018	8.922
EUR	6.906.040	DKK	51.450.000	Dominion Bank Toronto	4/6/2018	(5.979)
EUR	1.102.178	DKK	8.210.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(836)
EUR	14.797.405	DKK	110.180.000	Citibank	20/6/2018	(5.284)
EUR	216.334	DKK	1.610.000	Credit Suisse	20/6/2018	30
EUR	1.023.081	DKK	7.620.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(667)
EUR	18.142.387	GBP	15.995.000	Barclays Bank	4/6/2018	(106.038)
EUR	18.150.190	GBP	15.995.000	Citibank	4/6/2018	(98.236)
EUR	18.143.458	GBP	15.995.000	HSBC	4/6/2018	(104.968)
EUR	4.295.377	GBP	3.780.000	JP Morgan	4/6/2018	(17.162)
EUR	18.143.842	GBP	15.996.500	Societe Generale	4/6/2018	(106.295)
EUR	18.139.322	GBP	15.995.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(109.104)
EUR	15.659.655	GBP	13.980.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(283.074)
EUR	1.476.363	GBP	1.300.000	Barclays Bank	20/6/2018	(6.151)
EUR	3.322.212	GBP	2.910.000	HSBC	20/6/2018	3.661
EUR	158.376	GBP	140.000	JP Morgan	20/6/2018	(1.279)
EUR	805.679	GBP	710.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(4.002)
EUR	11.434	GBP	10.000	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	30
EUR	785.145	HUF	246.305.000	HSBC	4/6/2018	13.549
EUR	82.694	JPY	10.870.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(3.284)
EUR	284.133	NOK	2.740.000	JP Morgan	4/6/2018	(3.049)
EUR	2.666.080	NOK	25.809.474	Dominion Bank Toronto	4/6/2018	(39.032)
EUR	480.052	NOK	4.620.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(3.889)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	826.566	NOK	7.980.000	Standard Chartered Bank	20/6/2018	(9.332)
EUR	639.709	NZD	1.090.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(15.227)
EUR	481.644	NZD	830.000	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	(17.069)
EUR	2.242.876	PLN	9.491.000	Dominion Bank Toronto	4/6/2018	43.555
EUR	287.961	SEK	2.950.000	JP Morgan	4/6/2018	916
EUR	10.308.064	SEK	108.273.500	Dominion Bank Toronto	4/6/2018	(227.306)
EUR	957.610	SEK	9.860.000	JP Morgan	20/6/2018	(1.846)
EUR	1.745.180	SEK	17.830.000	Morgan Stanley	20/6/2018	10.179
EUR	1.195.817	SEK	12.310.000	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	(2.044)
EUR	171.058	SEK	1.748.568	Barclays Bank	29/6/2018	906
EUR	572.972	SEK	5.857.314	Credit Suisse	29/6/2018	3.000
EUR	1.282.942	SEK	13.116.864	Deutsche Bank	29/6/2018	6.548
EUR	88.588	SEK	905.330	Morgan Stanley	29/6/2018	491
EUR	427.646	SEK	4.371.925	UBS	29/6/2018	2.217
EUR	88.510	SEK	900.000	Deutsche Bank	14/8/2018	925
EUR	32.229	USD	40.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(2.061)
EUR	1.217.701	USD	1.480.000	Barclays Bank	20/6/2018	(51.017)
EUR	492.211	USD	610.000	BNP Paribas	20/6/2018	(30.707)
EUR	987.142	USD	1.230.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(67.266)
EUR	598.286	USD	740.000	HSBC	20/6/2018	(36.073)
EUR	14.403.098	USD	17.840.000	JP Morgan	20/6/2018	(890.097)
EUR	904.291	USD	1.050.000	Morgan Stanley	20/6/2018	4.187
EUR	16.218	USD	20.000	Societe Generale	20/6/2018	(927)
EUR	348.235	USD	410.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(3.234)
EUR	1.222.920	USD	1.490.000	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	(54.370)
EUR	132.691	USD	155.709	Barclays Bank	27/6/2018	(712)
EUR	670.000	USD	798.881	HSBC	27/6/2018	(14.441)
EUR	707.309	USD	829.979	JP Morgan	27/6/2018	(3.775)
EUR	316.951	ZAR	4.820.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(9.414)
EUR	914.437	ZAR	13.650.000	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	(9.814)
GBP	197.000	EUR	225.505	Barclays Bank	20/6/2018	(847)
GBP	1.260.000	EUR	1.434.121	Goldman Sachs	20/6/2018	2.778
GBP	2.227.000	EUR	2.541.830	JP Morgan	20/6/2018	(2.169)
GBP	240.000	EUR	273.438	Morgan Stanley	20/6/2018	257
GBP	170.000	EUR	193.731	Royal Bank of Canada	20/6/2018	137
GBP	1.200.000	EUR	1.385.264	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(16.789)
HUF	257.360.000	EUR	825.413	Goldman Sachs	20/6/2018	(19.292)
HUF	52.270.000	EUR	166.593	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	(2.869)
JPY	109.000.000	USD	1.004.707	UBS	29/6/2018	1.441
MXN	45.000.000	USD	2.326.291	Barclays Bank	29/6/2018	(73.806)
NOK	8.760.000	EUR	909.513	HSBC	20/6/2018	8.089
NOK	1.540.000	EUR	160.985	JP Morgan	20/6/2018	329
NZD	2.855.000	USD	1.989.421	HSBC	29/6/2018	9.984
PLN	2.890.000	EUR	685.345	HSBC	20/6/2018	(16.292)
PLN	660.000	EUR	153.243	JP Morgan	20/6/2018	(449)
SEK	1.610.000	EUR	156.091	JP Morgan	20/6/2018	575
SEK	3.160.000	EUR	299.789	Dominion Bank Toronto	20/6/2018	7.704
SEK	26.000.000	EUR	2.535.494	Citibank	29/6/2018	(5.450)
TRY	1.196.096	EUR	1.057.423	Deutsche Bank	14/8/2018	32.143
TRY	1.814.000	USD	415.626	Bank of America Merrill Lynch	14/8/2018	(22.417)
TRY	210.000	USD	47.081	State Street Bank & Trust Company	14/8/2018	(1.712)
USD	140.894	BRL	520.000	Barclays Bank	14/8/2018	1.890
USD	518.225	CAD	666.815	Bank of America Merrill Lynch	27/6/2018	2.700

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
USD	103.502	CAD	133.185	Credit Suisse	27/6/2018	535
USD	1.478.812	CAD	1.900.000	HSBC	27/6/2018	9.580
USD	4.550.000	EUR	3.816.755	HSBC	20/6/2018	83.695
USD	280.000	EUR	236.730	JP Morgan	20/6/2018	3.298
USD	995.316	EUR	840.000	Citibank	27/6/2018	12.736
USD	1.805.197	EUR	1.510.000	Morgan Stanley	29/6/2018	36.347
USD	999.882	JPY	109.000.000	Morgan Stanley	29/6/2018	(5.575)
USD	1.133.757	MXN	22.500.000	Citibank	29/6/2018	11.729
USD	1.133.296	MXN	22.500.000	UBS	29/6/2018	11.334
USD	280.070	NZD	405.253	JP Morgan	27/6/2018	(3.405)
USD	708.051	NZD	1.024.747	Morgan Stanley	27/6/2018	(8.740)
USD	61.586	TRY	273.000	Citibank	14/8/2018	2.551
USD	32.774	TRY	144.252	Deutsche Bank	14/8/2018	1.546
USD	18.346	TRY	80.748	Goldman Sachs	14/8/2018	866
USD	49.686	TRY	220.000	HSBC	14/8/2018	2.104
						(3.227.521)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Catégorie d'Actions couverte en couronnes tchèques						
CZK	54.541.372	EUR	2.133.803	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(21.196)
EUR	46.720	CZK	1.204.115	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	79
						(21.117)
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
EUR	5.451	USD	6.332	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	20
USD	542.138	EUR	455.612	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	9.398
						9.418
Total (exposition brute sous-jacente – 288.738.826 EUR)						(3.239.220)

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
79	GBP	3 Month Sterling Put Futures-Style Option (HSBC)			
		(strike price GBP 99,25)	Juin 2018	–	(4.506)
(30)	USD	90 Day Euro	Juin 2020	25.652.985	222
30	USD	90 Day Euro	Mars 2020	25.652.985	(998)
(6)	GBP	90 Day Sterling	Septembre 2020	3.416.985	(1.968)
6	GBP	90 Day Sterling	Septembre 2019	3.416.985	2.310
(5)	AUD	Australian 10 Year Bond	Juin 2018	416.872	(7.354)
32	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	1.897.310	36.168
10	USD	CBOE SPX Volatility Index	Septembre 2018	141.184	1.287
24	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	2.798.268	69.251
(80)	EUR	Euro BOBL	Juin 2018	8.705.840	(76.506)
(33)	EUR	Euro BTP	Juin 2018	3.804.834	72.375
29	EUR	Euro BTP	Juin 2018	2.850.120	26.913
55	EUR	Euro BTP	Juin 2018	6.341.390	(439.180)
(26)	EUR	Euro BTP	Juin 2018	2.555.280	26.150
7	EUR	Euro Bund	Juin 2018	703.157	4.800
(19)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	1.908.569	(5.120)
(14)	EUR	Euro Bund	Septembre 2018	1.430.212	8.680
(75)	EUR	Euro BUXL	Juin 2018	11.342.700	(488.651)
(39)	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	3.949.725	(9.265)
196	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	19.849.900	74.480
(164)	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2018	5.582.560	(1.830)
26	EUR	EURO STOXX 50 Index	Juin 2018	887.640	18.555
219	EUR	EURO STOXX 50 Index	Décembre 2019	2.741.880	(6.570)
(145)	EUR	Euro-OAT	Juin 2018	17.434.510	(219.615)
(23)	EUR	FTSE MIB Index	Juin 2018	2.498.950	63.125
20	EUR	IBEX 35 Index	Juin 2018	1.894.400	(142.750)
(2)	JPY	Japan 10 Year Bond	Juin 2018	1.623.173	(7.120)
(10)	EUR	STOXX 600 Automobiles & Parts Index	Juin 2018	303.650	(300)
(88)	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	12.745.143	(150.790)
19	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	2.751.792	47.632
(1)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	86.082	108
56	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	4.820.593	38.709
(20)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	1.698.364	(3.100)
24	USD	US Treasury 2 Year Note	Septembre 2018	4.038.231	(8.576)
(23)	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	1.913.588	(2.119)
(10)	USD	US Ultra Bond	Septembre 2018	972.702	(3.862)
Total				188.828.559	(1.089.415)

BlackRock European Select Strategies Fund suite

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
9	Put	STOXX 600 Automobiles & Parts Index	Credit Suisse	EUR 600,00	15/6/2018	(6.008)	2.993
517	Put	Intesa Sanpaolo SpA	Credit Suisse	EUR 2,60	16/8/2018	61.438	107.277
1.159	Call	Electricite de France SA	Credit Suisse	EUR 13,00	21/9/2018	(17.385)	24.339
114	Put	Euro STOXX Banks Index	Credit Suisse	EUR 110,00	21/9/2018	11.400	29.355
1.380.000	Call	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,17	29/10/2018	4.420	33.230
1.380.000	Put	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,17	29/10/2018	(4.987)	23.823
Total (exposition brute sous-jacente – 2.827.831 EUR)						48.878	221.017

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 mai 2018

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis			
USD 5.092.000	Fannie Mae Pool 3,00% TBA	4.348.404	0,76
USD (3.520.000)	Fannie Mae Pool 3,50% TBA	(3.013.519)	(0,53)
		1.334.885	0,23
Total (exposition brute sous-jacente – 7.361.923 EUR)		1.334.885	0,23

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	35,90
Finance	29,22
Biens de consommation non cyclique	9,33
Valeurs industrielles	7,06
Services aux collectivités	4,94
Communications	2,73
Biens de consommation cyclique	2,45
Énergie	2,44
Technologie	1,61
Organismes de placement collectif	1,16
Titres hypothécaires	1,08
Matériaux de base	0,99
Titres adossés à des actifs	0,77
Exchange Traded Funds	0,26
Portefeuille de titres à la valeur de marché	99,94
Autres éléments de l'actif net	0,06
	100,00

BlackRock Fixed Income Strategies Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS							
Argentine				Canada			
USD 20.655.000	Argentine Republic Government International Bond 4,625% 11/1/2023*	16.255.970	0,16	EUR 6.700.000	Bank of Nova Scotia/The RegS 0,50% 23/7/2020	6.794.771	0,07
EUR 21.415.000	Argentine Republic Government International Bond 3,375% 15/1/2023	20.226.468	0,20	EUR 3.575.000	Canadian Imperial Bank of Commerce RegS 0,375% 15/10/2019	3.607.247	0,03
USD 19.865.000	Argentine Republic Government International Bond 5,875% 11/1/2028	15.011.922	0,15			10.402.018	0,10
EUR 44.670.000	Argentine Republic Government International Bond 5,25% 15/1/2028	40.928.887	0,41	Îles Caïmans			
USD 11.312.000	Argentine Republic Government International Bond 7,625% 18/4/2037	9.463.823	0,10	USD 1.750.000	Magnetite IX Ltd '2014-9X' Regs FRN 25/7/2026	892.680	0,01
USD 6.920.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875% 11/1/2048	4.929.496	0,05	USD 1.880.400	Magnetite VIII Ltd '2014-8X' RegS FRN 30/4/2031	1.020.789	0,01
EUR 9.360.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 3,875% 15/1/2022	9.210.240	0,09	GBP 15.000.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd RegS 4,375% 3/7/2034	19.839.216	0,20
EUR 27.866.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 5,00% 15/1/2027	25.532.223	0,26	GBP 6.401.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd RegS 5,50% 11/2/2041	9.988.139	0,10
USD 10.930.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 7,125% 28/6/2117*	7.889.228	0,08	GBP 350.000	Trafford Centre Finance Ltd/The RegS FRN 28/7/2035	360.820	0,00
		149.448.257	1,50			32.101.644	0,32
Autriche				Chypre			
EUR 3.000.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 8,125% 30/10/2023	3.950.415	0,04	EUR 17.757.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,875% 6/5/2022	19.081.317	0,19
EUR 2.600.000	Erste Group Bank AG RegS FRN (Perpetual)	3.073.746	0,03	EUR 26.157.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023	27.928.875	0,28
GBP 13.033.000	Oesterreichische Kontrollbank AG RegS 0,75% 7/3/2022	14.675.311	0,15	EUR 81.769.000	Cyprus Government International Bond RegS 2,75% 27/6/2024*	82.269.427	0,83
EUR 1.400.000	Raiffeisen Bank International AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	1.225.735	0,01	EUR 55.027.000	Cyprus Government International Bond RegS 4,25% 4/11/2025*	59.466.028	0,60
EUR 2.600.000	Raiffeisen Bank International AG RegS FRN (Perpetual)	2.666.677	0,03			188.745.647	1,90
EUR 4.900.000	Volksbank Wien AG RegS FRN 6/10/2027	4.861.878	0,05	République tchèque			
		30.453.762	0,31	CZK 1.720.220.000	Czech Republic Government Bond 10/2/2020 (Zero Coupon)	66.009.829	0,66
Belgique				CZK 1.678.240.000	Czech Republic Government Bond 0,75% 23/2/2021	64.560.508	0,65
EUR 200.000	AG Insurance SA RegS FRN 30/6/2047	200.666	0,00	CZK 1.000.000.000	Czech Republic Government Bond RegS 4,70% 12/9/2022	44.436.050	0,45
EUR 24.075.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV RegS FRN 17/3/2020	24.358.604	0,25			175.006.387	1,76
EUR 4.400.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV RegS 2,00% 23/1/2035	4.257.088	0,04	Danemark			
EUR 3.000.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV RegS 2,75% 17/3/2036	3.187.155	0,03	EUR 11.300.000	Danske Bank A/S RegS 0,875% 22/5/2023	11.332.374	0,11
EUR 29.700.000	BNP Paribas Fortis SA RegS 0,875% 22/3/2028	29.672.676	0,30	EUR 8.838.000	Danske Bank A/S RegS FRN 4/10/2023	8.947.061	0,09
EUR 4.535.000	KBC Group NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	4.646.334	0,05	EUR 200.000	Danske Bank A/S RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	219.589	0,00
EUR 40.174.893	Kingdom of Belgium Government Bond RegS '144A' 1,60% 22/6/2047	39.931.433	0,40	EUR 9.609.000	Danske Bank A/S RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	10.142.300	0,10
EUR 1.000.000	Nyrstar NV RegS 5,00% 11/7/2022	992.500	0,01	DKK 96.500.000	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab RegS 2,00% 1/10/2019	13.386.088	0,13
		107.246.456	1,08	DKK 88.400.850	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab RegS 2,00% 1/10/2047	11.861.727	0,12
				DKK 690.717.842	Nykredit Realkredit A/S 1,00% 1/10/2020	95.568.131	0,96
				DKK 268.086.571	Nykredit Realkredit A/S 1,50% 1/10/2047	35.563.201	0,36
				DKK 206.635.000	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/1/2021	28.646.495	0,29
				DKK 250.000.000	Nykredit Realkredit A/S RegS 1,00% 1/1/2023	34.913.750	0,35

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Danemark suite				France suite			
DKK 20.662.559	Nykredit Realkredit A/S RegS 2,00% 1/10/2047	2.763.601	0,03	EUR 5.800.000	Cars Alliance Auto Loans France V '2018-1 B' RegS FRN 21/10/2029	5.864.295	0,06
DKK 25.607.244	Nykredit Realkredit A/S RegS 2,00% 1/10/2047	3.464.563	0,04	EUR 45.100.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,25% 11/4/2023	45.153.669	0,45
DKK 144.081.539	Nykredit Realkredit A/S RegS 2,00% 1/10/2050	19.253.857	0,19	EUR 23.000.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,75% 29/5/2026	23.021.390	0,23
EUR 22.586.000	Orsted A/S RegS FRN 8/7/3013	22.686.282	0,23	EUR 5.000.000	Cie de Saint-Gobain RegS 4,50% 30/9/2019	5.303.200	0,05
DKK 159.005.000	Realkredit Danmark A/S 2,00% 1/1/2020	22.175.510	0,22	EUR 6.200.000	Cie de Saint-Gobain RegS 27/3/2020 (Zero Coupon)	6.201.054	0,06
DKK 193.365.000	Realkredit Danmark A/S 1,00% 1/1/2021	26.806.311	0,27	EUR 6.000.000	Cie de Saint-Gobain RegS 1,125% 23/3/2026*	5.868.810	0,06
DKK 438.587.530	Realkredit Danmark A/S 2,00% 1/10/2047	59.337.163	0,60	EUR 200.000	CMA CGM SA RegS 5,25% 15/1/2025	173.802	0,00
EUR 910.000	TDC A/S 3,75% 2/3/2022	962.771	0,01	EUR 200.000	Credit Agricole Assurances SA RegS FRN (Perpetual)	213.048	0,00
		408.030.774	4,10	EUR 200.000	Credit Agricole SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	218.769	0,00
Estonie				EUR 25.200.000	Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA RegS 1,00% 30/4/2028	25.362.162	0,26
EUR 5.700.000	Elering AS RegS 0,875% 3/5/2023	5.763.910	0,06	EUR 3.200.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 3,25% 1/6/2026	3.332.832	0,03
		5.763.910	0,06	EUR 4.300.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 3,50% 9/2/2029	4.387.978	0,04
Finlande				EUR 9.100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS FRN 25/10/2029	8.695.232	0,09
EUR 8.200.000	OP Corporate Bank Plc RegS 1,125% 17/6/2019	8.311.602	0,08	EUR 11.400.000	Dexia Credit Local SA RegS 0,25% 19/3/2020	11.509.212	0,12
EUR 906.000	Stora Enso OYJ RegS 2,50% 21/3/2028	917.796	0,01	GBP 12.900.000	Dexia Credit Local SA RegS 1,125% 15/6/2022	14.621.656	0,15
		9.229.398	0,09	GBP 12.900.000	Dexia Credit Local SA RegS 1,625% 8/12/2023	14.819.090	0,15
France				EUR 1.475.971	Driver France FCT Compartment Driver France Three 'B' RegS FRN 21/4/2024	1.478.081	0,02
EUR 1.500.000	Air Liquide Finance SA RegS 1,50% 17/6/2019	1.525.755	0,02	GBP 10.200.000	Electricite de France SA RegS 5,50% 17/10/2041	14.743.856	0,15
EUR 6.400.000	Air Liquide Finance SA RegS 0,125% 13/6/2020	6.427.968	0,07	EUR 7.500.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	7.865.250	0,08
EUR 3.800.000	Altarea SCA RegS 2,25% 5/7/2024	3.810.374	0,04	EUR 2.400.000	Engie SA RegS 2,00% 28/9/2037*	2.385.948	0,02
USD 950.000	Altice France SA/France '144A' 7,375% 1/5/2026	799.039	0,01	EUR 2.100.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	2.246.559	0,02
EUR 7.900.000	APRR SA RegS FRN 3/1/2020	7.971.258	0,08	GBP 2.300.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	2.664.900	0,03
EUR 31.300.000	AXA SA RegS FRN 28/5/2049	30.531.272	0,31	EUR 5.300.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	5.418.932	0,05
EUR 5.000.000	AXA SA RegS FRN (Perpetual)	5.250.850	0,05	EUR 6.117.611	FCT SapphireOne Auto '2017-1 A' RegS FRN 24/1/2034	6.124.305	0,06
EUR 13.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS FRN 3/6/2020	13.490.986	0,14	EUR 207.858.439	French Republic Government Bond OAT RegS '144A' 2,00% 25/5/2048*+	227.359.718	2,28
EUR 20.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 2,50% 25/5/2028*	19.957.400	0,20	EUR 12.500.000	La Poste SA RegS FRN (Perpetual)*	12.226.875	0,12
EUR 4.400.000	BNP Paribas Cardif SA RegS 1,00% 29/11/2024	4.149.926	0,04	EUR 10.000.000	Orange SA RegS 1,875% 2/10/2019	10.270.300	0,10
EUR 300.000	BNP Paribas Cardif SA RegS FRN (Perpetual)	315.195	0,00	EUR 5.000.000	Orange SA RegS 1,375% 20/3/2028*	4.967.150	0,05
EUR 4.000.000	BNP Paribas SA RegS 1,125% 15/1/2023	4.121.000	0,04	EUR 5.165.000	Orange SA RegS FRN (Perpetual)	5.871.830	0,06
EUR 17.450.000	BNP Paribas SA RegS 1,125% 22/11/2023	17.456.282	0,18	EUR 1.000.000	Orano SA 4,875% 23/9/2024	1.080.110	0,01
EUR 3.500.000	BNP Paribas SA RegS 2,875% 1/10/2026	3.682.000	0,04	EUR 5.825.000	RCI Banque SA RegS FRN 8/7/2020	5.841.893	0,06
EUR 200.000	BNP Paribas SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	221.012	0,00	EUR 8.300.000	RCI Banque SA RegS FRN 12/4/2021	8.355.983	0,08
USD 2.400.000	BNP Paribas SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	2.170.537	0,02	EUR 8.900.000	RCI Banque SA RegS 0,25% 12/7/2021	8.891.100	0,09
EUR 3.000.000	BPCE SA RegS 1,125% 18/1/2023	3.018.180	0,03	EUR 8.150.000	RCI Banque SA RegS FRN 14/3/2022	8.184.638	0,08
EUR 15.000.000	BPCE SA RegS 1,375% 23/3/2026	14.643.000	0,15	EUR 13.000.000	RCI Banque SA RegS FRN 12/3/2025	12.851.150	0,13
GBP 7.600.000	Caisse des Depots et Consignations RegS 1,00% 25/1/2021	8.671.622	0,09	EUR 300.000	RCI Banque SA RegS 1,625% 26/5/2026	301.458	0,00
EUR 33.400.000	Caisse Francaise de Financement Local RegS 1,00% 25/4/2028	33.681.896	0,34	EUR 1.370.000	Renault SA RegS 3,625% 19/9/2018	1.385.392	0,01
EUR 2.000.000	Capgemini SE RegS 1,75% 1/7/2020	2.069.420	0,02	EUR 5.000.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR RegS 2,125% 20/9/2019	5.145.750	0,05
EUR 2.365.000	Carrefour SA RegS 1,75% 22/5/2019	2.407.357	0,02				
EUR 10.400.000	Cars Alliance Auto Loans France V '2018-1 A' RegS FRN 21/10/2029	10.455.002	0,11				

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

+Une partie de ces titres ont été mis en gage ou donnés en garantie, pour plus d'informations voir les informations supplémentaires.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				Allemagne suite			
EUR 3.600.000	Safran SA RegS FRN 28/6/2019	3.605.760	0,04	EUR 500.000	Senvion Holding GmbH RegS 3,875% 25/10/2022	435.755	0,00
EUR 6.100.000	Safran SA RegS FRN 28/6/2021	6.127.633	0,06	EUR 4.597.000	Symrise AG RegS 1,75% 10/7/2019	4.681.953	0,05
EUR 19.199.039	SapphireOne Mortgages FCT '2016-3A' RegS FRN 27/6/2061	19.322.523	0,19	EUR 1.700.000	Unitymedia GmbH RegS 3,75% 15/1/2027	1.791.095	0,02
GBP 4.059.000	Societe Generale SA 5,00% 20/12/2018*	4.730.964	0,05	EUR 6.600.000	Volkswagen Bank GmbH RegS FRN 15/6/2021	6.592.212	0,07
EUR 13.400.000	Societe Generale SA RegS 0,50% 13/1/2023	13.083.090	0,13	EUR 8.100.000	Volkswagen Financial Services AG RegS 0,875% 12/4/2023	8.117.091	0,08
EUR 5.700.000	Societe Generale SA RegS FRN 23/2/2028	5.527.632	0,06			259.932.847	2,61
USD 8.835.000	Societe Generale SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	8.085.073	0,08	Grèce			
EUR 295.000	Total SA RegS FRN (Perpetual)	306.830	0,00	EUR 10.225.000	Alpha Bank AE RegS 2,50% 5/2/2023	10.189.724	0,10
EUR 5.200.000	Total SA RegS FRN (Perpetual)	5.455.840	0,06	EUR 62.923.000	Hellenic Republic Government Bond RegS '144A' 4,375% 1/8/2022	64.430.006	0,65
		793.480.053	7,97	EUR 4.179.920	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,50% 30/1/2023	4.119.938	0,04
Allemagne				EUR 140.151.000	Hellenic Republic Government Bond RegS '144A' 3,375% 15/2/2025	133.213.525	1,34
EUR 10.400.000	ADLER Real Estate AG RegS 1,50% 6/12/2021	10.417.420	0,10	EUR 2.130.101	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,75% 30/1/2028	1.993.775	0,02
EUR 500.000	ADLER Real Estate AG RegS 2,125% 6/2/2024	490.795	0,01	EUR 2.225.253	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,90% 30/1/2033	2.011.072	0,02
EUR 4.200.000	ADLER Real Estate AG RegS 3,00% 27/4/2026	4.164.384	0,04	EUR 5.174.013	Hellenic Republic Government Bond RegS 4,00% 30/1/2037	4.531.142	0,05
EUR 1.000.000	ADLER Real Estate AG RegS 2,50% 19/7/2021	162.300	0,00	EUR 1.740.741	Hellenic Republic Government Bond RegS 4,20% 30/1/2042	1.524.454	0,01
EUR 2.770.000	Bayer AG RegS RegS FRN 1/7/2075	2.866.368	0,03	EUR 27.740.000	National Bank of Greece SA RegS 2,75% 19/10/2020	28.235.298	0,28
EUR 7.800.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	7.972.068	0,08			250.248.934	2,51
EUR 800.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	803.416	0,01	Guernesey			
EUR 5.000.000	Commerzbank AG RegS 4,00% 23/3/2026	5.391.975	0,05	USD 4.400.000	EFG International Guernsey Ltd RegS FRN 5/4/2027	3.739.483	0,04
EUR 6.065.000	Commerzbank AG RegS 4,00% 30/3/2027*	6.516.843	0,07			3.739.483	0,04
EUR 2.700.000	Continental AG RegS 5/2/2020 (Zero Coupon)	2.705.049	0,03	Hong Kong			
EUR 2.121.000	Daimler AG 2,125% 27/6/2018	2.124.584	0,02	USD 2.680.000	Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN (Perpetual)	1.721.397	0,02
EUR 11.900.000	Deutsche Bank AG 1,00% 18/3/2019	11.972.947	0,12			1.721.397	0,02
EUR 1.300.000	Deutsche Bank AG 4,50% 19/5/2026*	1.314.950	0,01	Islande			
EUR 34.100.000	Deutsche Bank AG RegS 0,375% 18/1/2021	33.622.600	0,34	EUR 8.675.000	Iceland Government International Bond RegS 0,50% 20/12/2022	8.773.505	0,09
EUR 800.000	Deutsche Bank AG RegS 1,25% 8/9/2021	803.696	0,01	EUR 9.875.000	Islandsbanki HF RegS FRN 19/1/2024	9.851.300	0,10
EUR 25.900.000	Deutsche Bank AG RegS 1,75% 17/1/2028	23.701.608	0,24	EUR 13.695.000	Landsbankinn HF RegS 1,00% 30/5/2023	13.652.545	0,13
USD 4.950.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 1/12/2032	3.663.082	0,04			32.277.350	0,32
EUR 2.400.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	2.290.560	0,02	Indonésie			
EUR 3.356.000	Henkel AG & Co KGaA RegS 13/9/2018 (Zero Coupon)	3.356.604	0,03	EUR 5.925.000	Indonesia Government International Bond 1,75% 24/4/2025	5.933.147	0,06
EUR 11.000.000	IHO Verwaltungs GmbH RegS (Pay-in-kind) 2,75% 15/9/2021	11.198.990	0,11	IDR 120.000.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,125% 15/5/2028	6.982.195	0,07
EUR 5.705.000	IHO Verwaltungs GmbH RegS (Pay-in-kind) 3,75% 15/9/2026	5.950.600	0,06			12.915.342	0,13
EUR 11.400.000	IKB Deutsche Industriebank AG RegS FRN 31/1/2028	11.350.752	0,11	Irlande			
EUR 58.177.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125% 24/2/2023	58.611.000	0,59	EUR 3.850.000	AIB Group Plc RegS 1,50% 29/3/2023	3.817.236	0,04
GBP 15.700.000	NRW Bank RegS 1,00% 15/6/2022	17.817.291	0,18	EUR 400.000	Allied Irish Banks Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	437.348	0,00
EUR 5.333.453	Red & Black Auto Germany 5 UG haftungsbeschränkt 'A' RegS FRN 15/1/2027	5.365.045	0,05				
EUR 3.675.000	SAP SE RegS FRN 20/11/2018	3.679.814	0,04				

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Irlande suite				Italie suite			
EUR 100.000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co '14X ER' RegS FRN 12/1/2031	100.535	0,00	EUR 8.300.000	Driver Italia One SRL 'A' RegS FRN 21/4/2029	8.314.294	0,08
EUR 100.000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co '14X FR' RegS FRN 12/1/2031	98.512	0,00	EUR 1.500.000	Driver Italia One SRL 'B' RegS FRN 21/4/2029	1.499.583	0,02
EUR 275.000	Avoca Clo XIV Designated Activity Co '14X SUB' RegS FRN 12/1/2031	224.154	0,00	GBP 1.500.000	Enel SpA RegS 5,75% 22/6/2037	2.143.195	0,02
EUR 500.000	Avoca CLO XV DAC '15X FR' RegS FRN 15/4/2031	468.288	0,01	EUR 350.000	Enel SpA RegS FRN 24/11/2078	335.927	0,00
GBP 1.650.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 19/9/2027	1.853.976	0,02	EUR 16.161.000	Enel SpA RegS FRN 24/11/2081*	15.487.248	0,16
USD 2.825.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 19/9/2027	2.315.342	0,02	EUR 9.155.000	Hera SpA 4,50% 3/12/2019	9.753.829	0,10
EUR 200.000	Bank of Ireland RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	215.776	0,00	USD 9.925.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3,375% 12/1/2023	7.970.566	0,08
SEK 65.580.000	Bluestep Mortgage Securities No 4 DAC 'B' RegS FRN 10/8/2066	6.394.225	0,06	EUR 1.050.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,125% 14/1/2020	1.057.324	0,01
SEK 4.443.573	Bluestep Mortgage Securities No2 Ltd 'AB' RegS FRN 10/11/2055	435.822	0,00	EUR 6.575.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 0,875% 27/6/2022*	6.429.561	0,06
EUR 250.000	CVC Cordatus Loan Fund DAC '6X' RegS FRN 15/4/2032	182.516	0,00	EUR 15.660.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,75% 20/3/2028	14.295.231	0,14
EUR 950.000	CVC Cordatus Loan Fund Ltd '5X XR' RegS FRN 21/7/2030	951.214	0,01	EUR 8.525.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)*	8.929.937	0,09
EUR 77.001.000	Ireland Government Bond RegS 18/10/2022 (Zero Coupon)	77.146.532	0,78	EUR 3.000.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)*	3.323.550	0,03
EUR 173.541.217	Ireland Government Bond RegS 0,90% 15/5/2028	172.775.900	1,74	EUR 6.600.000	Iren SpA RegS 1,50% 24/10/2027*	6.226.275	0,06
EUR 291.762.000	Ireland Government Bond RegS 1,30% 15/5/2033	286.624.071	2,88	EUR 9.275.000	Italgas SpA RegS 0,50% 19/1/2022	9.226.909	0,09
EUR 26.454.897	Ireland Government Bond RegS 1,70% 15/5/2037	26.992.725	0,27	EUR 1.488.440	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,70% 15/9/2018	1.504.693	0,02
EUR 950.000	OCP Euro CLO 2017-2 DAC 'A' RegS FRN 15/1/2032	952.096	0,01	EUR 49.557.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,35% 1/11/2021	47.594.543	0,48
EUR 2.455.441	SCF Rahoituspalvelut Kimi VI DAC '6 A' RegS FRN 25/11/2026	2.463.181	0,03	EUR 352.365.736	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 23/4/2020	357.298.856	3,59
GBP 670.000	Small Business Origination Loan Trust '2018-1A' DAC RegS FRN 15/12/2026	765.354	0,01	EUR 49.158.714	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,25% 27/10/2020*	49.570.664	0,50
GBP 265.000	Small Business Origination Loan Trust '2018-1B' DAC RegS FRN 15/12/2026	302.720	0,00	EUR 48.006.989	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 1,30% 15/5/2028	45.895.642	0,46
GBP 2.973.000	Taurus Dac '2017-UK2 A' RegS FRN 17/11/2027	3.408.805	0,03	EUR 127.753.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 2,95% 1/9/2038	122.586.669	1,23
GBP 2.652.000	Taurus Dac '2017-UK2 B' RegS FRN 17/11/2027	3.045.894	0,03	EUR 4.925.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,125% 17/6/2019	4.984.371	0,05
GBP 1.246.000	Taurus Dac '2017-UK2 C' RegS FRN 17/11/2027	1.431.491	0,02	EUR 7.450.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 0,75% 17/2/2020	7.453.725	0,08
GBP 300.000	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC RegS 5,50% 15/9/2024	340.155	0,00	EUR 18.617.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA RegS 1,25% 24/11/2029	17.803.530	0,18
		593.743.868	5,96	EUR 276.000	Nexi Capital SpA RegS 4,125% 1/11/2023	269.108	0,00
Italie				EUR 760.000	Sisal Group SpA RegS 7,00% 31/7/2023	769.500	0,01
EUR 78.901	Asset-Backed European Securitisation Transaction Ten Srl 'A' RegS FRN 10/12/2028	78.916	0,00	EUR 17.432.068	Sunrise SPV '2017-1 A1' RegS FRN 27/4/2041	17.457.455	0,18
EUR 2.400.000	Assicurazioni Generali SpA RegS 4,125% 4/5/2026*	2.570.940	0,03	EUR 450.000	Taurus '2018-IT1 B' SRL FRN 18/5/2030	450.858	0,00
EUR 2.800.000	Assicurazioni Generali SpA RegS FRN 12/12/2042	3.378.564	0,03	EUR 2.090.000	Taurus SRL '2018-IT1 A' FRN 18/5/2030	2.093.553	0,02
EUR 1.613.000	Atlantia SpA 3,625% 30/11/2018	1.642.695	0,02	EUR 6.900.000	Telecom Italia SpA/Milano 5,25% 17/3/2055	7.447.791	0,07
EUR 900.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS 2,875% 16/4/2021	961.047	0,01	EUR 2.700.000	Telecom Italia SpA/Milano RegS 1,125% 26/3/2022	2.577.123	0,03
EUR 1.650.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS FRN 18/1/2028*	1.403.308	0,01	EUR 20.711.000	UniCredit SpA RegS FRN 28/10/2025	22.127.632	0,22
EUR 5.465.000	BPER Banca RegS 3,375% 22/10/2018	5.540.554	0,06	EUR 200.000	UniCredit SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	204.086	0,00
EUR 18.355.000	Buzzi Unicem SpA RegS 2,125% 28/4/2023	18.818.739	0,19	EUR 4.115.000	UniCredit SpA RegS FRN (Perpetual)	4.649.950	0,05
				EUR 5.000.000	UniCredit SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)*	4.534.900	0,05
				EUR 5.000.000	UniCredit SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	5.060.450	0,05

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Italie suite				Luxembourg suite			
USD 700.000	Wind Tre SpA '144A' 5,00% 20/1/2026	481.377	0,00	EUR 656.914	Compartment VCL 23 'A' RegS FRN 21/1/2022	657.819	0,01
EUR 425.000	Wind Tre SpA RegS 3,125% 20/1/2025	355.649	0,00	EUR 2.743.394	Compartment VCL 24 'A' RegS FRN 21/8/2022	2.747.340	0,03
		852.560.317	8,56	EUR 2.600.082	Compartment VCL 24 'B' RegS FRN 21/8/2022	2.605.408	0,03
Japon				EUR 4.301.686	Compartment VCL 25 'A' RegS FRN 21/9/2023	4.313.559	0,04
EUR 100.000	SoftBank Group Corp RegS 3,125% 19/9/2025	93.609	0,00	EUR 2.600.000	Compartment VCL 25 'B' RegS FRN 21/9/2023	2.601.729	0,03
EUR 200.000	SoftBank Group Corp RegS 4,00% 19/9/2029	180.442	0,00	EUR 94.859.000	European Financial Stability Facility RegS 0,40% 17/2/2025	94.953.859	0,95
		274.051	0,00	EUR 41.626.000	European Financial Stability Facility RegS 0,875% 26/7/2027	42.197.941	0,42
Jersey				EUR 44.600.000	European Financial Stability Facility RegS 1,375% 31/5/2047*	42.587.202	0,43
GBP 19.967.000	AA Bond Co Ltd RegS 2,75% 31/7/2023	21.894.554	0,22	EUR 7.900.000	GELF Bond Issuer I SA RegS 1,625% 20/10/2026	7.899.368	0,08
EUR 500.000	Adient Global Holdings Ltd RegS 3,50% 15/8/2024	489.550	0,01	EUR 14.350.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA RegS 1,75% 24/4/2028	14.199.397	0,14
GBP 900.000	British Land White 2015 Ltd RegS 9/6/2020 (Zero Coupon)	989.394	0,01	EUR 3.475.000	Prologis International Funding II SA RegS 1,75% 15/3/2028	3.485.807	0,04
GBP 4.515.000	CPUK Finance Ltd RegS 4,25% 28/8/2022	5.194.562	0,05	EUR 13.325.000	Richemont International Holding SA RegS 1,50% 26/3/2030	13.453.120	0,14
GBP 200.000	Enterprise Funding Ltd RegS 3,50% 10/9/2020	228.177	0,00	EUR 6.725.000	SES SA RegS 1,625% 22/3/2026*	6.729.842	0,07
EUR 7.000.000	Glencore Finance Europe Ltd RegS 1,25% 17/3/2021	7.154.070	0,07	EUR 11.405.000	SES SA RegS FRN (Perpetual)*	11.887.318	0,12
EUR 9.475.000	Glencore Finance Europe Ltd RegS 1,75% 17/3/2025*	9.550.374	0,10	GBP 757.931	Silver Arrow Compartment Silver Arrow UK '2017-1 A' RegS FRN 20/7/2023	864.440	0,01
USD 400.000	HBOS Capital Funding LP RegS 6,85% (Perpetual)	347.710	0,00			334.645.557	3,36
EUR 637.000	LHC3 Plc RegS (Pay-in-kind) 4,125% 15/8/2024	645.759	0,01	Macédoine			
USD 200.000	Tullow Oil Jersey Ltd RegS 6,625% 12/7/2021	225.368	0,00	EUR 5.000.000	Macedonia Government International Bond RegS 2,75% 18/1/2025*	4.906.025	0,05
		46.719.518	0,47			4.906.025	0,05
Luxembourg				Mexique			
EUR 16.502.000	Allergan Funding SCS 1,25% 1/6/2024	16.142.504	0,16	EUR 3.300.000	America Movil SAB de CV 1,00% 4/6/2018	3.301.650	0,04
USD 1.700.000	Altice Financing SA '144A' 7,50% 15/5/2026	1.414.729	0,01	EUR 22.225.000	Petroleos Mexicanos RegS 3,625% 24/11/2025	21.992.860	0,22
EUR 410.000	Altice Finco SA RegS 4,75% 15/1/2028	354.138	0,00	EUR 7.950.000	Petroleos Mexicanos RegS 4,75% 26/2/2029	8.045.082	0,08
USD 200.000	Altice Luxembourg SA '144A' 7,75% 15/5/2022	165.644	0,00			33.339.592	0,34
EUR 600.000	Aroundtown SA RegS 1,50% 18/1/2021	785.349	0,01	Monténégro			
EUR 4.300.000	BL Consumer Issuance Platform SA Compartment BL Cards '2018-1A' RegS FRN 25/3/2034	4.322.669	0,04	EUR 14.275.000	Montenegro Government International Bond RegS 3,375% 21/4/2025	14.075.364	0,14
GBP 330.000	Cabot Financial Luxembourg SA RegS 7,50% 1/10/2023	395.293	0,00			14.075.364	0,14
USD 780.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA '144A' 7,625% 1/11/2021	638.253	0,01	Pays-Bas			
GBP 3.563.847	Compartment Driver UK '3A' RegS FRN 25/1/2024	4.066.991	0,04	EUR 20.675.000	ABN AMRO Bank NV RegS 0,875% 22/4/2025	20.702.188	0,21
GBP 7.100.000	Compartment Driver UK Five 'B' RegS FRN 25/7/2025	8.099.293	0,08	EUR 3.400.000	ABN AMRO Bank NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	3.621.000	0,04
GBP 4.364.708	Compartment Driver UK Four 'A' RegS FRN 25/3/2025	4.983.275	0,05	EUR 1.000.000	ABN AMRO Bank NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	971.700	0,01
GBP 5.843.327	Compartment Driver UK Four 'B' RegS FRN 25/3/2025	6.691.280	0,07	EUR 6.950.000	Achmea Bank NV RegS 0,875% 17/9/2018	6.972.518	0,07
GBP 12.281.641	Compartment Driver UK Six 'A' RegS FRN 25/2/2026	14.005.029	0,14	USD 4.500.000	AT Securities BV RegS FRN (Perpetual)	3.656.544	0,04
EUR 8.270.784	Compartment VCL '26A' RegS FRN 21/2/2024	8.295.786	0,08	EUR 500.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV RegS 3,75% 15/1/2025	520.020	0,01
EUR 13.100.000	Compartment VCL '26B' RegS FRN 21/2/2024	13.101.175	0,13				

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

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Pays-Bas suite			
GBP 26.300.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV RegS 1,00% 17/6/2022	29.839.298	0,30	EUR 460.000	Petrobras Global Finance BV 4,75% 14/1/2025	484.208	0,00
EUR 18.075.000	BMW Finance NV RegS 0,50% 22/11/2022	18.147.661	0,18	USD 43.160.000	Petrobras Global Finance BV 5,75% 1/2/2029	33.351.177	0,34
EUR 1.000.000	Brenntag Finance BV RegS 5,50% 19/7/2018	1.006.930	0,01	EUR 8.575.000	RELX Finance BV RegS 0,375% 22/3/2021	8.635.282	0,09
EUR 4.600.000	Bumper 9 NL Finance BV 'A' RegS FRN 22/7/2031	4.611.053	0,05	EUR 2.500.000	Roche Finance Europe BV RegS 2,00% 25/6/2018	2.503.175	0,03
GBP 1.280.000	Cable & Wireless International Finance BV RegS 8,625% 25/3/2019	1.530.499	0,02	EUR 5.100.000	Shell International Finance BV RegS 1,25% 12/5/2028	5.142.100	0,05
EUR 400.000	Capital Stage Finance BV RegS FRN (Perpetual)	436.356	0,00	EUR 1.800.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	1.998.432	0,02
EUR 330.000	Constellium NV RegS 4,25% 15/2/2026	329.155	0,00	EUR 2.000.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	2.032.500	0,02
EUR 7.000.000	CRH Finance BV RegS 5,00% 25/1/2019	7.235.830	0,07	EUR 4.000.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)*	4.125.540	0,04
EUR 16.925.000	Daimler International Finance BV RegS 0,25% 11/5/2022*	16.880.318	0,17	EUR 17.400.000	Telefonica Europe BV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)*	16.689.036	0,17
EUR 11.350.000	Daimler International Finance BV RegS 1,00% 11/11/2025	11.277.133	0,11	EUR 6.000.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	5.782.410	0,06
EUR 14.425.000	de Volksbank NV RegS 0,125% 28/9/2020	14.457.673	0,15	EUR 9.200.000	TenneT Holding BV RegS FRN (Perpetual)	9.252.808	0,09
GBP 4.555.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 2,25% 13/4/2029	4.995.012	0,05	EUR 5.100.000	Unilever NV RegS 29/4/2020 (Zero Coupon)	5.115.402	0,05
EUR 12.720.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 2,00% 1/12/2029	13.003.274	0,13	EUR 1.010.000	United Group BV RegS 4,875% 1/7/2024	1.036.462	0,01
EUR 3.225.000	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG RegS FRN 29/9/2047	3.290.242	0,03	EUR 890.000	UPC Holding BV RegS 3,875% 15/6/2029	848.312	0,01
EUR 2.000.000	Enel Finance International NV 5,75% 24/10/2018	2.045.910	0,02	EUR 1.700.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN 30/3/2019	1.701.955	0,02
USD 7.600.000	Enel Finance International NV RegS 3,50% 6/4/2028	5.861.762	0,06	EUR 12.300.000	Volkswagen International Finance NV RegS 0,50% 30/3/2021	12.395.386	0,12
EUR 16.925.000	Ferrari NV RegS 0,25% 16/1/2021	16.839.359	0,17	EUR 3.300.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	3.324.321	0,03
EUR 1.120.000	Globaldrive Auto Receivables BV '2016-B B' RegS FRN 20/8/2024	1.125.945	0,01	EUR 500.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	504.768	0,01
EUR 7.236.000	Goodyear Dunlop Tires Europe BV RegS 3,75% 15/12/2023*	7.452.971	0,07	EUR 18.600.000	Vonovia Finance BV RegS FRN 22/12/2022	18.564.474	0,19
EUR 1.096.000	Hertz Holdings Netherlands BV RegS 5,50% 30/3/2023	1.083.747	0,01	EUR 10.400.000	Vonovia Finance BV RegS 1,50% 22/3/2026	10.372.024	0,10
EUR 830.518	Highway BV '2015-1 A' RegS FRN 26/5/2025	830.920	0,01	EUR 6.500.000	Vonovia Finance BV RegS 1,50% 14/1/2028	6.286.865	0,06
EUR 4.000.000	Iberdrola International BV RegS 3,50% 1/2/2021	4.358.380	0,04	EUR 200.000	Ziggo Bond Finance BV RegS 4,625% 15/1/2025	201.125	0,00
USD 3.300.000	ING Groep NV RegS FRN 22/3/2028	2.822.880	0,03	EUR 100.000	Ziggo BV RegS 4,25% 15/1/2027	100.450	0,00
GBP 10.381.000	innogy Finance BV RegS 6,25% 3/6/2030	15.673.106	0,16			410.291.327	4,12
EUR 1.000.000	Koninklijke DSM NV RegS 1,75% 13/11/2019	1.023.995	0,01	Nouvelle-Zélande			
EUR 9.900.000	Koninklijke KPN NV RegS FRN (Perpetual)	10.065.033	0,10	EUR 10.000.000	Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023	10.135.700	0,10
EUR 1.700.000	LeasePlan Corp NV RegS 1,00% 8/4/2020	1.731.042	0,02	NZD 46.861.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,50% 20/9/2040	31.407.796	0,32
EUR 2.300.000	Louis Dreyfus Co BV RegS 3,875% 30/7/2018	2.309.775	0,02			41.543.496	0,42
EUR 7.125.000	NN Group NV RegS 0,25% 1/6/2020	7.161.052	0,07	Norvège			
EUR 4.875.000	NN Group NV RegS 0,875% 13/1/2023	4.966.504	0,05	USD 600.000	Aker BP ASA '144A' 5,875% 31/3/2025	530.404	0,01
EUR 5.910.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	6.505.580	0,07	GBP 12.149.000	Kommunalbanken AS RegS 1,125% 30/11/2022	13.839.660	0,14
EUR 300.000	NN Group NV RegS FRN (Perpetual)	317.525	0,00	NOK 520.335.000	Norway Government Bond RegS '144A' 1,75% 17/2/2027	54.938.666	0,55
EUR 4.175.000	PACCAR Financial Europe BV RegS 0,125% 24/5/2019*	4.183.225	0,04	NOK 315.625.000	Norway Government Bond RegS '144A' 2,00% 26/4/2028	33.865.755	0,34
				EUR 3.800.000	Santander Consumer Bank AS RegS 0,375% 17/2/2020	3.819.589	0,04
						106.994.074	1,08

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

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Portugal				Espagne suite			
EUR 6.500.000	Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria SA RegS 0,875% 17/10/2022	6.552.325	0,07	EUR 3.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA RegS FRN (Perpetual)*	3.405.060	0,03
EUR 9.400.000	EDP - Energias de Portugal SA RegS FRN 16/9/2075	10.283.318	0,10	EUR 9.100.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 5/3/2023	8.895.978	0,09
USD 130.971.000	Portugal Government International Bond RegS 5,125% 15/10/2024*	115.442.029	1,16	EUR 3.800.000	Banco de Sabadell SA RegS 5,625% 6/5/2026	4.385.884	0,04
EUR 36.727.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 3,85% 15/4/2021*	40.671.847	0,41	EUR 4.300.000	Banco Santander SA RegS 1,125% 17/1/2025	4.155.821	0,04
EUR 96.133.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 2,125% 17/10/2028*	97.631.713	0,98	EUR 3.000.000	Banco Santander SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	2.795.010	0,03
EUR 65.884.375	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 2,25% 18/4/2034	63.772.122	0,64	EUR 600.000	Banco Santander SA RegS FRN (Perpetual)	652.830	0,01
EUR 1.600.000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Via Ulisses Finance No. 1 'A' RegS FRN 20/3/2033	1.607.573	0,02	EUR 3.600.000	Bankia SA RegS 1,125% 5/8/2022	3.722.796	0,04
EUR 500.000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Via Ulisses Finance No. 1 'B' RegS FRN 20/3/2033	510.628	0,01	EUR 20.400.000	Bankia SA RegS FRN 22/5/2024	20.954.676	0,21
EUR 800.000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Via Ulisses Finance No. 1 'C' RegS FRN 20/3/2033	838.303	0,01	EUR 4.600.000	Bankia SA RegS FRN 15/3/2027	4.735.010	0,05
EUR 15.064.463	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Via Volta IV 2,423% 12/2/2021	15.446.474	0,15	EUR 1.000.000	Bankia SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	1.020.160	0,01
EUR 46.080.056	Volta Electricity Receivables RegS 0,85% 12/2/2022	46.309.917	0,46	EUR 1.900.000	Bankinter SA RegS 0,625% 9/10/2020	1.928.861	0,02
		399.066.249	4,01	EUR 100.000	CaixaBank SA RegS FRN 14/7/2028	99.935	0,00
Qatar				EUR 800.000	CaixaBank SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	740.128	0,01
USD 8.648.000	Qatar Government International Bond RegS 4,50% 23/4/2028	7.468.613	0,07	EUR 4.400.000	CaixaBank SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	4.723.972	0,05
USD 11.285.000	Qatar Government International Bond RegS 5,103% 23/4/2048	9.679.399	0,10	EUR 2.000.000	Cajamar Caja Rural SCC 3,75% 22/11/2018	2.035.840	0,02
		17.148.012	0,17	EUR 7.567.390	Driver Espana Five FDT '5A' RegS FRN 21/12/2028	7.585.881	0,08
Russie				EUR 9.109.690	Driver Espana Four FT 'A' RegS FRN 21/4/2028	9.128.903	0,09
USD 7.600.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 5,25% 23/6/2047	6.212.937	0,06	EUR 600.000	Driver Espana Four FT 'B' RegS FRN 21/4/2028	603.231	0,01
		6.212.937	0,06	EUR 2.468.115	Driver Espana Three FT 'A' RegS FRN 21/12/2026	2.484.715	0,02
Arabie Saoudite				EUR 4.625.000	NorteGas Energia Distribucion SAU RegS 0,918% 28/9/2022	4.644.703	0,05
USD 11.915.000	Saudi Government International Bond RegS 4,00% 17/4/2025	10.187.808	0,10	EUR 5.025.000	NorteGas Energia Distribucion SAU RegS 2,065% 28/9/2027	5.000.629	0,05
USD 28.385.000	Saudi Government International Bond RegS 5,00% 17/4/2049	23.630.831	0,24	EUR 3.000.000	Santander Consumer Finance SA RegS 1,10% 30/7/2018	3.005.490	0,03
		33.818.639	0,34	EUR 6.700.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,90% 18/2/2020	6.789.177	0,07
Singapour				EUR 4.900.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,50% 4/10/2021	4.905.439	0,05
EUR 20.000.000	DBS Group Holdings Ltd RegS FRN 11/4/2028	19.981.900	0,20	EUR 5.000.000	Spain Government Bond 1,40% 31/1/2020	5.124.600	0,05
		19.981.900	0,20	EUR 69.820.000	Spain Government Bond 0,05% 31/1/2021	69.785.788	0,70
Afrique du Sud				EUR 35.315.000	Spain Government Bond 0,75% 30/7/2021	36.036.662	0,36
ZAR 573.649.151	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048	36.364.388	0,37	EUR 49.555.000	Spain Government Bond 0,45% 31/10/2022	49.654.606	0,50
		36.364.388	0,37	EUR 96.050.000	Spain Government Bond RegS '144A' 4,40% 31/10/2023	115.030.441	1,15
Espagne				EUR 46.288.000	Spain Government Bond RegS '144A' 1,95% 30/4/2026	48.887.997	0,49
EUR 6.200.000	Amadeus Capital Markets SAU RegS 19/5/2019 (Zero Coupon)	6.206.076	0,06	EUR 48.582.000	Spain Government Bond RegS '144A' 2,70% 31/10/2048	49.663.435	0,50
EUR 2.700.000	Amadeus Capital Markets SAU RegS 0,125% 6/10/2020	2.708.964	0,03	EUR 197.146.003	Spain Government Inflation Linked Bond RegS '144A' 0,55% 30/11/2019	203.271.329	2,04
EUR 4.924.218	Auto ABS Spanish Loans FT '2016-1 A' RegS FRN 31/12/2032	4.940.406	0,05	EUR 300.000	SRF Fondo de Titulizacion '2017-1D' RegS FRN 26/4/2063	301.172	0,00
				GBP 3.500.000	Telefonica Emisiones SAU RegS 5,375% 2/2/2026	4.693.898	0,05
				EUR 4.300.000	Wizink Master Credit Cards FT 2017-3 'A' FRN 26/12/2031	4.310.070	0,04
						709.015.573	7,12

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Sri Lanka				Suisse suite			
USD 22.420.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,75% 18/4/2023	19.050.996	0,19	USD 200.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	155.165	0,00
USD 29.600.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 6,75% 18/4/2028	25.217.108	0,26	EUR 5.218.000	Zuercher Kantonalbank RegS FRN 15/6/2027	5.408.927	0,05
		44.268.104	0,45			136.069.761	1,37
Supranational				Royaume-Uni			
GBP 30.499.000	Council Of Europe Development Bank RegS 0,625% 15/6/2022	34.179.213	0,34	GBP 600.000	Ardonagh Midco 3 Plc RegS 8,375% 15/7/2023	711.630	0,01
GBP 30.420.000	European Investment Bank RegS 0,875% 15/12/2023*	33.900.494	0,34	GBP 6.440.000	Aviva Plc RegS FRN 14/11/2036	8.376.716	0,08
EUR 47.890.000	European Investment Bank RegS 0,875% 14/1/2028	48.627.745	0,49	USD 5.875.000	Barclays Plc FRN 16/5/2029	5.036.318	0,05
EUR 60.000.000	European Stability Mechanism RegS 18/10/2022 (Zero Coupon)	60.108.600	0,61	GBP 12.760.000	Barclays Plc 3,25% 17/1/2033	13.710.485	0,14
		176.816.052	1,78	EUR 3.200.000	Barclays Plc FRN (Contingent Convertible Bond) (Perpetual)*	3.578.976	0,04
Suède				EUR 8.335.000	Barclays Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	8.649.938	0,09
EUR 5.300.000	Atlas Copco AB RegS 2,625% 15/3/2019	5.418.773	0,05	GBP 3.000.000	Barclays Plc RegS FRN 6/10/2023	3.385.086	0,03
EUR 5.825.000	Essity AB RegS 27/11/2018 (Zero Coupon)	5.830.126	0,06	GBP 10.400.000	Barclays Plc RegS 3,125% 17/1/2024	11.916.205	0,12
SEK 325.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS 1,50% 21/12/2022	32.996.356	0,33	GBP 3.585.000	Barclays Plc RegS 3,25% 12/2/2027	4.033.460	0,04
SEK 310.000.000	Stadshypotek AB 4,50% 21/9/2022	35.342.285	0,36	EUR 12.212.000	Barclays Plc RegS FRN 7/2/2028	11.814.377	0,12
SEK 222.000.000	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB RegS 1,00% 21/6/2023	21.948.361	0,22	EUR 2.600.000	BAT International Finance Plc RegS 0,875% 13/10/2023*	2.594.124	0,03
SEK 137.600.000	Swedbank Hypotek AB RegS 1,00% 16/12/2020	13.756.931	0,14	GBP 6.607.000	BAT International Finance Plc RegS 4,00% 4/9/2026	8.275.352	0,08
SEK 145.800.000	Swedbank Hypotek AB RegS 1,00% 15/6/2022	14.543.196	0,15	EUR 6.747.000	BAT International Finance Plc RegS 2,25% 16/1/2030	6.752.094	0,07
EUR 1.270.000	Volvo Car AB RegS 2,00% 24/1/2025	1.265.783	0,01	GBP 5.900.000	BAT International Finance Plc RegS 6,00% 24/11/2034	9.105.510	0,09
SEK 137.000.000	Volvo Treasury AB RegS FRN 24/8/2018	13.344.884	0,13	GBP 6.510.000	Bavarian Sky UK 1 Plc 'A' RegS FRN 20/11/2025	7.419.172	0,07
		144.446.695	1,45	EUR 5.450.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,117% 25/1/2024	5.584.479	0,06
Suisse				EUR 5.122.000	BP Capital Markets Plc RegS 1,953% 3/3/2025	5.453.086	0,05
USD 5.590.000	Credit Suisse AG RegS 6,50% 8/8/2023	5.143.532	0,05	GBP 4.351.500	Brass No 6 Plc 'A' RegS FRN 16/12/2060	4.964.463	0,05
EUR 5.300.000	Credit Suisse AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN 18/9/2025	5.837.579	0,06	GBP 16.230.000	British Telecommunications Plc RegS 5,75% 7/12/2028	22.973.555	0,23
EUR 8.875.000	Credit Suisse AG/Guernsey RegS 0,75% 17/9/2021	9.088.000	0,09	GBP 13.935.000	British Telecommunications Plc RegS 3,125% 21/11/2031	15.553.056	0,16
EUR 11.625.000	Credit Suisse AG/London RegS 0,625% 20/11/2018	11.673.999	0,12	GBP 291.668	Broadgate Financing Plc RegS FRN 5/1/2020	330.649	0,00
EUR 10.000.000	Credit Suisse AG/London RegS 1,125% 15/9/2020	10.246.900	0,10	GBP 77.000	Broadgate Financing Plc RegS FRN 5/10/2023	87.156	0,00
EUR 16.000.000	Credit Suisse Group AG RegS FRN 17/7/2025	15.712.160	0,16	GBP 10.069.287	Bumper 8 UK Finance Plc 'A' RegS FRN 20/11/2027	11.493.756	0,12
USD 3.500.000	Credit Suisse Group AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	3.155.724	0,03	GBP 2.300.000	Bumper 8 UK Finance Plc 'B' RegS FRN 20/11/2027	2.626.432	0,03
EUR 23.363.000	UBS AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN 12/2/2026	25.478.052	0,26	GBP 5.812.000	BUPA Finance Plc RegS 5,00% 8/12/2026	7.305.564	0,07
EUR 9.725.000	UBS AG/London RegS 0,125% 5/11/2021	9.679.925	0,10	GBP 300.000	Canary Wharf Finance II Plc 'C2' RegS FRN 22/10/2037	303.493	0,00
EUR 17.100.000	UBS AG/London RegS 0,25% 10/1/2022	17.026.470	0,17	GBP 2.051.000	Canary Wharf Finance II Plc 'D2' RegS FRN 22/10/2037	2.093.771	0,02
EUR 12.250.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS FRN 20/9/2022	12.276.092	0,12	GBP 1.300.000	Care UK Health & Social Care Plc RegS FRN 15/7/2019	1.480.627	0,02
EUR 400.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	436.644	0,01	GBP 3.836.581	Castell Plc '2017-1 A' RegS FRN 25/10/2044	4.392.556	0,04
USD 5.340.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	4.750.592	0,05	GBP 929.064	Castell Plc '2017-1 X' RegS FRN 25/10/2044	1.060.208	0,01
				GBP 8.698.000	Centrica Plc RegS 4,375% 13/3/2029	11.383.382	0,11
				GBP 4.695.000	Centrica Plc RegS 7,00% 19/9/2033	7.833.642	0,08
				EUR 10.570.000	Centrica Plc RegS FRN 10/4/2076	10.841.860	0,11
				EUR 3.450.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	3.534.163	0,04
				EUR 5.125.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	5.399.188	0,05
				GBP 1.625.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	1.853.231	0,02

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
GBP 4.915.490	Charter Mortgage Funding Plc '2017-1 A' FRN 12/6/2054	5.614.463	0,06	GBP 1.600.000	GKN Holdings Plc RegS 4,625% 12/5/2032	1.895.655	0,02
GBP 3.229.000	Crh Finance UK Plc RegS 4,125% 2/12/2029	4.151.621	0,04	EUR 5.625.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,25% 21/5/2026	5.704.875	0,06
GBP 9.568.000	Delamare Cards MTN Issuer Plc '2017-1 A1' FRN 19/10/2022	10.930.986	0,11	EUR 10.141.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,75% 21/5/2030	10.382.204	0,10
EUR 2.625.000	Diageo Finance Plc RegS 17/11/2020 (Zero Coupon)	2.629.633	0,03	GBP 12.334.281	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2016-AA' RegS FRN 20/9/2024	14.074.596	0,14
GBP 1.091.533	Dignity Finance Plc RegS 3,546% 31/12/2034	1.336.979	0,01	GBP 5.660.000	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2017-A B' RegS FRN 20/6/2025	6.437.313	0,06
GBP 260.000	Dignity Finance Plc RegS 4,696% 31/12/2049	298.482	0,00	GBP 10.750.000	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2018-AA' RegS FRN 20/6/2026	12.277.801	0,12
GBP 5.235.000	DS Smith Plc RegS 2,875% 26/7/2029	5.828.735	0,06	GBP 3.470.000	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2018-A B' RegS FRN 20/6/2026	3.957.799	0,04
GBP 1.331.355	Duncan Funding Plc '2015-1 A1' RegS FRN 17/12/2062	1.528.577	0,02	GBP 3.170.000	Gosforth Funding Plc '2014-1 A2' RegS FRN 19/10/2056	3.627.718	0,04
GBP 5.995.753	Duncan Funding Plc '2016-1X A1B' RegS FRN 17/4/2063	6.875.814	0,07	GBP 1.302.664	Gosforth Funding Plc '2015-1 A1' RegS FRN 16/6/2057	1.486.731	0,02
GBP 30.777	E-CARAT 5 Plc 'A' RegS FRN 18/4/2023	35.115	0,00	EUR 3.500.000	Gosforth Funding Plc '2016-1X A2A' RegS FRN 15/2/2058	3.516.022	0,04
GBP 610.000	E-Carat 5 Plc 'B' RegS FRN 18/4/2023	696.318	0,01	EUR 3.081.499	Gosforth Funding Plc '2016-2X A1A' RegS FRN 24/7/2058	3.087.438	0,03
GBP 713.866	E-Carat 6 Plc 'A' RegS FRN 18/6/2024	815.847	0,01	GBP 5.000.000	Gosforth Funding Plc '2017-1X A2' RegS FRN 19/12/2059	5.724.760	0,06
GBP 10.436.747	E-Carat 8 Plc 'A' RegS FRN 18/3/2024	11.900.542	0,12	GBP 3.147.429	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	3.613.094	0,04
GBP 12.782.000	E-CARAT 8 Plc 'B' RegS FRN 8/3/2024	14.583.060	0,15	GBP 1.063.946	Greene King Finance Plc RegS 4,064% 15/3/2035	1.309.852	0,01
GBP 4.051.800	E-CARAT 9 Plc 'A' RegS FRN 18/1/2025	4.616.355	0,05	GBP 5.277.115	Hawksmoor Mortgages Plc '2016-1 A' RegS FRN 25/5/2053	6.076.485	0,06
GBP 150.000	EI Group Plc RegS 6,875% 15/2/2021	187.256	0,00	GBP 3.320.000	Holmes Master Issuer Plc '2018-1X A3' RegS FRN 15/10/2054	3.783.323	0,04
GBP 4.800.000	EI Group Plc RegS 6,00% 6/10/2023	5.974.002	0,06	USD 9.470.000	HSBC Holdings Plc FRN 18/5/2024	8.114.107	0,08
GBP 1.330.503	Eurosail Plc '2006-1X A2C' RegS FRN 10/6/2044	1.509.384	0,02	GBP 2.600.000	HSBC Holdings Plc 5,75% 20/12/2027	3.501.179	0,04
GBP 1.975.212	Eurosail-UK Plc '2007-4X A3' RegS FRN 13/6/2045	2.259.454	0,02	USD 5.180.000	HSBC Holdings Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	4.462.453	0,04
EUR 1.400.000	FCE Bank Plc RegS 1,875% 18/4/2019	1.424.003	0,01	GBP 20.155.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2026	22.297.766	0,22
GBP 4.170.027	Feldspar Plc '2016-1 A' RegS FRN 15/9/2045	4.785.204	0,05	EUR 200.000	HSBC Holdings Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	212.957	0,00
GBP 1.030.000	Finsbury Square '2018-1B' Plc RegS FRN 12/9/2065	1.176.430	0,01	EUR 3.200.000	Imperial Brands Finance Plc RegS 4,50% 5/7/2018	3.212.704	0,03
GBP 963.000	Finsbury Square '2018-1C' Plc RegS FRN 12/9/2065	1.100.190	0,01	EUR 3.625.000	Imperial Brands Finance Plc RegS 0,50% 27/7/2021	3.646.170	0,04
GBP 659.000	Finsbury Square '2018-1D' Plc RegS FRN 12/9/2065	753.266	0,01	EUR 8.365.000	Imperial Brands Finance Plc RegS 1,375% 27/1/2025	8.361.068	0,08
GBP 3.902.953	Finsbury Square Plc '2016-2 A' RegS FRN 16/8/2058	4.474.868	0,05	GBP 3.300.000	J Sainsbury Plc RegS 1,25% 21/11/2019	4.174.838	0,04
GBP 1.060.580	Finsbury Square Plc '2017-1 A' RegS FRN 12/3/2059	1.213.132	0,01	GBP 821.000	Jerrold Finco Plc RegS 6,125% 15/1/2024	946.509	0,01
GBP 409.991	Finsbury Square Plc '2017-1 B' RegS FRN 12/3/2059	472.078	0,00	GBP 721.573	Kenrick No 2 Plc 'A' RegS FRN 18/4/2049	823.837	0,01
GBP 805.982	Finsbury Square Plc '2017-1 C' RegS FRN 12/3/2059	931.223	0,01	GBP 6.740.193	Kenrick No 3 Plc 'A' FRN 11/10/2054	7.680.945	0,08
GBP 6.098.750	Finsbury Square Plc '2017-2 A' RegS FRN 12/9/2065	6.974.116	0,07	EUR 1.995.400	Kensington Mortgage Securities Plc '2007-1X A3B' RegS FRN 14/6/2040	1.976.391	0,02
GBP 6.530.000	Finsbury Square Plc '2018-1 A' RegS FRN 12/9/2065	7.462.729	0,08	EUR 2.097.450	Lanark Master Issuer Plc '2014-2X 1A' RegS FRN 22/12/2054	2.098.729	0,02
GBP 2.911.612	Friary No 4 Plc 'A' RegS FRN 21/1/2050	3.321.665	0,03	GBP 449.000	Lanark Master Issuer Plc '2015-1X 1A' RegS FRN 22/12/2054	512.958	0,01
EUR 10.225.000	G4S International Finance Plc RegS 1,875% 24/5/2025	10.314.367	0,10	GBP 6.800.000	Lanark Master Issuer Plc '2017-1X 1A' RegS FRN 22/12/2069	7.764.161	0,08
GBP 79.890	Gemgarto Plc '2015-1 A' RegS FRN 16/2/2047	91.262	0,00	GBP 8.200.000	Lanark Master Issuer Plc '2017-1X 2A' RegS FRN 22/12/2069	9.397.993	0,09
GBP 124.789	Gemgarto Plc '2015-2 A' RegS FRN 16/2/2054	142.843	0,00	GBP 7.500.000	Lanark Master Issuer Plc '2018-1X 2A' RegS FRN 22/12/2069	8.550.223	0,09
GBP 275.000	Gemgarto Plc '2015-2 B' RegS FRN 16/2/2054	320.756	0,00	GBP 20.517.000	LCR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028	29.780.425	0,30

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
USD 3.700.000	Lloyds Banking Group Plc 4,344% 9/1/2048	2.804.598	0,03	GBP 455.890	Paragon Mortgages No 23 Plc 'A2' RegS FRN 15/1/2043	521.572	0,01
EUR 15.225.000	Lloyds Banking Group Plc RegS FRN 15/1/2024	14.811.641	0,15	GBP 555.000	Paragon Mortgages No 23 Plc 'C' RegS FRN 15/1/2043	640.703	0,01
GBP 5.475.000	Lloyds Banking Group Plc RegS 2,25% 16/10/2024	6.110.727	0,06	GBP 565.386	Paragon Mortgages No 24 Plc 'A2' RegS FRN 15/7/2043	647.723	0,01
EUR 975.000	Lloyds Banking Group Plc RegS 1,50% 12/9/2027	940.017	0,01	EUR 1.024.735	Paragon Mortgages No 25 Plc '12X A2B' RegS FRN 15/11/2038	993.654	0,01
EUR 519.296	Ludgate Funding Plc '2007-1 BB' RegS FRN 1/1/2061	473.731	0,00	GBP 770.000	Paragon Mortgages No 25 Plc '1C' RegS FRN 15/5/2050	880.347	0,01
EUR 432.746	Ludgate Funding Plc '2007-1 MB' RegS FRN 1/1/2061	402.124	0,00	GBP 8.390.000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'A' RegS FRN 15/5/2050	9.572.882	0,10
GBP 367.923	Marketplace Originated Consumer Assets Plc '2016-1 A' RegS FRN 20/10/2024	420.439	0,00	GBP 975.000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'B' RegS FRN 15/5/2050	1.115.742	0,01
GBP 476.000	Marketplace Originated Consumer Assets Plc '2017-1 B' RegS FRN 20/12/2027	544.447	0,01	GBP 332.000	PCL Funding 'C' RegS FRN 15/6/2023	378.496	0,00
GBP 426.000	Marketplace Originated Consumer Assets Plc '2017-1 C' RegS FRN 20/12/2027	488.041	0,01	GBP 11.275.000	PCL Funding II Plc '2017-1 A' RegS FRN 15/6/2022	12.924.309	0,13
GBP 1.115.000	Marks & Spencer Plc RegS 3,00% 8/12/2023	1.301.470	0,01	GBP 7.462.000	PCL Funding III Plc '2017-2 A' RegS FRN 15/6/2023	8.532.936	0,09
GBP 390.000	Mclaren Finance Plc RegS 5,00% 1/8/2022	441.407	0,00	GBP 745.000	PCL Funding III Plc 'B' RegS FRN 15/6/2023	848.080	0,01
GBP 2.080.000	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS 6,469% 15/9/2030	2.779.158	0,03	GBP 5.305.000	Penarth Master Issuer Plc '2018-1X 1A' RegS FRN 18/3/2025	6.048.300	0,06
GBP 955.000	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/9/2034	903.237	0,01	GBP 817.000	Pennon Group Plc RegS FRN (Perpetual)	932.926	0,01
GBP 1.165.000	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/6/2036	1.065.071	0,01	GBP 32.242	Precise Mortgage Funding No 1 Plc 'A' RegS FRN 12/3/2047	36.869	0,00
EUR 18.100.000	Mondi Finance Plc RegS 1,625% 27/4/2026	18.222.899	0,18	GBP 146.414	Premiertel Plc 6,175% 8/5/2032	192.078	0,00
GBP 1.710.000	Motor Plc '2016-1 C' RegS 3,75% 25/11/2025	1.979.659	0,02	GBP 8.065.000	Prs Finance Plc RegS 1,75% 24/11/2026	9.324.933	0,09
GBP 343.000	Motor Plc '2016-1 D' RegS 4,25% 25/11/2025	395.565	0,00	GBP 897.413	Residential Mortgage Securities 25 Plc 'A1' RegS FRN 16/12/2050	1.033.811	0,01
GBP 285.000	Motor Plc '2016-1 E' RegS 5,25% 25/11/2025	329.227	0,00	GBP 78.312	Residential Mortgage Securities 26 Plc 'A1' RegS FRN 14/2/2041	91.337	0,00
GBP 1.741.000	Motor Plc '2017-1X A2' RegS FRN 25/9/2024	1.985.662	0,02	GBP 3.758.594	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'A' RegS FRN 20/12/2046	4.319.312	0,04
USD 1.200.000	National Westminster Bank Plc FRN (Perpetual)	842.364	0,01	GBP 2.570.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'B' RegS FRN 20/12/2046	2.972.024	0,03
EUR 42.250.000	Natwest Markets Plc RegS 0,625% 2/3/2022	42.206.905	0,42	GBP 695.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'C' RegS FRN 20/12/2046	803.929	0,01
USD 725.000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6,625% 15/5/2025	619.127	0,01	GBP 4.408.608	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'A' RegS FRN 20/3/2050	5.045.856	0,05
GBP 6.400.000	Newday Funding Plc '2017-1 A' RegS FRN 15/7/2025	7.311.441	0,07	GBP 2.350.000	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'B' RegS FRN 20/3/2050	2.702.878	0,03
GBP 1.390.000	Newday Funding Plc '2017-1 B' RegS FRN 15/7/2025	1.590.592	0,02	GBP 460.000	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'C' RegS FRN 20/3/2050	532.097	0,01
GBP 1.900.000	Newday Funding Plc '2017-1 C' RegS FRN 15/7/2025	2.188.271	0,02	GBP 10.066.032	Ripon Mortgages Plc '1X A1' RegS FRN 20/8/2056	11.545.493	0,12
GBP 2.100.000	Newday Funding Plc '2017-1 D' RegS FRN 15/7/2025	2.412.085	0,02	GBP 22.810.000	Ripon Mortgages Plc '1X B1' RegS FRN 20/8/2056	26.284.300	0,26
GBP 6.800.000	Newday Partnership Funding Plc '2017-1 A' RegS FRN 15/12/2027	7.787.608	0,08	GBP 485.000	Ripon Mortgages Plc '1X B2' RegS FRN 20/8/2056	559.797	0,01
EUR 452.823	Newgate Funding Plc '2006-1 BB' RegS FRN 1/12/2050	430.750	0,00	GBP 15.000.000	Ripon Mortgages Plc '1X C1' RegS FRN 20/8/2056	17.288.341	0,17
GBP 28.439.533	Oat Hill No 1 Plc 'A' RegS FRN 25/2/2046	32.424.208	0,33	EUR 3.101.266	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS1X M1C' RegS FRN 12/6/2044	2.977.215	0,03
EUR 11.030.000	Paragon Mortgages No 10 Plc '10X A2B' RegS FRN 15/6/2041	10.765.591	0,11	EUR 225.000	Rolls-Royce Plc RegS 0,875% 9/5/2024	223.394	0,00
USD 2.932.805	Paragon Mortgages No 13 Plc '144A' FRN 15/1/2039	2.416.729	0,02	EUR 175.000	Rolls-Royce Plc RegS 1,625% 9/5/2028	174.840	0,00
USD 51.492	Paragon Mortgages No 13 Plc '13X A2C' RegS FRN 15/1/2039	42.431	0,00	USD 2.100.000	Royal Bank of Scotland Group Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	1.951.037	0,02
EUR 1.955.945	Paragon Mortgages No 22 Plc '1A' RegS FRN 15/9/2042	1.956.581	0,02	USD 3.500.000	Royal Bank of Scotland Group Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	3.254.402	0,03
EUR 445.921	Paragon Mortgages No 23 Plc 'A1' RegS FRN 15/1/2043	446.445	0,00	GBP 20.600.000	Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 8/5/2026	23.652.254	0,24

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
GBP 200.000	Santander UK Group Holdings Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	242.285	0,00	GBP 32.661.000	University of Oxford RegS 2,544% 8/12/2117	37.703.943	0,38
GBP 270.000	Shop Direct Funding Plc RegS 7,75% 15/11/2022	245.045	0,00	GBP 2.000.000	Vodafone Group Plc RegS 26/11/2020 (Zero Coupon)	2.193.348	0,02
GBP 1.768.000	Silverstone Master Issuer Plc '2015-1X 1A' RegS FRN 21/1/2070	2.017.900	0,02	GBP 17.868.173	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'A' RegS FRN 21/9/2049	20.510.346	0,21
GBP 9.435.000	Silverstone Master Issuer Plc '2018-1X 2A' RegS FRN 21/1/2070	10.748.937	0,11	GBP 5.172.763	Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc 'A' RegS FRN 21/9/2049	5.987.905	0,06
EUR 1.531.000	Sky Plc RegS 2,25% 17/11/2025	1.638.346	0,02	GBP 3.100.000	Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc 'C' RegS FRN 21/9/2049	3.579.147	0,04
EUR 580.000	Sky Plc RegS 2,50% 15/9/2026	626.565	0,01	GBP 12.055.000	Westfield Stratford City Finance Plc RegS FRN 4/11/2019	13.780.372	0,14
GBP 1.972.000	Spirit Issuer Plc RegS FRN 28/12/2031	2.220.045	0,02	EUR 8.000.000	WPP Finance 2013 RegS 0,75% 18/11/2019	8.091.120	0,08
GBP 6.418.000	SSE Plc RegS 5,00% 1/10/2018	7.414.997	0,07			1.243.544.548	12,49
EUR 8.182.000	SSE Plc RegS 2,00% 17/6/2020*	8.508.298	0,09	Etats-Unis			
GBP 3.383.000	SSE Plc RegS FRN (Perpetual)	3.947.780	0,04	USD 15.365.000	Amazon.com Inc RegS 3,15% 22/8/2027	12.725.834	0,13
GBP 822.923	Stanlington No 1 Plc '2017-1 A' RegS FRN 12/6/2046	947.475	0,01	EUR 400.000	American Tower Corp 1,95% 22/5/2026	403.722	0,00
GBP 180.000	Stanlington No 1 Plc '2017-1E' RegS FRN 12/6/2046	216.797	0,00	EUR 4.000.000	Amgen Inc RegS 4,375% 5/12/2018	4.092.300	0,04
GBP 1.975.000	Stonegate Pub Co Financing Plc RegS FRN 15/3/2022	2.244.378	0,02	USD 5.040.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3,50% 12/1/2024	4.327.202	0,04
GBP 250.000	Telereal Securitisation Plc FRN 10/12/2031	242.151	0,00	EUR 700.000	AT&T Inc 3,15% 4/9/2036	711.078	0,01
GBP 3.000	Tesco Plc 5,50% 13/1/2033	4.062	0,00	EUR 9.000.000	Bank of America Corp RegS FRN 26/7/2019	9.042.165	0,09
GBP 200.000	Tesco Plc RegS 5,00% 24/3/2023	254.772	0,00	EUR 11.850.000	Bank of America Corp RegS FRN 21/9/2021	11.831.810	0,12
GBP 545.061	Tesco Property Finance 1 Plc RegS 7,623% 13/7/2039	845.960	0,01	EUR 15.250.000	Bank of America Corp RegS FRN 7/2/2022	15.355.682	0,15
GBP 1.012.038	Tesco Property Finance 3 Plc RegS 5,744% 13/4/2040	1.359.689	0,01	EUR 2.275.000	Bank of America Corp RegS FRN 4/5/2023	2.281.962	0,02
GBP 587.867	Tesco Property Finance 4 Plc RegS 5,801% 13/10/2040	793.132	0,01	EUR 11.825.000	BAT Capital Corp RegS FRN 16/8/2021	11.836.116	0,12
GBP 7.545.000	Tolkien Funding Sukuk No 1 Plc 'A' FRN 20/7/2052	8.629.591	0,09	EUR 2.971.000	BAT Capital Corp RegS 1,125% 16/11/2023	2.994.902	0,03
GBP 11.714.166	Towd Point Mortgage Funding Auburn 11 Plc '2017-A11X A1' RegS FRN 20/5/2045	13.410.006	0,13	USD 20.000.000	BAT Capital Corp RegS 3,557% 15/8/2027	16.208.893	0,16
GBP 1.310.000	Tower Bridge Funding No.1 Plc 'A' RegS FRN 20/3/2056	1.500.977	0,02	EUR 10.200.000	Becton Dickinson and Co 0,368% 6/6/2019	10.234.986	0,10
GBP 200.000	Trinity Square Plc '2015-1X B' RegS FRN 15/7/2051	230.738	0,00	EUR 365.000	Chemours Co/The 4,00% 15/5/2026	362.025	0,00
GBP 4.838.589	Turbo Finance 5 Plc 'B' RegS FRN 20/8/2021	5.521.804	0,06	EUR 3.475.000	Chubb INA Holdings Inc 2,50% 15/3/2038	3.513.607	0,03
GBP 1.584.229	Turbo Finance 6 Plc 'A' RegS FRN 20/2/2023	1.810.683	0,02	EUR 12.850.000	Coca-Cola Co/The FRN 8/3/2019	12.878.013	0,13
GBP 15.000.000	Turbo Finance 6 Plc 'B' RegS FRN 20/2/2023	17.199.361	0,17	USD 7.279.000	CRH America Finance Inc RegS 3,95% 4/4/2028	6.055.351	0,06
GBP 382.368	Turbo Finance 7 Plc 'A1' RegS FRN 20/6/2023	436.660	0,00	EUR 1.500.000	Federal-Mogul LLC Via Federal-Mogul Financing Corp RegS 5,00% 15/7/2024	1.565.250	0,02
GBP 405.000	Turbo Finance 7 Plc 'B' RegS FRN 20/6/2023	465.800	0,00	EUR 2.775.000	FedEx Corp 0,50% 9/4/2020	2.802.223	0,03
GBP 16.259.000	Unique Pub Finance Co Plc /The RegS 6,542% 30/3/2021	19.593.406	0,20	EUR 8.625.000	General Electric Co FRN 28/5/2020	8.637.463	0,09
GBP 1.387.068	Unique Pub Finance Co Plc/The 5,659% 30/6/2027	1.753.027	0,02	USD 1.825.000	General Mills Inc 4,20% 17/4/2028	1.548.072	0,02
GBP 272.000	Unique Pub Finance Co Plc/The RegS 7,395% 28/3/2024	344.549	0,00	USD 10.455.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 15/5/2026	8.916.113	0,09
GBP 5.977.000	Unique Pub Finance Co Plc/The RegS 6,464% 30/3/2032	6.682.677	0,07	EUR 1.900.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS FRN 31/12/2018	1.903.439	0,02
GBP 19.110.404	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 10/8/2048	36.264.711	0,36	EUR 11.825.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS FRN 29/4/2019	11.879.040	0,12
GBP 19.821.000	United Kingdom Gilt RegS 4,75% 7/12/2030	31.108.185	0,31	EUR 24.475.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS 0,75% 10/5/2019	24.667.006	0,25
GBP 28.225.000	United Kingdom Gilt RegS 4,50% 7/9/2034	45.470.668	0,46	EUR 16.150.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS FRN 16/12/2020	16.150.646	0,16
GBP 12.365.000	United Kingdom Gilt RegS 1,625% 22/10/2071	14.803.201	0,15				

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

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Irlande suite			
EUR 9.500.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS FRN 27/7/2021	9.652.665	0,10	EUR 1.083.992	Taurus Ltd '2015-DE2 A' RegS FRN 1/2/2026**	1.086.648	0,01
EUR 23.075.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS FRN 9/9/2022	23.052.386	0,23	EUR 986.000	Taurus Ltd '2015-DE2 D' RegS FRN 1/2/2026**	990.174	0,01
USD 13.105.000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2029	11.171.956	0,11	EUR 1.366.000	Taurus Ltd '2015-DE2 E' RegS FRN 1/2/2026**	1.372.010	0,01
EUR 11.240.000	Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027*	11.389.717	0,11			4.578.681	0,05
USD 7.890.000	McDonald's Corp 3,80% 1/4/2028	6.816.480	0,07	Norvège			
EUR 8.800.000	McDonald's Corp RegS 0,50% 15/1/2021	8.914.928	0,09	USD 3.205.000	Norske Skogindustrier ASA (Defaulted) '144A' 7,125% 15/10/2033**	62.683	0,00
EUR 20.500.000	Morgan Stanley FRN 3/12/2019	20.533.517	0,21			62.683	0,00
EUR 19.100.000	Morgan Stanley FRN 9/11/2021	19.044.037	0,19	Espagne			
EUR 14.800.000	Morgan Stanley FRN 27/1/2022	14.858.312	0,15	EUR 1.800.000	Driver Espana Five FDT '5B' RegS FRN 21/12/2028	1.801.467	0,02
EUR 16.808.000	PVH Corp RegS 3,125% 15/12/2027	16.583.781	0,17	EUR 200.000	SRF Fondo de Titulizacion '2017-1C' RegS FRN 26/4/2063**	200.950	0,00
EUR 4.000.000	SES GLOBAL Americas Holdings GP RegS 1,875% 24/10/2018	4.030.920	0,04	EUR 6.394.786	SRF Fondo de Titulizacion 2017-1 'A' FRN 26/4/2063**	6.434.753	0,06
EUR 5.075.000	Thermo Fisher Scientific Inc FRN 24/7/2019	5.083.425	0,05	EUR 800.000	SRF Fondo de Titulizacion 2017-1 'B' FRN 26/4/2063**	800.200	0,01
EUR 3.200.000	Thermo Fisher Scientific Inc 1,40% 23/1/2026	3.199.952	0,03			9.237.370	0,09
USD 169.861.476	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2022*	142.969.170	1,44	Royaume-Uni			
USD 48.305.014	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/4/2023	41.382.099	0,42	GBP 4.867.708	Marketplace Originated Consumer Assets Plc '2017-1 A' RegS FRN 20/12/2027**	5.556.263	0,05
USD 340.327.422	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,50% 15/1/2028*	285.030.284	2,86	GBP 15.400.000	Motor Plc '2016-1 A' RegS 1,30% 25/11/2025**	17.507.492	0,18
		826.638.529	8,30			23.063.755	0,23
Total des obligations		8.703.228.235	87,43	Total des obligations		36.942.489	0,37
EXCHANGE TRADED FUNDS¹				Total des autres valeurs mobilières and Money Market Instruments		36.942.489	0,37
Irlande				Organismes de placement collectif¹			
254.912	iShares Core Euro Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	32.990.711	0,33	Irlande			
223.679	iShares Euro Corporate Bond 1-5yr UCITS ETF (Dist)	24.642.715	0,25	9.587.967	Institutional Cash Series Plc - Institutional Euro Assets Liquidity Fund Agency Dis	9.587.967	0,09
62.500	iShares JP Morgan \$ Emerging Markets Bond UCITS ETF (Dist)	5.752.481	0,06	392.222.751	Institutional Cash Series Plc - Institutional Euro Liquidity Fund Agency Dis	392.222.751	3,94
		63.385.907	0,64			401.810.718	4,03
Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		63.385.907	0,64	Total des organismes de placement collectif		401.810.718	4,03
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		8.766.614.142	88,07	Portefeuille de titres à la valeur de marché		9.205.367.349	92,47
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				Autres éléments de l'actif net		750.090.164	7,53
OBLIGATIONS				Total de l'actif net (EUR)		9.955.457.513	100,00
Irlande							
EUR 531.956	Taurus Dac '2016-DE2 C' RegS FRN 3/1/2027**	547.649	0,01				
EUR 563.874	Taurus Dac '2016-DE2 D' RegS FRN 3/1/2027**	582.200	0,01				

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

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCCD	EUR 44.300.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2022	(389.469)	695.885
CCCD	EUR 8.000.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2022	(96.341)	89.435
CCCD	EUR 6.880.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 28 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2022	(29.073)	124.175
CCCD	EUR 56.548.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	988.532	(5.019.169)
CCCD	EUR 247.298.500	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	1.154.996	(3.890.243)
CCCD	EUR 17.400.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Sub Financials Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	507.681	693.710
CCCD	EUR 168.546.806	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 29 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(1.864.760)	1.354.353
CCIL	EUR 54.140.000	Fund receives Fixed 1,410% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2023	(232.663)	(231.847)
CCIL	GBP 81.766.886	Fund receives Fixed 3,273% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2023	944	2.531
CCIL	EUR 40.400.000	Fund receives Fixed 1,588% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(61.037)	(60.116)
CCIL	GBP 10.639.000	Fund receives Fixed 3,370% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2028	77.497	77.771
CCIL	EUR 49.573.750	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(347.038)	(345.908)
CCIL	EUR 24.510.000	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(171.581)	(171.022)
CCIL	EUR 24.505.000	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(171.546)	(170.987)
CCIL	EUR 49.568.750	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(347.003)	(345.873)
CCIL	EUR 49.571.250	Fund receives Fixed 1,592% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(107.770)	(106.640)
CCIL	EUR 49.571.250	Fund receives Fixed 1,598% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(81.128)	(79.998)
CCIL	EUR 46.599.000	Fund receives Fixed 1,598% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(76.264)	(75.201)
CCIR	CHF 272.549.301	Fund receives Fixed 0,358% and pays Floating CHF 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/3/2020	418.920	420.839
CCIR	CHF 168.485.000	Fund receives Fixed 0,320% and pays Floating CHF 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/3/2021	514.497	515.901
CCIR	USD 629.000.000	Fund receives Fixed 3,044% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2022	1.573.517	1.580.229
CCIR	USD 628.892.038	Fund receives Fixed 3,063% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2022	1.767.488	1.774.198
CCIR	EUR 115.950.000	Fund receives Fixed 0,413% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2022	466.561	551.248
CCIR	USD 139.010.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,088%	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2022	(772.372)	(717.560)
CCIR	EUR 436.680.000	Fund receives Fixed 0,395% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2022	1.778.642	1.827.436
CCIR	USD 550.820.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,101%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2022	(3.089.127)	(3.011.828)
CCIR	EUR 440.020.000	Fund receives Fixed 0,408% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/5/2022	1.244.138	1.979.509
CCIR	USD 556.860.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,108%	Bank of America Merrill Lynch	28/5/2022	(2.460.806)	(3.138.868)
CCIR	EUR 321.380.000	Fund receives Fixed 0,222% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2022	(384.203)	(380.009)
CCIR	USD 390.150.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,896%	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2022	(192.190)	(187.794)
CCIR	GBP 26.641.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,078%	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2022	87.606	87.997
CCIR	EUR 396.445.814	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,430%	Bank of America Merrill Lynch	7/10/2022	(4.151.192)	(4.146.018)
CCIR	GBP 12.128.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,161%	Bank of America Merrill Lynch	30/11/2022	16.650	17.270
CCIR	EUR 110.401.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,412%	Bank of America Merrill Lynch	24/2/2023	(863.068)	(861.627)
CCIR	PLN 95.920.000	Fund receives Fixed 2,426% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	40.336	40.663
CCIR	PLN 145.380.000	Fund receives Fixed 2,592% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	323.886	324.373

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	JPY 20.900.000.000	Fund receives Fixed 0,142% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	66.264	68.576
CCIRS	JPY 20.900.000.000	Fund receives Fixed 0,143% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	72.052	74.364
CCIRS	JPY 7.952.000.000	Fund receives Fixed 0,158% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	73.986	74.850
CCIRS	GBP 13.000.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,424%	Bank of America Merrill Lynch	8/12/2023	(133.027)	(132.528)
CCIRS	USD 5.603.200	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,872%	Bank of America Merrill Lynch	2/12/2024	(13.210)	(13.145)
CCIRS	USD 262.100.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,057%	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2025	(1.623.513)	(1.619.784)
CCIRS	USD 262.269.494	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,078%	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2025	(1.834.898)	(1.831.167)
CCIRS	CAD 71.300.000	Fund receives Floating CAD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,712%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(485.412)	(484.516)
CCIRS	CAD 42.781.828	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,821%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(516.976)	(516.433)
CCIRS	EUR 208.134.052	Fund receives Fixed 1,047% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2027	4.917.406	4.921.403
CCIRS	USD 28.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,972%	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2027	(217.381)	(216.931)
CCIRS	EUR 55.880.000	Fund receives Fixed 0,835% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/8/2027	(123.644)	(122.571)
CCIRS	EUR 42.644.000	Fund receives Fixed 1,380% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2027	(175.039)	(174.220)
CCIRS	EUR 39.635.000	Fund receives Fixed 1,586% and pays Floating EUR 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/1/2028	(65.129)	(64.368)
CCIRS	EUR 22.482.500	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,953%	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(181.831)	(181.399)
CCIRS	EUR 22.482.500	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,956%	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(188.217)	(187.785)
CCIRS	CHF 27.254.657	Fund receives Fixed 0,454% and pays Floating CHF 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2028	192.489	192.936
CCIRS	EUR 23.785.882	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,032%	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2028	(337.883)	(337.426)
CCIRS	CHF 27.254.657	Fund receives Fixed 0,422% and pays Floating CHF 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/3/2028	113.593	114.040
CCIRS	EUR 23.785.883	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,994%	Bank of America Merrill Lynch	27/3/2028	(246.697)	(246.241)
CCIRS	USD 12.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,860%	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2028	14.351	14.546
CCIRS	USD 14.143.511	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,871%	Bank of America Merrill Lynch	23/4/2028	6.913	7.133
CCIRS	USD 5.340.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,974%	Bank of America Merrill Lynch	3/5/2028	(38.858)	(38.772)
CCIRS	USD 1.903.567	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,018%	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2028	(20.046)	(20.015)
CCIRS	NZD 18.937.500	Fund receives Floating NZD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,215%	Bank of America Merrill Lynch	18/5/2028	(114.444)	(114.231)
CCIRS	NZD 22.093.750	Fund receives Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate and pays Fixed 3,219%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2028	(137.807)	(137.557)
CCIRS	NZD 22.093.750	Fund receives Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate and pays Fixed 3,220%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2028	(139.017)	(138.767)
CCIRS	ZAR 212.070.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,710%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	261.542	261.826
CCIRS	ZAR 391.360.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,765%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	381.650	382.193
CCIRS	ZAR 212.100.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,790%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	181.963	182.254
CCIRS	JPY 6.089.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,340%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(66.409)	(65.468)
CCIRS	JPY 10.491.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,340%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(114.409)	(112.789)
CCIRS	JPY 850.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,341%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(9.778)	(9.647)
CCIRS	JPY 10.491.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,341%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(120.611)	(118.991)
CCIRS	JPY 4.097.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,357%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(99.561)	(98.940)
CCIRS	JPY 508.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,362%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(14.347)	(14.270)

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	JPY 6.455.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,364%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(189.944)	(188.952)
CCIRS	SEK 419.310.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 1,368%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(536.324)	(535.523)
CCIRS	SEK 730.830.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 1,372%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(969.727)	(968.292)
CCIRS	EUR 23.305.500	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,935%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2037	119.558	120.338
CCIRS	GBP 34.689.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,827%	Bank of America Merrill Lynch	2/5/2038	(267.034)	(266.027)
CCIRS	EUR 21.420.000	Fund receives Fixed 1,502% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	220.164	220.940
CCIRS	EUR 12.600.000	Fund receives Fixed 1,522% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	183.092	183.548
CCIRS	EUR 8.272.000	Fund receives Fixed 1,529% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	132.514	132.813
CCIRS	EUR 14.000.000	Fund receives Fixed 1,562% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	322.511	323.018
CCIRS	EUR 35.270.000	Fund receives Fixed 1,583% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	966.988	968.265
CCIRS	EUR 21.390.000	Fund receives Fixed 1,617% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	752.062	752.836
CCIRS	EUR 22.010.000	Fund receives Fixed 1,644% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	900.341	901.138
CCIRS	JPY 490.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,951%	Bank of America Merrill Lynch	22/2/2048	(95.071)	(94.931)
CCIRS	GBP 11.123.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,536%	Bank of America Merrill Lynch	27/3/2048	110.118	110.856
CCIRS	GBP 29.733.500	Fund receives Fixed 1,654% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2048	354.157	355.443
CCIRS	GBP 43.609.000	Fund receives Fixed 1,376% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2058	416.644	418.529
CCIRS	GBP 40.140.000	Fund receives Fixed 1,378% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2058	388.076	389.811
CCIRS	GBP 12.536.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,244%	Bank of America Merrill Lynch	18/12/2067	1.124.542	1.125.373
CCIRS	GBP 2.307.693	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,239%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2067	212.008	212.107
CDS	EUR 2.700.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 28 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2022	25.661	(48.731)
CDS	EUR 2.700.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 28 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2022	(33.682)	262.253
CDS	EUR 9.240.000	Fund receives default protection on BASF SE and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2021	16.667	(236.741)
CDS	EUR 9.240.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Air Liquide SA	Barclays Bank	20/6/2021	(19.870)	233.539
CDS	EUR 32.510.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 26 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2022	(283.683)	(665.993)
CDS	EUR 130.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/12/2022	10.872	3.589
CDS	EUR 6.370.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Centrica Plc	Barclays Bank	20/12/2022	(10.899)	61.180
CDS	EUR 240.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Deutsche Bank AG	Barclays Bank	20/12/2022	(4.969)	(4.799)
CDS	EUR 3.333.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on UniCredit SpA	Barclays Bank	20/12/2022	(133.448)	(70.105)
CDS	EUR 975.000	Fund receives default protection on Ardagh Packaging Finance Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	18.921	(117.086)
CDS	EUR 1.160.000	Fund receives default protection on ITV Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	(3.434)	(216.584)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Kingfisher Plc and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	584	(18.374)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Smurfit Kappa Group Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	941	(20.704)
CDS	EUR 104.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	1.677	4.279
CDS	EUR 209.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	2.491	8.600
CDS	EUR 130.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on SFR Group SA	Barclays Bank	20/6/2023	8.088	10.065
CDS	EUR 2.750.000	Fund receives default protection on Barclays Bank Plc and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2021	(196.079)	(11.791)
CDS	EUR 30.000.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	BNP Paribas	20/6/2022	(339.617)	471.254

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 510.000	Fund receives default protection on Cellnex Telecom SA and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/12/2022	14.206	(83.252)
CDS	EUR 400.000	Fund receives default protection on Unitymedia GmbH and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/12/2022	(2.898)	(77.254)
CDS	EUR 2.130.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Centrica Plc	BNP Paribas	20/12/2022	(2.608)	20.457
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Ziggo Finance BV and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2023	764	(14.180)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Ziggo Finance BV and pays Fixed 5,000%	BNP Paribas	20/6/2023	764	(14.180)
CDS	EUR 160.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA	BNP Paribas	20/6/2023	(3.214)	(17.110)
CDS	EUR 160.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA	BNP Paribas	20/6/2023	(3.214)	(17.110)
CDS	EUR 140.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Financing SA	BNP Paribas	20/6/2023	(659)	3.425
CDS	EUR 162.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc	BNP Paribas	20/6/2023	(3.896)	19.164
CDS	JPY 26.470.000	Fund receives default protection on SoftBank Group Corp and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	(4.063)	10.781
CDS	EUR 3.500.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 19 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2018	37.303	(1.451)
CDS	EUR 2.500.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Sub Financials Series 19 Version 1	Citibank	20/6/2018	(202.420)	5.910
CDS	EUR 3.500.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 20 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/12/2018	27.755	(14.609)
CDS	EUR 2.500.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Sub Financials Series 20 Version 1	Citibank	20/12/2018	(190.625)	59.607
CDS	USD 11.932.000	Fund receives default protection on General Motors Co and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/12/2020	399.927	(1.189.058)
CDS	EUR 240.000	Fund receives default protection on Constellium NV and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/12/2021	(683)	(27.940)
CDS	EUR 37.518.422	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	Citibank	20/6/2022	(308.971)	589.357
CDS	EUR 1.670.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 28 Version 1	Citibank	20/12/2022	(7.236)	30.141
CDS	EUR 130.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice Financing SA	Citibank	20/12/2022	(1.933)	4.880
CDS	EUR 60.000	Fund receives default protection on Altice Financing SA and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	606	(1.468)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	4.498	4.711
CDS	EUR 80.000	Fund receives default protection on Wind Tre SpA and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	2.313	2.313
CDS	EUR 50.000	Fund receives default protection on Wind Tre SpA and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	824	1.446
CDS	EUR 500.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on HEMA Bondco I BV	Citibank	20/6/2023	(10.860)	7.600
CDS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Ladbrokes Coral Group Plc	Citibank	20/6/2023	1.784	16.393
CDS	USD 1.170.000	Fund receives default protection on People's Republic of China and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	(5.013)	(20.956)
CDS	USD 1.150.000	Fund receives default protection on Republic of Korea and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	(5.188)	(26.472)
CDS	EUR 240.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Constellium NV	Citibank	20/12/2024	1.202	25.943
CDS	EUR 515.000	Fund receives default protection on Louis Dreyfus Commodities BV and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2019	39.293	(35.863)
CDS	EUR 1.610.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2020	7.128	25.111
CDS	EUR 1.075.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1	Credit Suisse	20/6/2020	6.065	16.767
CDS	EUR 4.925.000	Fund receives default protection on Volvo AB and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/12/2021	(72.939)	(106.438)
CDS	EUR 5.075.000	Fund receives default protection on Volvo AB and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/12/2021	(75.236)	(109.680)
CDS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum Justitia AB	Credit Suisse	20/12/2022	(8.313)	7.947
CDS	EUR 170.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Wind Acquisition Finance SA	Credit Suisse	20/12/2022	(2.351)	25.786
CDS	EUR 220.000	Fund receives default protection on Care UK Health and Social Care Plc and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	(5.491)	(41.303)

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 1.425.000	Fund receives default protection on Marks & Spencer Plc and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	3.047	36.903
CDS	EUR 210.000	Fund receives default protection on Stena AB and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	(218)	7.920
CDS	EUR 600.000	Fund receives default protection on Suedzucker AG and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	(440)	(1.064)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Wind Tre SpA and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	640	2.892
CDS	EUR 130.000	Fund receives default protection on Wind Tre SpA and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	6.312	3.759
CDS	EUR 270.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on ADLER Real Estate AG	Credit Suisse	20/6/2023	(5.050)	42.630
CDS	USD 1.300.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.30 and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	4.895	(70.425)
CDS	USD 1.300.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.30 and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	4.546	(70.425)
CDS	USD 7.800.000	Fund receives default protection on National Australia Bank Ltd and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/12/2020	(62.398)	(117.712)
CDS	EUR 14.925.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 26 Version 1	Deutsche Bank	20/12/2021	91.758	302.670
CDS	USD 400.000	Fund receives default protection on Republic of South Africa and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	(186)	11.210
CDS	EUR 2.000.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Scandinavian Airlines System	Goldman Sachs	20/6/2019	209.991	84.474
CDS	EUR 1.485.000	Fund receives default protection on Louis Dreyfus Commodities BV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2019	114.182	(103.412)
CDS	EUR 140.000	Fund receives default protection on Constellium NV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(563)	(13.947)
CDS	USD 7.077.915	Fund receives default protection on Australia & New Zealand Banking Group Ltd and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(25.212)	(62.646)
CDS	EUR 830.000	Fund receives default protection on Stena AB and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2021	6.796	(29.412)
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Constellium NV and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2021	1.478	(34.925)
CDS	EUR 600.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2022	10.239	18.687
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Commerzbank AG	Goldman Sachs	20/12/2022	(1.657)	(7.962)
CDS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Wind Acquisition Finance SA	Goldman Sachs	20/12/2022	(1.155)	15.168
CDS	EUR 275.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Wind Acquisition Finance SA	Goldman Sachs	20/12/2022	(3.177)	41.712
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Altice Financing SA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	1.850	(3.669)
CDS	EUR 2.690.000	Fund receives default protection on Cable & Wireless Limited and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	(15.961)	(439.816)
CDS	EUR 550.000	Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo SpA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	39.227	65.460
CDS	EUR 3.250.000	Fund receives default protection on J Sainsbury Plc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	7.795	17.437
CDS	EUR 50.000	Fund receives default protection on Societe Generale SA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	1.335	1.463
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	(1.512)	12.344
CDS	EUR 170.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA	Goldman Sachs	20/6/2023	(3.261)	(18.179)
CDS	EUR 270.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Deutsche Bank AG	Goldman Sachs	20/6/2023	(5.218)	(6.849)
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Altice NV	Goldman Sachs	20/6/2023	188	11.614
CDS	EUR 94.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc	Goldman Sachs	20/6/2023	(2.512)	11.120
CDS	EUR 50.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on United Group BV	Goldman Sachs	20/6/2023	(288)	5.616
CDS	JPY 48.960.000	Fund receives default protection on SoftBank Group Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	(6.911)	19.941
CDS	EUR 140.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Constellium NV	Goldman Sachs	20/12/2024	1.434	15.134
CDS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Constellium NV	Goldman Sachs	20/12/2024	(7.526)	32.429
CDS	EUR 6.103.000	Fund receives default protection on BNP Paribas and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	(9.178)	(140.369)
CDS	USD 722.085	Fund receives default protection on Australia & New Zealand Banking Group Ltd and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(8.990)	(10.887)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 7.700.000	Fund receives default protection on Commonwealth Bank of Australia and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(95.063)	(115.292)
CDS	USD 7.700.000	Fund receives default protection on Westpac Banking Corp and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(88.093)	(114.992)
CDS	EUR 640.000	Fund receives default protection on Sol Melia Europe BV and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2022	10.801	(118.403)
CDS	EUR 1.445.000	Fund receives default protection on STMicroelectronics NV and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2022	(23.922)	(32.042)
CDS	EUR 37.470.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	JP Morgan	20/6/2022	(310.026)	588.596
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Stena AB and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/12/2022	403	1.778
CDS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Alice Financing SA	JP Morgan	20/12/2022	(73)	3.754
CDS	EUR 80.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on SFR Group SA	JP Morgan	20/12/2022	3.969	6.588
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Vue International Bidco Plc	JP Morgan	20/12/2022	2.027	23.953
CDS	EUR 5.843.000	Fund receives default protection on Credit Agricole SA and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	(21.525)	(150.102)
CDS	EUR 650.000	Fund receives default protection on Deutsche Lufthansa AG and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	1.490	(7.570)
CDS	EUR 50.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking Group Plc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	166	1.590
CDS	EUR 250.000	Fund receives default protection on Suedzucker AG and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	2.503	(443)
CDS	EUR 270.000	Fund receives default protection on UPC Holding BV and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2023	1.419	(44.416)
CDS	EUR 170.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Casino Guichard Perrachon SA	JP Morgan	20/6/2023	(3.558)	(18.179)
CDS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on HEMA Bondco I BV	JP Morgan	20/6/2023	(3.984)	3.040
CDS	EUR 130.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on SFR Group SA	JP Morgan	20/6/2023	7.511	10.065
CDS	EUR 290.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2022	4.089	8.006
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2022	12.207	4.141
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on CMA CGM SA and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/12/2022	7.986	2.761
CDS	EUR 270.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Intrum Justitia AB	Morgan Stanley	20/12/2022	(22.873)	21.458
CDS	EUR 540.000	Fund receives default protection on Enel SpA and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	(3.229)	(1.906)
CDS	EUR 6.667.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on UniCredit SpA	Societe Generale	20/12/2022	(266.935)	(140.232)
ILS	GBP 144.449.000	Fund receives Floating GBP 3,580% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Barclays Bank	15/3/2022	2.265.231	2.265.231
ILS	GBP 27.791.000	Fund receives Fixed 3,395% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Barclays Bank	15/7/2022	186.697	186.697
ILS	EUR 45.869.000	Fund receives Fixed 1,412% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Barclays Bank	15/3/2027	(628.775)	(628.775)
ILS	GBP 66.490.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,552%	Barclays Bank	15/3/2027	(1.730.114)	(1.730.113)
ILS	GBP 12.777.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,355%	Barclays Bank	15/7/2027	(17.234)	(17.234)
ILS	EUR 139.110.000	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,172%	Citibank	15/7/2022	2.116.155	2.116.155
ILS	EUR 139.110.000	Fund receives Fixed 1,392% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Citibank	15/7/2027	(2.512.132)	(2.512.132)
ILS	GBP 48.896.000	Fund receives Fixed 3,440% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Citibank	15/7/2027	645.487	645.487
ILS	GBP 10.993.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,475%	Citibank	15/7/2047	(413.019)	(413.019)
ILS	EUR 135.259.000	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,210%	Goldman Sachs	15/7/2022	1.791.342	1.791.342
ILS	EUR 72.469.795	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,290%	Goldman Sachs	15/9/2022	828.083	828.083
ILS	EUR 135.259.000	Fund receives Fixed 1,405% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Goldman Sachs	15/7/2027	(2.261.547)	(2.261.547)
ILS	EUR 72.469.795	Fund receives Fixed 1,468% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Goldman Sachs	15/9/2027	(939.627)	(939.627)
ILS	GBP 59.585.000	Fund receives Fixed 3,408% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Goldman Sachs	15/11/2027	767.588	767.588

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
ILS	GBP 55.884.000	Fund receives Fixed 3,430% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Goldman Sachs	15/11/2027	894.735	894.735
ILS	USD 98.413.000	Fund receives Floating USD 12 Month USCPI and pays Fixed 2,152%	Goldman Sachs	30/11/2027	1.575.429	1.575.429
ILS	GBP 12.233.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,489%	Goldman Sachs	15/8/2047	(586.399)	(586.399)
ILS	GBP 12.642.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,504%	Goldman Sachs	15/11/2047	(822.448)	(822.448)
ILS	EUR 68.169.600	Fund receives Fixed 1,362% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Morgan Stanley	15/7/2027	(1.449.620)	(1.449.620)
ILS	EUR 91.750.000	Fund receives Fixed 0,738% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Royal Bank of Scotland	15/9/2019	(1.908.420)	(1.908.420)
ILS	EUR 91.750.000	Fund receives Fixed 0,748% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Royal Bank of Scotland	15/9/2019	(1.880.357)	(1.880.357)
IRS	GBP 15.500.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,064%	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	60.923	60.923
IRS	GBP 12.000.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,949%	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2022	112.561	112.561
IRS	GBP 33.567.000	Fund receives Fixed 3,215% and pays Floating GBP 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2023	(42.903)	(42.326)
IRS	GBP 31.135.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,860%	Bank of America Merrill Lynch	31/8/2023	693.562	693.562
IRS	CNY 208.970.000	Fund receives Fixed 3,630% and pays Floating CNY 1 Month 7D China Fixing Repo Rates	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(9.995)	(9.995)
IRS	CNY 89.783.027	Fund receives Fixed 3,965% and pays Floating CNY 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	178.070	178.070
IRS	INR 695.696.704	Fund receives Fixed 6,983% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(34.368)	(34.368)
IRS	INR 1.769.220.600	Fund receives Fixed 7,126% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	44.118	44.118
IRS	KRW 35.421.310.000	Fund receives Fixed 2,252% and pays Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(9.623)	(9.623)
IRS	BRL 18.816.033	Fund receives Fixed 10,040% and pays Floating BRL 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(131.217)	(131.217)
IRS	BRL 15.039.732	Fund receives Fixed 9,555% and pays Floating BRL One Day Brazil Interbank Deposit Overnight Rate	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(161.871)	(161.871)
IRS	BRL 30.200.000	Fund receives Fixed 9,650% and pays Floating BRL 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(303.885)	(303.885)
IRS	BRL 15.417.876	Fund receives Fixed 9,855% and pays Floating BRL One Day Brazil Interbank Deposit Overnight Rate	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(131.032)	(131.032)
IRS	CAD 41.360.000	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,749%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(355.842)	(355.323)
IRS	CAD 42.781.828	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,817%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(507.909)	(507.371)
IRS	GBP 25.823.000	Fund receives Fixed 3,320% and pays Floating GBP 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2028	10.555	11.227
IRS	GBP 4.640.000	Fund receives Floating GBP 12 Month LIBOR and pays Fixed 3,422%	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2048	(63.479)	(63.231)
IRS	GBP 6.623.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,777%	Barclays Bank	7/3/2022	98.163	98.163
IRS	GBP 19.872.000	Fund receives Fixed 1,812% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Barclays Bank	7/3/2025	717.920	717.920
IRS	GBP 19.000.000	Fund receives Fixed 1,826% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Barclays Bank	3/7/2025	718.006	718.006
IRS	GBP 19.000.000	Fund receives Fixed 1,846% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Barclays Bank	3/7/2025	748.442	748.442
IRS	GBP 10.600.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 2,030%	Barclays Bank	7/6/2032	(750.963)	(750.963)
IRS	GBP 10.889.585	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 2,052%	Barclays Bank	7/6/2032	(808.553)	(808.553)
IRS	GBP 10.732.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 2,089%	Barclays Bank	7/9/2034	(932.379)	(932.379)
IRS	JPY 2.329.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,800%	Barclays Bank	31/5/2047	275.592	275.592
IRS	JPY 1.927.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,902%	Barclays Bank	12/7/2047	(193.166)	(193.166)
IRS	JPY 1.927.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,912%	Barclays Bank	12/7/2047	(234.920)	(234.920)
IRS	CNY 83.000.000	Fund receives Fixed 3,978% and pays Floating CNY 3 Month 7D China Fixing Repo Rates	BNP Paribas	19/9/2023	171.160	171.160
IRS	GBP 6.623.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,776%	Citibank	7/3/2022	98.443	98.443
IRS	CNY 208.970.000	Fund receives Fixed 3,640% and pays Floating CNY 1 Month 7D China Fixing Repo Rates	Citibank	19/9/2023	2.675	2.675
IRS	INR 1.885.924.800	Fund receives Fixed 7,128% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Citibank	19/9/2023	48.251	48.251

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
IRS	KRW 35.421.310.000	Fund receives Fixed 2,225% and pays Floating KRW 3 Month LIBOR	Citibank	19/9/2023	(46.086)	(46.086)
IRS	GBP 62.491.000	Fund receives Fixed 1,136% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Citibank	5/6/2027	(1.776.466)	(1.776.466)
IRS	EUR 85.297.000	Fund receives Fixed 1,475% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Citibank	5/12/2027	74.915	74.915
IRS	EUR 28.456.274	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,231%	Citibank	6/1/2037	816.236	816.236
IRS	EUR 46.616.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 2,069%	Citibank	6/12/2037	(291.228)	(291.228)
IRS	GBP 14.749.453	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,450%	Citibank	1/12/2067	17.423	17.423
IRS	INR 980.680.896	Fund receives Fixed 7,080% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	918	918
IRS	INR 1.769.220.600	Fund receives Fixed 7,170% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	84.285	84.285
IRS	INR 1.665.148.800	Fund receives Fixed 7,180% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	87.968	87.968
IRS	GBP 28.547.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,767%	Goldman Sachs	7/9/2022	550.144	550.144
IRS	CNY 223.040.000	Fund receives Fixed 3,981% and pays Floating CNY 3 Month 7D China Fixing Repo Rates	Goldman Sachs	19/9/2023	464.340	464.340
IRS	GBP 39.645.000	Fund receives Fixed 1,840% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Goldman Sachs	7/3/2025	1.516.686	1.516.686
IRS	GBP 21.409.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 2,114%	Goldman Sachs	7/9/2034	(1.949.723)	(1.949.723)
IRS	INR 1.676.377.600	Fund receives Fixed 7,130% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	JP Morgan	19/9/2023	45.065	45.065
TRS	EUR 1.400.000	Fund receives iBoxx Euro Liquid High Yield Index and pays 3 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	5.215	5.215
TRS	EUR 400.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Ardagh Packaging Finance Plc Via Ardagh Holdings USA Inc	Credit Suisse	14/3/2019	(9.353)	(9.353)
TRS	EUR 400.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Mobilux Finance SAS	Credit Suisse	13/4/2019	16.226	16.226
TRS	USD 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays ARD Finance SA	Credit Suisse	12/7/2019	12.111	12.111
TRS	EUR 300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Cooperativa Muratori & Cementisti-CMC di Ravenna SC	Credit Suisse	9/11/2019	47.078	47.078
TRS	EUR 300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Cooperativa Muratori & Cementisti-CMC di Ravenna SC	Credit Suisse	15/11/2019	43.557	43.557
TRS	EUR 500.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Luxembourg SA	Credit Suisse	13/12/2019	10.550	10.550
TRS	USD 800.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays McLaren Finance Plc	Credit Suisse	14/12/2019	14.104	14.104
TRS	EUR 330.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Luxembourg SA	Credit Suisse	2/1/2020	9.463	9.463
TRS	GBP 100.000	Fund receives Wagamama Finance Plc and pays 3 Month LIBOR	Credit Suisse	27/2/2020	965	965
TRS	GBP 320.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Wagamama Finance Plc	Credit Suisse	9/3/2020	851	851
TRS	EUR 100.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Luxembourg SA	Credit Suisse	20/3/2020	(3.436)	(3.436)
TRS	EUR 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Hema Bondco I BV	Credit Suisse	13/4/2020	3.108	3.108
TRS	EUR 100.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Lecta SA	Credit Suisse	27/4/2020	3.689	3.689
TRS	EUR 100.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Altice Luxembourg SA	Credit Suisse	2/5/2020	(591)	(591)
TRS	EUR 300.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays LKQ European Holdings BV	Credit Suisse	18/5/2020	3.164	3.164
TRS	EUR 200.000	Fund receives 1 Month LIBOR and pays Codere Finance 2 Luxembourg SA	Credit Suisse	24/5/2020	2.622	2.622
TRS	EUR 100.000	Fund receives Codere Finance 2 Luxembourg SA and pays 1 Month LIBOR	Credit Suisse	24/5/2020	1.311	1.311
TRS	EUR 1.300.000	Fund receives 3 Month EURIBOR and pays iBoxx Euro Liquid High Yield Index	JP Morgan	20/6/2018	5.691	5.691
TRS	EUR 2.000.000	Fund receives 3 Month EURIBOR and pays iBoxx Euro Liquid High Yield Index	JP Morgan	20/6/2018	22.483	22.483
TRS	EUR 2.640.000	Fund receives iBoxx Euro Liquid High Yield Index and pays 3 Month EURIBOR	JP Morgan	20/6/2018	6.379	6.379
TRS	USD 300.000	Fund receives Fixed 0,250% and pays ARD Finance SA	JP Morgan	17/8/2018	18.488	18.488
TRS	USD 200.000	Fund receives Fixed 0,100% and pays Deutsche Bank AG	JP Morgan	3/12/2018	18.679	18.679
TRS	EUR 200.000	Fund receives Wind Tre SpA and pays Fixed 2,200%	JP Morgan	20/2/2019	23.860	23.860
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,500% and pays Vallourec SA	JP Morgan	26/3/2019	3.475	3.475
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,550% and pays Altice France SA	JP Morgan	27/3/2019	(1.819)	(1.819)
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,650% and pays Altice France SA	JP Morgan	27/3/2019	(1.820)	(1.820)
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 2,150% and pays Vallourec SA	JP Morgan	27/3/2019	2.943	2.943
TRS	USD 200.000	Fund receives Fixed 0,500% and pays Deutsche Bank AG	JP Morgan	28/3/2019	19.143	19.143
TRS	EUR 100.000	Fund receives Tereos Finance Groupe I SA and pays Fixed 1,400%	JP Morgan	8/4/2019	3.987	3.987
TRS	USD 300.000	Fund receives Fixed 0,350% and pays Hertz Corp/The	JP Morgan	15/4/2019	7.675	7.675
TRS	USD 300.000	Fund receives Fixed 3,600% and pays Hertz Corp/The	JP Morgan	15/4/2019	15.717	15.717
TRS	USD 600.000	Fund receives Fixed 0,700% and pays Deutsche Bank AG	JP Morgan	26/4/2019	50.452	50.452
TRS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 1,600% and pays Carlsberg Breweries A/S	JP Morgan	3/5/2019	6.742	6.742

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
TRS	EUR 500.000	Fund receives Fixed 0,600% and pays Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	JP Morgan	12/6/2019	29.268	29.268
TRS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,350% and pays Gestamp Automocion SA	JP Morgan	16/6/2019	2.727	2.727
TRS	EUR 500.000	Fund receives Fixed 1,200% and pays Hema Bondco I BV	JP Morgan	17/6/2019	8.038	8.038
TRS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 1,350% and pays Gestamp Automocion SA	JP Morgan	17/6/2019	4.439	4.439
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,350% and pays Vodafone Group Plc	JP Morgan	19/6/2019	(1.750)	(1.750)
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,350% and pays Vodafone Group Plc	JP Morgan	19/6/2019	(1.783)	(1.783)
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 2,000% and pays ProGroup AG	JP Morgan	20/6/2019	433	433
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 2,250% and pays Gamenet Group SpA	JP Morgan	20/6/2019	1.939	1.939
TRS	EUR 200.000	Fund receives ProGroup AG and pays Fixed 2,000%	JP Morgan	20/6/2019	866	866
TRS	GBP 400.000	Fund receives Arrow Global Finance Plc and pays Fixed 1,800%	JP Morgan	25/6/2019	3.344	3.344
TRS	EUR 500.000	Fund receives Fixed 0,680% and pays French Republic Government Bond OAT	JP Morgan	26/6/2019	25	25
TRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 2,100% and pays Naviera Armas SA	JP Morgan	26/6/2019	(602)	(602)
TRS	EUR 1.000.000	Fund receives Spain Government Bond and pays Fixed 0,750%	JP Morgan	26/6/2019	2.163	2.163
Total (exposition brute sous-jacente – 11.143.967.335 EUR)					(8.037.884)	(13.805.193)

CCCDs : Centrally Cleared Credit Default Swaps ou swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale
 CCILS : Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)
 CCIRS : Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)
 CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance
 ILS (inflation linked swaps) : swaps liés à l'inflation
 IRS (interest rate swaps) : swaps sur taux d'intérêt
 TRS (total return swaps) : swaps sur rendement total

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
BRL	28.390.000	USD	7.972.704	Morgan Stanley	14/8/2018	(342.564)
CAD	133.050.000	EUR	85.600.134	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	2.482.044
CAD	76.800.000	USD	59.560.227	Morgan Stanley	27/6/2018	(203.105)
CHF	337.946	EUR	288.628	Bank of America		
				Merrill Lynch	27/6/2018	5.707
CHF	15.472.054	EUR	13.216.489	Barclays Bank	27/6/2018	258.953
CHF	43.810.000	EUR	37.262.432	Credit Suisse	27/6/2018	894.046
DKK	1.229.810.000	EUR	165.105.706	Toronto		
				Dominion Bank	20/6/2018	119.336
EUR	1.132.527	AUD	1.800.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(36.456)
EUR	263.735.093	CAD	420.730.000	Royal Bank of Canada	20/6/2018	(14.797.899)
EUR	114.652.569	CZK	2.916.870.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	1.676.440
EUR	65.840.739	CZK	1.674.330.000	Citibank	20/6/2018	990.635
EUR	489.355.216	DKK	3.643.690.000	Citibank	20/6/2018	(174.739)
EUR	25.767.925	DKK	191.770.000	Credit Suisse	20/6/2018	3.615
EUR	1.212.469.476	GBP	1.082.420.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(21.917.373)
EUR	60.684.007	GBP	53.290.000	Barclays Bank	20/6/2018	(87.666)
EUR	4.732.212	GBP	4.170.000	BNP Paribas	20/6/2018	(23.237)
EUR	1.593.263	GBP	1.400.000	Citibank	20/6/2018	(3.291)
EUR	14.394.465	GBP	12.650.000	Credit Suisse	20/6/2018	(31.537)
EUR	39.045.315	GBP	34.220.000	HSBC	20/6/2018	20.983
EUR	1.705.426	GBP	1.520.000	Societe Generale	20/6/2018	(27.975)
EUR	6.487.463	GBP	5.660.000	UBS	20/6/2018	32.825
EUR	11.401	GBP	10.000	Barclays Bank	21/6/2018	(3)
EUR	14.197.817	GBP	12.450.000	BNP Paribas	21/6/2018	303
EUR	34.209	GBP	30.000	HSBC	21/6/2018	(2)
EUR	41.859	JPY	5.470.000	Credit Suisse	21/6/2018	(1.406)
EUR	53.365.822	NOK	513.590.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(432.313)
EUR	32.659.720	NOK	315.310.000	Standard		
				Chartered Bank	20/6/2018	(368.746)
EUR	25.594.225	NZD	43.610.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(609.230)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	11.834.800	RON	55.420.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(58.396)
EUR	1.079.950	SEK	11.160.000	Barclays Bank	20/6/2018	(6.007)
EUR	21.650.151	SEK	222.920.000	JP Morgan	20/6/2018	(41.732)
EUR	96.222.506	SEK	977.510.000	Morgan Stanley	20/6/2018	1.103.034
EUR	17.450.822	SEK	179.620.000	Toronto		
				Dominion Bank	20/6/2018	(27.628)
EUR	4.828.434	SEK	49.356.694	Barclays Bank	29/6/2018	25.564
EUR	16.173.233	SEK	165.333.944	Credit Suisse	29/6/2018	84.687
EUR	36.213.508	SEK	370.248.712	Deutsche Bank	29/6/2018	184.830
EUR	2.500.578	SEK	25.554.672	Morgan Stanley	29/6/2018	13.868
EUR	12.071.141	SEK	123.405.978	UBS	29/6/2018	62.580
EUR	2.183.234	SEK	22.200.000	Deutsche Bank	14/8/2018	22.807
EUR	1.071.615	SEK	11.000.000	UBS	14/8/2018	1.133
EUR	992.491	USD	1.152.334	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	4.094
EUR	215.033.185	USD	258.450.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(6.520.970)
EUR	32.225.031	USD	39.220.000	Barclays Bank	20/6/2018	(1.395.994)
EUR	4.072.984	USD	5.050.000	BNP Paribas	20/6/2018	(256.087)
EUR	24.881.607	USD	30.730.000	HSBC	20/6/2018	(1.461.435)
EUR	749.848.857	USD	929.020.000	JP Morgan	20/6/2018	(46.545.962)
EUR	10.257.865	USD	12.390.000	State Street Bank & Trust Company		
				Toronto	20/6/2018	(363.361)
EUR	69.577.508	USD	85.960.000	Dominion Bank	20/6/2018	(4.111.001)
EUR	8.527	USD	10.000	Barclays Bank	21/6/2018	(44)
EUR	9.191.297	USD	10.810.000	BNP Paribas	21/6/2018	(74.726)
EUR	494.707	USD	580.000	Goldman Sachs	21/6/2018	(2.452)
EUR	3.885.955	USD	4.560.040	Barclays Bank	27/6/2018	(20.855)
EUR	18.970.000	USD	22.619.069	HSBC	27/6/2018	(408.873)
EUR	20.714.045	USD	24.306.523	JP Morgan	27/6/2018	(110.548)
EUR	9.069.926	ZAR	137.930.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(269.405)
EUR	26.130.597	ZAR	390.060.000	Toronto		
				Dominion Bank	20/6/2018	(280.624)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
GBP	10.910.000	EUR	12.572.618	Barclays Bank	20/6/2018	(130.904)
JPY	3.059.000.000	USD	28.196.329	UBS	29/6/2018	40.453
MXN	1.305.200.000	USD	67.472.769	Barclays Bank	29/6/2018	(2.140.705)
NZD	80.345.000	USD	55.986.003	HSBC	29/6/2018	280.970
SEK	733.900.000	EUR	71.569.208	Citibank	29/6/2018	(153.844)
SEK	324.163.171	EUR	30.615.802	Deutsche Bank	14/8/2018	930.640
TRY	51.334.000	USD	11.761.714	Bank of America Merrill Lynch	14/8/2018	(634.381)
TRY	5.990.000	USD	1.342.918	State Street Bank & Trust Company	14/8/2018	(48.826)
USD	4.006.187	BRL	14.780.000	Barclays Bank	14/8/2018	55.034
USD	13.538.617	CAD	17.420.545	Bank of America Merrill Lynch	27/6/2018	70.548
USD	2.703.980	CAD	3.479.455	Credit Suisse	27/6/2018	13.983
USD	43.508.209	CAD	55.900.000	HSBC	27/6/2018	281.854
USD	80.886.335	EUR	67.995.803	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	1.383.245
USD	17.900.000	EUR	14.999.225	Citibank	20/6/2018	345.404
USD	253.450.000	EUR	212.605.863	HSBC	20/6/2018	4.662.083
USD	29.148.540	EUR	24.600.000	Citibank	27/6/2018	372.987
USD	50.790.605	EUR	42.485.000	Morgan Stanley	29/6/2018	1.022.664
USD	28.060.899	JPY	3.059.000.000	Morgan Stanley	29/6/2018	(156.463)
USD	32.883.994	MXN	652.600.000	Citibank	29/6/2018	340.188
USD	32.870.613	MXN	652.600.000	UBS	29/6/2018	328.725
USD	7.806.720	NZD	11.296.079	JP Morgan	27/6/2018	(94.907)
USD	19.736.299	NZD	28.563.921	Morgan Stanley	27/6/2018	(243.609)
USD	1.737.278	TRY	7.701.000	Citibank	14/8/2018	71.962
USD	934.419	TRY	4.112.798	Deutsche Bank	14/8/2018	44.073
USD	523.067	TRY	2.302.202	Goldman Sachs	14/8/2018	24.680
USD	1.391.210	TRY	6.160.000	HSBC	14/8/2018	58.901
						(86.301.403)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	232.003.032	EUR	195.130.477	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	6.898.383
EUR	5.873.819	CHF	6.851.813	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(92.757)
						6.805.626
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
EUR	24.011.822	GBP	20.983.566	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	77.425
GBP	76.427.837	EUR	87.235.215	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(59.654)
						17.771
Catégorie d'Actions couverte en couronnes suédoises						
EUR	138.625	SEK	1.426.453	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(179)
SEK	58.558.666	EUR	5.640.348	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	57.807
						57.628
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
EUR	34.423.970	USD	40.342.102	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(178.867)
USD	667.962.124	EUR	561.358.213	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	11.576.346
						11.397.479
Total (exposition brute sous-jacente – 6.384.954.182 EUR)						(68.022.899)

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
8.827	GBP	3 Month Sterling Put Futures-Style Option (HSBC)			
		(strike price GBP 99,25)			
			Juin 2018	–	(503.529)
(953)	AUD	90 Day Australian Bank Bill	Décembre 2018	615.910.112	15.130
(3.506)	USD	90 Day Euro	Juin 2020	2.997.978.918	45.465
3.506	USD	90 Day Euro	Mars 2020	2.997.978.918	(141.992)
(688)	GBP	90 Day Sterling	Septembre 2020	391.814.234	(226.238)
688	GBP	90 Day Sterling	Septembre 2019	391.814.234	265.456
(149)	AUD	Australian 10 Year Bond	Juin 2018	12.422.772	(219.152)
762	AUD	Australian 3 Year Bond	Juin 2018	54.757.318	15.273
591	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	35.040.959	466.139
(2.541)	EUR	Euro BOBL	Juin 2018	276.519.243	(1.377.240)
(3.590)	EUR	Euro BTP	Juin 2018	413.919.820	8.526.452
2.273	EUR	Euro BTP	Juin 2018	223.390.440	3.595.276
2.224	EUR	Euro Bund	Juin 2018	223.403.001	(53.485)
(53)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	5.323.902	(186.670)
(340)	EUR	Euro Bund	Septembre 2018	34.733.720	210.800
21	EUR	Euro Bund Put Futures-Style Option (Goldman Sachs)			
		(strike price EUR 160,5)			
			Juillet 2018	709.961	(3.150)
(3.892)	EUR	Euro BUXL	Juin 2018	588.610.512	(27.497.304)
(2.831)	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	286.709.525	(608.665)
(13.065)	EUR	Euro-OAT	Juin 2018	1.570.909.470	(20.726.475)
(58)	JPY	Japan 10 Year Bond	Juin 2018	47.072.002	(212.387)
(8.342)	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	1.034.769.106	(13.515.529)
35	USD	US Long Bond	Septembre 2018	3.668.963	2.195
1.286	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	110.701.481	(6.379)
(2.883)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	244.819.238	(711.501)
2.509	USD	US Treasury 2 Year Note	Septembre 2018	422.163.444	(896.522)
(2.215)	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	184.286.833	(187.001)
(615)	USD	US Ultra Bond	Septembre 2018	59.821.133	(236.861)
Total				13.229.249.259	(54.167.894)

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
40.000.000	Call	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,17	29/10/2018	128.120	963.200
40.000.000	Put	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,17	29/10/2018	(144.560)	690.520
Total (exposition brute sous-jacente – 40.079.764 EUR)						(16.440)	1.653.720

Swaptions achetées au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values latentes EUR	Valeur de marché EUR
2.900.000	Put	Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 from 20/6/2018; and provides 5% Fixed quarterly from 20/6/2017	Barclays Bank	EUR 300,00	20/6/2018	4.610	24.026
5.930.000	Put	Fund purchases an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 from 20/6/2018; and provides 1% Fixed quarterly from 20/6/2018	Morgan Stanley	EUR 60,00	20/6/2018	20.069	29.556
Total (exposition brute sous-jacente – 7.057.865 EUR)						24.679	53.582

Swaptions vendues au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
(2.900.000)	Put	Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed quarterly from 20/6/2018; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 from 20/6/2018	Barclays Bank	EUR 350,00	20/6/2018	1.664	(6.456)
(2.900.000)	Put	Fund writes an option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed quarterly from 20/6/2018; and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 from 20/6/2018	Citibank	EUR 70,00	20/6/2018	(3.435)	(6.175)
(1.161.525.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 24/6/2020; and pays 2,4% Fixed semi-annually from 24/3/2020	JP Morgan	USD 2,40	20/3/2020	287.551	(3.278.968)
(1.161.525.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,4% Fixed semi-annually from 24/3/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 24/6/2020	JP Morgan	USD 3,40	20/3/2020	317.557	(3.248.962)
Total (exposition brute sous-jacente – 604.218.076 EUR)						603.337	(6.540.561)

BlackRock Fixed Income Strategies Fund suite

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 mai 2018

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis			
USD 172.228.000	Fannie Mae Pool 3,00% TBA	147.077.150	1,48
USD (120.580.000)	Fannie Mae Pool 3,50% TBA	(103.230.158)	(1,04)
		43.846.992	0,44
Total (exposition brute sous-jacente – 250.307.308 EUR)		43.846.992	0,44

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	44,36
Finance	21,34
Titres adossés à des actifs	4,55
Organismes de placement collectif	4,04
Titres hypothécaires	3,90
Biens de consommation non cyclique	3,16
Biens de consommation cyclique	3,04
Services aux collectivités	2,51
Communications	2,24
Valeurs industrielles	1,12
Énergie	0,88
Exchange Traded Funds	0,64
Matériaux de base	0,54
Technologie	0,15
Diversifiés	0,00
Portefeuille de titres à la valeur de marché	92,47
Autres éléments de l'actif net	7,53
	100,00

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES				Argentine suite			
2.984.631	Indonésie			USD 225.000	Generacion Mediterranea SA Via Generacion Frias SA Via Central Termica Roca SA '144A' 9,625% 27/7/2023	202.574	0,04
	Bumi Resources Tbk PT	48.669	0,01	USD 190.000	Genneia SA '144A' 8,75% 20/1/2022	166.328	0,04
		48.669	0,01	USD 150.000	Pampa Energia SA '144A' 7,50% 24/1/2027	124.416	0,03
Total des actions ordinaires				USD 150.000	Provincia de Rio Negro '144A' 7,75% 7/12/2025	113.612	0,03
OBLIGATIONS				USD 227.000	Tarjeta Naranja SA '144A' FRN 11/4/2022	144.870	0,03
ARS 598.000	Argentine			USD 110.000	Tecpetrol SA '144A' 4,875% 12/12/2022	88.271	0,02
	Arcor SAIC '144A' 6,00% 6/7/2023	36.542	0,01	USD 192.000	YPF SA '144A' 8,875% 19/12/2018	167.667	0,04
	Argentina Bonar Bonds 9,00% 29/11/2018	209.405	0,05	USD 140.000	YPF SA '144A' 8,50% 23/3/2021	126.825	0,03
ARS 1.195.000	Argentina Bonar Bonds FRN 11/3/2019	20.322	0,00	USD 95.000	YPF SA '144A' 8,75% 4/4/2024	84.735	0,02
USD 206.000	Argentina Bonar Bonds FRN 1/3/2020	40.750	0,01	USD 86.000	YPF SA '144A' 6,95% 21/7/2027	69.691	0,02
USD 206.000	Argentina Bonar Bonds 8,00% 8/10/2020	189.611	0,04	USD 126.000	YPF SA RegS 8,75% 4/4/2024	112.386	0,02
USD 335.892	Argentina Bonar Bonds 8,75% 7/5/2024	310.812	0,07			5.723.696	1,27
ARS 8.181.000	Argentina Treasury Bill 14/9/2018 (Zero Coupon)	288.939	0,06	Australie			
ARS 3.514.000	Argentine Bonos del Tesoro 21,20% 19/9/2018	116.917	0,03	USD 200.000	Asciano Finance Ltd RegS 4,75% 22/3/2028	168.843	0,04
CHF 60.000	Argentine Republic Government International Bond 3,375% 12/10/2020	51.590	0,01	EUR 200.000	BHP Billiton Finance Ltd RegS FRN 22/4/2076	219.914	0,05
USD 326.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875% 22/4/2021	282.800	0,06	USD 400.000	BHP Billiton Finance USA Ltd '144A' FRN 19/10/2075	358.924	0,08
USD 370.000	Argentine Republic Government International Bond 5,625% 26/1/2022	312.396	0,07	USD 200.000	Macquarie Bank Ltd/London RegS FRN (Perpetual)	158.349	0,03
USD 266.000	Argentine Republic Government International Bond 7,50% 22/4/2026	226.870	0,05	USD 146.000	Macquarie Group Ltd RegS FRN 28/11/2023	120.258	0,02
USD 147.000	Argentine Republic Government International Bond 5,875% 11/1/2028	111.087	0,02	AUD 167.127	Torrens Series Trust '2013-1 A' FRN 12/4/2044	108.657	0,02
EUR 475.000	Argentine Republic Government International Bond 5,25% 15/1/2028	435.219	0,10	USD 200.000	Transurban Queensland Finance Pty Ltd RegS 4,50% 19/4/2028	166.032	0,04
USD 634.892	Argentine Republic Government International Bond 7,625% 18/4/2037	531.162	0,12	USD 101.056	Virgin Australia Pass Through Trust '2013-1B' '144A' 6,00% 23/10/2020	88.754	0,02
USD 241.000	Argentine Republic Government International Bond 7,625% 22/4/2046	185.639	0,04	USD 100.000	Westpac Banking Corp/New Zealand (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	75.267	0,02
USD 336.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875% 11/1/2048	239.351	0,05			1.464.998	0,32
USD 107.847	Argentine Republic Government International Bond (Step-up Coupon) 2,50% 31/12/2038	56.231	0,01	Autriche			
EUR 225.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 5,00% 15/1/2027	206.156	0,05	EUR 400.000	BAWAG Group AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	377.500	0,08
USD 205.000	Argentine Republic Government International Bond RegS 7,125% 28/6/2117	147.968	0,03	EUR 400.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG RegS 8,125% 30/10/2023	526.722	0,12
ARS 3.854.000	Banco Hipotecario SA '144A' FRN 7/11/2022	129.773	0,03	EUR 400.000	Erste Group Bank AG RegS FRN (Perpetual)	472.884	0,10
ARS 1.768.000	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER 4,00% 6/3/2020	62.390	0,01	GBP 1.063.000	Oesterreichische Kontrollbank AG RegS 0,75% 7/3/2022	1.196.951	0,27
USD 120.000	Cablevision SA '144A' 6,50% 15/6/2021	103.506	0,02	EUR 200.000	Raiffeisen Bank International AG RegS FRN (Perpetual)	205.129	0,05
USD 35.000	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios SA '144A' 9,50% 20/7/2023	26.885	0,01	EUR 200.000	Volksbank Wien AG RegS FRN 6/10/2027 (traded in Austr)	198.444	0,04
				EUR 300.000	Volksbank Wien AG RegS FRN 6/10/2027 (traded in Germany)	297.666	0,07
						3.275.296	0,73
				Belgique			
				EUR 200.000	Belfius Bank SA/NV RegS 0,75% 12/9/2022	199.997	0,04
				EUR 100.000	Belfius Bank SA/NV RegS 1,00% 26/10/2024	97.849	0,02

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Belgique suite				Îles Caïmans			
EUR 200.000	KBC Group NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	204.910	0,05	USD 2.360.000	Alibaba Group Holding Ltd 3,40% 6/12/2027	1.916.763	0,42
		502.756	0,11	USD 400.000	Alibaba Group Holding Ltd 4,00% 6/12/2037	324.308	0,07
				USD 630.000	Alibaba Group Holding Ltd 4,20% 6/12/2047	511.275	0,11
Bermudes				USD 200.000	Alpha Star Holding V Ltd RegS 6,625% 18/4/2023	161.567	0,03
HKD 2.000.000	Haitong International Securities Group Ltd RegS 25/10/2021 (Zero Coupon)	220.465	0,05	USD 250.000	Arbor Realty Collateralized Loan Obligation Ltd '2015-FL2A A' '144A' FRN 15/9/2025	215.906	0,05
USD 200.000	Inkia Energy Ltd '144A' 5,875% 9/11/2027	161.138	0,03	USD 1.580.000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd '2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	1.357.758	0,30
		381.603	0,08	USD 340.802	Atrium X '10A AR' '144A' FRN 16/7/2025	292.626	0,06
Îles Vierges britanniques				USD 300.000	Azure Orbit IV International Finance Ltd RegS 3,75% 25/1/2023	252.326	0,05
USD 200.000	Baoxin Auto Finance I Ltd RegS 6,625% 2/4/2019	171.612	0,04	USD 200.000	Baidu Inc 3,875% 29/9/2023	171.777	0,04
USD 270.000	Baoxin Auto Finance I Ltd RegS FRN (Perpetual)	212.231	0,05	USD 375.000	Baidu Inc 4,375% 29/3/2028*	322.787	0,07
USD 295.000	CCTI 2017 Ltd RegS 3,625% 8/8/2022	244.087	0,05	USD 345.000	BlueMountain CLO Ltd '2014-4A A1R' '144A' FRN 30/11/2026	296.201	0,06
USD 300.000	China Cinda Finance 2015 I Ltd RegS 4,25% 23/4/2025*	253.114	0,05	USD 1.970.000	Bsprt Issuer Ltd '2017-FL1 A' '144A' FRN 15/6/2027	1.696.240	0,38
USD 200.000	China Reinsurance Finance Corp Ltd RegS 3,375% 9/3/2022	165.212	0,04	USD 215.000	CDBL Funding 1 RegS 3,00% 24/4/2023	175.390	0,04
USD 315.000	Chinalco Capital Holdings Ltd RegS 4,25% 21/4/2022	257.314	0,06	USD 230.000	CDBL Funding 1 RegS 3,50% 24/10/2027	180.504	0,04
USD 200.000	Easy Tactic Ltd RegS 7,00% 25/4/2021	170.364	0,04	USD 200.000	Central China Real Estate Ltd RegS 6,875% 23/10/2020	168.862	0,04
EUR 350.000	Global Switch Holdings Ltd RegS 1,50% 31/1/2024	352.305	0,08	USD 200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 6,375% 2/5/2020	170.794	0,04
EUR 550.000	Global Switch Holdings Ltd RegS 2,25% 31/5/2027	558.525	0,12	USD 200.000	CIFI Holdings Group Co Ltd RegS 6,875% 23/4/2021	169.721	0,04
USD 200.000	Guojing Capital BVI Ltd RegS 3,95% 11/12/2022	166.252	0,04	USD 200.000	Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 7,25% 13/2/2019	170.334	0,04
USD 300.000	Huarong Finance II Co Ltd RegS FRN (Perpetual)*	241.054	0,05	USD 200.000	Fantasia Holdings Group Co Ltd RegS 8,375% 8/3/2021	164.442	0,04
EUR 125.000	Huarong Universe Investment Holding Ltd RegS 1,625% 5/12/2022	123.547	0,03	USD 200.000	FWD Ltd RegS FRN (Perpetual)	162.297	0,04
USD 200.000	Leader Goal International Ltd RegS FRN (Perpetual)	163.420	0,03	USD 540.000	Galaxy XV CLO Ltd '2013-15A AR' '144A' FRN 15/10/2030	465.671	0,10
		3.079.037	0,68	USD 133.000	Gol Finance Inc '144A' 7,00% 31/1/2025	98.168	0,02
Canada				USD 200.000	Golden Wheel Tiandi Holdings Co Ltd RegS 7,00% 18/1/2021	166.433	0,04
USD 115.000	Bank of Montreal 1,50% 18/7/2019	97.482	0,02	USD 100.000	GPMT 2018-FL1 - Class A '144A' FRN 21/11/2035	85.833	0,02
USD 35.000	Bank of Montreal 1,75% 11/9/2019	29.706	0,01	USD 250.000	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd '2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027**	214.241	0,05
USD 155.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,50% 1/11/2025	131.035	0,03	USD 43.880	GT Loan Financing I Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 28/10/2024	37.674	0,01
USD 25.000	Canadian Natural Resources Ltd 2,95% 15/1/2023	20.845	0,00	USD 200.000	Jingrui Holdings Ltd RegS 9,45% 23/4/2021	169.384	0,04
USD 315.000	Emera Inc FRN 15/6/2076	287.572	0,06	USD 400.000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd '2017-16SAA A' '144A' FRN 15/1/2028	343.431	0,08
USD 35.000	Enbridge Inc 2,90% 15/7/2022	29.122	0,01	USD 70.650	Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd '144A' 6,35% 1/12/2021	59.757	0,01
USD 200.000	Kinross Gold Corp 5,95% 15/3/2024	178.947	0,04	USD 58.616	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 6,72% 1/12/2022	48.030	0,01
USD 278.000	Stoneway Capital Corp '144A' 10,00% 1/3/2027	249.388	0,05	USD 225.000	Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd RegS FRN (Perpetual)	186.623	0,04
USD 300.000	Stoneway Capital Corp RegS 10,00% 1/3/2027	269.123	0,06	USD 425.000	OZLM Funding II Ltd '2012-2A A1R' '144A' FRN 30/10/2027	365.049	0,08
USD 80.000	Teck Resources Ltd '144A' 8,50% 1/6/2024	76.128	0,02	USD 290.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 5,25% 15/8/2022	246.717	0,05
USD 35.000	TransCanada PipeLines Ltd 3,75% 16/10/2023	30.243	0,01				
USD 264.000	TransCanada PipeLines Ltd FRN 15/5/2067	215.535	0,05				
USD 122.000	Transcanada Trust FRN 15/8/2076	104.969	0,02				
		1.720.095	0,38				

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

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

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Îles Caïmans suite				France			
USD 300.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 5,50% 15/2/2024	254.259	0,06	EUR 500.000	Altarea SCA RegS 2,25% 5/7/2024	501.365	0,11
USD 200.000	Redco Group RegS 6,375% 27/2/2019	168.485	0,04	EUR 500.000	BNP Paribas Cardif SA RegS 1,00% 29/11/2024	471.583	0,10
USD 200.000	Ronshine China Holdings Ltd RegS 6,95% 8/12/2019	167.146	0,04	USD 100.000	BNP Paribas SA 5,00% 15/1/2021	89.897	0,02
USD 500.000	Seagate HDD Cayman 4,25% 1/3/2022	423.494	0,09	USD 400.000	BNP Paribas SA '144A' 4,375% 12/5/2026	336.224	0,07
GBP 1.106.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd RegS 2,625% 24/1/2032	1.204.549	0,27	USD 715.000	BNP Paribas SA '144A' 4,625% 13/3/2027	608.693	0,14
USD 200.000	Times China Holdings Ltd RegS 6,25% 17/1/2021	165.689	0,04	EUR 300.000	BPCE SA RegS 1,125% 18/1/2023	301.818	0,07
USD 250.000	Tryon Park CLO Ltd '2013-1A1SR' '144A' FRN 15/4/2029	214.330	0,05	EUR 200.000	Carrefour SA RegS 4,00% 9/4/2020	215.014	0,05
USD 15.000	Vale Overseas Ltd 4,375% 11/1/2022	12.958	0,00	EUR 500.000	Cars Alliance Auto Loans France V '2018-1 A' RegS FRN 21/10/2029	502.644	0,11
USD 800.000	Vale Overseas Ltd 6,25% 10/8/2026	746.685	0,16	EUR 300.000	Cars Alliance Auto Loans France V '2018-1 B' RegS FRN 21/10/2029	303.326	0,07
		14.726.484	3,26	USD 475.000	Credit Agricole SA RegS FRN 10/1/2033	376.566	0,08
Chine				USD 300.000	Credit Agricole SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	259.434	0,06
EUR 100.000	Chengdu Xingcheng Investment Group Co Ltd RegS 2,50% 20/3/2021	100.170	0,02	EUR 500.000	Credit Agricole SA/London RegS 1,875% 20/12/2026	505.470	0,11
USD 200.000	China Minmetals Corp RegS FRN (Perpetual)	168.274	0,04	EUR 100.000	Credit Agricole SA/London RegS 1,375% 3/5/2027	100.896	0,02
CNY 2.000.000	China Railway Construction Corp Ltd RegS 1,50% 21/12/2021	251.738	0,06	EUR 100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS 3,50% 9/2/2029	102.046	0,02
USD 250.000	CRRC Corp Ltd RegS 5/2/2021 (Zero Coupon)	216.877	0,05	EUR 100.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS FRN 25/10/2029 (traded in France)	95.552	0,02
USD 250.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/New York 3,538% 8/11/2027	203.963	0,04	EUR 300.000	Credit Mutuel Arkea SA RegS FRN 25/10/2029 (traded in Luxembourg)	286.656	0,06
USD 200.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd RegS FRN (Perpetual)	161.095	0,04	EUR 500.000	Danone SA RegS 1,25% 6/6/2018	500.035	0,11
USD 236.000	Union Life Insurance Co Ltd RegS 3,00% 19/9/2021	189.750	0,04	EUR 500.000	Danone SA RegS 0,167% 3/11/2020	503.042	0,11
EUR 200.000	Zhejiang Expressway Co Ltd RegS 21/4/2022 (Zero Coupon)	192.390	0,04	EUR 300.000	Danone SA RegS FRN (Perpetual)	293.772	0,07
		1.484.257	0,33	GBP 1.800.000	Dexia Credit Local SA RegS 1,125% 15/6/2022	2.040.231	0,45
Colombie				GBP 600.000	Dexia Credit Local SA RegS 1,625% 8/12/2023	689.260	0,15
USD 200.000	Credivalores-Crediservicios SAS '144A' 9,75% 27/7/2022	171.663	0,04	EUR 295.194	Driver France FCT Compartment Driver France Three 'B' RegS FRN 21/4/2024	295.616	0,07
		171.663	0,04	GBP 500.000	Electricite de France SA RegS 5,50% 17/10/2041	722.738	0,16
Chypre				EUR 100.000	Electricite de France SA RegS FRN (Perpetual)	104.870	0,02
EUR 85.000	Cyprus Government International Bond RegS 4,75% 25/6/2019	89.181	0,02	EUR 300.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	301.182	0,07
EUR 300.000	Cyprus Government International Bond RegS '144A' 4,625% 3/2/2020	318.600	0,07	EUR 500.000	Engie SA RegS FRN (Perpetual)	479.415	0,11
		407.781	0,09	EUR 1.911.753	FCT SapphireOne Auto '2017-1 A' RegS FRN 24/1/2034	1.913.845	0,42
Danemark				EUR 775.000	Fnac Darty SA RegS 3,25% 30/9/2023	801.168	0,18
EUR 400.000	Danske Bank A/S RegS FRN 4/10/2023	404.936	0,09	EUR 966.000	French Republic Government Bond OAT RegS '144A' 2,00% 25/5/2048*	1.056.630	0,23
USD 200.000	Danske Bank A/S RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	169.414	0,04	EUR 850.000	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE RegS 0,375% 26/5/2022	855.380	0,19
EUR 300.000	Orsted A/S RegS 1,50% 26/11/2029	300.993	0,07	EUR 250.000	Renault SA RegS 3,625% 19/9/2018	252.809	0,06
EUR 400.000	Orsted A/S RegS FRN 8/7/3013	401.776	0,09	EUR 200.000	Societe Generale SA RegS 1,00% 1/4/2022	201.750	0,05
EUR 200.000	Orsted A/S RegS FRN 6/11/3015	208.816	0,04	EUR 575.000	Total SA RegS FRN (Perpetual)	598.057	0,13
		1.485.935	0,33	EUR 205.000	Total SA RegS FRN (Perpetual)	210.976	0,05
				EUR 700.000	Wendel SA RegS 2,50% 9/2/2027*	735.301	0,16
						17.613.261	3,90
				Allemagne			
				EUR 400.000	ADLER Real Estate AG RegS 2,125% 6/2/2024	392.636	0,09
				EUR 300.000	ADLER Real Estate AG RegS 3,00% 27/4/2026	297.456	0,07

* Une partie de ces titres ont été mis en gage ou donnés en garantie, pour plus d'informations voir les informations supplémentaires.

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

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Allemagne suite				Hong Kong suite			
EUR 400.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	408.824	0,09	USD 215.000	Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd RegS FRN (Perpetual)	171.563	0,04
EUR 300.000	Bertelsmann SE & Co KGaA RegS FRN 23/4/2075	301.281	0,07	USD 250.000	Wing Lung Bank Ltd RegS FRN 22/11/2027	206.195	0,04
EUR 43.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 3,25% 4/7/2042	64.875	0,01	USD 200.000	Yancoal International Resources Development Co Ltd RegS FRN (Perpetual)	170.411	0,04
EUR 200.000	Deutsche Bank AG 4,50% 19/5/2026 (traded in Germany)	202.300	0,05			2.745.491	0,61
EUR 100.000	Deutsche Bank AG 4,50% 19/5/2026 (traded in Luxembourg)	101.150	0,02	Inde			
EUR 200.000	Deutsche Bank AG RegS 1,25% 8/9/2021	200.924	0,04	INR 195.900.000	Indiabulls Housing Finance Ltd RegS 8,567% 15/10/2019	2.498.817	0,55
USD 1.600.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 1/12/2032	1.184.027	0,26	USD 200.000	Indian Railway Finance Corp Ltd RegS 3,835% 13/12/2027	160.830	0,04
EUR 200.000	Deutsche Pfandbriefbank AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	190.880	0,04	USD 200.000	Power Finance Corp Ltd RegS 3,75% 6/12/2027	156.767	0,03
EUR 300.000	Hapag-Lloyd AG RegS 6,75% 1/2/2022	314.262	0,07	USD 200.000	Rural Electrification Corp Ltd RegS 4,625% 22/3/2028	167.517	0,04
EUR 800.000	IKB Deutsche Industriebank AG RegS FRN 31/1/2028	796.544	0,18	USD 200.000	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch RegS 3,75% 6/2/2023	166.317	0,04
GBP 1.100.000	NRW Bank RegS 1,00% 15/6/2022	1.248.345	0,28			3.150.248	0,70
EUR 827.605	Red & Black Auto Germany 5 UG haftungsbeschränkt 'A' RegS FRN 15/1/2027	832.507	0,18	Indonésie			
		6.536.011	1,45	USD 200.000	Indonesia Government International Bond 4,35% 11/1/2048	158.203	0,03
Grèce				USD 200.000	Indonesia Government International Bond RegS 4,125% 15/1/2025	170.909	0,04
EUR 25.000	Hellenic Republic Government Bond RegS '144A' 3,375% 15/2/2025	23.762	0,01	IDR 6.035.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/9/2026	400.704	0,09
EUR 142.450	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,75% 30/1/2028	133.333	0,03	IDR 7.057.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,00% 15/5/2027	434.409	0,09
EUR 150.600	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,90% 30/1/2033	136.105	0,03	IDR 12.693.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,125% 15/5/2028	738.542	0,16
EUR 100.000	Hellenic Republic Government Bond RegS 4,00% 30/1/2037 (traded in Germany)	87.575	0,02	IDR 5.035.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,50% 15/8/2032	310.610	0,07
EUR 101.950	Hellenic Republic Government Bond RegS 4,00% 30/1/2037 (traded in Greece)	89.283	0,02	IDR 4.613.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,625% 15/5/2033	266.056	0,06
EUR 99.100	Hellenic Republic Government Bond RegS 4,20% 30/1/2042	86.787	0,01	IDR 2.000.000.000	Jasa Marga Persero Tbk PT RegS 7,50% 11/12/2020	121.978	0,03
		556.845	0,12	USD 300.000	Pertamina Persero PT RegS 6,45% 30/5/2044	282.237	0,06
Guernesey				USD 200.000	Perusahaan Listrik Negara PT RegS 6,15% 21/5/2048	178.423	0,04
USD 400.000	EFG International Guernsey Ltd RegS FRN 5/4/2027	339.953	0,08	USD 200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III RegS 4,40% 1/3/2028	169.450	0,04
		339.953	0,08	IDR 2.000.000.000	Wijaya Karya Persero Tbk PT RegS 7,70% 31/1/2021	122.435	0,03
Hong Kong						3.353.956	0,74
USD 250.000	Bank of East Asia Ltd/The RegS FRN (Perpetual)	213.009	0,05	Irlande			
USD 200.000	Baosteel Hong Kong Investment Co Ltd RegS 1/12/2018 (Zero Coupon)	194.624	0,04	EUR 100.000	AIB Group Plc RegS 1,50% 29/3/2023	99.149	0,02
USD 210.000	CITIC Ltd RegS 4,00% 11/1/2028	170.072	0,04	GBP 300.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 19/9/2027	337.086	0,07
USD 300.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd RegS 4,125% 14/3/2021	258.582	0,06	USD 250.000	Bank of Ireland Group Plc RegS FRN 19/9/2027	204.897	0,05
USD 280.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd RegS 4,625% 14/3/2023	242.257	0,05	EUR 190.000	Bank of Ireland RegS FRN 11/6/2024	196.108	0,04
USD 200.000	CNAC HK Finbridge Co Ltd RegS 4,875% 14/3/2025	172.306	0,04	EUR 400.000	Bank of Ireland RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	431.552	0,10
USD 511.000	CNAC HK Synbridge Co Ltd 5,00% 5/5/2020	447.412	0,10	SEK 1.230.000	Bluestep Mortgage Securities No 4 DAC 'B' RegS FRN 10/8/2066	119.928	0,03
USD 200.000	Hongkong Xiangyu Investment Co Ltd RegS 4,50% 30/1/2023	166.416	0,04	EUR 200.000	ESB Finance DAC RegS 2,125% 8/6/2027	213.797	0,05
USD 200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd RegS FRN 25/5/2023	172.284	0,04				
USD 200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd RegS 3,975% 9/11/2027	160.360	0,03				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Irlande suite				Japon			
EUR 300.000	GE Capital European Funding Unlimited Co RegS 0,80% 21/1/2022	304.686	0,07	USD 200.000	Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The RegS FRN (Perpetual)	162.211	0,04
EUR 1.400.000	Ireland Government Bond RegS 1,30% 15/5/2033	1.375.346	0,30	JPY 10.000.000	Iwatani Corp RegS 22/10/2020 (Zero Coupon)	84.960	0,02
USD 700.000	Russian Railways Via RZD Capital Plc RegS 3,45% 6/10/2020	591.019	0,13	USD 200.000	Nippon Life Insurance Co RegS FRN 20/1/2046	170.365	0,04
USD 125.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1,90% 23/9/2019	105.864	0,02	USD 200.000	Sumitomo Life Insurance Co RegS FRN 14/9/2077	160.065	0,04
USD 65.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2,875% 23/9/2023	52.747	0,01	USD 80.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2,846% 11/1/2022	67.320	0,01
GBP 1.700.000	Taurus Dac '2017-UK2 A' RegS FRN 17/11/2027	1.949.199	0,43	JPY 100.000.000	Tohoku Electric Power Co Inc RegS 3/12/2020 (Zero Coupon)	787.103	0,17
GBP 100.000	Taurus Dac '2017-UK2 B' RegS FRN 17/11/2027	114.853	0,03			1.432.024	0,32
GBP 103.000	Taurus Dac '2017-UK2 C' RegS FRN 17/11/2027	118.334	0,03	Jersey			
		6.214.565	1,38	GBP 865.000	AA Bond Co Ltd RegS 2,75% 31/7/2023	948.505	0,21
Île de Man				EUR 650.000	Glencore Finance Europe Ltd RegS 2,75% 1/4/2021	689.494	0,15
USD 220.000	Gohl Capital Ltd RegS 4,25% 24/1/2027	182.828	0,04	EUR 250.000	Glencore Finance Europe Ltd RegS 1,875% 13/9/2023	258.857	0,06
		182.828	0,04			1.896.856	0,42
Italie				Liban			
EUR 8.503	Asset-Backed European Securitisation Transaction Ten Srl 'A' RegS FRN 10/12/2028	8.504	0,00	USD 140.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,10% 4/10/2022	109.492	0,02
EUR 100.000	Assicurazioni Generali SpA RegS 2,875% 14/1/2020	104.238	0,02	USD 106.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,25% 4/11/2024	79.035	0,02
EUR 300.000	Assicurazioni Generali SpA RegS 4,125% 4/5/2026	321.368	0,07	USD 50.000	Lebanon Government International Bond RegS 6,85% 23/3/2027	36.315	0,01
EUR 200.000	Assicurazioni Generali SpA RegS FRN 12/12/2042	241.326	0,06			224.842	0,05
EUR 200.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA RegS FRN 18/1/2028	170.098	0,04	Luxembourg			
EUR 500.000	Driver Italia One SRL 'A' RegS FRN 21/4/2029	500.861	0,11	USD 154.000	Allergan Funding SCS 3,45% 15/3/2022	130.548	0,03
EUR 100.000	Driver Italia One SRL 'B' RegS FRN 21/4/2029	99.972	0,02	EUR 150.000	Allergan Funding SCS 2,125% 1/6/2029	145.142	0,03
GBP 100.000	Enel SpA RegS 5,75% 22/6/2037	142.880	0,03	EUR 300.000	Aroundtown SA RegS 2,125% 13/3/2023	314.664	0,07
USD 100.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 6,50% 24/2/2021	90.436	0,02	GBP 600.000	Compartment Driver UK Five 'B' RegS FRN 25/7/2025	684.447	0,15
USD 1.100.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5,017% 26/6/2024	861.225	0,19	GBP 2.696.920	Compartment Driver UK Four 'B' RegS FRN 25/3/2025	3.088.283	0,68
USD 325.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 4,375% 12/1/2048	221.229	0,05	GBP 5.062.661	Compartment Driver UK Six 'A' RegS FRN 25/2/2026	5.773.065	1,28
EUR 500.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,75% 20/3/2028	456.425	0,10	EUR 1.000.000	Compartment VCL 25 'B' RegS FRN 21/9/2023	1.000.665	0,22
EUR 300.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	314.250	0,07	EUR 1.421.000	European Financial Stability Facility RegS 0,40% 17/2/2025	1.422.421	0,31
EUR 400.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	443.140	0,10	EUR 1.540.000	European Financial Stability Facility RegS 0,875% 26/7/2027	1.561.160	0,35
EUR 2.576.913	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 23/4/2020	2.612.989	0,58	USD 182.000	Gilex Holding Sarl '144A' 8,50% 2/5/2023	159.726	0,04
EUR 587.119	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,25% 27/10/2020	592.039	0,13	EUR 150.000	Novartis Finance SA RegS 31/3/2021 (Zero Coupon)	150.250	0,03
EUR 100.000	Taurus SRL '2018-IT1 A' FRN 18/5/2030	100.170	0,02	EUR 125.000	Prologis International Funding II SA RegS 1,75% 15/3/2028	125.389	0,03
USD 750.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5,303% 30/5/2024	635.648	0,14	USD 200.000	Puma International Financing SA '144A' 5,00% 24/1/2026	160.750	0,04
USD 400.000	UniCredit SpA '144A' FRN 19/6/2032	315.145	0,07	EUR 775.000	Richemont International Holding SA RegS 1,00% 26/3/2026	777.147	0,17
EUR 425.000	UniCredit SpA RegS FRN (Perpetual)	480.250	0,11	USD 209.000	Rumo Luxembourg Sarl '144A' 7,375% 9/2/2024	186.551	0,04
EUR 300.000	UniCredit SpA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	303.627	0,07	USD 200.000	Rumo Luxembourg Sarl '144A' 5,875% 18/1/2025	162.533	0,04
		9.015.820	2,00	EUR 125.000	SELP Finance Sarl RegS 1,25% 25/10/2023	125.495	0,03
				EUR 400.000	SES SA RegS FRN (Perpetual)	416.916	0,09

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Luxembourg suite				Pays-Bas suite			
GBP 1.263.218	Silver Arrow Compartment Silver Arrow UK '2017-1 A' RegS FRN 20/7/2023	1.440.734	0,32	EUR 410.000	Globaldrive Auto Receivables BV '2016-B B' RegS FRN 20/8/2024	412.176	0,09
		17.825.886	3,95	USD 225.000	Greenko Dutch BV RegS 5,25% 24/7/2024	180.315	0,04
Malaisie				EUR 300.000	ING Groep NV RegS 0,75% 9/3/2022	303.017	0,07
MYR 3.000.000	Malaysia Government Bond 3,844% 15/4/2033	588.705	0,13	USD 450.000	ING Groep NV RegS FRN 22/3/2028	384.938	0,09
		588.705	0,13	EUR 200.000	ING Groep NV RegS FRN 22/3/2030	197.878	0,04
Maurice				GBP 578.000	innogy Finance BV RegS 6,25% 3/6/2030	872.657	0,19
USD 200.000	UPL Corp Ltd RegS 4,50% 8/3/2028	165.543	0,04	EUR 300.000	JAB Holdings BV RegS 1,25% 22/5/2024	302.724	0,07
		165.543	0,04	EUR 100.000	JAB Holdings BV RegS 2,00% 18/5/2028	100.872	0,02
Mexique				USD 750.000	NXP BV Via NXP Funding LLC '144A' 4,125% 1/6/2021	651.740	0,14
USD 200.000	Axtel SAB de CV '144A' 6,375% 14/11/2024	165.644	0,04	USD 500.000	NXP BV Via NXP Funding LLC '144A' 3,875% 1/9/2022	427.252	0,09
USD 200.000	Cydsa SAB de CV '144A' 6,25% 4/10/2027	160.870	0,04	USD 54.000	Petrobras Global Finance BV 8,375% 23/5/2021	51.760	0,01
USD 200.000	Grupo KUO SAB de CV '144A' 5,75% 7/7/2027	163.069	0,04	USD 670.000	Petrobras Global Finance BV 6,125% 17/1/2022	604.492	0,13
MXN 10.200.000	Mexican Bonos 4,75% 14/6/2018	437.274	0,10	USD 1.611.000	Petrobras Global Finance BV 5,75% 1/2/2029	1.244.874	0,28
USD 200.000	Mexichem SAB de CV '144A' 5,50% 15/1/2048	147.191	0,03	USD 57.000	Petrobras Global Finance BV 6,85% 5/6/2115	42.934	0,01
USD 70.000	Petroleos Mexicanos 6,00% 5/3/2020	62.136	0,01	EUR 300.000	Repsol International Finance BV RegS FRN (Perpetual)	315.813	0,07
USD 228.000	Petroleos Mexicanos '144A' 5,35% 12/2/2028	185.508	0,04	USD 200.000	Royal Capital BV RegS 5,875% (Perpetual)	164.037	0,04
USD 94.000	Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047	77.086	0,02	USD 359.000	Syngenta Finance NV '144A' 4,441% 24/4/2023	307.921	0,07
EUR 114.000	Petroleos Mexicanos RegS 4,75% 26/2/2029	115.363	0,02	EUR 300.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	313.159	0,07
		1.514.141	0,34	EUR 200.000	Telefonica Europe BV RegS FRN (Perpetual)	206.277	0,05
Mongolie				EUR 200.000	Volkswagen International Finance NV RegS 1,875% 30/3/2027	202.390	0,05
USD 13.166	Energy Resources LLC FRN 30/9/2022	11.063	0,00	EUR 230.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	242.933	0,05
		11.063	0,00	EUR 900.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	906.633	0,20
Pays-Bas				EUR 300.000	Volkswagen International Finance NV RegS FRN (Perpetual)	302.861	0,07
EUR 200.000	ABN AMRO Bank NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	213.000	0,05	EUR 300.000	Vonovia Finance BV RegS 2,125% 22/3/2030	299.979	0,07
EUR 300.000	ABN AMRO Bank NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	291.510	0,06			14.449.985	3,20
EUR 100.000	Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd RegS FRN 1/10/2046	106.813	0,02	Nouvelle-Zélande			
EUR 116.000	ASML Holding NV RegS 1,625% 28/5/2027	119.896	0,03	EUR 105.000	Chorus Ltd RegS 1,125% 18/10/2023	106.425	0,02
USD 500.000	AT Securities BV RegS FRN (Perpetual)	406.283	0,09	NZD 500.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,50% 20/9/2040	335.117	0,07
GBP 1.900.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV RegS 1,00% 17/6/2022*	2.155.691	0,48			441.542	0,09
EUR 650.000	BMW Finance NV RegS 0,125% 3/7/2020	652.476	0,14	Norvège			
EUR 500.000	Constellium NV RegS 4,25% 15/2/2026	498.720	0,11	USD 300.000	DNB Bank ASA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	257.526	0,06
USD 75.000	Deutsche Telekom International Finance BV 6,00% 8/7/2019	66.628	0,01	EUR 155.000	Statnett SF RegS 1,25% 26/4/2030	151.660	0,03
EUR 400.000	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG RegS FRN 29/9/2047	408.092	0,09			409.186	0,09
EUR 300.000	Ferrari NV RegS 0,25% 16/1/2021	298.482	0,07	Panama			
EUR 200.000	Gas Natural Fenosa Finance BV RegS 0,875% 15/5/2025	192.762	0,04	USD 200.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA '144A' 5,625% 18/5/2036	182.637	0,04
				USD 200.000	Avianca Holdings SA Via Avianca Leasing LLC Via Grupo Taca Holdings Ltd 8,375% 10/5/2020	173.797	0,04
						356.434	0,08

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Pérou				Afrique du Sud suite			
USD 200.000	Orazul Energy Egenor S en C por A '144A' 5,625% 28/4/2027	157.061	0,03	ZAR 16.680.000	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048	1.057.367	0,23
		157.061	0,03	USD 580.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,50% 9/3/2020	514.591	0,11
Philippines				USD 181.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 30/5/2022	164.860	0,04
USD 200.000	Philippine National Bank RegS 4,25% 27/4/2023	170.579	0,04			3.095.033	0,69
USD 200.000	Rizal Commercial Banking Corp RegS 4,125% 16/3/2023	169.619	0,04	Corée du Sud			
USD 200.000	Union Bank of the Philippines RegS 3,369% 29/11/2022	164.786	0,03	USD 350.000	Export-Import Bank of Korea 3,00% 1/11/2022	292.993	0,06
		504.984	0,11	USD 275.000	Hyundai Capital Services Inc RegS 3,00% 29/8/2022	227.624	0,05
Portugal				KRW 400.000.000	Kakao Corp RegS 11/5/2021 (Zero Coupon)	321.209	0,07
EUR 687.875	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Via Volta IV 2,423% 12/2/2021	705.318	0,16	USD 200.000	KDB Life Insurance Co Ltd RegS FRN 21/5/2048	166.834	0,04
EUR 464.517	Volta Electricity Receivables RegS 0,85% 12/2/2022	466.834	0,10	USD 275.000	Woori Bank RegS FRN (Perpetual)	229.236	0,05
		1.172.152	0,26			1.237.896	0,27
Qatar				Espagne			
USD 426.000	Qatar Government International Bond '144A' 3,875% 23/4/2023	365.847	0,08	EUR 400.000	Amadeus Capital Markets SAU RegS 19/5/2019 (Zero Coupon)	400.392	0,09
USD 225.000	Qatar Government International Bond RegS 4,50% 23/4/2028	194.315	0,04	EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentina SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	206.128	0,05
USD 550.000	Qatar Government International Bond RegS 5,103% 23/4/2048	471.748	0,11	EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentina SA RegS FRN (Perpetual)	227.004	0,05
		1.031.910	0,23	EUR 200.000	Banco de Sabadell SA RegS 0,875% 5/3/2023	195.516	0,04
Russie				EUR 400.000	Banco de Sabadell SA RegS 5,625% 6/5/2026	461.672	0,10
USD 1.400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,75% 27/5/2026	1.212.076	0,27	EUR 200.000	Banco de Sabadell SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	203.118	0,04
USD 1.600.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 4,25% 23/6/2027	1.333.735	0,29	EUR 200.000	Banco Santander SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	205.101	0,05
USD 200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond RegS 5,25% 23/6/2047	163.498	0,04	EUR 600.000	Banco Santander SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	559.002	0,12
		2.709.309	0,60	EUR 400.000	Bankia SA RegS FRN 15/3/2027	411.740	0,09
Arabie Saoudite				EUR 200.000	Bankia SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	204.032	0,05
USD 385.000	Saudi Government International Bond RegS 4,00% 17/4/2025	329.191	0,07	EUR 600.000	CaixaBank SA RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	644.178	0,14
USD 740.000	Saudi Government International Bond RegS 5,00% 17/4/2049	616.058	0,14	EUR 600.000	Driver Espana Four FT 'B' RegS FRN 21/4/2028	603.231	0,13
		945.249	0,21	EUR 100.000	Mapfre SA RegS FRN 31/3/2047	105.348	0,02
Singapour				EUR 90.000	Spain Government Bond RegS '144A' 2,70% 31/10/2048	92.003	0,02
USD 64.910	Eterna Capital Pte Ltd (Pay-in kind) 8,00% 11/12/2022	54.128	0,01	EUR 300.000	Telefonica Emisiones SAU RegS 1,715% 12/1/2028	294.021	0,07
USD 200.000	Global Prime Capital Pte Ltd RegS 7,25% 26/4/2021	173.461	0,04	EUR 1.600.000	Wizink Master Credit Cards FT 2017-3 'A' FRN 26/12/2031	1.603.747	0,36
USD 200.000	Medco Straits Services Pte Ltd RegS 8,50% 17/8/2022	180.025	0,04			6.416.233	1,42
USD 200.000	Modernland Overseas Pte Ltd RegS 6,95% 13/4/2024	158.134	0,03	Sri Lanka			
USD 200.000	United Overseas Bank Ltd RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	160.709	0,04	LKR 28.000.000	Sri Lanka Government Bonds 11,75% 15/6/2027	161.636	0,03
		726.457	0,16	LKR 18.000.000	Sri Lanka Government Bonds 11,50% 1/9/2028	102.874	0,02
Afrique du Sud				USD 200.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 5,75% 18/4/2023	169.946	0,04
ZAR 4.479.000	Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035	294.801	0,07	USD 730.000	Sri Lanka Government International Bond RegS 6,75% 18/4/2028	621.908	0,14
ZAR 12.788.000	Republic of South Africa Government Bond 6,25% 31/3/2036	643.422	0,14			1.056.364	0,23
ZAR 1.327.000	Republic of South Africa Government Bond 8,50% 31/1/2037	83.678	0,02				
ZAR 6.780.000	Republic of South Africa Government Bond 6,50% 28/2/2041	336.314	0,08				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Supranational				Royaume-Uni			
GBP 1.073.000	Council Of Europe Development Bank RegS 0,625% 15/6/2022	1.202.475	0,26	USD 400.000	Anglo American Capital Plc '144A' 3,625% 11/9/2024	327.311	0,07
GBP 1.080.000	European Investment Bank RegS 0,875% 15/12/2023	1.203.568	0,27	EUR 200.000	Anglo American Capital Plc RegS 3,50% 28/3/2022	220.153	0,05
		2.406.043	0,53	EUR 100.000	Anglo American Capital Plc RegS 3,25% 3/4/2023	110.070	0,02
Suède				EUR 275.000	Anglo American Capital Plc RegS 1,625% 18/9/2025	274.211	0,06
EUR 300.000	Nordea Bank AB RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	276.339	0,06	GBP 400.000	Annington Funding Plc RegS 3,935% 12/7/2047	483.659	0,11
EUR 300.000	Ovako AB 5,00% 5/10/2022	306.675	0,07	USD 30.000	Aon Plc 2,80% 15/3/2021	25.378	0,01
USD 200.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	166.774	0,04	GBP 290.000	Aviva Plc RegS FRN 14/11/2036	377.212	0,08
		749.788	0,17	USD 200.000	Barclays Bank Plc 5,125% 8/1/2020	177.115	0,04
Suisse				USD 300.000	Barclays Plc 5,20% 12/5/2026	253.430	0,06
USD 685.000	Credit Suisse AG RegS 6,50% 8/8/2023	630.290	0,14	USD 275.000	Barclays Plc FRN 16/5/2029	235.743	0,05
USD 250.000	Credit Suisse Group AG '144A' 4,282% 9/1/2028	209.181	0,05	GBP 755.000	Barclays Plc 3,25% 17/1/2033	811.240	0,18
USD 422.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 12/1/2029	340.844	0,08	EUR 200.000	Barclays Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	223.686	0,05
USD 200.000	Credit Suisse Group AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	170.874	0,04	EUR 200.000	Barclays Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	207.557	0,05
USD 400.000	Credit Suisse Group AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	360.654	0,08	GBP 320.000	Barclays Plc RegS 3,25% 12/2/2027	360.030	0,08
USD 300.000	Credit Suisse Group AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	262.982	0,06	EUR 598.000	Barclays Plc RegS FRN 7/2/2028	578.529	0,13
EUR 187.000	UBS AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN 12/2/2026	203.929	0,04	USD 200.000	Barclays Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	179.859	0,04
USD 500.000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 2,95% 24/9/2020	426.573	0,09	GBP 250.000	Barclays Plc RegS FRN (Perpetual)	299.634	0,07
USD 200.000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 3,00% 15/4/2021	169.468	0,04	GBP 200.000	BAT International Finance Plc RegS 4,00% 4/9/2026	250.503	0,06
USD 500.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	444.812	0,10	EUR 465.000	BAT International Finance Plc RegS 2,25% 16/1/2030	465.351	0,10
USD 870.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	674.966	0,15	GBP 300.000	BAT International Finance Plc RegS 6,00% 24/11/2034	462.992	0,10
EUR 400.000	Zuercher Kantonalbank RegS FRN 15/6/2027	414.636	0,09	GBP 3.290.000	Bavarian Sky UK 1 Plc 'A' RegS FRN 20/11/2025	3.749.474	0,83
		4.309.209	0,96	GBP 243.540	Brass No 3 Plc 'A' RegS FRN 16/4/2051	278.221	0,06
Taiwan				EUR 275.000	British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024	270.850	0,06
USD 100.000	Neo Solar Power Corp RegS 27/10/2019 (Zero Coupon)	84.031	0,02	GBP 1.525.000	British Telecommunications Plc RegS 5,75% 7/12/2028	2.158.637	0,48
		84.031	0,02	GBP 415.000	British Telecommunications Plc RegS 3,125% 21/11/2031	463.188	0,10
Thaïlande				EUR 84.080	Brunel Residential Mortgage Securitisation No 1 Plc '2007-1X A4A' RegS FRN 13/1/2039	84.070	0,02
USD 200.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd RegS FRN (Perpetual)	165.901	0,04	GBP 400.000	Bumper 8 UK Finance Plc 'B' RegS FRN 20/11/2027	456.771	0,10
		165.901	0,04	GBP 610.000	BUPA Finance Plc RegS 5,00% 8/12/2026	766.757	0,17
Turquie				GBP 550.000	Cadent Finance Plc RegS 2,75% 22/9/2046	574.865	0,13
USD 200.000	Petkim Petrokimya Holding AS '144A' 5,875% 26/1/2023	162.211	0,04	GBP 845.000	Centrica Plc RegS 4,375% 13/3/2029	1.105.882	0,24
USD 265.000	Turkey Government International Bond 6,25% 26/9/2022	232.272	0,05	EUR 850.000	Centrica Plc RegS FRN 10/4/2076	871.862	0,19
		394.483	0,09	EUR 325.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	332.928	0,07
Émirats arabes unis				EUR 225.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	237.038	0,05
USD 325.000	Abu Dhabi Government International Bond RegS 4,125% 11/10/2047	258.537	0,06	GBP 175.000	Channel Link Enterprises Finance Plc RegS FRN 30/6/2050	199.579	0,04
		258.537	0,06	GBP 2.978.416	Charter Mortgage Funding Plc '2017-1 A' FRN 12/6/2054	3.401.941	0,75
				GBP 220.000	Coventry Building Society RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	259.106	0,06
				GBP 4.964.000	Delamare Cards MTN Issuer Plc '2017-1 A1' FRN 19/10/2022	5.671.134	1,26
				EUR 1.075.000	DS Smith Plc RegS 1,375% 26/7/2024	1.074.683	0,24
				GBP 6.721	E-CARAT 5 Plc 'A' RegS FRN 18/4/2023	7.668	0,00
				GBP 2.877.000	E-CARAT 8 Plc 'B' RegS FRN 8/3/2024	3.282.386	0,73

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
GBP 1.167.468	E-CARAT 9 Plc 'A' RegS FRN 18/1/2025	1.330.136	0,29	GBP 600.000	Liberty Living Finance Plc RegS 3,375% 28/11/2029	697.837	0,15
GBP 1.000.000	EE Finance Plc RegS 4,375% 28/3/2019	1.171.179	0,26	USD 570.000	Lloyds Banking Group Plc 4,45% 8/5/2025	494.093	0,11
GBP 1.889.060	Feldspar Plc '2016-1 A' RegS FRN 15/9/2045	2.167.741	0,48	GBP 200.000	Lloyds Banking Group Plc RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	236.046	0,05
GBP 1.165.573	Finsbury Square Plc '2016-2 A' RegS FRN 16/8/2058	1.336.368	0,30	USD 281.000	MARB BondCo Plc '144A' 6,875% 19/1/2025	225.374	0,05
GBP 1.777.336	Finsbury Square Plc '2017-1 A' RegS FRN 12/3/2059	2.032.984	0,45	GBP 33.631	Marketplace Originated Consumer Assets Plc '2016-1 A' RegS FRN 20/10/2024	38.431	0,01
GBP 700.984	Finsbury Square Plc '2017-1 B' RegS FRN 12/3/2059	807.139	0,18	GBP 405.000	Mitchells & Butlers Finance Plc RegS FRN 15/9/2034	383.048	0,08
GBP 99.998	Finsbury Square Plc '2017-1 C' RegS FRN 12/3/2059	115.536	0,03	GBP 288.000	Motor Plc '2016-1 C' RegS 3,75% 25/11/2025	333.416	0,07
GBP 2.810.000	Finsbury Square Plc '2018-1 A' RegS FRN 12/9/2065	3.211.374	0,71	GBP 300.000	Nationwide Building Society RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	353.739	0,08
GBP 1.489.913	Friary No 4 Plc 'A' RegS FRN 21/1/2050	1.699.743	0,38	GBP 165.000	Newday Funding Plc '2017-1 B' RegS FRN 15/7/2025	188.811	0,04
GBP 13.781	Gemgarto Plc '2015-1 A' RegS FRN 16/2/2047	15.743	0,00	GBP 100.000	Newday Funding Plc '2017-1 C' RegS FRN 15/7/2025	115.172	0,03
GBP 43.593	Gemgarto Plc '2015-2 A' RegS FRN 16/2/2054	49.900	0,01	GBP 100.000	Newday Funding Plc '2017-1 D' RegS FRN 15/7/2025	114.861	0,03
EUR 360.000	GlaxoSmithKline Capital Plc RegS 1,75% 21/5/2030	368.563	0,08	EUR 37.735	Newgate Funding Plc '2006-1 BB' RegS FRN 1/12/2050	35.896	0,01
GBP 1.437.300	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2016-AA' RegS FRN 20/9/2024	1.640.097	0,36	EUR 1.075.000	Nomad Foods Bondco Plc RegS 3,25% 15/5/2024	1.084.879	0,24
GBP 402.000	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2017-A B' RegS FRN 20/6/2025	457.208	0,10	GBP 1.849.284	Oat Hill No 1 Plc 'A' RegS FRN 25/2/2046	2.108.388	0,47
GBP 490.000	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2018-AA' RegS FRN 20/6/2026	559.639	0,12	EUR 1.295.000	Paragon Mortgages No 10 Plc '10X A2B' RegS FRN 15/6/2041	1.263.957	0,28
GBP 165.000	Globaldrive Auto Receivables UK Plc '2018-A B' RegS FRN 20/6/2026	188.195	0,04	EUR 41.367	Paragon Mortgages No 11 Plc '11X BB' RegS FRN 15/10/2041	39.461	0,01
GBP 10.298	Gosforth Funding Plc '2014-1 A1' RegS FRN 19/10/2056	11.753	0,00	EUR 50.000	Paragon Mortgages No 12 Plc '12X B1B' RegS FRN 15/11/2038	47.885	0,01
USD 1.804.507	Gosforth Funding Plc '2017-1A A1A' '144A' FRN 19/12/2059	1.550.344	0,34	USD 161.192	Paragon Mortgages No 13 Plc '13X A2C' RegS FRN 15/1/2039	132.828	0,03
GBP 2.700.000	Gosforth Funding Plc '2017-1X A2' RegS FRN 19/12/2059	3.091.370	0,69	EUR 150.000	Paragon Mortgages No 13 Plc '13X B1B' RegS FRN 15/1/2039	141.522	0,03
GBP 290.000	Great Hall Mortgages No 1 Plc '2007-2X BA' RegS FRN 18/6/2039	300.638	0,07	EUR 300.000	Paragon Mortgages No 14 Plc '14X BB' RegS FRN 15/9/2039	272.311	0,06
GBP 547.379	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	628.364	0,14	GBP 362.537	Paragon Mortgages No 23 Plc 'A2' RegS FRN 15/5/2043	414.769	0,09
GBP 231.292	Greene King Finance Plc RegS 4,064% 15/3/2035	284.750	0,06	GBP 199.068	Paragon Mortgages No 24 Plc 'A2' RegS FRN 15/7/2043	228.058	0,05
USD 3.500.000	Holmes Master Issuer Plc '2011-3A A6' '144A' FRN 15/10/2054	3.030.654	0,67	GBP 400.000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'A' RegS FRN 15/5/2050	456.395	0,10
GBP 214.000	Holmes Master Issuer Plc '2018-1X A3' RegS FRN 15/10/2054	243.865	0,05	GBP 100.000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'B' RegS FRN 15/5/2050	114.435	0,03
EUR 200.000	HSBC Bank Plc RegS 3,875% 24/10/2018	203.252	0,05	GBP 1.218.000	PCL Funding II Plc '2017-1 A' RegS FRN 15/6/2022	1.396.169	0,31
USD 1.000.000	HSBC Holdings Plc 3,40% 8/3/2021	859.810	0,19	GBP 348.000	PCL Funding II Plc '2017-1 B' RegS FRN 15/6/2022	399.902	0,09
USD 500.000	HSBC Holdings Plc 4,25% 14/3/2024	431.985	0,10	GBP 255.000	PCL Funding II Plc '2017-1 C' RegS FRN 15/6/2022	293.249	0,06
USD 200.000	HSBC Holdings Plc FRN 18/5/2024	172.278	0,04	GBP 425.000	Prs Finance Plc RegS 1,75% 24/11/2026	491.395	0,11
USD 380.000	HSBC Holdings Plc 4,375% 23/11/2026	322.014	0,07	GBP 295.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'B' RegS FRN 20/12/2046	341.147	0,08
USD 425.000	HSBC Holdings Plc FRN (Perpetual)	346.978	0,08	GBP 100.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'C' RegS FRN 20/12/2046	115.673	0,03
USD 300.000	HSBC Holdings Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	258.443	0,06	GBP 220.000	Residential Mortgage Securities 30 Plc 'B' RegS FRN 20/3/2050	253.035	0,06
GBP 1.765.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN 13/11/2026	1.952.645	0,43	GBP 438.856	Ripon Mortgages Plc '1X A1' RegS FRN 20/8/2056	503.357	0,11
EUR 250.000	HSBC Holdings Plc RegS FRN (Perpetual)	254.375	0,06	GBP 3.850.000	Ripon Mortgages Plc '1X B1' RegS FRN 20/8/2056	4.436.412	0,98
EUR 354.000	Imperial Brands Finance Plc RegS 3,375% 26/2/2026	397.362	0,09	GBP 822.000	Ripon Mortgages Plc '1X C1' RegS FRN 20/8/2056	947.401	0,21
GBP 1.953.180	Kenrick No 3 Plc 'A' FRN 11/10/2054	2.225.792	0,49				
GBP 375.000	Lanark Master Issuer Plc '2014-2X 2A' RegS FRN 22/12/2054	429.494	0,10				
GBP 175.000	Lanark Master Issuer Plc '2015-1X 1A' RegS FRN 22/12/2054	199.928	0,04				
GBP 1.065.000	LOR Finance Plc RegS 4,50% 7/12/2028	1.545.848	0,34				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Etats-Unis suite			
GBP 1.505.995	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS4X A3A' RegS FRN 12/6/2044	1.661.925	0,37	USD 45.000	Abbott Laboratories 3,25% 15/4/2023	38.145	0,01
GBP 1.200.000	Rolls-Royce Plc 6,75% 30/4/2019	1.440.128	0,32	USD 500.000	Abbott Laboratories 3,75% 30/11/2026	424.835	0,09
USD 341.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 15/5/2023	296.332	0,07	USD 35.000	AbbVie Inc 2,90% 6/11/2022	29.334	0,01
USD 400.000	Royal Bank of Scotland Group Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	371.626	0,08	USD 10.000	Aetna Inc 2,20% 15/3/2019	8.551	0,00
USD 200.000	Royal Bank of Scotland Group Plc (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	185.966	0,04	USD 14.000	AHS Hospital Corp 5,024% 1/7/2045	13.718	0,00
EUR 275.000	Royal Bank of Scotland Group Plc RegS FRN 2/3/2026	270.999	0,06	USD 100.000	AIG Global Funding '144A' 1,95% 18/10/2019	84.723	0,02
USD 75.000	Santander UK Group Holdings Plc 3,125% 8/1/2021	63.813	0,01	USD 55.000	Air Lease Corp 2,625% 1/7/2022	45.391	0,01
GBP 1.000.000	Santander UK Group Holdings Plc RegS FRN 8/5/2026	1.148.168	0,25	USD 380.000	Alameda Corridor Transportation Authority 'B' 5,00% 1/10/2035	365.944	0,08
GBP 298.000	Spirit Issuer Plc RegS FRN 28/12/2031	335.484	0,07	USD 20.000	American Electric Power Co Inc 2,95% 15/12/2022	16.811	0,00
EUR 271.000	SSE Plc RegS 0,875% 6/9/2025	268.837	0,06	USD 60.000	American Express Co 2,50% 1/8/2022	49.530	0,01
EUR 300.000	Standard Chartered Plc RegS 1,625% 20/11/2018	302.409	0,07	USD 140.000	American Express Credit Account Master Trust '2018-5 A' FRN 15/12/2025	120.341	0,03
GBP 898.624	Stanlington No 1 Plc '2017-1 A' RegS FRN 12/6/2046	1.034.635	0,23	EUR 100.000	American International Group Inc 1,875% 21/6/2027	98.544	0,02
GBP 150.000	Stonegate Pub Co Financing Plc RegS FRN 15/3/2022	170.459	0,04	USD 5.000	American Municipal Power Inc 'B' 6,449% 15/2/2044	5.700	0,00
EUR 650.000	Thomas Cook Finance 2 Plc RegS 3,875% 15/7/2023*	665.174	0,15	USD 25.000	American Tower Corp 3,50% 31/1/2023	21.279	0,00
GBP 980.000	Tolkien Funding Sukuk No 1 Plc 'A' FRN 20/7/2052	1.120.875	0,25	USD 122.495	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2016-2 A3' 1,60% 9/11/2020	104.856	0,02
GBP 977.244	Towd Point Mortgage Funding Auburn 11 Plc '2017-A11X A1' RegS FRN 20/5/2045	1.118.718	0,25	USD 30.000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2017-1 A3' 1,87% 18/8/2021	25.566	0,01
GBP 430.000	Tower Bridge Funding No.1 Plc 'A' RegS FRN 20/3/2056	492.687	0,11	USD 220.000	AmeriGas Partners LP Via AmeriGas Finance Corp 5,50% 20/5/2025	185.041	0,04
GBP 841.494	Turbo Finance 5 Plc 'B' RegS FRN 20/8/2021	960.314	0,21	USD 300.000	AmeriGas Partners LP Via AmeriGas Finance Corp 5,75% 20/5/2027	244.604	0,05
GBP 935.666	Turbo Finance 7 Plc 'A1' RegS FRN 20/6/2023	1.068.519	0,24	USD 10.000	Amgen Inc 2,65% 11/5/2022	8.339	0,00
GBP 1.025.000	Turbo Finance 7 Plc 'B' RegS FRN 20/6/2023	1.178.877	0,26	USD 700.000	Amgen Inc 3,625% 15/5/2022	605.316	0,13
GBP 732.800	Unique Pub Finance Co Plc /The RegS 6,542% 30/3/2021	883.083	0,20	USD 80.000	Analog Devices Inc 2,50% 5/12/2021	66.803	0,02
GBP 699.803	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 10/8/2048	1.327.976	0,29	USD 203.000	Analog Devices Inc 4,50% 5/12/2036	174.515	0,04
GBP 300.000	United Kingdom Gilt RegS 1,625% 22/10/2071	359.156	0,08	USD 26.000	Andeavor Logistics LP Via Tesoro Logistics Finance Corp 6,25% 15/10/2022	23.291	0,01
GBP 620.000	University of Oxford RegS 2,544% 8/12/2117	715.730	0,16	USD 30.000	Andeavor Logistics LP Via Tesoro Logistics Finance Corp 3,50% 1/12/2022	25.373	0,01
USD 310.000	Vodafone Group Plc 3,75% 16/1/2024	265.368	0,06	USD 399.000	Andeavor Logistics LP Via Tesoro Logistics Finance Corp 5,20% 1/12/2047	341.199	0,08
USD 270.000	Vodafone Group Plc 4,125% 30/5/2025	232.265	0,05	USD 25.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3,30% 1/2/2023	21.376	0,00
USD 265.000	Vodafone Group Plc 5,25% 30/5/2048	231.567	0,05	USD 30.000	Anthem Inc 2,50% 21/11/2020	25.373	0,01
GBP 500.000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'B' RegS FRN 21/9/2049	573.313	0,13	USD 40.000	Apache Corp 3,25% 15/4/2022	33.991	0,01
GBP 300.000	Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc 'C' RegS FRN 21/9/2049	346.369	0,08	USD 700.000	Ares Capital Corp 3,50% 10/2/2023	575.655	0,13
GBP 100.000	Westfield Stratford City Finance Plc RegS FRN 4/11/2019	114.313	0,03	USD 700.000	Ares Capital Corp 4,25% 1/3/2025	584.954	0,13
		105.368.627	23,36	USD 105.000	AT&T Inc 3,60% 17/2/2023	89.637	0,02
Etats-Unis				USD 71.000	AT&T Inc 5,25% 1/3/2037	62.176	0,01
USD 2.150.000	245 Park Avenue Trust '2017-245P E' '144A' FRN 5/6/2037	1.705.574	0,38	USD 194.000	AT&T Inc 4,75% 15/5/2046	154.507	0,03
				USD 50.000	Aviation Capital Group LLC '144A' 2,875% 20/1/2022	41.750	0,01
				USD 700.000	Aviation Capital Group LLC '144A' 3,875% 1/5/2023	600.746	0,13
				USD 51.000	AXA Equitable Holdings Inc '144A' 3,90% 20/4/2023	43.768	0,01
				USD 140.000	BA Credit Card Trust '2018-A2 A2' 3,00% 15/9/2023	120.615	0,03
				USD 45.000	Baker Hughes a GE Co LLC Via Baker Hughes Co-Obligor Inc 2,773% 15/12/2022	37.730	0,01

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

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 240.000	Bank of America Corp FRN 1/10/2021	201.835	0,04	USD 290.000	California Health Facilities Financing Authority 'A' 5,00% 15/8/2047	278.857	0,06
USD 70.000	Bank of America Corp 2,503% 21/10/2022	57.638	0,01	USD 350.000	California Municipal Finance Authority 'A' 5,00% 1/2/2028	347.876	0,08
USD 40.000	Bank of America Corp 3,30% 11/1/2023	34.024	0,01	USD 430.000	California Municipal Finance Authority 'A' 5,00% 1/2/2029	425.256	0,09
USD 300.000	Bank of America Corp FRN 5/3/2024	255.346	0,06	USD 350.000	California Pollution Control Financing Authority '144A' 5,00% 21/11/2045	320.414	0,07
USD 359.000	Bank of America Corp 3,95% 21/4/2025	302.292	0,07	USD 150.000	California State Public Works Board 'G2' 8,361% 1/10/2034	191.678	0,04
USD 400.000	Bank of America Corp FRN 23/1/2026	331.833	0,07	USD 45.000	Capital One Financial Corp 3,05% 9/3/2022	37.895	0,01
EUR 322.000	Bank of America Corp RegS FRN 7/2/2022	324.545	0,07	USD 140.000	Capital One Multi-Asset Execution Trust '2018-A2 A2' FRN 16/3/2026	120.248	0,03
EUR 100.000	Bank of America Corp RegS FRN 4/5/2027	101.378	0,02	USD 170.000	CarMax Auto Owner Trust '2018-2 A3' 2,98% 17/1/2023	146.059	0,03
USD 955.000	BAT Capital Corp '144A' 2,297% 14/8/2020	804.029	0,18	USD 35.000	Caterpillar Financial Services Corp 1,70% 9/8/2021	28.784	0,01
USD 490.000	BAT Capital Corp '144A' 2,764% 15/8/2022	405.880	0,09	USD 600.000	CDW LLC Via CDW Finance Corp 5,00% 1/9/2025	510.604	0,11
USD 700.000	BAT Capital Corp '144A' 3,222% 15/8/2024	573.965	0,13	USD 20.000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 'S1' 5,00% 1/11/2050	19.309	0,00
EUR 175.000	BAT Capital Corp RegS 1,125% 16/11/2023	176.408	0,04	USD 6.034.750	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 XA' FRN 10/5/2058	531.712	0,12
USD 500.000	Baxter International Inc 2,60% 15/8/2026	393.241	0,09	USD 160.000	CGBAM Commercial Mortgage Trust '2015-SMRT A' 2,808% 10/4/2028	137.269	0,03
USD 305.000	Bay Area Toll Authority 'S1' 6,918% 1/4/2040	363.629	0,08	USD 100.000	CGDBB Commercial Mortgage Trust '2017-BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	86.010	0,02
USD 10.000	Bay Area Toll Authority 'S1' 7,043% 1/4/2050	12.835	0,00	USD 135.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital 3,579% 23/7/2020	116.158	0,03
USD 135.000	Baylor Scott & White Holdings 4,185% 15/11/2045	118.201	0,03	USD 1.000.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital 4,464% 23/7/2022	876.531	0,19
USD 30.000	BB&T Corp 2,625% 29/6/2020	25.576	0,01	USD 170.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital 3,75% 15/2/2028	133.392	0,03
USD 70.000	Becton Dickinson and Co 2,404% 5/6/2020	59.063	0,01	USD 121.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital 6,484% 23/10/2045	111.482	0,02
USD 400.000	Becton Dickinson and Co FRN 29/12/2020	344.202	0,08	USD 277.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital 5,375% 1/5/2047	221.533	0,05
EUR 150.000	Belden Inc RegS 2,875% 15/9/2025*	146.788	0,03	USD 280.000	Chase Issuance Trust '2018-A1 A1' FRN 17/4/2023	240.350	0,05
USD 240.000	BlueLine Rental Finance Corp Via BlueLine Rental LLC '144A' 9,25% 15/3/2024	219.628	0,05	EUR 490.000	Chemours Co/The 6,125% 15/5/2023	513.814	0,11
USD 235.000	BMW US Capital LLC '144A' 3,10% 12/4/2021	201.416	0,04	EUR 425.000	Chemours Co/The 4,00% 15/5/2026	421.536	0,09
USD 60.000	Boston Properties LP 5,625% 15/11/2020	54.226	0,01	USD 220.000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5,00% 1/7/2041	212.544	0,05
USD 500.000	Boston Scientific Corp 3,85% 15/5/2025	427.811	0,10	USD 25.000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5,00% 1/7/2051	23.639	0,01
USD 131.000	Broadcom Corp Via Broadcom Cayman Finance Ltd 3,00% 15/1/2022	109.774	0,02	EUR 350.000	Chubb INA Holdings Inc 2,50% 15/3/2038	353.889	0,08
USD 10.000	Broadcom Corp Via Broadcom Cayman Finance Ltd 2,65% 15/1/2023	8.144	0,00	USD 100.000	Citibank Credit Card Issuance Trust '2018-A3 A3' 3,29% 23/5/2025	86.673	0,02
USD 1.000.000	Broadcom Corp Via Broadcom Cayman Finance Ltd 3,625% 15/1/2024	835.712	0,19	USD 250.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SHP2 A' '144A' FRN 15/7/2027	214.978	0,05
USD 895.000	Broadcom Corp Via Broadcom Cayman Finance Ltd 3,125% 15/1/2025	717.361	0,16	USD 30.000	Citigroup Inc 2,50% 29/7/2019	25.690	0,01
USD 300.000	Broadcom Corp Via Broadcom Cayman Finance Ltd 3,50% 15/1/2028	237.723	0,05	USD 145.000	Citigroup Inc 2,75% 25/4/2022	121.155	0,03
USD 400.000	Buckeye Partners LP 3,95% 1/12/2026	321.221	0,07				
USD 30.000	Buckeye Tobacco Settlement Financing Authority 'A-2' 5,875% 1/6/2047	25.747	0,01				
USD 45.000	California Health Facilities Financing Authority 'A' 5,00% 15/8/2033	45.206	0,01				

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

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 10.000	City & County of Denver Co Airport System Revenue 5,00% 15/11/2028	10.024	0,00	USD 280.000	County of Clark NV 'A' 5,00% 1/6/2043	281.314	0,06
USD 10.000	City & County of Denver Co Airport System Revenue 5,00% 15/11/2029	9.970	0,00	USD 300.000	County of Clark NV 'A' 5,00% 1/5/2048	298.996	0,07
USD 5.000	City & County of Denver Co Airport System Revenue 5,00% 15/11/2030	4.970	0,00	USD 5.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2,504% 1/10/2024	4.101	0,00
USD 170.000	City of Aurora CO Water Revenue 5,00% 1/8/2046	167.560	0,04	USD 290.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5,00% 1/10/2040	281.117	0,06
USD 290.000	City of Austin TX Water & Wastewater System Revenue 5,00% 15/11/2043	277.975	0,06	USD 5.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 'D' 3,354% 1/10/2029	4.161	0,00
USD 485.000	City of Charlotte NC Airport Revenue 5,00% 1/7/2047	481.599	0,11	USD 10.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 'D' 3,504% 1/10/2031	8.360	0,00
USD 10.000	City of Colorado Springs Co Utilities System Revenue 'A2' 5,00% 15/11/2042	10.017	0,00	USD 60.000	Cox Communications Inc '144A' 3,15% 15/8/2024	49.245	0,01
USD 325.000	City of Dallas TX Waterworks & Sewer System Revenue 'A' 5,00% 1/10/2031	322.910	0,07	USD 300.000	Cox Communications Inc '144A' 4,50% 30/6/2043	228.620	0,05
USD 280.000	City of New York NY 'F-1' 5,00% 1/4/2045	279.163	0,06	USD 250.000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2016-2A A' '144A' 2,42% 15/11/2023	214.224	0,05
USD 560.000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 'B' 5,00% 1/7/2047	539.430	0,12	USD 450.000	Crown Castle International Corp 4,875% 15/4/2022	401.845	0,09
USD 10.000	City of Riverside CA Electric Revenue 7,605% 1/10/2040	12.586	0,00	USD 350.000	Crown Castle International Corp 5,25% 15/1/2023	316.718	0,07
USD 500.000	City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue 5,00% 1/2/2048	466.556	0,10	USD 70.000	Crown Castle International Corp 3,20% 1/9/2024	57.386	0,01
USD 2.725.000	CityLine Commercial Mortgage Trust '2016-CLNE A' '144A' FRN 10/11/2031	2.273.599	0,50	USD 30.000	CSX Corp 3,70% 30/10/2020	26.152	0,01
USD 400.000	Cleveland-Cliffs Inc 5,75% 1/3/2025	328.713	0,07	USD 85.000	CVS Health Corp 3,70% 9/3/2023	72.792	0,02
USD 895.000	CLNS Trust '2017-IKPR E' '144A' FRN 11/6/2032	772.754	0,17	USD 650.000	CVS Health Corp 2,875% 1/6/2026	511.146	0,11
USD 200.000	CNH Equipment Trust '2017-C A3' 2,08% 15/2/2023	168.772	0,04	USD 280.000	CVS Health Corp 4,30% 25/3/2028	239.870	0,05
USD 215.000	Colorado Health Facilities Authority 'A' 5,25% 1/2/2031	195.244	0,04	USD 215.000	CVS Health Corp 4,78% 25/3/2038	183.855	0,04
USD 349.176	COMM Mortgage Trust '2012-CR2 ASB' 2,752% 15/8/2045	300.606	0,07	USD 340.000	Dallas Area Rapid Transit 'A' 5,00% 1/12/2041	331.124	0,07
USD 180.000	COMM Mortgage Trust '2014-PAT A' '144A' FRN 13/8/2027	154.939	0,03	USD 350.000	Dallas Area Rapid Transit 'A' 5,00% 1/12/2046	339.786	0,08
USD 681.309	COMM Mortgage Trust '2015-CR23 XA' FRN 10/5/2048	26.027	0,01	USD 880.000	Darden Restaurants Inc 3,85% 1/5/2027	733.524	0,16
USD 10.000	Commonwealth Financing Authority 4,144% 1/6/2038	8.816	0,00	USD 1.880.000	DBUBS Mortgage Trust '2017-BRBK A' '144A' 3,452% 10/10/2034	1.605.050	0,36
USD 15.000	Commonwealth Financing Authority Pennsylvania Revenue 3,864% 1/6/2038	12.875	0,00	USD 7.000	Dell International LLC Via EMC Corp '144A' 4,42% 15/6/2021	6.116	0,00
USD 170.000	Connecticut State Health & Educational Facility Authority 5,00% 1/7/2045	159.320	0,04	USD 200.000	Dell International LLC Via EMC Corp '144A' 8,35% 15/7/2046	208.708	0,05
USD 170.000	Connecticut State Health & Educational Facility Authority 'L' 5,00% 1/7/2045	160.760	0,04	USD 30.000	Delta Air Lines Inc 2,875% 13/3/2020	25.613	0,01
USD 400.000	Continental Resources Inc/OK 4,50% 15/4/2023	350.565	0,08	USD 45.000	Delta Air Lines Inc 2,60% 4/12/2020	37.984	0,01
USD 300.000	Contra Costa Community College District 6,504% 1/8/2034	327.849	0,07	USD 299.000	Delta Air Lines Inc 3,40% 19/4/2021	257.130	0,06
USD 300.000	Core Industrial Trust '2015-TEXW A' '144A' 3,077% 10/2/2034	256.910	0,06	USD 33.571	Delta Air Lines Pass Through Trust '2012-1B B' '144A' 6,875% 7/5/2019	29.614	0,01
USD 11.600.000	Core Industrial Trust '2015-WEST XA' '144A' FRN 10/2/2037	551.953	0,12	USD 40.000	Devon Energy Corp 3,25% 15/5/2022	33.972	0,01
USD 50.000	Corning Inc 4,25% 15/8/2020	43.900	0,01	EUR 525.000	Digital Euro Finco LLC RegS 2,625% 15/4/2024	559.335	0,12
USD 180.000	Corning Inc 4,375% 15/11/2057	137.614	0,03	GBP 400.000	Digital Stout Holding LLC RegS 4,75% 13/10/2023	508.898	0,11
USD 290.000	County of Anne Arundel MD 5,00% 1/10/2047	290.692	0,06	EUR 100.000	Discovery Communications LLC 1,90% 19/3/2027	98.344	0,02
				USD 290.000	District of Columbia 'D' 5,00% 1/6/2042	287.690	0,06
				USD 15.000	Dow Chemical Co/The 4,25% 15/11/2020	13.235	0,00
				USD 50.000	Drive Auto Receivables Trust '2017-2 B' 2,25% 15/6/2021	42.816	0,01
				USD 70.000	Duke Energy Corp 1,80% 1/9/2021	57.382	0,01
				USD 25.000	Duke Energy Corp 2,40% 15/8/2022	20.700	0,00
				GBP 1.200.000	DXC Technology Co 2,75% 15/1/2025	1.378.965	0,31
				USD 650.000	DXC Technology Co 4,75% 15/4/2027	571.376	0,13

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 30.000	E*TRADE Financial Corp 2,95% 24/8/2022	25.132	0,01	EUR 2.300.000	Ford Motor Credit Co LLC FRN 14/5/2021	2.297.286	0,51
USD 35.000	Enbridge Energy Partners LP 5,20% 15/3/2020	31.015	0,01	USD 348.009	Freddie Mac Gold Pool 3,00% 1/8/2030	298.048	0,07
USD 300.000	Energizer Holdings Inc '144A' 5,50% 15/6/2025	253.652	0,06	USD 4.881.700	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K041 X1' FRN 25/10/2024	125.528	0,03
USD 50.000	Energy Transfer Partners LP 4,15% 1/10/2020	43.604	0,01	USD 23.216.775	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K064 X1' FRN 25/3/2027	900.881	0,20
USD 20.000	Energy Transfer Partners LP 3,60% 1/2/2023	16.846	0,00	USD 5.502.568	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K718 X1' FRN 25/1/2022	93.020	0,02
USD 250.000	Energy Transfer Partners LP 5,15% 1/2/2043	193.679	0,04	USD 804.191	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KW01 X1' FRN 25/1/2026	40.383	0,01
USD 75.000	Energy Transfer Partners LP Via Regency Energy Finance Corp 5,75% 1/9/2020	67.192	0,02	USD 348.091	Freddie Mac REMICS '4253 PA' 3,50% 15/8/2041	301.516	0,07
USD 230.000	Enterprise Fleet Financing LLC '2016-2 A3' '144A' 2,04% 22/2/2022	194.823	0,04	USD 43.966	Freddie Mac REMICS '4274 PN' 3,50% 15/10/2035	38.300	0,01
USD 166.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 16/8/2077	134.635	0,03	USD 364.530	Freddie Mac REMICS '4293 MP' 4,00% 15/4/2054	321.072	0,07
USD 288.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 15/2/2078	231.922	0,05	USD 178.849	Freddie Mac REMICS '4314 LP' 3,50% 15/7/2043	155.655	0,03
USD 30.000	EOG Resources Inc 2,45% 1/4/2020	25.598	0,01	USD 169.872	Freddie Mac REMICS '4390 CA' 3,50% 15/6/2050	148.146	0,03
USD 185.000	EP Energy LLC Via Everest Acquisition Finance Inc '144A' 8,00% 15/2/2025	115.511	0,03	USD 251.846	Freddie Mac REMICS '4446 MA' 3,50% 15/12/2050	219.670	0,05
EUR 650.000	Equinix Inc 2,875% 1/10/2025	626.190	0,14	USD 84.838	Freddie Mac REMICS '4459 BN' 3,00% 15/8/2043	72.448	0,02
USD 5.000	Eversource Energy 2,75% 15/3/2022	4.202	0,00	USD 46.718	Freddie Mac REMICS '4482 DH' 3,00% 15/6/2042	40.128	0,01
USD 35.000	Exelon Corp 2,45% 15/4/2021	29.303	0,01	USD 63.330	Freddie Mac REMICS '4493 PA' 3,00% 15/2/2044	54.073	0,01
USD 25.000	Exelon Generation Co LLC 5,20% 1/10/2019	22.080	0,01	USD 75.810	Freddie Mac REMICS '4494 KA' 3,75% 15/10/2042	66.530	0,01
USD 21.386	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C02 1M1' FRN 25/5/2024	18.397	0,00	USD 57.651.121	FREMF Mortgage Trust '2015-K151 X2A' '144A' FRN 25/4/2030	360.993	0,08
USD 173.945	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C04 2M1' FRN 25/11/2029	149.993	0,03	USD 95.351.295	FREMF Mortgage Trust '2015-K718 X2A' '144A' FRN 25/2/2022	246.278	0,05
USD 243.173	Fannie Mae Pool 4,50% 1/2/2026	217.836	0,05	USD 185.000	Frontier Communications Corp '144A' 8,50% 1/4/2026	154.213	0,03
USD 132.096	Fannie Mae Pool 4,00% 1/5/2027	117.442	0,03	USD 258.039	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF AFL1' '144A' FRN 15/12/2034	221.842	0,05
USD 161.935	Fannie Mae Pool 2,50% 1/3/2030	135.991	0,03	USD 250.000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF ASX' '144A' 3,235% 15/12/2034	215.157	0,05
USD 706.205	Fannie Mae Pool 3,00% 1/12/2030	604.650	0,13	USD 50.000	GATX Corp 2,60% 30/3/2020	42.523	0,01
USD 88.279	Fannie Mae Pool 2,50% 1/4/2032	74.052	0,02	USD 35.000	General Mills Inc 3,70% 17/10/2023	30.046	0,01
USD 19.290.597	Fannie Mae-Aces '2013-M5 X2' FRN 25/1/2022	760.129	0,17	USD 127.000	General Mills Inc 4,20% 17/4/2028	107.729	0,02
USD 156.509.980	Fannie Mae-Aces '2014-M13 X2' FRN 25/8/2024	1.006.868	0,22	USD 45.000	General Motors Financial Co Inc 3,20% 6/7/2021	38.305	0,01
USD 3.890.731	Fannie Mae-Aces '2016-M4 X2' FRN 25/1/2039	312.572	0,07	USD 1.700.000	General Motors Financial Co Inc 4,375% 25/9/2021	1.496.376	0,33
EUR 175.000	Federal-Mogul LLC Via Federal-Mogul Financing Corp RegS 5,00% 15/7/2024	182.613	0,04	USD 50.000	General Motors Financial Co Inc 3,25% 5/1/2023	41.843	0,01
USD 200.000	First Data Corp '144A' 5,75% 15/1/2024	173.368	0,04	USD 320.000	General Motors Financial Co Inc 4,35% 9/4/2025	274.143	0,06
USD 25.000	FirstEnergy Corp 2,85% 15/7/2022	20.875	0,00	EUR 400.000	General Motors Financial Co Inc RegS 0,955% 7/9/2023	397.596	0,09
USD 35.000	Florida Hurricane Catastrophe Fund Finance Corp 2,995% 1/7/2020	30.200	0,01	USD 45.000	Gilead Sciences Inc 2,50% 1/9/2023	37.083	0,01
USD 90.000	Ford Credit Auto Owner Trust '2018-A A3' 3,03% 15/11/2022	77.522	0,02	USD 60.000	Golden State Tobacco Securitization Corp 'A-1' 5,125% 1/6/2047	51.497	0,01
USD 464.000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust '2013-2 A' '144A' 2,09% 15/3/2022	392.276	0,09	USD 800.000	Goldman Sachs Group Inc/The 2,75% 15/9/2020	680.274	0,15
USD 125.000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust '2015-5 A1' 2,42% 15/8/2022	105.989	0,02	USD 115.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,00% 26/4/2022	97.018	0,02
USD 250.000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust '2017-1 A1' 2,07% 15/5/2022	211.067	0,05				
USD 200.000	Ford Motor Credit Co LLC 2,459% 27/3/2020	169.127	0,04				
USD 450.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,75% 1/2/2021	407.624	0,09				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 300.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 24/7/2023	249.247	0,06	USD 750.000	Jefferies Group LLC 5,125% 20/1/2023	675.269	0,15
USD 750.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,75% 25/2/2026	627.700	0,14	USD 60.000	Jeld-Wen Inc '144A' 4,625% 15/12/2025	48.663	0,01
USD 235.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 15/5/2026	200.410	0,04	USD 50.000	John Deere Capital Corp 2,35% 8/1/2021	42.344	0,01
GBP 600.000	Goldman Sachs Group Inc/The RegS 4,25% 29/1/2026	753.530	0,17	USD 350.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2012-CIBX A4FX' '144A' 3,483% 15/6/2045	304.235	0,07
USD 184.467	Government National Mortgage Association '1999-10 ZC' 6,50% 20/4/2029	176.305	0,04	USD 200.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-C16 ASB' 3,674% 15/12/2046	174.596	0,04
USD 29.578.192	Government National Mortgage Association '2017-127 IO' FRN 16/2/2059	1.685.098	0,37	USD 157.070	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-LC11 ASB' 2,554% 15/4/2046	133.984	0,03
USD 4.526.717	Government National Mortgage Association '2017-54 IO' FRN 16/12/2058	246.472	0,05	USD 123.974	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL4 C' '144A' FRN 15/12/2030	107.209	0,02
USD 5.674.151	Government National Mortgage Association '2017-64 IO' FRN 16/11/2057	316.014	0,07	USD 989.447	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-JP4 XA' FRN 15/12/2049	35.994	0,01
USD 21.392.614	Government National Mortgage Association '2017-72 IO' FRN 16/4/2057	1.160.267	0,26	USD 130.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-WPT A' '144A' FRN 15/10/2033	112.053	0,03
USD 165.000	GRACE Mortgage Trust '2014-GRCE A' '144A' 3,369% 10/6/2028	142.673	0,03	USD 316.107	JP Morgan Mortgage Trust '2016-2 A1' '144A' FRN 25/6/2046	269.897	0,06
USD 300.000	Grant County Public Utility District No 2 4,584% 1/1/2040	270.674	0,06	USD 114.522	JP Morgan Mortgage Trust '2017-4 A6' '144A' FRN 25/11/2048	96.790	0,02
USD 100.000	Great Wolf Trust '2017-WOLF A' '144A' FRN 15/9/2034	86.044	0,02	USD 1.250.000	JPMorgan Chase & Co 2,55% 1/3/2021	1.054.538	0,23
USD 153.418	GS Mortgage Securities Corp II '2013-KING A' '144A' 2,706% 10/12/2027	131.889	0,03	USD 60.000	JPMorgan Chase & Co 2,972% 15/1/2023	50.333	0,01
USD 316.285	GS Mortgage Securities Trust '2012-GCJ7 AAB' 2,935% 10/5/2045	273.295	0,06	USD 140.000	JPMorgan Chase & Co FRN 25/4/2023	116.836	0,03
USD 35.000	Harley-Davidson Financial Services Inc '144A' 2,15% 26/2/2020	29.579	0,01	USD 580.000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	495.583	0,11
USD 60.000	Hartford Financial Services Group Inc/The 5,125% 15/4/2022	54.840	0,01	USD 355.000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2029	302.636	0,07
USD 500.000	HCA Inc 4,50% 15/2/2027	407.673	0,09	EUR 350.000	JPMorgan Chase & Co RegS 0,625% 25/1/2024	343.532	0,08
USD 175.000	Hess Corp 5,80% 1/4/2047	159.559	0,04	USD 28.000	Kaiser Foundation Hospitals 4,15% 1/5/2047	24.548	0,01
USD 50.000	Hewlett Packard Enterprise Co '144A' 2,10% 4/10/2019	42.421	0,01	USD 290.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 5,25% 1/6/2050	268.021	0,06
USD 165.000	Honda Auto Receivables Owner Trust '2018-2 A4' 3,16% 19/8/2024	142.646	0,03	USD 250.000	Keysight Technologies Inc 4,60% 6/4/2027	218.223	0,05
USD 120.000	Hospitality Mortgage Trust '2017-HIT A' '144A' FRN 8/5/2030	103.216	0,02	USD 175.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5,00% 1/3/2043	142.745	0,03
USD 300.000	Hospitality Properties Trust 4,95% 15/2/2027	256.780	0,06	USD 45.000	Kinder Morgan Inc/DE '144A' 5,00% 15/2/2021	40.010	0,01
USD 150.000	HSBC USA Inc 2,35% 5/3/2020	127.352	0,03	USD 30.000	Kinder Morgan Inc/DE 3,15% 15/1/2023	24.978	0,01
USD 45.000	Hyundai Capital America '144A' 2,40% 30/10/2018	38.544	0,01	USD 246.000	Kinder Morgan Inc/DE 5,55% 1/6/2045	220.409	0,05
USD 5.000	Hyundai Capital America '144A' 2,50% 18/3/2019	4.269	0,00	USD 51.000	KLA-Tencor Corp 4,125% 1/11/2021	44.784	0,01
USD 55.000	Hyundai Capital America '144A' 1,75% 27/9/2019	46.304	0,01	USD 40.000	Kraft Heinz Foods Co 2,80% 2/7/2020	34.146	0,01
USD 65.000	Hyundai Capital America '144A' 2,55% 3/4/2020	54.955	0,01	USD 68.000	Lam Research Corp 2,75% 15/3/2020	58.186	0,01
USD 500.000	Intercontinental Exchange Inc 3,75% 1/12/2025	430.857	0,10	USD 85.000	Lam Research Corp 2,80% 15/6/2021	72.168	0,02
USD 55.000	International Lease Finance Corp 5,875% 1/4/2019	48.243	0,01	USD 500.000	Lear Corp 3,80% 15/9/2027	410.697	0,09
USD 90.000	International Lease Finance Corp 4,625% 15/4/2021	79.672	0,02	USD 620.000	LMREC Inc '2016-CRE2 A' '144A' FRN 24/11/2031	539.145	0,12
USD 4.141.966	Invitation Homes Trust '2015-SFR3 A' '144A' FRN 17/8/2032	3.562.398	0,79	USD 20.000	Los Angeles Community College District/CA 6,60% 1/8/2042	24.186	0,01
EUR 500.000	Iron Mountain Inc RegS 3,00% 15/1/2025	492.027	0,11				

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 230.000	Los Angeles County Metropolitan Transportation Authority 'A' 5,00% 1/7/2042	230.607	0,05	EUR 1.500.000	Morgan Stanley FRN 21/5/2021	1.499.115	0,33
USD 300.000	Los Angeles Department of Water & Power Power System Revenue 6,603% 1/7/2050	374.888	0,08	EUR 300.000	Morgan Stanley 1,75% 11/3/2024	308.724	0,07
USD 260.000	Los Angeles Department of Water 'A' 5,00% 1/7/2048	262.689	0,06	USD 695.000	Morgan Stanley FRN 24/4/2024	596.355	0,13
USD 385.000	Maple Escrow Subsidiary Inc '144A' 3,551% 25/5/2021	332.405	0,07	USD 595.000	Morgan Stanley 3,125% 27/7/2026	478.907	0,11
USD 35.000	Maple Escrow Subsidiary Inc '144A' 4,057% 25/5/2023	30.246	0,01	USD 350.000	Morgan Stanley 3,95% 23/4/2027	290.754	0,06
USD 100.000	Maple Escrow Subsidiary Inc '144A' 4,597% 25/5/2028	86.320	0,02	USD 1.590.000	Morgan Stanley Capital I Inc '2017-JWDR D' '144A' FRN 15/11/2034	1.365.874	0,30
USD 40.000	Marriott International Inc/MD 3,00% 1/3/2019	34.396	0,01	USD 500.000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-150E A' '144A' 3,912% 9/9/2032	436.557	0,10
USD 60.000	Marriott International Inc/MD 3,125% 15/10/2021	51.079	0,01	USD 105.000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-CPT A' '144A' 3,35% 13/7/2029	90.347	0,02
USD 120.000	Maryland Economic Development Corp 5,00% 31/3/2041	113.353	0,03	USD 20.000	MPLX LP 3,375% 15/3/2023	16.966	0,00
USD 290.000	Maryland Stadium Authority 5,00% 1/5/2041	282.204	0,06	USD 800.000	MPLX LP 4,50% 15/7/2023	707.220	0,16
USD 80.000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5,00% 1/7/2043	79.262	0,02	USD 147.000	MPLX LP 4,70% 15/4/2048	121.972	0,03
USD 350.000	Massachusetts Clean Water Trust/The 5,00% 1/2/2035	344.989	0,08	USD 267.000	MPLX LP 4,90% 15/4/2058	214.592	0,05
USD 180.000	Massachusetts Development Finance Agency 5,00% 1/7/2047	174.133	0,04	USD 350.000	Municipal Electric Authority of Georgia 5,00% 1/1/2035	330.532	0,07
USD 20.000	Massachusetts School Building Authority 'A' 5,25% 15/2/2048	20.475	0,00	USD 425.000	National Fuel Gas Co 3,95% 15/9/2027	349.669	0,08
USD 75.000	Massachusetts Water Resources Authority 'B' 5,00% 1/8/2040	74.277	0,02	EUR 100.000	National Grid North America Inc RegS 1,00% 12/7/2024	100.787	0,02
USD 885.000	Mastercard Inc 2,95% 21/11/2026	733.376	0,16	USD 200.000	Navient Corp 6,125% 25/3/2024	172.939	0,04
EUR 500.000	Mastercard Inc 2,10% 1/12/2027	543.950	0,12	USD 160.000	Navient Private Education Loan Trust '2018-BAA1' '144A' FRN 15/12/2059	137.086	0,03
USD 205.000	Mastercard Inc 3,50% 26/2/2028	176.518	0,04	EUR 300.000	Netflix Inc 3,625% 15/5/2027	298.056	0,07
USD 500.000	McDonald's Corp 3,70% 30/1/2026	430.443	0,10	USD 20.000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5,00% 15/6/2029	18.903	0,00
USD 250.000	Mercedes-Benz Master Owner Trust '2016-BA A' '144A' FRN 17/5/2021	215.524	0,05	USD 20.000	New Orleans Aviation Board 5,00% 1/1/2040	18.824	0,00
USD 230.000	Mercedes-Benz Master Owner Trust '2018-BA A' '144A' FRN 15/5/2023	197.630	0,04	USD 94.060	New Residential Mortgage Trust '2018-1A A1A' '144A' FRN 25/12/2057	82.164	0,02
USD 310.000	Mesquite Independent School District 'B' 5,00% 15/8/2042	305.298	0,07	USD 5.000	New York and Presbyterian Hospital/The 3,563% 1/8/2036	4.092	0,00
USD 135.000	Metropolitan Transportation Authority 6,687% 15/11/2040	156.381	0,03	USD 210.000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue 5,00% 15/7/2040	203.659	0,05
USD 170.000	Metropolitan Transportation Authority 5,25% 15/11/2057	167.910	0,04	USD 230.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 'B1' 5,00% 1/8/2031	230.281	0,05
USD 150.000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 7,462% 1/10/2046	190.858	0,04	USD 130.000	New York City Water & Sewer System 5,00% 15/6/2047	128.077	0,03
USD 110.000	Metropolitan Water District of Southern California 'A' 5,00% 1/7/2031	111.244	0,02	USD 170.000	New York Convention Center Development Corp 5,00% 15/11/2040	165.143	0,04
USD 140.000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 'A' 5,00% 1/4/2048	136.213	0,03	USD 170.000	New York Convention Center Development Corp 'A' 5,00% 15/11/2046	166.365	0,04
USD 295.000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 'B' 5,073% 1/4/2050	284.894	0,06	USD 20.000	New York State Dormitory Authority 5,00% 15/2/2036	19.951	0,00
USD 90.000	Michigan Finance Authority 5,00% 15/11/2041	86.551	0,02	USD 20.000	New York State Dormitory Authority 5,00% 15/2/2037	19.936	0,00
USD 240.000	Michigan Finance Authority 'A' 5,00% 1/12/2047	224.109	0,05	USD 10.000	New York State Dormitory Authority 5,00% 15/2/2038	9.960	0,00
USD 327.882	Mill City Mortgage Loan Trust '2016-1 A1' '144A' FRN 25/4/2057	277.990	0,06	USD 10.000	New York State Dormitory Authority 5,00% 15/2/2039	9.945	0,00
USD 350.000	Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 5,00% 1/9/2046	324.351	0,07	USD 20.000	New York State Dormitory Authority 5,00% 15/2/2041	19.861	0,00
USD 30.000	Moody's Corp 2,625% 15/1/2023	24.843	0,01	USD 20.000	New York State Dormitory Authority 5,00% 15/2/2042	19.846	0,00
USD 25.000	Morgan Stanley 2,375% 23/7/2019	21.385	0,00	USD 10.000	New York State Dormitory Authority 5,00% 15/2/2043	9.916	0,00
USD 405.000	Morgan Stanley 2,50% 21/4/2021	340.730	0,08	USD 220.000	New York State Dormitory Authority 'A' 5,00% 15/2/2031	220.704	0,05
				USD 140.000	New York State Dormitory Authority 'A' 5,00% 15/3/2041	140.739	0,03
				USD 140.000	New York State Dormitory Authority 'A' 5,00% 15/3/2042	140.627	0,03

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 140.000	New York State Dormitory Authority 'A' 5,00% 15/3/2043	140.516	0,03	USD 300.000	Port of Seattle WA 'C' 5,25% 1/5/2042	299.436	0,07
USD 10.000	New York State Dormitory Authority 'A' 5,00% 1/10/2048	11.607	0,00	USD 35.000	Praxair Inc 4,05% 15/3/2021	30.830	0,01
USD 20.000	New York State Dormitory Authority 'B' 5,00% 1/10/2038	20.486	0,00	USD 88.936	Prestige Auto Receivables Trust '2014-1A C' '144A' 2,39% 15/5/2020	76.312	0,02
USD 40.000	New York State Urban Development Corp 'B' 2,86% 15/3/2024	33.868	0,01	USD 150.000	Prestige Auto Receivables Trust '2014-1A D' '144A' 2,91% 15/7/2021	128.771	0,03
USD 30.000	New York State Urban Development Corp 'B' 3,12% 15/3/2025	25.576	0,01	USD 300.000	PulteGroup Inc 5,00% 15/1/2027	245.891	0,05
USD 160.000	New York Transportation Development Corp 'A' 5,00% 1/7/2046	148.972	0,03	USD 50.000	QEP Resources Inc 5,625% 1/3/2026	41.357	0,01
USD 10.000	New York Transportation Development Corp 'A' 5,25% 1/1/2050	9.408	0,00	USD 106.000	QUALCOMM Inc 3,00% 20/5/2022	89.650	0,02
USD 410.000	Nissan Auto Receivables Owner Trust '2017-AA4' 2,11% 15/5/2023	345.625	0,08	EUR 1.100.000	Quintiles IMS Inc RegS 3,50% 15/10/2024	1.120.493	0,25
USD 310.000	Nissan Auto Receivables Owner Trust '2017-B A4' 1,95% 16/10/2023	259.658	0,06	USD 1.824.350	RAIT Trust '2017-FL7 A' '144A' FRN 15/6/2037	1.568.166	0,35
USD 300.000	North Carolina Department of Transportation 5,00% 30/6/2054	276.805	0,06	USD 50.000	Realty Income Corp 3,25% 15/10/2022	42.418	0,01
USD 350.000	NVIDIA Corp 3,20% 16/9/2026	290.436	0,06	USD 135.000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6,583% 15/5/2049	156.504	0,03
USD 150.000	Ochsner Clinic Foundation 5,897% 15/5/2045	159.591	0,04	USD 290.000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 'L' 5,00% 15/5/2047	284.803	0,06
USD 470.000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 'A' 5,00% 15/2/2048	440.499	0,10	USD 60.000	Reynolds American Inc 6,875% 1/5/2020	54.937	0,01
USD 1.810.000	Olympic Tower Mortgage Trust '2017-OT E' '144A' FRN 10/5/2039	1.474.235	0,33	USD 170.000	Royal Oak Hospital Finance Authority 'D' 5,00% 1/9/2039	159.653	0,04
USD 400.000	Omaha Airport Authority 'A' 5,00% 15/12/2036	389.113	0,09	USD 52.000	S&P Global Inc 2,95% 22/1/2027	41.828	0,01
USD 250.000	Omega Healthcare Investors Inc 4,75% 15/1/2028*	207.259	0,05	USD 400.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625% 1/2/2021	360.179	0,08
USD 35.000	Oregon School Boards Association 4,759% 30/6/2028	32.450	0,01	USD 500.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625% 1/3/2025	459.523	0,10
USD 55.000	Oregon School Boards Association 'B' 5,49% 30/6/2023	52.423	0,01	USD 310.000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 'A' 5,00% 1/7/2047	300.385	0,07
USD 501.000	Patterson-UTI Energy Inc '144A' 3,95% 1/2/2028	412.942	0,09	USD 20.000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 'A' 5,00% 1/12/2045	19.408	0,00
USD 290.000	Pennsylvania Turnpike Commission 'A' 5,00% 1/12/2048	288.305	0,06	USD 280.000	San Antonio Water System 'B' 5,00% 15/5/2039	271.533	0,06
USD 65.000	Penske Truck Leasing Co Lp Via PTL Finance Corp '144A' 3,05% 9/1/2020	55.690	0,01	USD 170.000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 'B' 5,00% 1/5/2041	165.211	0,04
USD 35.000	Penske Truck Leasing Co Lp Via PTL Finance Corp '144A' 3,375% 1/2/2022	29.882	0,01	USD 20.000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 'B' 5,00% 1/5/2046	19.334	0,00
EUR 200.000	Pfizer Inc 6/3/2020 (Zero Coupon)	200.643	0,04	USD 180.000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2017-3 A3' 1,87% 15/6/2021	153.534	0,03
USD 100.000	PFS Financing Corp '2016-BA A' '144A' 1,87% 15/10/2021	84.530	0,02	USD 50.000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2018-1 A3' 2,32% 16/8/2021	42.708	0,01
USD 100.000	PFS Financing Corp '2017-AA A' '144A' FRN 15/3/2021	85.833	0,02	USD 35.000	Santander Holdings USA Inc 3,70% 28/3/2022	29.718	0,01
USD 195.000	PFS Financing Corp '2017-C A' '144A' FRN 15/10/2021	167.777	0,04	USD 35.000	Sempra Energy 1,625% 7/10/2019	29.499	0,01
USD 200.000	PFS Financing Corp '2018-AA A' '144A' FRN 15/2/2022	171.794	0,04	USD 45.000	Sempra Energy FRN 15/1/2021	38.684	0,01
USD 130.000	PFS Financing Corp '2018-C A' '144A' FRN 15/4/2022	111.640	0,02	USD 91.891	Sequoia Mortgage Trust '2017-CH2 A10' '144A' FRN 25/12/2047	79.969	0,02
USD 54.000	Pioneer Natural Resources Co 3,45% 15/1/2021	46.658	0,01	USD 400.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5,375% 15/7/2026	333.004	0,07
USD 350.000	Port Authority of New York & New Jersey 5,00% 15/10/2041	340.447	0,08	USD 119.412	SLM Private Credit Student Loan Trust '2005-A A3' FRN 15/6/2023	102.283	0,02
USD 15.000	Port Authority of New York & New Jersey '174TH' 4,458% 1/10/2062	14.033	0,00	USD 69.708	SLM Student Loan Trust '2013-4 A' FRN 25/6/2043	60.067	0,01
USD 10.000	Port Authority of New York & New Jersey '192' 4,81% 15/10/2065	9.955	0,00	USD 173.698	SMB Private Education Loan Trust '2015-A A2A' '144A' 2,49% 15/6/2027	147.538	0,03
USD 160.000	Port Authority of New York & New Jersey '206' 5,00% 15/11/2047	156.373	0,03	USD 181.895	SMB Private Education Loan Trust '2015-C A2A' '144A' 2,75% 15/7/2027	155.182	0,03

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

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 106.117	SMB Private Education Loan Trust '2016-B A2B' '144A' FRN 17/2/2032	93.028	0,02	USD 40.000	Thermo Fisher Scientific Inc 3,30% 15/2/2022	34.272	0,01
USD 153.340	SMB Private Education Loan Trust '2017-AA A1' '144A' FRN 17/6/2024	131.690	0,03	USD 25.000	Thermo Fisher Scientific Inc 3,00% 15/4/2023	20.992	0,00
USD 250.000	SMB Private Education Loan Trust '2017-A A2B' '144A' FRN 15/9/2034	216.422	0,05	USD 15.000	Time Warner Cable LLC 8,75% 14/2/2019	13.376	0,00
USD 115.323	SMB Private Education Loan Trust '2018-AA A1' '144A' FRN 16/3/2026	98.892	0,02	USD 10.000	Time Warner Cable LLC 8,25% 1/4/2019	8.957	0,00
USD 241.680	SoFi Professional Loan Program LLC '2015-B A1' '144A' FRN 25/4/2035	210.284	0,05	USD 5.000	Total System Services Inc 3,75% 1/6/2023	4.285	0,00
USD 100.000	SoFi Professional Loan Program LLC '2016-C A2B' '144A' 2,36% 27/12/2032	84.247	0,02	USD 20.000	Total System Services Inc 4,00% 1/6/2023	17.300	0,00
USD 144.594	SoFi Professional Loan Program LLC '2017-A A2A' '144A' 1,55% 26/3/2040	123.048	0,03	USD 179.965	Towd Point Mortgage Trust '2016-3 A1' '144A' FRN 25/4/2056	151.866	0,03
USD 100.000	Sofi Professional Loan Program LLC '2018-A A2B' '144A' 2,95% 25/2/2042	84.031	0,02	USD 130.000	Toyota Auto Receivables Owner Trust '2018-A A3' 2,35% 16/5/2022	110.614	0,02
USD 100.000	South Carolina Public Service Authority 'A' 5,00% 1/12/2049	91.346	0,02	USD 250.000	TPC Group Inc '144A' 8,75% 15/12/2020	213.492	0,05
USD 100.000	South Carolina Public Service Authority 'A' 5,00% 1/12/2050	91.825	0,02	USD 75.000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 7,85% 1/2/2026	78.875	0,02
USD 17.000	South Carolina Public Service Authority 'D' 2,388% 1/12/2023	13.766	0,00	USD 320.000	TSASC Inc/NY 'A' 5,00% 1/6/2041	298.673	0,07
USD 150.000	Southern Baptist Hospital of Florida Inc 4,857% 15/7/2045	144.411	0,03	USD 250.000	United Rentals North America Inc 4,875% 15/1/2028	201.691	0,04
USD 10.000	Spectra Energy Partners LP 4,75% 15/3/2024	8.845	0,00	USD 5.799.450	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2022*	4.881.287	1,08
USD 739.375	Sprint Spectrum Co LLC Via Sprint Spectrum Co II LLC Via Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3,36% 20/9/2021	631.402	0,14	USD 2.968.876	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,25% 15/1/2025	2.477.398	0,55
USD 19.000	SSM Health Care Corp 3,823% 1/6/2027	16.296	0,00	USD 1.311.935	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/1/2027	1.091.528	0,24
USD 135.000	State of California 7,50% 1/4/2034	163.746	0,04	USD 200.000	Uniti Group LP Via Uniti Group Finance Inc Via CSL Capital LLC '144A' 6,00% 15/4/2023	168.219	0,04
USD 135.000	State of California 7,55% 1/4/2039	173.843	0,04	USD 20.000	University of California 4,601% 15/5/2031	18.719	0,00
USD 10.000	State of Illinois 5,00% 1/12/2024	9.065	0,00	USD 350.000	University of Houston 'A' 5,00% 15/2/2031	347.881	0,08
USD 10.000	State of Illinois 'A' 5,00% 1/5/2020	8.835	0,00	USD 10.000	University of Houston 'A' 5,00% 15/2/2033	9.869	0,00
USD 30.000	State of Illinois 'D' 5,00% 1/11/2025	27.248	0,01	USD 20.000	University of Houston 'A' 5,00% 15/2/2034	19.661	0,00
USD 170.000	State of Ohio 'A' 5,00% 1/5/2030	168.712	0,04	USD 20.000	University of Houston 'A' 5,00% 15/2/2035	19.597	0,00
USD 170.000	State of Ohio 'A' 5,00% 15/3/2032	165.502	0,04	USD 20.000	University of Houston 'A' 5,00% 15/2/2036	19.534	0,00
USD 5.000	State of Washington 5,00% 1/8/2030	5.034	0,00	USD 10.000	University of Oregon 5,00% 1/4/2046	9.824	0,00
USD 80.000	State of Washington 5,00% 1/8/2040	79.822	0,02	USD 250.000	VeriSign Inc 4,75% 15/7/2027	208.128	0,05
USD 80.000	State of Washington 5,00% 1/8/2041	79.763	0,02	USD 800.000	Verisk Analytics Inc 4,00% 15/6/2025	681.293	0,15
USD 80.000	State of Washington 5,00% 1/8/2042	79.703	0,02	USD 20.000	Verizon Communications Inc 1,75% 15/8/2021	16.406	0,00
USD 20.000	State of Wisconsin 3,154% 1/5/2027	16.800	0,00	USD 100.000	Verizon Communications Inc 2,946% 15/3/2022	84.476	0,02
USD 200.000	Steel Dynamics Inc 5,50% 1/10/2024	175.514	0,04	EUR 100.000	Verizon Communications Inc 2,875% 15/1/2038	99.953	0,02
USD 20.000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5,50% 15/2/2020	17.768	0,00	USD 8.000	Viacom Inc 2,75% 15/12/2019	6.815	0,00
USD 50.000	SunTrust Banks Inc 2,70% 27/1/2022	41.982	0,01	USD 500.000	Viacom Inc 4,375% 15/3/2043	370.063	0,08
USD 1.000.000	Tapestry Inc 3,00% 15/7/2022	832.281	0,18	USD 15.000	Virginia Electric & Power Co 5,00% 30/6/2019	13.185	0,00
USD 500.000	TD Ameritrade Holding Corp 3,30% 1/4/2027	414.937	0,09	USD 25.000	Virginia Electric & Power Co 3,45% 1/9/2022	21.713	0,00
USD 115.000	Teleflex Inc 4,625% 15/11/2027	93.148	0,02	USD 945.000	Visa Inc 2,75% 15/9/2027	763.653	0,17
USD 45.000	Texas Eastern Transmission LP '144A' 2,80% 15/10/2022	37.229	0,01	USD 1.000.000	VMware Inc 2,95% 21/8/2022	818.720	0,18
USD 160.000	Texas Municipal Gas Acquisition & Supply Corp I 'D' 6,25% 15/12/2026	160.750	0,04	USD 100.000	Waldorf Astoria Boca Raton Trust '2016-BOCA' '144A' FRN 15/6/2029	85.913	0,02
USD 100.000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5,00% 31/12/2055	92.782	0,02	USD 60.000	Walgreens Boots Alliance Inc 3,30% 18/11/2021	51.524	0,01
USD 290.000	Texas Water Development Board 'A' 5,00% 15/10/2043	290.886	0,06	USD 30.000	Wells Fargo & Co 2,125% 22/4/2019	25.619	0,01

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

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire					
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net		
Etats-Unis suite				Îles Caïmans					
USD 34.000	Wells Fargo & Co 2,60% 22/7/2020	28.859	0,01	USD 200.000	China Hongqiao Group Ltd RegS 6,85% 22/4/2019***	172.725	0,04		
USD 35.000	Wells Fargo & Co 2,625% 22/7/2022	28.994	0,01	USD 11.000	Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd '144A' (Perpetual) (Zero Coupon)***	229	0,00		
EUR 400.000	Wells Fargo & Co RegS 1,50% 12/9/2022	413.344	0,09			172.954	0,04		
USD 9.496.756	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-C41 XA' FRN 15/11/2050	714.350	0,16						
USD 150.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2018-BXI E' '144A' FRN 15/12/2036	128.462	0,03	USD 9.912	Indonésie Bumi Resources Tbk PT 11/12/2022 (Zero Coupon)***	3.360	0,00		
USD 500.000	Westlake Chemical Corp 3,60% 15/8/2026	411.746	0,09			3.360	0,00		
USD 25.000	WestRock Co '144A' 3,75% 15/3/2025	21.200	0,00						
USD 25.000	Williams Partners LP 4,00% 15/11/2021	21.699	0,00	EUR 77.134	Irlande Taurus Dac '2016-DE2 C' RegS FRN 3/1/2027***	79.409	0,02		
USD 20.000	Williams Partners LP 3,60% 15/3/2022	17.116	0,00			EUR 69.154	Taurus Dac '2016-DE2 D' RegS FRN 3/1/2027***	71.402	0,01
USD 30.000	Willis North America Inc 3,60% 15/5/2024	25.026	0,01			EUR 300.000	Taurus Ltd '2015-DE2 E' RegS FRN 1/2/2026***	301.320	0,07
USD 180.000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5,00% 15/12/2044	167.252	0,04			452.131	0,10		
USD 50.000	Xerox Corp 3,50% 20/8/2020	42.891	0,01	EUR 621.715	Espagne SRF Fondo de Titulizacion 2017-1 'A' FRN 26/4/2063***	625.601	0,14		
USD 12.000	Xerox Corp 3,625% 15/3/2023	9.967	0,00			EUR 100.000	SRF Fondo de Titulizacion 2017-1 'B' FRN 26/4/2063***	100.025	0,02
USD 30.000	Xilinx Inc 2,125% 15/3/2019	25.662	0,01					725.626	0,16
USD 370.000	Zayo Group LLC Via Zayo Capital Inc '144A' 5,75% 15/1/2027	307.632	0,07	GBP 4.056.424	Royaume-Uni Marketplace Originated Consumer Assets Plc '2017-1 A' RegS FRN 20/12/2027***	4.630.219	1,03		
USD 500.000	ZF North America Capital Inc '144A' 4,50% 29/4/2022	438.570	0,10			4.630.219	1,03		
		129.129.006	28,62			Total des obligations	5.999.584	1,33	
		385.367.059	85,41	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	5.999.584	1,33			
Total des obligations									
EXCHANGE TRADED FUNDS									
Irlande									
166.299	iShares USD Corporate Bond UCITS ETF	15.899.856	3,53						
		15.899.856	3,53						
Total des Exchange Traded Funds									
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé									
		401.315.584	88,95						
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire									
OBLIGATIONS									
Canada									
USD 18.000	Largo Resources Ltd '144A' 9,25% 1/6/2021***	15.294	0,00						
		15.294	0,00						

*** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCCDs	EUR 860.500	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1 and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	10.689	(76.377)
CCCDs	EUR 8.205.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	33.064	(129.073)
CCCDs	EUR 1.150.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Sub Financials Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	33.554	45.849
CCCDs	EUR 13.659.336	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 29 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(146.111)	109.759
CCCDs	EUR 58.118.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(309.283)	914.252
CCCDs	USD 290.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.30 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	319	(3.968)
CCILS	EUR 6.140.000	Fund receives Floating EUR 12 Month CPTFEMU and pays Fixed 1,210%	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2022	81.237	81.317
CCILS	EUR 3.940.000	Fund receives Fixed 1,410% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2023	(16.932)	(16.873)
CCILS	GBP 500.000	Fund receives Fixed 3,208% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2023	1.712	1.722
CCILS	GBP 1.060.000	Fund receives Fixed 3,296% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2023	1.525	1.543
CCILS	GBP 736.000	Fund receives Fixed 3,250% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2025	2.032	2.046
CCILS	EUR 6.140.000	Fund receives Fixed 1,405% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2027	(102.779)	(102.662)
CCILS	GBP 2.213.000	Fund receives Fixed 3,440% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2027	29.153	29.214
CCILS	GBP 2.201.000	Fund receives Fixed 3,430% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Bank of America Merrill Lynch	15/11/2027	35.191	35.239
CCILS	USD 3.672.000	Fund receives Floating USD 12 Month USCPI and pays Fixed 2,152%	Bank of America Merrill Lynch	30/11/2027	58.712	58.783
CCILS	EUR 2.890.000	Fund receives Fixed 1,588% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(4.366)	(4.300)
CCILS	EUR 522.500	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(3.658)	(3.646)
CCILS	EUR 522.500	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(3.658)	(3.646)
CCILS	EUR 522.500	Fund receives Fixed 1,592% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(1.136)	(1.124)
CCILS	EUR 522.500	Fund receives Fixed 1,598% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(855)	(843)
CCILS	EUR 424.000	Fund receives Fixed 1,598% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2028	(694)	(684)
CCILS	GBP 498.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,480%	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2047	(20.354)	(20.327)
CCILS	GBP 498.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,509%	Bank of America Merrill Lynch	15/11/2047	(34.044)	(34.023)
CCILS	GBP 287.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,535%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2048	(24.476)	(24.460)
CCILS	GBP 202.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,368%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2068	(42.018)	(42.008)
CCIRS	USD 28.070.000	Fund receives Fixed 2,435% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2019	(7.786)	(7.629)
CCIRS	USD 9.000.000	Fund receives Fixed 2,590% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	17/9/2019	(3.862)	(3.801)
CCIRS	USD 42.370.000	Fund receives Fixed 2,176% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	18/12/2019	(196.995)	(196.698)
CCIRS	USD 38.930.000	Fund receives Fixed 2,410% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	16/2/2020	(136.534)	(139.130)
CCIRS	USD 1.680.000	Fund receives Fixed 2,535% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/2/2020	(3.122)	(3.066)
CCIRS	EUR 6.980.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,140%	Bank of America Merrill Lynch	19/3/2020	(2.835)	(3.259)
CCIRS	EUR 11.350.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,272%	Bank of America Merrill Lynch	21/3/2020	(2.540)	(2.539)
CCIRS	GBP 2.230.000	Fund receives Fixed 1,123% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	21/3/2020	9.443	9.255
CCIRS	USD 28.070.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,852%	Bank of America Merrill Lynch	22/3/2020	(8.754)	(8.565)
CCIRS	EUR 7.580.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,143%	Bank of America Merrill Lynch	26/3/2020	(4.008)	(2.868)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	USD 2.170.000	Fund receives Fixed 2,642% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/3/2020	(946)	(697)
CCIRS	GBP 2.050.000	Fund receives Fixed 1,142% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/4/2020	7.874	7.878
CCIRS	GBP 12.360.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,110%	Bank of America Merrill Lynch	23/4/2020	(39.847)	(40.964)
CCIRS	GBP 8.200.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,123%	Bank of America Merrill Lynch	24/4/2020	(29.562)	(29.416)
CCIRS	USD 11.040.000	Fund receives Fixed 2,722% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	24/4/2020	6.885	7.520
CCIRS	GBP 8.270.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,130%	Bank of America Merrill Lynch	25/4/2020	(30.845)	(30.696)
CCIRS	USD 14.420.000	Fund receives Fixed 2,743% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/4/2020	15.785	14.345
CCIRS	GBP 4.050.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,126%	Bank of America Merrill Lynch	26/4/2020	(14.672)	(14.600)
CCIRS	USD 14.180.000	Fund receives Fixed 2,758% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/4/2020	17.202	17.298
CCIRS	GBP 3.940.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,120%	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2020	(14.577)	(14.503)
CCIRS	USD 9.090.000	Fund receives Fixed 2,760% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2020	11.345	11.407
CCIRS	GBP 4.430.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,058%	Bank of America Merrill Lynch	30/4/2020	(10.539)	(10.463)
CCIRS	GBP 4.140.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,042%	Bank of America Merrill Lynch	1/5/2020	(8.418)	(8.349)
CCIRS	GBP 6.480.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,072%	Bank of America Merrill Lynch	3/5/2020	(17.658)	(17.541)
CCIRS	USD 7.430.000	Fund receives Fixed 2,752% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/5/2020	8.079	8.130
CCIRS	GBP 2.060.000	Fund receives Fixed 1,022% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	10/5/2020	3.319	3.323
CCIRS	GBP 12.450.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,043%	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2020	(26.263)	(27.202)
CCIRS	EUR 27.150.000	Fund receives Fixed 0,121% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2020	13.978	13.706
CCIRS	EUR 4.480.000	Fund receives Fixed 0,122% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	21/5/2020	1.977	2.107
CCIRS	EUR 9.340.000	Fund receives Fixed 0,128% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2020	2.976	3.053
CCIRS	USD 11.150.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,800%	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2020	(21.177)	(21.099)
CCIRS	EUR 6.620.000	Fund receives Fixed 0,125% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/5/2020	663	2.497
CCIRS	USD 6.010.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,806%	Bank of America Merrill Lynch	25/5/2020	(9.252)	(11.948)
CCIRS	EUR 4.140.000	Fund receives Fixed 0,148% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	29/5/2020	(6.843)	(6.344)
CCIRS	USD 6.620.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,748%	Bank of America Merrill Lynch	30/5/2020	(6.103)	(7.374)
CCIRS	USD 11.470.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,660%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2020	4.469	4.550
CCIRS	EUR 10.990.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,091%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2020	(10.083)	(10.407)
CCIRS	GBP 10.270.000	Fund receives Fixed 1,148% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2020	42.643	47.152
CCIRS	GBP 10.550.000	Fund receives Fixed 1,150% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2020	48.292	48.983
CCIRS	GBP 10.097.500	Fund receives Fixed 1,170% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2020	49.937	51.489
CCIRS	GBP 10.360.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,059%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2020	(24.306)	(26.681)
CCIRS	GBP 10.360.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,087%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2020	(23.925)	(33.167)
CCIRS	USD 32.600.000	Fund receives Fixed 2,649% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2020	(41.491)	(22.873)
CCIRS	USD 14.540.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,647%	Bank of America Merrill Lynch	5/7/2020	15.729	15.827
CCIRS	GBP 10.060.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,999%	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2020	1.252	2.185

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	USD 9.220.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,860%	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2020	2.546	2.608
CCIRS	USD 1.300.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,714%	Bank of America Merrill Lynch	11/10/2020	1.440	1.449
CCIRS	USD 6.470.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,190%	Bank of America Merrill Lynch	3/12/2020	66.311	66.372
CCIRS	USD 5.860.000	Fund receives Fixed 2,305% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	17/12/2020	(28.815)	(28.774)
CCIRS	USD 42.370.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,279%	Bank of America Merrill Lynch	18/12/2020	216.725	217.021
CCIRS	USD 4.390.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,299%	Bank of America Merrill Lynch	21/12/2020	37.715	37.745
CCIRS	USD 3.070.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,315%	Bank of America Merrill Lynch	24/12/2020	25.635	25.656
CCIRS	USD 3.460.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,388%	Bank of America Merrill Lynch	8/1/2021	25.116	25.139
CCIRS	USD 4.170.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,424%	Bank of America Merrill Lynch	11/1/2021	27.885	27.914
CCIRS	USD 4.460.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,429%	Bank of America Merrill Lynch	12/1/2021	29.441	29.472
CCIRS	USD 18.800.000	Fund receives Fixed 2,645% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/1/2021	(40.238)	(40.113)
CCIRS	USD 8.890.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,650%	Bank of America Merrill Lynch	31/1/2021	26.835	26.895
CCIRS	USD 4.310.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,801%	Bank of America Merrill Lynch	20/2/2021	3.203	3.231
CCIRS	MXN 1.436.000	Fund receives Fixed 7,658% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	22/2/2021	(643)	(643)
CCIRS	USD 9.500.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,868%	Bank of America Merrill Lynch	18/3/2021	(2.015)	(1.952)
CCIRS	USD 2.320.000	Fund receives Fixed 2,750% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/4/2021	(4.171)	(4.155)
CCIRS	USD 2.320.000	Fund receives Fixed 2,752% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/4/2021	(4.114)	(4.098)
CCIRS	USD 4.280.000	Fund receives Fixed 2,842% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2021	(1.982)	(1.953)
CCIRS	USD 1.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,830%	Bank of America Merrill Lynch	16/4/2021	556	563
CCIRS	USD 850.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,048%	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2021	(2.441)	(2.435)
CCIRS	USD 2.840.000	Fund receives Fixed 2,944% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	30/5/2021	3.132	3.153
CCIRS	USD 3.330.000	Fund receives Fixed 2,748% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2021	(6.765)	(6.742)
CCIRS	USD 3.700.000	Fund receives Fixed 2,752% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2021	(7.277)	(7.250)
CCIRS	USD 1.840.000	Fund receives Fixed 2,788% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2021	(2.527)	(2.514)
CCIRS	USD 1.840.000	Fund receives Fixed 2,798% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2021	(2.243)	(2.230)
CCIRS	USD 3.690.000	Fund receives Fixed 2,809% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2021	(3.838)	(3.812)
CCIRS	USD 1.840.000	Fund receives Fixed 2,869% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2021	(120)	(107)
CCIRS	USD 1.840.000	Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2021	135	148
CCIRS	USD 3.280.000	Fund receives Fixed 2,890% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2021	933	956
CCIRS	USD 270.000	Fund receives Fixed 2,862% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/6/2021	(67)	(65)
CCIRS	USD 1.815.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,811%	Bank of America Merrill Lynch	3/6/2021	1.931	1.943
CCIRS	USD 5.470.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,180%	Bank of America Merrill Lynch	8/11/2021	62.917	62.978
CCIRS	USD 5.860.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,343%	Bank of America Merrill Lynch	17/12/2021	24.991	25.056
CCIRS	USD 19.240.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,686%	Bank of America Merrill Lynch	26/1/2022	29.128	29.284
CCIRS	GBP 903.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,776%	Bank of America Merrill Lynch	7/3/2022	13.307	13.330

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	USD 2.560.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,876%	Bank of America Merrill Lynch	9/3/2022	478	499
CCIRS	USD 4.740.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,958%	Bank of America Merrill Lynch	24/3/2022	(5.364)	(5.326)
CCIRS	USD 4.280.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,845%	Bank of America Merrill Lynch	6/4/2022	969	1.004
CCIRS	USD 1.500.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,830%	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2022	1.340	1.352
CCIRS	USD 1.900.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,863%	Bank of America Merrill Lynch	7/4/2022	712	727
CCIRS	USD 7.800.000	Fund receives Fixed 3,044% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2022	19.532	19.596
CCIRS	USD 7.750.000	Fund receives Fixed 3,063% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2022	21.800	21.864
CCIRS	USD 1.930.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,062%	Bank of America Merrill Lynch	12/5/2022	(5.437)	(5.420)
CCIRS	USD 1.910.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,182%	Bank of America Merrill Lynch	19/5/2022	(9.015)	(8.998)
CCIRS	EUR 7.720.000	Fund receives Fixed 0,413% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2022	31.064	36.702
CCIRS	USD 9.750.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,088%	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2022	(54.173)	(50.329)
CCIRS	EUR 7.690.000	Fund receives Fixed 0,395% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2022	31.322	32.181
CCIRS	USD 9.700.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,101%	Bank of America Merrill Lynch	24/5/2022	(54.400)	(53.039)
CCIRS	EUR 7.470.000	Fund receives Fixed 0,408% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/5/2022	21.143	33.605
CCIRS	USD 9.450.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,108%	Bank of America Merrill Lynch	28/5/2022	(41.736)	(53.267)
CCIRS	EUR 6.970.000	Fund receives Fixed 0,222% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2022	(8.312)	(8.242)
CCIRS	USD 8.300.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,896%	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2022	(4.067)	(3.995)
CCIRS	USD 1.900.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,852%	Bank of America Merrill Lynch	2/6/2022	987	1.003
CCIRS	GBP 1.098.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,064%	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	4.300	4.316
CCIRS	GBP 1.719.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,949%	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2022	16.073	16.124
CCIRS	GBP 1.819.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,767%	Bank of America Merrill Lynch	7/9/2022	35.009	35.055
CCIRS	JPY 729.000.000	Fund receives Fixed 0,106% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	6/10/2022	1.199	1.270
CCIRS	EUR 9.986.911	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,430%	Bank of America Merrill Lynch	7/10/2022	(104.573)	(104.443)
CCIRS	GBP 1.750.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,070%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2022	10.820	10.873
CCIRS	GBP 3.907.000	Fund receives Fixed 3,340% and pays Floating GBP 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/1/2023	23.355	23.421
CCIRS	JPY 469.000.000	Fund receives Fixed 0,135% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	22/1/2023	4.498	4.543
CCIRS	USD 2.830.000	Fund receives Fixed 2,641% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2023	(17.703)	(17.673)
CCIRS	USD 1.580.000	Fund receives Fixed 2,768% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/3/2023	(2.013)	(1.996)
CCIRS	USD 1.970.000	Fund receives Fixed 2,778% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2023	(1.717)	(1.696)
CCIRS	USD 680.000	Fund receives Fixed 2,689% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2023	(3.054)	(3.047)
CCIRS	USD 2.400.000	Fund receives Fixed 2,721% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2023	(7.783)	(7.758)
CCIRS	GBP 870.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,412%	Bank of America Merrill Lynch	19/4/2023	(8.535)	(8.508)
CCIRS	USD 1.850.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,986%	Bank of America Merrill Lynch	22/5/2023	(13.379)	(13.358)
CCIRS	EUR 4.380.000	Fund receives Fixed 0,475% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	39.795	40.414
CCIRS	EUR 46.740.000	Fund receives Fixed 0,543% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	538.130	591.003

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	EUR 4.715.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,296%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	4.021	(1.116)
CCIRS	GBP 4.240.000	Fund receives Fixed 1,361% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	29.657	31.222
CCIRS	GBP 4.240.000	Fund receives Fixed 1,398% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	30.586	39.995
CCIRS	GBP 4.117.500	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,375%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	(31.983)	(33.462)
CCIRS	GBP 4.320.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,435%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	(47.237)	(49.637)
CCIRS	GBP 4.205.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,450%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	(48.475)	(51.752)
CCIRS	JPY 1.678.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,140%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	(13.663)	(13.478)
CCIRS	USD 13.310.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,804%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2023	12.726	1.796
CCIRS	PLN 2.080.000	Fund receives Fixed 2,445% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	1.321	1.328
CCIRS	PLN 2.150.000	Fund receives Fixed 2,592% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	4.790	4.797
CCIRS	GBP 1.137.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,860%	Bank of America Merrill Lynch	31/8/2023	25.294	25.328
CCIRS	EUR 3.200.000	Fund receives Fixed 0,540% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2023	27.512	29.249
CCIRS	GBP 4.055.000	Fund receives Fixed 1,268% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2023	(2.946)	(1.021)
CCIRS	GBP 4.110.000	Fund receives Fixed 1,271% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2023	944	(318)
CCIRS	USD 5.835.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,046%	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2023	7.734	(49.470)
CCIRS	MXN 42.810.000	Fund receives Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate and pays Fixed 7,600%	Bank of America Merrill Lynch	13/9/2023	29.787	29.814
CCIRS	AUD 2.440.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 2,632%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(3.938)	(3.916)
CCIRS	AUD 2.540.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 2,679%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(7.730)	(7.707)
CCIRS	AUD 2.650.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 2,685%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(8.554)	(8.530)
CCIRS	AUD 2.700.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 2,724%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(11.932)	(11.907)
CCIRS	CAD 3.350.000	Fund receives Fixed 2,540% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	805	835
CCIRS	CAD 3.000.000	Fund receives Fixed 2,580% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	4.465	4.493
CCIRS	CAD 3.070.000	Fund receives Fixed 2,655% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	11.754	11.783
CCIRS	CAD 1.960.000	Fund receives Fixed 2,772% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	14.691	14.709
CCIRS	EUR 12.100.000	Fund receives Fixed 0,637% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	148.710	163.341
CCIRS	GBP 5.230.000	Fund receives Fixed 1,498% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	60.729	63.960
CCIRS	HKD 15.010.000	Fund receives Fixed 2,618% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(6.295)	(6.272)
CCIRS	HKD 12.310.000	Fund receives Fixed 2,694% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(341)	(322)
CCIRS	JPY 455.500.000	Fund receives Fixed 0,142% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	1.444	1.495
CCIRS	JPY 1.135.500.000	Fund receives Fixed 0,143% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	3.915	4.040
CCIRS	JPY 221.000.000	Fund receives Fixed 0,158% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	2.056	2.080
CCIRS	JPY 276.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,154%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(2.191)	(2.161)
CCIRS	PLN 36.700.000	Fund receives Fixed 2,615% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	62.929	63.055
CCIRS	SEK 11.640.000	Fund receives Fixed 0,790% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	14.419	14.436
CCIRS	SGD 4.780.000	Fund receives Floating SGD 6 Month STIBOR and pays Fixed 2,292%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	8.382	8.424

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	USD 10.580.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,855%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(7.601)	(7.478)
CCIRS	USD 3.090.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,863%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(3.208)	(3.172)
CCIRS	USD 2.550.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,896%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(6.009)	(5.979)
CCIRS	USD 2.380.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,045%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(19.776)	(19.747)
CCIRS	ZAR 96.830.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,295%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	73.823	73.918
CCIRS	ZAR 26.240.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,300%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	19.643	19.669
CCIRS	GBP 600.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,424%	Bank of America Merrill Lynch	8/12/2023	(6.140)	(6.117)
CCIRS	USD 840.000	Fund receives Fixed 2,497% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2024	(12.158)	(12.148)
CCIRS	USD 3.870.000	Fund receives Fixed 2,730% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/1/2024	(20.400)	(20.355)
CCIRS	USD 2.100.000	Fund receives Fixed 2,842% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2024	(2.029)	(2.003)
CCIRS	USD 2.420.000	Fund receives Fixed 2,905% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/2/2024	3.558	3.587
CCIRS	USD 390.000	Fund receives Fixed 3,063% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	13/5/2024	2.828	2.833
CCIRS	USD 630.000	Fund receives Fixed 3,167% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	21/5/2024	7.119	7.127
CCIRS	USD 1.530.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,803%	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2024	4.606	4.625
CCIRS	USD 570.000	Fund receives Fixed 2,878% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/6/2024	(46)	(39)
CCIRS	EUR 1.494.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,594%	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2025	(6.366)	(6.338)
CCIRS	USD 3.200.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,057%	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2025	(19.814)	(19.776)
CCIRS	USD 3.260.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,078%	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2025	(22.800)	(22.761)
CCIRS	USD 1.145.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,022%	Bank of America Merrill Lynch	30/4/2025	(10.111)	(10.097)
CCIRS	CAD 1.735.000	Fund receives Floating CAD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,712%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(11.812)	(11.790)
CCIRS	CAD 2.085.000	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,821%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(25.195)	(25.169)
CCIRS	EUR 5.512.124	Fund receives Fixed 1,047% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2027	130.230	130.336
CCIRS	USD 310.000	Fund receives Fixed 2,290% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/5/2027	(12.086)	(12.081)
CCIRS	JPY 352.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,286%	Bank of America Merrill Lynch	6/10/2027	(2.621)	(2.570)
CCIRS	USD 1.690.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,312%	Bank of America Merrill Lynch	12/10/2027	67.132	67.159
CCIRS	USD 1.640.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,437%	Bank of America Merrill Lynch	27/10/2027	50.771	50.798
CCIRS	GBP 2.223.000	Fund receives Fixed 3,422% and pays Floating GBP 1 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/11/2027	33.215	33.272
CCIRS	EUR 1.375.000	Fund receives Fixed 1,586% and pays Floating EUR 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/1/2028	(2.259)	(2.233)
CCIRS	GBP 1.769.000	Fund receives Floating GBP 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,419%	Bank of America Merrill Lynch	4/1/2028	(23.930)	(23.885)
CCIRS	EUR 1.607.500	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,953%	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(13.001)	(12.970)
CCIRS	EUR 1.607.500	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,956%	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2028	(13.458)	(13.427)
CCIRS	JPY 217.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,355%	Bank of America Merrill Lynch	22/1/2028	(10.939)	(10.908)
CCIRS	JPY 79.810.000	Fund receives Fixed 0,366% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	29/1/2028	4.639	4.651
CCIRS	USD 1.480.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,847%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2028	3.064	3.087
CCIRS	USD 4.430.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,130%	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2028	(75.217)	(75.145)

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	USD 4.520.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,881%	Bank of America Merrill Lynch	16/2/2028	(2.505)	(1.987)
CCIRS	USD 500.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,969%	Bank of America Merrill Lynch	26/2/2028	(2.871)	(3.465)
CCIRS	USD 820.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,896%	Bank of America Merrill Lynch	2/3/2028	(1.370)	(1.357)
CCIRS	PLN 1.029.000	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 2,965%	Bank of America Merrill Lynch	6/3/2028	(2.023)	(2.019)
CCIRS	ZAR 4.364.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,640%	Bank of America Merrill Lynch	6/3/2028	6.155	6.165
CCIRS	ZAR 4.428.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,660%	Bank of America Merrill Lynch	6/3/2028	5.834	5.844
CCIRS	EUR 9.770.000	Fund receives Fixed 0,856% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2028	247.300	(23.625)
CCIRS	USD 390.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,878%	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2028	(106)	(99)
CCIRS	EUR 930.000	Fund receives Fixed 1,067% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2028	15.842	16.456
CCIRS	USD 1.020.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,892%	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2028	(1.415)	(1.399)
CCIRS	EUR 930.000	Fund receives Fixed 1,020% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	21/3/2028	12.331	12.131
CCIRS	EUR 960.000	Fund receives Fixed 1,025% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/3/2028	12.126	12.893
CCIRS	USD 580.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,914%	Bank of America Merrill Lynch	26/3/2028	(748)	(1.665)
CCIRS	USD 352.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,769%	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2028	2.812	2.818
CCIRS	USD 1.250.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,805%	Bank of America Merrill Lynch	3/4/2028	6.627	6.647
CCIRS	GBP 1.290.000	Fund receives Fixed 1,612% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/4/2028	21.158	20.760
CCIRS	GBP 870.000	Fund receives Fixed 1,635% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	24/4/2028	16.110	16.108
CCIRS	USD 1.570.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,938%	Bank of America Merrill Lynch	24/4/2028	(8.167)	(7.090)
CCIRS	GBP 860.000	Fund receives Fixed 1,670% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/4/2028	19.143	19.140
CCIRS	USD 1.280.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,987%	Bank of America Merrill Lynch	25/4/2028	(13.037)	(10.536)
CCIRS	GBP 420.000	Fund receives Fixed 1,635% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/4/2028	7.760	7.760
CCIRS	USD 1.880.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,997%	Bank of America Merrill Lynch	26/4/2028	(16.845)	(16.816)
CCIRS	GBP 400.000	Fund receives Fixed 1,607% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2028	6.269	6.268
CCIRS	USD 1.310.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,047%	Bank of America Merrill Lynch	27/4/2028	(16.649)	(16.629)
CCIRS	GBP 880.000	Fund receives Fixed 1,564% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	30/4/2028	9.688	9.687
CCIRS	GBP 430.000	Fund receives Fixed 1,559% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/5/2028	4.516	4.515
CCIRS	GBP 870.000	Fund receives Fixed 1,614% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	3/5/2028	14.328	14.325
CCIRS	USD 980.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,000%	Bank of America Merrill Lynch	8/5/2028	(9.017)	(9.001)
CCIRS	EUR 2.780.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,048%	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2028	(41.721)	(40.250)
CCIRS	GBP 1.230.000	Fund receives Fixed 1,575% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2028	22.706	15.165
CCIRS	GBP 420.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,656%	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2028	(9.963)	(8.854)
CCIRS	GBP 840.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,656%	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2028	(20.876)	(17.707)
CCIRS	EUR 470.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,072%	Bank of America Merrill Lynch	18/5/2028	(7.613)	(7.941)
CCIRS	EUR 470.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,060%	Bank of America Merrill Lynch	21/5/2028	(8.360)	(7.319)
CCIRS	USD 1.500.000	Fund receives Fixed 3,106% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	22/5/2028	25.725	25.749

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	EUR 970.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,021%	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2028	(11.408)	(11.389)
CCIRS	USD 1.290.000	Fund receives Fixed 3,096% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	23/5/2028	21.196	21.217
CCIRS	EUR 470.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,025%	Bank of America Merrill Lynch	25/5/2028	(4.577)	(5.664)
CCIRS	USD 640.000	Fund receives Fixed 3,102% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/5/2028	7.931	10.833
CCIRS	EUR 450.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,997%	Bank of America Merrill Lynch	29/5/2028	(2.969)	(4.191)
CCIRS	USD 780.000	Fund receives Fixed 3,040% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	30/5/2028	7.561	9.614
CCIRS	EUR 270.000	Fund receives Fixed 0,868% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	31/5/2028	(922)	(917)
CCIRS	EUR 820.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,906%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2028	(241)	(226)
CCIRS	USD 2.120.000	Fund receives Fixed 2,896% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2028	2.806	2.841
CCIRS	EUR 2.485.000	Fund receives Fixed 0,920% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	(1.980)	3.188
CCIRS	EUR 2.331.642	Fund receives Fixed 0,994% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	17.916	19.830
CCIRS	EUR 2.475.000	Fund receives Fixed 1,041% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	32.769	32.387
CCIRS	EUR 2.474.753	Fund receives Fixed 1,073% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	36.406	40.163
CCIRS	EUR 19.260.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,149%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	(431.111)	(456.534)
CCIRS	JPY 852.000.000	Fund receives Fixed 0,338% and pays Floating JPY 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	21.388	21.520
CCIRS	USD 3.540.000	Fund receives Fixed 3,098% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	(2.743)	58.644
CCIRS	USD 2.920.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,879%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	61	131
CCIRS	USD 6.600.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,914%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	(79.605)	9.795
CCIRS	USD 3.220.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,976%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	(51.962)	(23.494)
CCIRS	USD 3.800.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,026%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2028	(37.278)	(42.160)
CCIRS	PLN 1.033.000	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 3,005%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	(2.575)	(2.570)
CCIRS	ZAR 14.850.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,765%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	14.482	14.502
CCIRS	ZAR 3.023.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,895%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	1.104	1.108
CCIRS	ZAR 3.610.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,918%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	929	934
CCIRS	ZAR 3.640.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,925%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	817	822
CCIRS	ZAR 3.640.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,935%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	646	652
CCIRS	ZAR 5.235.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,940%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2028	807	814
CCIRS	EUR 1.685.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,135%	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2028	(26.994)	(28.673)
CCIRS	GBP 2.170.000	Fund receives Fixed 1,726% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2028	54.123	55.474
CCIRS	GBP 2.095.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,499%	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2028	(325)	(2.159)
CCIRS	USD 3.125.000	Fund receives Fixed 3,123% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2028	(2.392)	52.910
CCIRS	JPY 122.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,340%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(1.330)	(1.312)
CCIRS	JPY 576.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,340%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(6.282)	(6.193)
CCIRS	JPY 235.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,341%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(2.702)	(2.665)
CCIRS	JPY 104.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,357%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(2.527)	(2.512)

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCIRS	JPY 13.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,362%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(367)	(365)
CCIRS	JPY 110.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,364%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(3.237)	(3.220)
CCIRS	SEK 7.390.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 1,368%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(9.452)	(9.438)
CCIRS	SEK 12.840.000	Fund receives Floating SEK 3 Month STIBOR and pays Fixed 1,372%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(17.037)	(17.012)
CCIRS	EUR 1.040.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,370%	Bank of America Merrill Lynch	20/2/2029	(31.391)	(31.370)
CCIRS	EUR 425.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,380%	Bank of America Merrill Lynch	22/2/2029	(13.194)	(13.186)
CCIRS	USD 310.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,642%	Bank of America Merrill Lynch	28/6/2037	6.744	6.752
CCIRS	USD 350.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,762%	Bank of America Merrill Lynch	29/9/2037	4.964	4.972
CCIRS	GBP 623.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,827%	Bank of America Merrill Lynch	2/5/2038	(4.796)	(4.778)
CCIRS	EUR 890.000	Fund receives Fixed 1,502% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	9.148	9.180
CCIRS	EUR 510.000	Fund receives Fixed 1,522% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	7.411	7.429
CCIRS	EUR 1.100.000	Fund receives Fixed 1,583% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	30.158	30.198
CCIRS	EUR 1.150.000	Fund receives Fixed 1,617% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	40.433	40.475
CCIRS	EUR 290.000	Fund receives Fixed 1,644% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	4/7/2042	11.863	11.873
CCIRS	USD 2.170.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,156%	Bank of America Merrill Lynch	15/11/2043	(80.102)	(80.032)
CCIRS	JPY 17.500.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,913%	Bank of America Merrill Lynch	12/7/2047	(2.158)	(2.152)
CCIRS	JPY 162.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,920%	Bank of America Merrill Lynch	12/7/2047	(22.429)	(22.382)
CCIRS	JPY 31.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,925%	Bank of America Merrill Lynch	20/2/2048	(4.245)	(4.236)
CCIRS	JPY 33.000.000	Fund receives Floating JPY 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,951%	Bank of America Merrill Lynch	22/2/2048	(6.403)	(6.393)
CCIRS	GBP 1.373.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,536%	Bank of America Merrill Lynch	27/3/2048	13.593	13.684
CCIRS	GBP 160.000	Fund receives Fixed 1,755% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2048	9.514	8.511
CCIRS	GBP 310.000	Fund receives Fixed 1,755% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	17/5/2048	18.989	16.491
CCIRS	EUR 921.283	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,498%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2048	(2.556)	(6.418)
CCIRS	EUR 972.500	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,532%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2048	(15.823)	(14.979)
CCIRS	EUR 972.403	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 1,569%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2048	(22.060)	(24.122)
CCIRS	USD 1.260.000	Fund receives Fixed 2,921% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2048	5.080	5.078
CCIRS	USD 2.690.000	Fund receives Fixed 2,958% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2048	24.849	28.808
CCIRS	USD 1.430.000	Fund receives Fixed 3,020% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2048	30.950	31.318
CCIRS	USD 1.600.000	Fund receives Fixed 3,048% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2048	38.099	43.261
CCIRS	USD 1.440.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,114%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2048	(655)	(56.055)
CCIRS	GBP 810.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,804%	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2048	(51.358)	(52.639)
CCIRS	USD 960.000	Fund receives Fixed 3,015% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2053	17.775	17.805
CCIRS	GBP 1.610.000	Fund receives Fixed 1,376% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/5/2058	15.382	15.452
CCIRS	GBP 630.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,505%	Bank of America Merrill Lynch	27/2/2068	(14.444)	(14.401)
CCIRS	USD 950.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,842%	Deutsche Bank	27/1/2037	9.575	9.575

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 10.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Scandinavian Airlines	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2018	269	269
CDS	EUR 80.000	Fund receives default protection on Scandinavian Airlines and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2019	(3.379)	(3.379)
CDS	EUR 112.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on EDP - Energias de Portugal SA	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2021	(166)	17.714
CDS	EUR 650.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on British American Tobacco Plc	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2022	(4.274)	8.340
CDS	EUR 225.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Wendel SA	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2022	(6.258)	42.125
CDS	EUR 525.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Wendel SA	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2022	(14.601)	98.293
CDS	EUR 287.000	Fund receives default protection on Air Liquide SA and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	179	(9.684)
CDS	EUR 971.000	Fund receives default protection on Banco Santander SA and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	19.267	(6.180)
CDS	EUR 625.000	Fund receives default protection on Deutsche Telekom AG and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	5.862	(14.655)
CDS	EUR 650.000	Fund receives default protection on Rexel SA and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	9.272	(113.881)
CDS	EUR 716.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Atlantia SpA	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(10.925)	(1.399)
CDS	EUR 609.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Atlantia SpA	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(8.951)	(1.190)
CDS	EUR 1.375.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Diageo Plc	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(7.669)	43.922
CDS	EUR 2.050.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on RELX Plc	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(1.986)	56.428
CDS	USD 1.275.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Qantas Airways Ltd	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(1.808)	4.616
CDS	USD 600.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Peoples Republic of China	Barclays Bank	20/9/2020	13.194	8.867
CDS	JPY 15.857.728	Fund receives default protection on Mitsubishi Corp and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/12/2020	(432)	(2.782)
CDS	JPY 8.312.552	Fund receives default protection on Sumitomo Corp and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/12/2020	(1.817)	(1.445)
CDS	USD 5.760.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.25 and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/12/2020	(212.799)	(345.353)
CDS	USD 5.760.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.25	Barclays Bank	20/12/2020	274.927	345.353
CDS	USD 205.090	Fund receives default protection on Kingdom of Thailand and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2021	(3.631)	(3.885)
CDS	EUR 125.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Technip SA	Barclays Bank	20/12/2021	3.997	2.540
CDS	EUR 125.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Technip SA	Barclays Bank	20/12/2021	3.997	2.540
CDS	EUR 589.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Kingfisher Plc	Barclays Bank	20/6/2022	(254)	11.935
CDS	EUR 1.100.000	Fund receives default protection on Adecco Group AG and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	7.826	(26.450)
CDS	EUR 1.675.000	Fund receives default protection on Cie de Saint-Gobain and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	6.387	(38.053)
CDS	EUR 1.325.000	Fund receives default protection on Jaguar Land Rover Automotive Plc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	37.312	(156.741)
CDS	EUR 175.000	Fund receives default protection on Merck KGaA and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	33	(7.370)
CDS	EUR 900.000	Fund receives default protection on Novartis AG and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	1.332	(37.717)
CDS	EUR 1.025.000	Fund receives default protection on Pearson Plc and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	(4.235)	(24.735)
CDS	EUR 175.000	Fund receives default protection on Veolia Environnement SA and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	692	(4.370)
CDS	EUR 975.000	Fund receives default protection on Veolia Environnement SA and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	3.855	(24.348)
CDS	EUR 850.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Volvo AB	Barclays Bank	20/6/2023	(4.604)	17.948
CDS	EUR 900.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Volvo AB	Barclays Bank	20/6/2023	(4.874)	19.004
CDS	EUR 438.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Fiat Chrysler Automobiles NV	Barclays Bank	20/6/2023	(1.592)	71.812

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 52.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2023	13	(2.122)
CDS	USD 90.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	1.923	4.167
CDS	USD 204.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	1.282	2.671
CDS	USD 97.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2023	592	1.270
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Securitas AB	BNP Paribas	20/9/2019	92	1.666
CDS	EUR 140.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Securitas AB	BNP Paribas	20/9/2019	(191)	1.555
CDS	EUR 250.000	Fund receives default protection on Standard Chartered Bank and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/12/2020	(9.416)	(3.230)
CDS	EUR 280.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Safeway Ltd	BNP Paribas	20/12/2021	8.806	7.677
CDS	EUR 310.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Telefonaktiebolaget LM Ericsson	BNP Paribas	20/6/2022	3.244	(535)
CDS	EUR 575.000	Fund receives default protection on Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	6.939	374
CDS	EUR 3.096.000	Fund receives default protection on Banco Santander SA and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	58.238	(19.706)
CDS	EUR 3.122.555	Fund receives default protection on Banco Santander SA and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	58.737	(19.875)
CDS	EUR 1.200.000	Fund receives default protection on Renault SA and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	9.053	(16.429)
CDS	EUR 350.000	Fund receives default protection on Telekom Austria AG and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	1.009	(11.016)
CDS	EUR 1.125.000	Fund receives default protection on Telenor ASA and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	2.247	(40.032)
CDS	EUR 350.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on BP Plc	BNP Paribas	20/6/2023	(845)	8.965
CDS	EUR 1.075.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Fortum OYJ	BNP Paribas	20/6/2023	(198)	24.898
CDS	EUR 550.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Rolls-Royce Holdings Plc	BNP Paribas	20/6/2023	(2.805)	8.556
CDS	EUR 650.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Rolls-Royce Holdings Plc	BNP Paribas	20/6/2023	(3.315)	10.111
CDS	EUR 2.250.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Vinci SA	BNP Paribas	20/6/2023	(6.586)	60.060
CDS	USD 133.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	1.580	6.158
CDS	USD 133.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	BNP Paribas	20/6/2023	1.580	6.158
CDS	EUR 425.000	Fund receives default protection on TVN Finance Corp III AB and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/12/2020	42.008	(50.642)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Westpac Banking Corp and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/12/2020	(3.582)	(4.480)
CDS	USD 111.971	Fund receives default protection on Kingdom of Thailand and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2021	(1.936)	(2.121)
CDS	EUR 450.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Safeway Ltd	Citibank	20/12/2021	14.403	12.337
CDS	EUR 350.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Safeway Ltd	Citibank	20/12/2021	10.123	9.596
CDS	EUR 210.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Safeway Ltd	Citibank	20/12/2021	6.398	5.757
CDS	EUR 2.650.000	Fund receives default protection on Bayerische Motoren Werke AG and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	21.285	(62.113)
CDS	EUR 1.350.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Vodafone Group Plc	Citibank	20/6/2023	(11.531)	9.239
CDS	USD 50.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Citibank	20/6/2023	(80)	(2.040)
CDS	USD 90.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	1.973	4.167
CDS	USD 121.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	1.349	5.603
CDS	USD 235.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	1.405	3.077
CDS	USD 188.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	1.131	2.462

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 129.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	811	1.689
CDS	USD 118.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Citibank	20/6/2023	582	1.545
CDS	EUR 300.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Smurfit Kappa Acquisitions	Credit Suisse	20/9/2018	(21.119)	4.560
CDS	EUR 10.000	Fund receives default protection on Scandinavian Airlines and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2019	(401)	(422)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Scandinavian Airlines and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2019	(3.722)	(4.224)
CDS	EUR 118.000	Fund receives default protection on Cerved Group SpA and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2020	12.545	(11.829)
CDS	EUR 50.000	Fund receives default protection on Stena AB and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/12/2021	(5.901)	(964)
CDS	EUR 196.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on International Game Technology Plc	Credit Suisse	20/12/2021	(3.623)	25.747
CDS	EUR 196.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on International Game Technology Plc	Credit Suisse	20/12/2021	(3.623)	25.747
CDS	EUR 90.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Beni Stabili SpA SII Q	Credit Suisse	20/6/2022	1.776	15.380
CDS	EUR 202.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on TUI AG	Credit Suisse	20/6/2022	(2.052)	31.965
CDS	USD 5.000.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.29 and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/12/2022	(5.916)	(76.788)
CDS	USD 5.500.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.29 and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/12/2022	7.460	(84.467)
CDS	USD 4.000.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.29 and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/12/2022	3.036	(61.430)
CDS	USD 6.500.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.30 and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	7.104	(88.934)
CDS	USD 3.340.000	Fund receives Fixed 2,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.A.9	Credit Suisse	17/9/2058	44	(62.707)
CDS	USD 300.000	Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.BBB.9	Credit Suisse	17/9/2058	599	(26.082)
CDS	EUR 70.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Infineon Technologies Holding BV	Deutsche Bank	20/9/2018	(11.162)	1.038
CDS	USD 71.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	1.628	3.288
CDS	USD 40.000	Fund receives default protection on Rep Turkey and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	(93)	2.432
CDS	USD 195.000	Fund receives default protection on United Mexican States and pays Fixed 1,000%	Deutsche Bank	20/6/2023	1.734	2.553
CDS	USD 750.000	Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.BBB.9	Deutsche Bank	17/9/2058	(13.703)	(65.204)
CDS	EUR 70.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Imperial Tobacco Finance Plc	Goldman Sachs	20/9/2018	(11.771)	1.038
CDS	EUR 60.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Infineon Technologies Holding BV	Goldman Sachs	20/9/2018	(8.947)	890
CDS	EUR 90.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Scandinavian Airlines	Goldman Sachs	20/12/2018	3.767	2.417
CDS	EUR 20.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Scandinavian Airlines	Goldman Sachs	20/12/2018	537	537
CDS	EUR 130.000	Fund receives default protection on Scandinavian Airlines and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/3/2019	(388)	(4.484)
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Infineon Technologies Holding	Goldman Sachs	20/3/2019	(26.473)	5.687
CDS	EUR 211.000	Fund receives default protection on Cerved Group SpA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	22.664	(21.151)
CDS	EUR 211.000	Fund receives default protection on Cerved Group SpA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	22.215	(21.151)
CDS	EUR 97.000	Fund receives default protection on Cerved Group SpA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	10.478	(9.723)
CDS	EUR 113.000	Fund receives default protection on Cerved Group SpA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	12.196	(11.327)
CDS	EUR 131.000	Fund receives default protection on Cerved Group SpA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	14.448	(13.132)
CDS	EUR 201.000	Fund receives default protection on Cerved Group SpA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	23.386	(20.149)
CDS	EUR 84.000	Fund receives default protection on Cerved Group SpA and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	9.927	(8.420)

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 340.000	Fund receives default protection on Standard Chartered Bank and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(10.092)	(6.491)
CDS	EUR 193.000	Fund receives default protection on Sudzucker International Finance BV and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(3.696)	(2.598)
CDS	EUR 380.000	Fund receives default protection on Suedzucker AG and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(6.923)	(5.116)
CDS	EUR 194.000	Fund receives default protection on Suedzucker AG and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(4.171)	(2.612)
CDS	EUR 211.000	Fund receives default protection on Suedzucker AG and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(6.099)	(2.841)
CDS	JPY 9.775.171	Fund receives default protection on ITOCHU Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(1.059)	(1.685)
CDS	JPY 9.775.171	Fund receives default protection on ITOCHU Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(1.037)	(1.700)
CDS	JPY 5.000.000	Fund receives default protection on ITOCHU Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(625)	(870)
CDS	JPY 10.674.487	Fund receives default protection on ITOCHU Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(1.102)	(1.857)
CDS	JPY 9.775.171	Fund receives default protection on Mitsubishi Corp and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(416)	(1.715)
CDS	JPY 15.000.000	Fund receives default protection on Mitsui & Co Ltd and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(1.819)	(2.610)
CDS	JPY 9.775.171	Fund receives default protection on Mitsui & Co Ltd and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/12/2020	(1.333)	(1.701)
CDS	USD 600.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Asia ex-Japan IG Series 24 Version 1	Goldman Sachs	20/12/2020	23.851	8.450
CDS	EUR 175.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Cap Gemini SA	Goldman Sachs	20/12/2021	3.178	4.671
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Rentokil Initial Plc	Goldman Sachs	20/12/2021	194	3.313
CDS	EUR 260.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on EDP - Energias de Portugal SA	Goldman Sachs	20/12/2021	1.667	41.122
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Telefonaktiebolaget LM Ericsson	Goldman Sachs	20/6/2022	1.763	(431)
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Telefonaktiebolaget LM Ericsson	Goldman Sachs	20/6/2022	1.763	(431)
CDS	EUR 1.850.000	Fund receives default protection on British Telecommunications Plc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	19.897	(9.677)
CDS	EUR 75.000	Fund receives default protection on Carrefour SA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	40	(533)
CDS	EUR 375.000	Fund receives default protection on Carrefour SA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	198	(2.666)
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Carrefour SA and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	106	(1.422)
CDS	EUR 650.000	Fund receives default protection on PostNL NV and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	2.102	(10.555)
CDS	EUR 325.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Carlsberg Breweries A/S	Goldman Sachs	20/6/2023	(1.593)	7.670
CDS	EUR 1.600.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Enel SpA	Goldman Sachs	20/6/2023	(23.112)	5.649
CDS	EUR 400.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Heineken NV	Goldman Sachs	20/6/2023	(1.452)	10.368
CDS	EUR 375.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Goldman Sachs	20/6/2023	(760)	14.025
CDS	EUR 1.400.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on National Grid Plc	Goldman Sachs	20/6/2023	(4.596)	28.269
CDS	EUR 75.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Galp Energia SGPS SA	Goldman Sachs	20/6/2023	(996)	15.661
CDS	EUR 75.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Galp Energia SGPS SA	Goldman Sachs	20/6/2023	(1.072)	15.661
CDS	USD 291.684	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	12.005	(11.902)
CDS	USD 4.000.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.30 and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	4.272	(54.729)
CDS	USD 40.000	Fund receives default protection on Rep Turkey and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	34	2.432
CDS	USD 675.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Rio Tinto Ltd	Goldman Sachs	20/6/2023	(809)	12.481
CDS	USD 300.000	Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.BBB.9	Goldman Sachs	17/9/2058	2.203	(26.082)
CDS	EUR 382.000	Fund receives default protection on BNP Paribas and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	(574)	(8.786)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 143.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	1.976	6.621
CDS	USD 175.000	Fund receives default protection on Federative Republic of Brazil and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	2.450	8.103
CDS	USD 50.000	Fund receives default protection on Rep Turkey and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	130	3.040
CDS	USD 80.000	Fund receives default protection on Rep Turkey and pays Fixed 1,000%	HSBC	20/6/2023	67	4.865
CDS	EUR 220.000	Fund receives default protection on Metsa OYJ and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2018	(7.161)	(1.096)
CDS	JPY 8.438.819	Fund receives default protection on Sumitomo Corp and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(2.094)	(1.467)
CDS	USD 662.624	Fund receives default protection on Australia & New Zealand Banking Group Ltd and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(7.038)	(9.991)
CDS	USD 437.376	Fund receives default protection on Australia & New Zealand Banking Group Ltd and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(4.450)	(6.594)
CDS	USD 650.000	Fund receives default protection on Commonwealth Bank of Australia and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(7.428)	(9.732)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on National Australia Bank Ltd and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(4.143)	(4.527)
CDS	USD 53.188	Fund receives default protection on Kingdom of Thailand and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2021	(986)	(1.008)
CDS	USD 53.188	Fund receives default protection on Kingdom of Thailand and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2021	(964)	(1.008)
CDS	EUR 353.000	Fund receives default protection on Melia Hotels International SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2022	9.434	(65.307)
CDS	EUR 425.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on J Sainsbury Plc	JP Morgan	20/6/2022	13.748	2.231
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on J Sainsbury Plc	JP Morgan	20/6/2022	8.087	1.312
CDS	EUR 675.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Swedish Match AB	JP Morgan	20/6/2022	3.706	13.396
CDS	EUR 360.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Telefonaktiebolaget LM Ericsson	JP Morgan	20/6/2022	1.988	(621)
CDS	EUR 275.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Glencore International AG	JP Morgan	20/12/2022	(7.469)	45.779
CDS	EUR 700.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Glencore International AG	JP Morgan	20/12/2022	(19.013)	116.528
CDS	EUR 275.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Smurfit Kappa Group Plc	JP Morgan	20/12/2022	(4.222)	52.837
CDS	EUR 375.000	Fund receives default protection on Bayer AG and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	2.236	(10.471)
CDS	EUR 2.443.000	Fund receives default protection on CaixaBank SA and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	51.088	1.590
CDS	EUR 366.000	Fund receives default protection on Credit Agricole SA and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	(1.348)	(9.402)
CDS	EUR 1.050.000	Fund receives default protection on E.ON SE and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	3.019	(25.851)
CDS	EUR 925.000	Fund receives default protection on Koninklijke KPN NV and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	4.244	(5.640)
CDS	EUR 800.000	Fund receives default protection on Statoil ASA and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	5.109	(31.902)
CDS	EUR 1.000.000	Fund receives default protection on Statoil ASA and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	6.386	(39.877)
CDS	EUR 1.400.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Accor SA	JP Morgan	20/6/2023	(3.365)	26.994
CDS	EUR 1.175.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Gas Natural SDG SA	JP Morgan	20/6/2023	(8.746)	12.436
CDS	EUR 725.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Kering	JP Morgan	20/6/2023	(2.691)	21.774
CDS	EUR 900.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Nestle SA	JP Morgan	20/6/2023	(2.178)	34.646
CDS	EUR 725.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Nestle SA	JP Morgan	20/6/2023	(1.755)	27.909
CDS	EUR 1.850.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Vivendi SA	JP Morgan	20/6/2023	(999)	39.029
CDS	USD 6.401.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.30 and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	4.909	(87.580)
CDS	USD 3.500.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.30 and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	2.012	(47.888)
CDS	USD 3.500.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.30 and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	5.246	(47.888)

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 793.000	Fund receives default protection on Republic of the Philippines and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2023	2.922	(5.103)
CDS	EUR 130.000	Fund receives default protection on Standard Chartered Bank and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/12/2020	(5.761)	(2.482)
CDS	EUR 582.000	Fund receives default protection on Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	9.665	379
CDS	USD 167.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	11	(6.814)
CDS	USD 171.000	Fund receives default protection on Argentine Republic and pays Fixed 5,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	12	(6.977)
CDS	USD 35.000	Fund receives default protection on Rep Turkey and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	(143)	2.128
CDS	USD 5.000	Fund receives default protection on Rep Turkey and pays Fixed 1,000%	Morgan Stanley	20/6/2023	3	304
CDS	USD 300.000	Fund receives Fixed 3,000% and provides default protection on Markit CMBX.NA.BBB.9	Morgan Stanley	17/9/2058	3.120	(26.082)
CDS	EUR 225.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Technip SA	Societe Generale	20/12/2021	7.308	4.572
CDS	EUR 225.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Technip SA	Societe Generale	20/12/2021	6.282	4.572
CDS	EUR 725.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on J Sainsbury Plc	Societe Generale	20/6/2022	23.279	3.806
CDS	EUR 1.100.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Thales SA	Societe Generale	20/6/2022	4.769	29.184
CDS	EUR 250.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on TUI AG	Societe Generale	20/6/2022	(4.678)	39.560
CDS	EUR 425.000	Fund receives default protection on Anheuser-Busch InBev SA/NV and pays Fixed 1,000%	Societe Generale	20/6/2023	5.496	(6.185)
CDS	EUR 606.000	Fund receives default protection on Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA and pays Fixed 1,000%	Societe Generale	20/6/2023	7.313	394
CDS	EUR 1.260.000	Fund receives default protection on Carrefour SA and pays Fixed 1,000%	Societe Generale	20/6/2023	13.904	(8.959)
CDS	EUR 925.000	Fund receives default protection on Koninklijke KPN NV and pays Fixed 1,000%	Societe Generale	20/6/2023	5.166	(5.640)
CDS	EUR 425.000	Fund receives default protection on Rexel SA and pays Fixed 5,000%	Societe Generale	20/6/2023	5.447	(74.461)
CDS	EUR 1.200.000	Fund receives default protection on Sanofi and pays Fixed 1,000%	Societe Generale	20/6/2023	3.827	(43.322)
CDS	EUR 350.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Solvay SA	Societe Generale	20/6/2023	(132)	8.177
ILS	GBP 6.831.000	Fund receives Fixed 3,580% and pays Floating GBP 12 Month UKRPI	Barclays Bank	15/3/2022	107.123	107.123
ILS	GBP 2.731.000	Fund receives Floating GBP 12 Month UKRPI and pays Fixed 3,552%	Barclays Bank	15/3/2027	(71.063)	(71.063)
IRS	EUR 3.150.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,144%	Bank of America Merrill Lynch	25/4/2020	(1.161)	(543)
IRS	EUR 4.370.000	Fund receives Fixed 0,121% and pays Floating EUR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	18/5/2020	1.983	2.219
IRS	EUR 22.960.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,412%	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2020	(41.424)	(44.529)
IRS	GBP 1.904.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,078%	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2022	6.261	6.289
IRS	GBP 670.000	Fund receives Fixed 3,328% and pays Floating GBP 1 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/1/2023	3.482	3.493
IRS	CNY 18.877.323	Fund receives Fixed 3,966% and pays Floating CNY 3 Month 7D China Fixing Repo Rates	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	37.497	37.497
IRS	INR 11.847.088	Fund receives Fixed 6,983% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(585)	(585)
IRS	INR 31.116.800	Fund receives Fixed 7,126% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	776	776
IRS	KRW 603.585.000	Fund receives Fixed 2,252% and pays Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(164)	(164)
IRS	KRW 5.250.680.000	Fund receives Fixed 2,358% and pays Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	19.212	19.212
IRS	KRW 2.686.030.000	Fund receives Fixed 2,372% and pays Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	11.336	6
IRS	BRL 308.916	Fund receives Fixed 10,040% and pays Floating BRL 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(2.154)	(2.154)
IRS	BRL 758.977	Fund receives Fixed 9,555% and pays Floating BRL One Day Brazil Interbank Deposit Overnight Rate	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(8.169)	(8.169)
IRS	BRL 1.200.000	Fund receives Fixed 9,650% and pays Floating BRL 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(12.075)	(12.075)
IRS	BRL 658.471	Fund receives Fixed 9,855% and pays Floating BRL One Day Brazil Interbank Deposit Overnight Rate	Bank of America Merrill Lynch	2/1/2025	(5.596)	(5.596)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
IRS	CAD 1.010.000	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,749%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(8.690)	(8.677)
IRS	CAD 1.042.500	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,817%	Bank of America Merrill Lynch	1/6/2026	(12.377)	(12.364)
IRS	GBP 2.864.000	Fund receives Fixed 1,122% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2027	(85.102)	(85.102)
IRS	GBP 670.000	Fund receives Fixed 3,366% and pays Floating GBP 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2028	8.347	8.365
IRS	EUR 9.770.000	Fund receives Floating EUR 6 Month LIBOR and pays Fixed 0,856%	Bank of America Merrill Lynch	8/3/2028	23.428	23.625
IRS	GBP 2.620.000	Fund receives Fixed 3,320% and pays Floating GBP 12 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2028	1.071	1.139
IRS	GBP 451.000	Fund receives Floating GBP 12 Month LIBOR and pays Fixed 3,422%	Bank of America Merrill Lynch	15/3/2048	(6.170)	(6.146)
IRS	USD 770.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,018%	Barclays Bank	20/3/2037	(459)	(459)
IRS	INR 111.000.000	Fund receives Fixed 6,180% and pays Floating INR 1 Month LIBOR	Citibank	20/9/2022	41.308	41.308
IRS	COP 429.666.438	Fund receives Floating COP 3 Month LIBOR and pays Fixed 5,400%	Citibank	23/2/2023	(191)	(191)
IRS	COP 1.690.287.264	Fund receives Floating COP 3 Month LIBOR and pays Fixed 5,450%	Citibank	8/3/2023	(1.719)	(1.719)
IRS	COP 237.125.242	Fund receives Floating COP 3 Month LIBOR and pays Fixed 5,450%	Citibank	12/3/2023	(236)	(236)
IRS	CNY 5.200.000	Fund receives Fixed 3,610% and pays Floating CNY 3 Month LIBOR	Citibank	19/9/2023	(879)	(879)
IRS	INR 32.115.600	Fund receives Fixed 7,128% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Citibank	19/9/2023	822	822
IRS	KRW 603.585.000	Fund receives Fixed 2,225% and pays Floating KRW 3 Month LIBOR	Citibank	19/9/2023	(785)	(785)
IRS	MXN 91.043.000	Fund receives Fixed 8,030% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Deutsche Bank	9/1/2019	(2.063)	(2.063)
IRS	MXN 81.388.000	Fund receives Fixed 7,900% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Deutsche Bank	8/1/2020	(14.900)	(14.900)
IRS	MXN 5.124.000	Fund receives Fixed 7,710% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Deutsche Bank	5/1/2022	(2.172)	(2.172)
IRS	INR 16.700.112	Fund receives Fixed 7,080% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	16	16
IRS	INR 31.116.800	Fund receives Fixed 7,170% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	1.482	1.482
IRS	INR 29.286.400	Fund receives Fixed 7,180% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	1.547	1.547
IRS	MXN 702.000	Fund receives Fixed 7,790% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Deutsche Bank	31/12/2025	(464)	(464)
IRS	USD 5.080.000	Fund receives Fixed 2,401% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Goldman Sachs	17/3/2020	(17.267)	(17.267)
IRS	USD 5.080.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,600%	Goldman Sachs	17/3/2021	12.314	12.314
IRS	CNY 7.140.000	Fund receives Fixed 3,770% and pays Floating CNY 3 Month LIBOR	Goldman Sachs	19/9/2023	5.719	5.719
IRS	USD 1.450.000	Fund receives Fixed 2,982% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Goldman Sachs	14/3/2027	3.215	3.215
IRS	INR 28.547.200	Fund receives Fixed 7,130% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	JP Morgan	19/9/2023	767	767
IRS	KRW 1.331.660.000	Fund receives Fixed 2,338% and pays Floating KRW 3 Month LIBOR	JP Morgan	19/9/2023	3.875	3.875
IRS	KRW 1.551.880.000	Fund receives Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate and pays Fixed 1,837%	JP Morgan	20/9/2027	17.518	17.518
TRS	EUR 5.500.000	Fund receives 3 Month EURIBOR and pays iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index	Societe Generale	20/6/2018	(2.685)	(2.685)
TRS	EUR 25.500.000	Fund receives 3 Month EURIBOR and pays iBoxx Euro Corporates Overall Total Return Index	Societe Generale	20/9/2018	(64.709)	(64.709)
Total (exposition brute sous-jacente – 1.601.820.082 EUR)					744.127	783.335

CCDCS : Centrally Cleared Credit Default Swaps ou swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale
CCILS : Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)
CCIRS : Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)
CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance
ILS (inflation linked swaps) : swaps liés à l'inflation
IRS (interest rate swaps) : swaps sur taux d'intérêt
TRS (total return swaps) : swaps sur rendement total

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
AUD	40.000	CAD	38.415	Citibank	20/6/2018	546
AUD	220.000	EUR	137.115	State Street Bank & Trust Company	14/6/2018	5.832
BRL	856.206	USD	229.116	BNP Paribas	4/6/2018	684
BRL	3.185.444	USD	852.407	Goldman Sachs	4/6/2018	2.544
BRL	8.681.067	USD	2.455.664	UBS	4/6/2018	(106.923)
BRL	858.616	USD	234.000	BNP Paribas	3/7/2018	(3.521)
BRL	1.415.000	USD	397.371	Morgan Stanley	14/8/2018	(17.074)
CAD	90.946	AUD	90.000	HSBC	20/6/2018	1.759
CAD	39.061	AUD	40.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(118)
CAD	50.000	CHF	38.378	Citibank	20/6/2018	(321)
CAD	300.000	EUR	185.119	Goldman Sachs	14/6/2018	13.550
CAD	220.000	EUR	137.123	Royal Bank of Canada	14/6/2018	8.567
CAD	210.000	EUR	138.593	State Street Bank & Trust Company	14/6/2018	475
CAD	48.394	EUR	30.000	ANZ	20/6/2018	2.038
CAD	94.276	NZD	100.000	HSBC	20/6/2018	2.327
CHF	46.769	EUR	40.000	Barclays Bank	20/6/2018	730
CHF	34.786	EUR	30.000	Nomura	20/6/2018	295
CHF	30.000	JPY	3.316.422	JP Morgan	20/6/2018	(105)
CLP	168.823.200	USD	273.000	JP Morgan	3/7/2018	(4.736)
EUR	90.315	AUD	145.000	Bank of America	4/6/2018	(3.954)
EUR	144.288	AUD	230.000	Merrill Lynch	14/6/2018	(5.157)
EUR	74.677	AUD	120.000	HSBC	14/6/2018	(3.294)
EUR	80.964	CAD	130.000	Morgan Stanley	14/6/2018	(5.125)
EUR	125.502	CAD	200.000	Barclays Bank	14/6/2018	(6.943)
EUR	74.391	CAD	120.000	HSBC	14/6/2018	(5.077)
EUR	455.982	CAD	710.000	Societe Generale	14/6/2018	(14.199)
EUR	125.906	CAD	190.000	State Street Bank & Trust Company	14/6/2018	82
EUR	30.000	CAD	48.488	Toronto	20/6/2018	(2.100)
EUR	70.000	CHF	81.877	Dominion Bank	14/6/2018	(1.305)
EUR	129.552	GBP	114.000	Credit Suisse	20/6/2018	(508)
EUR	757.521	GBP	670.000	Bank of America	14/6/2018	(6.676)
EUR	68.068	GBP	60.000	Merrill Lynch	14/6/2018	(367)
EUR	2.689.608	GBP	2.360.000	State Street Bank & Trust Company	14/6/2018	(2.191)
EUR	510.030	GBP	450.000	Barclays Bank	14/6/2018	(3.237)
EUR	319.952	GBP	280.000	BNP Paribas	14/6/2018	586
EUR	138.624	GBP	120.000	HSBC	14/6/2018	1.753
EUR	112.725.401	GBP	100.120.000	Morgan Stanley	14/6/2018	(1.470.757)
EUR	30.000	GBP	26.258	Royal Bank of Canada	14/6/2018	56
EUR	1.145.895	GBP	1.000.000	Societe Generale	20/6/2018	7.277
EUR	576.510	GBP	510.000	State Street Bank & Trust Company	14/8/2018	(4.185)
EUR	1.739.047	GBP	1.520.000	Barclays Bank	14/8/2018	8.347
EUR	22.820	HKD	220.000	BNP Paribas	14/8/2018	(1.228)
EUR	7.564	HKD	70.000	HSBC	14/6/2018	(88)
EUR	2.052	HKD	20.000	Royal Bank of Canada	14/6/2018	(135)
EUR	75.391	JPY	9.966.000	State Street Bank & Trust Company	14/6/2018	(3.446)
EUR	38.425	JPY	4.864.000	Westpac	4/6/2018	(43)
EUR	243.232	MXN	5.700.000	Standard	5/7/2018	(812)
EUR	515.311	MXN	12.050.000	Chartered Bank	14/6/2018	(607)
EUR	60.000	NZD	102.642	Bank of America	14/6/2018	(1.673)
EUR	314.495	NZD	528.000	Merrill Lynch	20/6/2018	(2.515)
EUR	136.525	PLN	580.000	JP Morgan	29/6/2018	2.202
EUR	9.668	SEK	100.000	UBS	14/6/2018	(63)
EUR	186.853	SEK	1.900.000	BNP Paribas	14/6/2018	1.952
EUR	641.288	SEK	6.600.000	Deutsche Bank	14/8/2018	(1.001)
EUR	97.420	SEK	1.000.000	HSBC	14/8/2018	103

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	12.288	SGD	20.000	Bank of America	14/6/2018	(520)
EUR	142.233	SGD	230.000	Merrill Lynch	14/6/2018	(5.064)
EUR	153.471	SGD	250.000	HSBC	14/6/2018	(6.635)
EUR	30.338	TRY	160.000	Societe Generale	14/6/2018	172
EUR	11.723	TRY	60.000	HSBC	14/6/2018	411
EUR	34.113	USD	41.000	State Street Bank & Trust Company	14/6/2018	(1.076)
EUR	57.805	USD	70.000	Barclays Bank	4/6/2018	(2.273)
EUR	1.084.000	USD	1.312.512	Deutsche Bank	4/6/2018	(42.475)
EUR	1.305.717	USD	1.540.902	Nomura	4/6/2018	(16.776)
EUR	92.138.018	USD	111.555.000	International Toronto	4/6/2018	(3.605.064)
EUR	32.385.518	USD	38.711.867	Dominion Bank	4/6/2018	(832.937)
EUR	595.500	USD	711.771	UBS	7/6/2018	(15.267)
EUR	88.219.136	USD	110.000.000	Barclays Bank	7/6/2018	(6.123.970)
EUR	9.248.802	USD	11.060.000	Goldman Sachs	14/6/2018	(236.969)
EUR	170.082	USD	210.000	Bank of America	14/6/2018	(10.028)
EUR	881.594	USD	1.090.000	Merrill Lynch	14/6/2018	(53.261)
EUR	3.324.853	USD	4.130.000	Morgan Stanley	14/6/2018	(217.302)
EUR	358.900	ZAR	5.440.000	Royal Bank of Canada	14/6/2018	(9.940)
EUR	1.077.514	ZAR	16.000.000	State Street Bank & Trust Company	14/6/2018	(7.311)
EUR	7.866	ZAR	120.000	UBS	14/6/2018	(260)
GBP	280.000	EUR	318.928	Toronto	20/6/2018	438
GBP	160.000	EUR	181.887	Dominion Bank	14/6/2018	607
GBP	160.000	EUR	182.639	BNP Paribas	14/6/2018	(145)
GBP	280.000	EUR	320.046	Goldman Sachs	14/6/2018	(680)
GBP	120.000	EUR	137.716	HSBC	14/6/2018	(845)
GBP	26.225	EUR	30.000	Royal Bank of Canada	20/6/2018	(93)
GBP	701.652	EUR	795.884	Dominion Bank	14/6/2018	3.029
GBP	1.010.000	EUR	1.144.178	Goldman Sachs	14/8/2018	5.827
GBP	328.348	EUR	372.430	Bank of America	14/8/2018	1.433
GBP	990.000	EUR	1.130.118	Merrill Lynch	14/8/2018	(2.886)
GBP	30.000	NOK	324.587	Barclays Bank	14/8/2018	212
IDR	4.062.140.121	USD	288.607	Citibank	20/6/2018	2.780
IDR	488.635.840	USD	34.496	JP Morgan	8/6/2018	524
IDR	2.080.785.000	USD	149.000	HSBC	8/6/2018	40
IDR	8.020.000.000	USD	565.665	Standard	27/6/2018	4.393
JPY	3.278.295	CHF	29.479	Chartered Bank	14/8/2018	257
JPY	4.507.486	CHF	40.521	Morgan Stanley	20/6/2018	363
JPY	4.864.000	EUR	38.434	Barclays Bank	20/6/2018	43
JPY	4.471.836	NZD	60.000	Citibank	4/6/2018	(681)
JPY	3.884.658	SEK	300.000	Deutsche Bank	20/6/2018	1.534
JPY	7.662.284	USD	70.000	Barclays Bank	20/6/2018	599
MXN	22.038.653	USD	1.175.000	JP Morgan	4/6/2018	(62.510)
MXN	23.131.903	USD	1.175.000	UBS	20/6/2018	(18.470)
MXN	15.070.631	USD	774.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(35.592)
MYR	1.101.722	USD	277.651	HSBC	26/11/2018	(951)
MYR	1.112.882	USD	280.712	Goldman Sachs	8/6/2018	(1.174)
MYR	549.479	USD	138.408	Morgan Stanley	8/6/2018	(415)
MYR	6.550.000	USD	1.659.404	UBS	8/6/2018	(16.734)
NOK	324.629	CHF	40.000	Goldman Sachs	14/8/2018	(831)
NOK	291.256	EUR	30.000	Royal Bank of Scotland	20/6/2018	509
NOK	289.273	EUR	30.000	Bank of America	20/6/2018	301
NOK	322.526	GBP	30.000	Merrill Lynch	20/6/2018	(428)
NZD	51.427	EUR	30.000	Citibank	20/6/2018	900
NZD	51.620	EUR	30.000	HSBC	20/6/2018	1.016
NZD	60.000	JPY	4.565.154	BNP Paribas	20/6/2018	(57)

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
RUB	18.536.800	USD	320.000	Deutsche Bank	6/6/2018	(19.127)
RUB	20.230.300	USD	316.445	Morgan Stanley	12/7/2018	6.104
RUB	13.547.581	USD	211.499	UBS	12/7/2018	4.442
SEK	603.754	EUR	60.000	BNP Paribas	20/6/2018	(1.250)
SEK	26.813.959	EUR	2.532.462	Deutsche Bank	14/8/2018	76.980
SEK	300.000	JPY	3.772.342	JP Morgan	20/6/2018	(645)
SGD	300.000	EUR	184.499	Goldman Sachs	14/6/2018	7.628
TRY	1.546.865	USD	341.000	Barclays Bank	22/6/2018	(1.798)
TRY	3.995.000	USD	915.340	Bank of America		
				Merrill Lynch	14/8/2018	(49.370)
USD	200.000	ARS	4.296.600	BNP Paribas	2/7/2018	27.531
USD	110.000	ARS	2.357.300	BNP Paribas	31/7/2018	17.256
USD	110.000	ARS	2.357.300	Citibank	31/7/2018	17.256
USD	215.000	ARS	4.673.760	JP Morgan	31/7/2018	31.568
USD	22.000	ARS	581.214	JP Morgan	8/8/2018	8
USD	341.000	ARS	7.639.150	BNP Paribas	14/9/2018	51.811
USD	234.000	BRL	856.206	BNP Paribas	4/6/2018	3.508
USD	914.000	BRL	3.185.444	Goldman Sachs	4/6/2018	50.319
USD	2.347.341	BRL	8.681.067	UBS	4/6/2018	13.954
USD	179.517	BRL	660.000	Barclays Bank	14/8/2018	2.988
USD	72.064	BRL	260.000	Standard		
				Chartered Bank	14/8/2018	2.326
USD	63.322	CHF	63.009	Nomura		
				International	18/7/2018	(728)
USD	273.000	CLP	166.994.100	JP Morgan	3/7/2018	7.218
USD	303.893	CNY	1.933.991	Barclays Bank	7/6/2018	1.895
USD	8.041.086	EUR	6.727.434	Deutsche Bank	7/6/2018	172.581
USD	1.000.000	EUR	841.518	HSBC	7/6/2018	16.577
USD	842.459	EUR	716.035	JP Morgan	7/6/2018	6.875
USD	650.908	EUR	548.997	Standard		
				Chartered Bank	7/6/2018	9.544
USD	487.765	EUR	397.000	Goldman Sachs	3/7/2018	20.686
USD	134.298	EUR	113.355	Nomura		
				International	17/8/2018	1.261
USD	228.917	HKD	1.795.295	Barclays Bank	7/6/2018	134
USD	1.393.317	IDR	19.835.922.477	HSBC	8/6/2018	(27.293)
USD	334.290	IDR	4.625.224.030	BNP Paribas	20/6/2018	2.344
USD	329.163	IDR	4.556.149.579	Citibank	20/6/2018	2.194
USD	186.874	IDR	2.584.462.877	Deutsche Bank	20/6/2018	1.379
USD	558.481	IDR	7.733.048.589	HSBC	20/6/2018	3.552
USD	407.545	IDR	5.636.974.498	JP Morgan	20/6/2018	2.968
USD	130.152	IDR	1.799.867.500	UBS	20/6/2018	968
USD	297.000	IDR	4.222.300.500	Barclays Bank	27/6/2018	(4.664)
USD	314.248	IDR	4.532.077.446	Deutsche Bank	14/8/2018	(7.099)
USD	1.744.212	IDR	24.727.000.000	Morgan Stanley	14/8/2018	(13.397)
USD	2.857.586	INR	193.445.554	HSBC	8/6/2018	(6.748)
USD	960.225	JPY	104.422.500	Citibank	7/6/2018	(2.060)
USD	4.337.628	KRW	4.665.943.099	Nomura		
				International	8/6/2018	12.229
USD	1.175.000	MXN	23.069.293	Goldman Sachs	4/6/2018	18.272

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
USD	671.000	MXN	12.899.170	UBS	20/6/2018	23.825
USD	774.000	MXN	15.454.303	Citibank	23/7/2018	6.642
USD	658.541	MXN	13.191.755	Deutsche Bank	22/8/2018	6.554
USD	1.437.813	MYR	5.679.362	Barclays Bank	8/6/2018	10.506
USD	427.350	MYR	1.700.000	Morgan Stanley	14/8/2018	1.497
USD	1.225.502	MYR	4.850.000	UBS	14/8/2018	9.645
USD	836.000	RUB	51.992.930	BNP Paribas	7/6/2018	924
USD	37.856	RUB	2.207.014	BNP Paribas	12/7/2018	2.187
USD	508.551	RUB	31.570.867	HSBC	12/7/2018	3.068
USD	48.134	TRY	198.758	Goldman Sachs	20/6/2018	3.902
USD	240.670	TRY	993.223	Morgan Stanley	20/6/2018	19.617
USD	52.196	TRY	215.566	Royal Bank		
				of Scotland	20/6/2018	4.225
USD	129.941	TRY	580.000	Barclays Bank	14/8/2018	4.650
USD	210.500	TRY	930.000	Deutsche Bank	14/8/2018	9.288
USD	207.778	TRY	920.000	HSBC	14/8/2018	8.797
USD	97.796	TWD	2.907.268	Bank of America		
				Merrill Lynch	8/6/2018	675
USD	334.263	ZAR	4.076.459	Barclays Bank	20/6/2018	10.524
USD	354.371	ZAR	4.320.440	Goldman Sachs	20/6/2018	11.242
USD	1.390.877	ZAR	17.664.519	Barclays Bank	16/8/2018	5.039
ZAR	6.020.299	USD	487.593	Toronto		
				Dominion Bank	20/6/2018	(10.347)
						(12.329.374)
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	5.289.686	EUR	4.448.251	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	158.022
EUR	67.360	CHF	79.701	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	(2.044)
						155.978
Catégorie d'Actions couverte en couronnes suédoises						
EUR	2.893.830	SEK	29.734.449	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	467
SEK	1.739.433.743	EUR	167.568.102	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	1.690.605
						1.691.072
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
EUR	7.605	USD	8.908	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	(36)
USD	121.933	EUR	102.473	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	2.114
						2.078
Total (exposition brute sous-jacente – 638.869.956 EUR)						(10.480.246)

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
690	Put	iShares USD High Yield Corp Bond	Exchange Traded	USD 98,00	15/6/2018	(44.854)	5.922
47	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.450,00	15/6/2018	(97.126)	6.050
21	Call	US Treasury 10 Year Note Futures	Exchange Traded	USD 120,75	22/6/2018	(1.712)	5.632
7	Call	90 Day Euro Futures	Exchange Traded	USD 97,38	18/3/2019	857	2.103
4.250.000	Put	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 104,00	6/11/2018	1.277	39.996
Total (exposition brute sous-jacente – 3.354.375 EUR)						(141.558)	59.703

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Options vendues au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	(Moins-value) non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
(5)	Call	2 Year Mid-Curve Futures	Exchange Traded	USD 97,25	15/3/2019	(838)	(2.119)
Total (exposition brute sous-jacente – 424.362 EUR)						(838)	(2.119)

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous- jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
148	EUR	3 Month Euribor	Décembre 2019	148.000.000	39.238
164	GBP	3 Month Sterling Put Futures-Style Option (HSBC) (strike price GBP 99,25)	Juin 2018	-	(9.355)
(44)	AUD	90 Day Bank Bill	Décembre 2018	28.436.563	699
(14)	USD	90 Day Euro	Mars 2020	11.971.393	1.621
(104)	USD	90 Day Euro	Juin 2020	88.930.350	(1.048)
(7)	USD	90 Day Euro	Décembre 2020	5.985.697	(601)
83	USD	90 Day Euro	Mars 2020	70.973.260	(7.692)
35	USD	90 Day Euro	Mars 2019	29.928.483	(1.111)
66	USD	90 Day Euro	Décembre 2018	56.436.568	5.428
(66)	USD	90 Day Euro	Décembre 2019	56.436.568	(14.161)
32	GBP	90 Day Sterling	Décembre 2018	18.223.918	4.663
(17)	GBP	90 Day Sterling	Septembre 2020	9.681.457	(5.605)
17	GBP	90 Day Sterling	Septembre 2019	9.681.457	6.574
(32)	GBP	90 Day Sterling	Décembre 2019	18.223.918	(8.842)
217	AUD	Australian 10 Year Bond	Juin 2018	18.092.225	105.114
(5)	AUD	Australian 10 Year Bond	Juin 2018	416.872	(7.354)
35	AUD	Australian 3 Year Bond	Juin 2018	2.515.100	702
42	CAD	Banker's Acceptance Bill	Décembre 2018	27.647.535	6.855
(42)	CAD	Banker's Acceptance Bill	Décembre 2019	27.647.535	(6.039)
(203)	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	12.747.558	(336.161)
31	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	1.838.019	51.652
196	EUR	Euro BOBL	Juin 2018	43.437.188	245.115
(78)	EUR	Euro BOBL	Juin 2018	22.635.184	(166.170)
20	EUR	Euro BTP	Juin 2018	2.305.960	(124.509)
(27)	EUR	Euro BTP	Juin 2018	2.653.560	74.790
65	EUR	Euro Bund	Juin 2018	10.547.355	191.939
(90)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	18.030.393	(186.908)
1	EUR	Euro BUXL	Juin 2018	151.236	2.060
(26)	EUR	Euro BUXL	Juin 2018	3.932.136	(191.960)
(12)	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	1.215.300	(4.565)
19	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	1.924.225	7.220
172	EUR	Euro-OAT	Juin 2018	20.680.936	361.993
(64)	EUR	Euro-OAT	Juin 2018	7.695.232	(113.520)
(2)	JPY	Japan 10 Year Bond	Juin 2018	1.623.173	(7.436)
14	KRW	Korean 10 Year Bond	Juin 2018	1.333.128	6.019
(292)	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	42.290.702	(630.680)
(99)	USD	US Long Bond	Septembre 2018	10.377.923	(172.489)
33	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	2.802.302	(2.824)
(610)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	52.510.034	(328.641)
2	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	172.164	208
(29)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	2.462.629	(172)
(123)	USD	US Treasury 2 Year Note	Septembre 2018	20.695.936	(34.231)
113	USD	US Treasury 2 Year Note	Septembre 2018	19.013.340	(676)
(534)	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	44.428.518	128.899
126	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	10.483.133	7.987
54	USD	US Ultra Bond	Septembre 2018	5.252.587	136.226
(71)	USD	US Ultra Bond	Septembre 2018	6.906.179	(88.717)
Total				979.374.929	(1.066.465)

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaptions achetées au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
1.310.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/5/2021; and pays 3,5% Fixed semi-annually from 3/2/2021	Bank of America Merrill Lynch	USD 3,50	1/2/2021	(13.737)	24.706
9.240.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Cap. If exercised Fund receives Max USD 0 - 5 Year Constant Maturity Swap - 0,24% quarterly from 24/4/2018; and pays 0,24% on 24/1/2019	Barclays Bank	USD 0,24	24/1/2019	(8.144)	2.443
9.840.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Cap. If exercised Fund receives Max USD 0 - 5 Year Constant Maturity Swap - 0,33% annually from 30/1/2019; and pays 0,33% on 30/1/2019	Barclays Bank	USD 0,33	30/1/2019	(7.383)	1.317
1.030.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,75% Fixed semi-annually from 15/3/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/6/2019	Barclays Bank	USD 2,75	13/3/2019	(21.284)	11.868
103.180.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 19/11/2020; and pays 1,1% Fixed semi-annually from 19/5/2020	Barclays Bank	JPY 1,10	15/5/2020	(5.559)	4.771
51.590.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,65% Fixed semi-annually from 10/6/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 10/12/2020	Barclays Bank	JPY 0,65	8/6/2020	(5.148)	6.557
51.590.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 10/12/2020; and pays 0,65% Fixed semi-annually from 10/6/2020	Barclays Bank	JPY 0,65	8/6/2020	(3.812)	7.892
19.250.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,66% Fixed semi-annually from 16/9/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 16/3/2021	Barclays Bank	JPY 0,66	14/9/2020	(1.530)	2.533
19.250.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 16/3/2021; and pays 0,66% Fixed semi-annually from 16/9/2020	Barclays Bank	JPY 0,66	14/9/2020	(791)	3.272
2.850.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/2/2023; and pays 3,35% Fixed semi-annually from 15/2/2023	Barclays Bank	USD 3,35	13/2/2023	(19.191)	175.798
1.210.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 11/2/2034; and pays 4% Fixed annually from 11/8/2033	Barclays Bank	EUR 4,00	9/8/2033	(14.306)	27.439
256.410.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 23/11/2019; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 23/11/2019	Citibank	JPY 1,25	21/5/2019	(35.994)	90
256.410.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 30/11/2019; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 30/11/2019	Citibank	JPY 1,25	28/5/2019	(35.313)	91
1.430.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/5/2021; and pays 3,5% Fixed semi-annually from 3/2/2021	Citibank	USD 3,50	1/2/2021	(19.698)	26.969
103.180.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 13/7/2022; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 13/1/2022	Credit Suisse	JPY 1,25	11/1/2022	(6.925)	5.065
103.180.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 24/8/2022; and pays 1,55% Fixed semi-annually from 24/2/2022	Credit Suisse	JPY 1,55	22/2/2022	(5.400)	3.886
4.850.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,25% Fixed semi-annually from 19/10/2018; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 19/1/2019	Deutsche Bank	USD 1,25	17/10/2018	(27.982)	1
16.600.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/2/2019; and pays 3,25% Fixed semi-annually from 15/2/2019	Deutsche Bank	USD 3,25	13/2/2019	(37.965)	59.294

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaptions achetées au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
269.500.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 11/1/2020; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 11/1/2020	Deutsche Bank	JPY 1,25	9/7/2019	(34.499)	145
77.000.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 19/1/2020; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 19/1/2020	Deutsche Bank	JPY 1,25	17/7/2019	(9.483)	45
77.000.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 1/2/2020; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 1/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,25	30/7/2019	(8.922)	50
77.000.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 8/2/2020; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 8/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,25	6/8/2019	(8.678)	53
77.000.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 15/2/2020; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 15/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,25	13/8/2019	(8.092)	56
77.000.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 19/2/2020; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 19/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,25	15/8/2019	(8.065)	57
192.500.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 29/2/2020; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 29/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,25	28/8/2019	(7.824)	63
2.850.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/5/2022; and pays 1,75% Fixed semi-annually from 10/2/2022	Deutsche Bank	USD 1,75	7/11/2019	(20.013)	253
1.620.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,6% Fixed semi-annually from 27/1/2027; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 27/4/2027	Deutsche Bank	USD 2,60	25/1/2027	(17.888)	(17.888)
1.070.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,4% Fixed semi-annually from 10/2/2027; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/5/2027	Deutsche Bank	USD 2,40	8/2/2027	(11.123)	(11.123)
1.150.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 5/2/2020; and pays 4% Fixed semi-annually from 5/2/2020	Goldman Sachs	USD 4,00	3/2/2020	(6.903)	11.476
2.200.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 5/8/2022; and pays 3,25% Fixed semi-annually from 5/5/2022	Goldman Sachs	USD 3,25	3/5/2022	(15.090)	91.714
275.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,113% Fixed semi-annually from 28/4/2023; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023	Goldman Sachs	USD 3,11	26/4/2023	6.763	29.781
275.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/7/2023; and pays 3,113% Fixed semi-annually from 28/04/2023	Goldman Sachs	USD 3,11	26/4/2023	(1.921)	21.097
257.180.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 20/12/2019; and pays 1,25% Fixed semi-annually from 20/12/2019	JP Morgan	JPY 1,25	18/6/2019	(35.499)	112
55.000.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,78% Fixed semi-annually from 20/04/2021; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 20/10/2021	JP Morgan	JPY 0,78	16/4/2021	(3.763)	10.161
55.000.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 20/10/2021; and pays 0,78% Fixed semi-annually from 20/4/2021	JP Morgan	JPY 0,78	16/4/2021	3.257	17.181

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaptions achetées au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
103.180.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 18/9/2022; and pays 1,6% Fixed semi-annually from 18/3/2022	JP Morgan	JPY 1,60	16/3/2022	(6.823)	3.818
103.180.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 6/10/2022; and pays 1,45% Fixed semi-annually from 6/4/2022	JP Morgan	JPY 1,45	4/4/2022	(5.622)	4.545
10.780.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 18/11/2022; and pays 3% Fixed semi-annually from 18/8/2022	JP Morgan	USD 3,00	16/8/2022	10.353	427.367
1.070.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,5% Fixed semi-annually from 19/2/2027; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 19/5/2027	JP Morgan	USD 2,50	17/2/2027	(9.763)	(9.763)
1.220.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 14/7/2027; and pays 3% Fixed semi-annually from 14/4/2027	JP Morgan	USD 3,00	12/4/2027	(12.457)	59.631
480.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,985% Fixed semi-annually from 29/4/2038; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/7/2038	JP Morgan	USD 2,99	27/4/2038	4.098	22.555
480.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/7/2038; and pays 2,985% Fixed semi-annually from 29/4/2038	JP Morgan	USD 2,99	27/4/2038	321	18.779
19.250.000	Call	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,66% Fixed semi-annually from 16/9/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 16/3/2021	Morgan Stanley	JPY 0,66	14/9/2020	(1.546)	2.533
19.250.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 16/3/2021; and pays 0,66% Fixed semi-annually from 16/9/2020	Morgan Stanley	JPY 0,66	14/9/2020	(808)	3.272
Total (exposition brute sous-jacente – 31.966.288 EUR)						(459.826)	1.070.288

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaptions vendues au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
(8.640.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 21/7/2020; and pays 2,944% Fixed semi-annually from 21/4/2020	Bank of America Merrill Lynch	USD 2,94	17/4/2020	(6.603)	(55.219)
(8.640.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,944% Fixed semi-annually from 21/4/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 21/7/2020	Bank of America Merrill Lynch	USD 2,94	17/4/2020	(822)	(49.438)
(3.270.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5,5% Fixed semi-annually from 3/2/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/5/2021	Bank of America Merrill Lynch	USD 5,50	1/2/2021	16.024	(7.042)
(1.390.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,45% Fixed semi-annually from 10/9/2018; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/12/2018	Barclays Bank	USD 2,45	6/9/2018	(31.165)	(48.385)
(8.300.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/5/2019; and pays 2,5% Fixed semi-annually from 15/2/2019	Barclays Bank	USD 2,50	13/2/2019	1.080	(29.288)
(2.060.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/6/2019; and pays 2% Fixed semi-annually from 15/3/2019	Barclays Bank	USD 2,00	13/3/2019	22.658	(3.057)
(5.500.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,2% Fixed semi-annually from 7/5/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/8/2019	Barclays Bank	USD 3,20	2/5/2019	3.157	(9.508)
(5.770.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,7% Fixed semi-annually from 6/11/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 6/2/2020	Barclays Bank	USD 1,70	4/11/2019	12.407	(3.055)
(5.770.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 6/2/2020; and pays 2,7% Fixed semi-annually from 6/11/2019	Barclays Bank	USD 2,70	4/11/2019	(22.208)	(39.526)
(18.690.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 5/5/2020; and pays 3,15% Fixed semi-annually from 5/2/2020	Barclays Bank	USD 3,15	3/2/2020	(5.376)	(72.866)
(103.180.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,1% Fixed semi-annually from 19/5/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 19/11/2020	Barclays Bank	JPY 2,10	15/5/2020	2.131	(948)
(1.400.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2% Fixed annually from 6/5/2021; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 6/11/2021	Barclays Bank	EUR 2,00	4/5/2021	3.187	(25.964)
(4.285.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,1% Fixed semi-annually from 4/3/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 4/6/2019	Citibank	USD 3,10	28/2/2019	1.447	(7.222)
(256.410.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 23/11/2019; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 23/11/2019	Citibank	JPY 1,75	21/5/2019	25.313	(39)
(256.410.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 30/11/2019; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 30/11/2019	Citibank	JPY 1,75	28/5/2019	24.301	(39)
(3.580.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5,5% Fixed semi-annually from 3/2/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/5/2021	Citibank	USD 5,50	1/2/2021	21.772	(7.710)
(8.730.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/7/2020; and pays 2,888% Fixed semi-annually from 16/4/2020	Credit Suisse	USD 2,89	14/4/2020	(496)	(51.664)
(8.730.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,888% Fixed semi-annually from 16/4/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/7/2020	Credit Suisse	USD 2,89	14/4/2020	(2.439)	(53.607)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaptions vendues au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
(1.540.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/10/2018; and pays 2,454% Fixed semi-annually from 17/7/2018	Deutsche Bank	USD 2,45	13/7/2018	33.809	(502)
(1.540.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,454% Fixed semi-annually from 17/7/2018; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 17/10/2018	Deutsche Bank	USD 2,45	13/7/2018	(16.093)	(50.404)
(4.850.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 19/1/2019; and pays 0,9% Fixed semi-annually from 19/10/2018	Deutsche Bank	USD 0,90	17/10/2018	15.702	–
(30.180.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,95% Fixed semi-annually from 31/1/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 30/4/2019	Deutsche Bank	USD 2,95	29/1/2019	(22.587)	(68.605)
(269.500.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 11/1/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 11/1/2020	Deutsche Bank	JPY 1,75	9/7/2019	24.010	(65)
(77.000.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 19/1/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 19/1/2020	Deutsche Bank	JPY 1,75	17/7/2019	6.593	(20)
(77.000.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 1/2/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 1/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,75	30/7/2019	6.117	(23)
(77.000.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 8/2/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 8/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,75	6/8/2019	5.946	(25)
(77.000.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 15/2/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 15/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,75	13/8/2019	5.453	(26)
(77.000.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 19/2/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 19/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,75	15/8/2019	5.518	(27)
(77.000.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 29/2/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 29/2/2020	Deutsche Bank	JPY 1,75	28/8/2019	5.364	(30)
(192.500.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 11/5/2020; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 11/5/2020	Deutsche Bank	JPY 1,75	7/11/2019	13.923	(127)
(5.630.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,2% Fixed semi-annually from 11/2/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 11/5/2020	Deutsche Bank	USD 2,20	7/2/2020	1.550	(10.428)
(5.630.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 11/5/2020; and pays 3,2% Fixed semi-annually from 11/2/2020	Deutsche Bank	USD 3,20	7/2/2020	(2.947)	(20.400)
(5.540.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 19/5/2020; and pays 2,35% Fixed semi-annually from 19/2/2020	Deutsche Bank	USD 2,35	14/2/2020	1.471	(13.407)
(5.540.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,35% Fixed semi-annually from 19/2/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 19/5/2020	Deutsche Bank	USD 3,35	14/2/2020	2.370	(15.848)
(8.480.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/6/2020; and pays 2,876% Fixed semi-annually from 16/4/2020	Deutsche Bank	USD 2,88	14/4/2020	105	(49.524)
(8.480.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,876% Fixed semi-annually from 16/4/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/7/2020	Deutsche Bank	USD 2,88	14/4/2020	(3.118)	(52.748)

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaptions vendues au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
(7.500.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,55% Fixed semi-annually from 27/5/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 27/8/2020	Deutsche Bank	USD 3,55	22/5/2020	5.447	(18.623)
(4.470.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 2/9/2020; and pays 2,9% Fixed semi-annually from 2/6/2020	Deutsche Bank	USD 2,90	29/5/2020	136	(28.149)
(4.470.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,9% Fixed semi-annually from 2/6/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 2/9/2020	Deutsche Bank	USD 2,90	29/5/2020	82	(28.203)
(6.930.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,45% Fixed semi-annually from 29/6/2018; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/9/2018	Goldman Sachs	USD 1,45	27/6/2018	(112.948)	(143.780)
(7.930.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,6% Fixed semi-annually from 25/3/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/6/2019	Goldman Sachs	USD 2,60	21/3/2019	(4.094)	(48.095)
(4.700.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,15% Fixed semi-annually from 7/5/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/8/2020	Goldman Sachs	USD 3,15	5/5/2020	938	(20.833)
(6.290.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,35% Fixed semi-annually from 2/6/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 2/9/2020	Goldman Sachs	USD 3,35	29/5/2020	(1.902)	(21.660)
(2.820.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/4/2022; and pays 1,7% Fixed semi-annually from 7/1/2022	Goldman Sachs	USD 1,70	5/1/2022	25.869	(16.925)
(5.510.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,25% Fixed semi-annually from 5/5/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 5/8/2022	Goldman Sachs	USD 3,25	3/5/2022	14.547	(91.105)
(115.500.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed semi-annually from 6/3/2019; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 6/9/2019	JP Morgan	JPY 1,00	4/3/2019	3.209	(49)
(115.500.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed semi-annually from 13/3/2019; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 13/9/2019	JP Morgan	JPY 1,00	11/3/2019	3.245	(52)
(7.930.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/6/2019; and pays 2,2% Fixed semi-annually from 25/3/2019	JP Morgan	USD 2,20	21/3/2019	3.716	(4.912)
(5.140.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,15% Fixed semi-annually from 25/3/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/6/2019	JP Morgan	USD 3,15	21/3/2019	3.327	(8.345)
(5.930.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 1/7/2019; and pays 1,75% Fixed semi-annually from 1/4/2019	JP Morgan	USD 1,75	28/3/2019	22.454	(1.011)
(5.930.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,75% Fixed semi-annually from 1/4/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 1/7/2019	JP Morgan	USD 2,75	28/3/2019	(1.900)	(26.975)
(3.330.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,35% Fixed semi-annually from 10/4/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/7/2019	JP Morgan	USD 2,35	8/4/2019	(11.495)	(31.230)
(3.930.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/7/2019; and pays 2,2% Fixed semi-annually from 16/4/2019	JP Morgan	USD 2,20	12/4/2019	1.836	(2.754)
(7.850.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,6% Fixed semi-annually from 16/4/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 16/7/2019	JP Morgan	USD 2,60	12/4/2019	(17.398)	(49.399)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Swaptions vendues au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
(7.700.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,15% Fixed semi-annually from 10/5/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/8/2019	JP Morgan	USD 3,15	8/5/2019	36.776	(98.791)
(13.755.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/9/2019; and pays 2,45% Fixed semi-annually from 3/6/2019	JP Morgan	USD 2,45	30/5/2019	(180)	(21.851)
(13.755.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,25% Fixed semi-annually from 3/6/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/9/2019	JP Morgan	USD 3,25	30/5/2019	(1.900)	(23.571)
(257.180.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1,75% Fixed semi-annually from 20/12/2019; and pays Floating JPY LIBOR 6 Month BBA semi-annually from 20/12/2019	JP Morgan	JPY 1,75	18/6/2019	24.619	(49)
(18.480.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 8/2/2020; and pays 2,7% Fixed semi-annually from 8/11/2019	JP Morgan	USD 2,70	6/11/2019	(75.384)	(126.822)
(9.470.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 23/1/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 23/4/2020	JP Morgan	USD 2,85	21/1/2020	(24.315)	(56.570)
(4.700.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,5% Fixed semi-annually from 20/5/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 20/8/2020	JP Morgan	USD 3,50	18/5/2020	5.141	(12.567)
(2.300.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,15% Fixed annually from 21/4/2021; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 21/10/2021	JP Morgan	EUR 2,15	19/4/2021	5.797	(33.996)
(690.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0,65% Fixed semi-annually from 7/1/2019; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/4/2019	Morgan Stanley	EUR 0,65	3/1/2019	877	(1.319)
(690.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 7/4/2019; and pays 1,65% Fixed semi-annually from 7/1/2019	Morgan Stanley	EUR 1,65	3/1/2019	1.870	(964)
(8.250.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/5/2020; and pays 2,35% Fixed semi-annually from 25/2/2020	UBS	USD 2,35	21/2/2020	(514)	(20.261)
(8.250.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,35% Fixed semi-annually from 25/2/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/5/2020	UBS	USD 3,35	21/2/2020	2.173	(23.934)
Total (exposition brute sous-jacente – 117.661.411 EUR)						57.583	(1.709.581)

BlackRock Global Absolute Return Bond Fund suite

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 mai 2018

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis			
USD 13.328.840	Fannie Mae Pool 2,50% TBA	11.150.032	2,47
USD 32.281.500	Fannie Mae Pool 3,00% TBA	27.567.359	6,11
USD (663.000)	Fannie Mae Pool 3,00% TBA	(566.181)	(0,13)
USD 8.264.000	Fannie Mae Pool 3,50% TBA	7.074.921	1,57
USD (79.349.000)	Fannie Mae Pool 3,50% TBA	(67.931.745)	(15,06)
USD (7.000.000)	Fannie Mae Pool 3,50% TBA	(5.986.222)	(1,33)
USD 11.207.500	Fannie Mae Pool 4,00% TBA	9.833.485	2,18
USD 61.918.000	Fannie Mae Pool 4,00% TBA	54.252.257	12,03
USD (5.572.000)	Fannie Mae Pool 4,00% TBA	(4.888.885)	(1,08)
USD 7.771.000	Freddie Mac 4,00% TBA	6.819.074	1,51
USD 13.225.000	Ginnie Mae II Pool 4,00% TBA	11.636.011	2,58
		48.960.106	10,85
Total (exposition brute sous-jacente – 207.706.171 EUR)		48.960.106	10,85

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	18,60
Titres hypothécaires	16,95
Titres adossés à des actifs	14,21
Gouvernement	13,94
Biens de consommation cyclique	4,25
Biens de consommation non cyclique	3,96
Communications	3,72
<i>Exchange Traded Funds</i>	3,52
Services aux collectivités	2,59
Énergie	2,51
Organismes de placement collectif	2,22
Technologie	2,14
Matériaux de base	2,01
Valeurs industrielles	1,68
Diversifiés	0,20
Portefeuille de titres à la valeur de marché	92,50
Autres éléments de l'actif net	7,50
	100,00

BlackRock Global Event Driven Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES				Etats-Unis suite			
19.862	Bermudes Axalta Coating Systems Ltd	619.099	0,04	USD 2.250.000	Chesapeake Energy Corp 8,00% 15/6/2027	2.238.728	0,16
		619.099	0,04	USD 8.000.000	CSC Holdings LLC '144A' 6,625% 15/10/2025	8.280.000	0,60
50.000	Canada Bombardier Inc 'B'	190.675	0,01	USD 5.000.000	First Data Corp '144A' 5,00% 15/1/2024	5.025.000	0,36
		190.675	0,01	USD 5.685.000	Frontier Communications Corp 8,125% 1/10/2018	5.784.488	0,42
13.660	Pays-Bas Akzo Nobel NV	1.208.020	0,09	USD 7.500.000	GenOn Americas Generation LLC (Defaulted) 9,125% 1/5/2031	3.921.750	0,28
		1.208.020	0,09	USD 5.975.000	HCA Inc 4,25% 15/10/2019	6.049.687	0,44
28.108	Royaume-Uni Reckitt Benckiser Group Plc	2.199.989	0,16	USD 6.241.000	Kindred Healthcare Inc 8,00% 15/1/2020	6.685.671	0,49
		2.199.989	0,16	USD 3.335.000	Kindred Healthcare Inc 8,75% 15/1/2023	3.564.281	0,26
8.718	Etats-Unis AmerisourceBergen Corp	726.733	0,05	USD 7.500.000	Newell Brands Inc 3,85% 1/4/2023	7.467.479	0,54
		339.756	0,03	USD 13.888.000	Pinnacle Entertainment Inc 5,625% 1/5/2024	14.582.400	1,06
1.479	Anthem Inc	339.756	0,03	USD 3.000.000	Rite Aid Corp 6,75% 15/6/2021	3.057.900	0,22
540.909	Arconic Inc	9.666.044	0,70	USD 13.940.000	Rite Aid Corp '144A' 6,125% 1/4/2023	14.305.925	1,04
11.126	Broadcom Inc	2.797.855	0,20	USD 10.000.000	RSP Permian Inc 6,625% 1/10/2022	10.425.000	0,76
5.044	Brookdale Senior Living Inc	40.175	0,00	USD 7.561.000	Sprint Communications Inc '144A' 9,00% 15/11/2018	7.759.476	0,56
12.632	Charter Communications Inc 'A'	3.354.933	0,24	USD 5.000.000	Sprint Corp 7,625% 15/2/2025	5.162.500	0,37
289.954	Coty Inc 'A'	3.859.288	0,28	USD 5.000.000	Tallgrass Energy Partners LP Via Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5,50% 15/1/2028	4.875.000	0,35
25.788	CVS Health Corp	1.671.062	0,12	USD 5.000.000	Tenet Healthcare Corp 4,75% 1/6/2020	5.062.500	0,37
36.631	Discovery Communications Inc 'A'	766.687	0,06	USD 132.000	Tenet Healthcare Corp 6,875% 15/11/2031	121.110	0,01
12.018	Evo Payments Inc 'A'	249.974	0,02	USD 17.000.000	United States Treasury Bill 5/7/2018 (Zero Coupon)	16.972.128	1,23
146.950	GreenSky Inc	3.927.974	0,29	USD 10.000.000	United States Treasury Bill 18/10/2018 (Zero Coupon)	9.924.670	0,72
24.711	Kraft Heinz Co/The*	1.432.497	0,10	USD 13.000.000	United States Treasury Bill 1/11/2018 (Zero Coupon)	12.891.019	0,93
6.447	Macy's Inc	228.288	0,02	USD 3.574.998	VICI Properties 1 LLC Via VICI FC Inc 8,00% 15/10/2023	3.986.373	0,29
47.458	Olin Corp	1.548.080	0,11			167.259.534	12,12
387.358	QUALCOMM Inc	22.462.890	1,63	Total des obligations		182.303.907	13,21
9.782	Sherwin-Williams Co/The	3.776.341	0,27				
54.331	T-Mobile US Inc	3.032.213	0,22				
21.049	Tenet Healthcare Corp	755.659	0,06				
97.030	VICI Properties Inc	1.927.986	0,14				
48.663	Walgreens Boots Alliance Inc	3.055.063	0,22				
		65.619.498	4,76				
Total des actions ordinaires		69.837.281	5,06				
OBLIGATIONS				CERTIFICATS DE DÉPÔT			
USD 4.806.000	Canada Bombardier Inc '144A' 7,75% 15/3/2020	5.124.398	0,37	USD 27.050.000	Barclays Bank Plc/New York FRN 16/11/2018	27.050.000	1,96
		2.506.250	0,18	USD 4.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 17/8/2018	4.000.000	0,29
USD 2.500.000	Bombardier Inc '144A' 6,125% 15/1/2023	2.590.625	0,19	USD 10.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,178% 13/11/2018	10.000.000	0,73
USD 2.500.000	Bombardier Inc '144A' 7,50% 15/3/2025	10.221.273	0,74	USD 15.000.000	Citibank/New York 1,83% 18/6/2018	15.000.000	1,09
USD 4.660.000	Luxembourg Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 9,75% 15/7/2025	4.823.100	0,35	USD 18.000.000	DNB ASA 2,08% 6/8/2018	18.000.000	1,30
		4.823.100	0,35	USD 6.700.000	HSBC Bank USA NA 2,30% 4/9/2018	6.700.000	0,49
USD 4.000.000	Etats-Unis BI-LO LLC BI-LO Finance Corp '144A' (Defaulted) 9,25% 15/2/2019	4.010.000	0,29	USD 15.000.000	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd 2,34% 22/6/2018	15.000.000	1,09
		5.106.449	0,37	USD 8.200.000	Mizuho Bank Ltd/Sydney 2,165% 18/7/2018	8.200.000	0,59
USD 5.000.000	Charter Communications Operating LLC Via Charter Communications Operating Capital 4,464% 23/7/2022			USD 10.000.000	Royal Bank of Canada/New York 2,138% 9/8/2018	10.000.000	0,72
				USD 7.000.000	Royal Bank of Canada/New York 2,173% 6/11/2018	7.000.000	0,51
				USD 15.200.000	Standard Chartered Bank 2,128% 14/6/2018	15.200.000	1,10
				USD 16.400.000	Standard Chartered Bank 2,148% 9/7/2018	16.400.000	1,19

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

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 11.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 2,452% 12/10/2018	11.000.000	0,80	USD 5.100.000	Hyundai Capital America 25/6/2018 (Zero Coupon)	5.091.806	0,37
USD 5.000.000	Sumitomo Mitsui Trust and Banking Ltd/New York 2,168% 21/6/2018	5.000.000	0,36	USD 20.250.000	ING US Funding LLC 2,098% 9/7/2018	20.250.000	1,47
USD 11.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 2,452% 12/10/2018	11.000.000	0,80	USD 7.750.000	ING US Funding LLC 2,515% 7/1/2019	7.750.000	0,56
USD 10.000.000	Svenska Handelsbanken AB/New York FRN 17/12/2018	10.000.000	0,72	USD 8.000.000	JP Morgan Securities LLC 22/2/2019 (Zero Coupon)	7.853.404	0,57
USD 1.500.000	The Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ 2,26% 31/8/2018	1.500.000	0,11	USD 5.220.000	Liberty Street Funding LLC 16/7/2018 (Zero Coupon)	5.205.123	0,38
USD 12.000.000	Wells Fargo Bank NA 2,185% 19/11/2018	12.000.000	0,87	USD 12.800.000	Macquarie Bank Ltd 26/7/2018 (Zero Coupon)	12.755.022	0,92
		203.050.000	14,72	USD 10.000.000	Macquarie Bank Ltd 2,148% 9/8/2018	10.000.000	0,72
Total des certificats de dépôt		203.050.000	14,72	USD 3.600.000	Manhattan Asset Funding Co LLC 21/6/2018 (Zero Coupon)	3.596.160	0,26
BILLET DE TRÉSORERIE				USD 25.000.000	Marriott International Inc/MD 'A' 11/6/2018 (Zero Coupon)	24.983.125	1,81
Etats-Unis				USD 25.000.000	Nbcuniversal Enterprise Inc 19/7/2018 (Zero Coupon)	25.000.000	1,81
USD 16.300.000	AbbVie Inc 19/6/2018 (Zero Coupon)	16.282.885	1,18	USD 13.800.000	Nederlandse Waterschapsbank NV RegS 7/6/2018 (Zero Coupon)	13.795.304	1,00
USD 19.650.000	American Honda Motor Co 7/6/2018 (Zero Coupon)	19.643.515	1,42	USD 32.000.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 1/8/2018 (Zero Coupon)	31.886.133	2,31
USD 4.000.000	ASB Finance Ltd/London 2,178% 21/9/2018	4.000.000	0,29	USD 6.100.000	Old Line Funding LLC 30/7/2018 (Zero Coupon)	6.077.406	0,44
USD 16.300.000	AstraZeneca Plc 19/7/2018 (Zero Coupon)	16.248.927	1,18	USD 6.500.000	Omnicom Capital Inc 6/6/2018 (Zero Coupon)	6.497.969	0,47
USD 12.000.000	Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 10/7/2018 (Zero Coupon)	11.976.340	0,87	USD 21.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 8/6/2018 (Zero Coupon)	20.991.139	1,52
USD 12.000.000	Bedford Row Funding Corp 24/7/2018 (Zero Coupon)	11.959.720	0,87	USD 9.000.000	Prudential Plc 18/6/2018 (Zero Coupon)	8.991.500	0,65
USD 1.805.000	Bell Canada 6/6/2018 (Zero Coupon)	1.804.376	0,13	USD 10.000.000	Reckitt Benckiser Group Plc 18/7/2018 (Zero Coupon)	9.968.928	0,72
USD 15.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,143% 22/8/2018	15.000.000	1,09	USD 15.500.000	Rogers Communications Inc 24/7/2018 (Zero Coupon)	15.446.602	1,12
USD 7.500.000	Chariot Funding LLC 3/7/2018 (Zero Coupon)	7.484.600	0,54	USD 15.300.000	Skandinaviska Enskilda Banken 21/6/2018 (Zero Coupon)	15.283.340	1,11
USD 7.500.000	Ciesco LLC 20/7/2018 (Zero Coupon)	7.477.031	0,54	USD 10.600.000	Suncor Energy Inc 8/6/2018 (Zero Coupon)	10.575.602	0,77
USD 10.375.000	Ciesco LLC 16/10/2018 (Zero Coupon)	10.277.478	0,74	USD 15.200.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,493% 10/5/2019	15.200.000	1,10
USD 5.000.000	Coca-Cola Company/The FRN 8/6/2018	4.998.192	0,36	USD 15.000.000	TransCanada PipeLines Ltd 18/6/2018 (Zero Coupon)	14.982.646	1,09
USD 5.250.000	Coca-Cola Company/The 13/6/2018 (Zero Coupon)	5.247.113	0,38	USD 6.500.000	United Overseas Bank Ltd 21/11/2018 (Zero Coupon)	6.423.628	0,47
USD 9.000.000	CRC Funding LLC 5/11/2018 (Zero Coupon)	8.903.838	0,65	USD 8.000.000	Victory Receivables Corp 5/6/2018 (Zero Coupon)	7.998.062	0,58
USD 15.100.000	Crown Point Capital Co LLC 5/7/2018 (Zero Coupon)	15.067.199	1,09	USD 5.904.000	Volkswagen Credit Inc 22/6/2018 (Zero Coupon)	5.894.873	0,43
USD 15.100.000	Danske Corp 2/8/2018 (Zero Coupon)	15.041.357	1,09	USD 10.250.000	Volkswagen Credit Inc 25/6/2018 (Zero Coupon)	10.231.892	0,74
USD 14.500.000	Deutsche Telekom AG 4/6/2018 (Zero Coupon)	14.497.450	1,05	USD 13.000.000	Walgreens Boots Alliance Inc 18/6/2018 (Zero Coupon)	12.985.512	0,94
USD 1.912.000	Electricite de France SA 12/6/2018 (Zero Coupon)	1.910.756	0,14	USD 8.400.000	Walgreens Boots Alliance Inc 26/7/2018 (Zero Coupon)	8.366.377	0,61
USD 9.351.000	Eni Finance USA Inc 5/7/2018 (Zero Coupon)	9.326.612	0,68	USD 2.000.000	Waste Management Inc 12/6/2018 (Zero Coupon)	1.998.711	0,14
USD 25.000.000	Fairway Finance Corp 5/7/2018 (Zero Coupon)	24.946.167	1,81			585.067.778	42,40
USD 9.400.000	Federation des caisses Desjardins du Quebec 14/6/2018 (Zero Coupon)	9.393.958	0,68	Total des billets de trésorerie		585.067.778	42,40
USD 7.500.000	HSBC Bank Plc RegS 2,337% 11/4/2019	7.500.000	0,54				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
EXCHANGE TRADED FUNDS			
	Etats-Unis		
741.570	Altaba Inc	57.301.114	4,15
		57.301.114	4,15
	Total des <i>Exchange Traded Funds</i>	57.301.114	4,15
	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	57.301.114	4,15
	Portefeuille de titres à la valeur de marché	1.097.560.080	79,54
	Autres éléments de l'actif net	282.281.689	20,46
	Total de l'actif net (USD)	1.379.841.769	100,00

BlackRock Global Event Driven Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Canada				Etats-Unis suite			
(14.752)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Citibank	(1.784.481)	(1.329)	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Citibank	(2.802)
(3.760)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Morgan Stanley	(428.072)	230.003	Express Scripts Holding Co	Goldman Sachs	249.621
			(2.212.553)	14.752	Fairfax Financial Holdings Ltd	Citibank	(5.246.910)
				3.760	Fairfax Financial Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.310.975)
Royaume-Uni				(2.555)	FedEx Corp	Citibank	(1.258)
651.129	Fenner Plc	Goldman Sachs	—	(288.972)	Fifth Third Bancorp	Morgan Stanley	393.002
225.656	Sky Plc	Goldman Sachs	(8.902)	(387.564)	Fifth Third Bancorp	UBS	253.317
399.706	Sky Plc	Credit Suisse	(26.566)	(4.749)	FMC Corp	Morgan Stanley	12.421
337.657	Sky Plc	Citibank	(83.037)	(27.749)	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	(4.085)
152.679	Worldpay Inc	Morgan Stanley	(530.626)	984.621	General Cable Corp	Goldman Sachs	1.930
			(649.131)	(34.991)	General Electric Co	Citibank	34.782
				(17.621)	Genesis Energy LP	Citibank	2.001
Etats-Unis				2.338.531	Gramercy Property Trust (Reit)	Goldman Sachs	96.568
(2.794)	3M Co	Citibank	1.835	(4.119)	Honeywell International Inc	Citibank	4.537
(13.597)	Advanced Micro Devices Inc	Citibank	(12.237)	487.517	ILG Inc	Goldman Sachs	351.507
(6.606)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	(8.476)	(3.982)	Illinois Tool Works Inc	Citibank	4.946
471.950	Aetna Inc	Morgan Stanley	(100.500)	(5.972)	Intel Corp	Goldman Sachs	(8.531)
(2.614)	Air Products & Chemicals Inc	Morgan Stanley	10.070	(2.942)	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	2.389
456.823	Akorn Inc	Goldman Sachs	(18.273)	(7.419)	International Paper Co	Morgan Stanley	8.759
(3.643)	Albemarle Corp	Morgan Stanley	22.210	(2.286)	Kellogg Co	Citibank	(5.501)
(222.469)	Alibaba Group Holding Ltd ADR	Citibank	(503.856)	(1.290)	Kimberly-Clark Corp	Citibank	2.626
(2.280)	Altria Group Inc	Citibank	(1.319)	(69.316)	Kinder Morgan Inc/DE	Citibank	(37.190)
397.751	AmTrust Financial Services Inc	UBS	7.955	(2.211)	KLA-Tencor Corp	Citibank	(2.498)
(1.313)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	(4.558)	(661)	KLA-Tencor Corp	Goldman Sachs	(1.936)
(3.598)	Analog Devices Inc	Citibank	(5.901)	(1.503)	Lam Research Corp	Citibank	1.819
222.936	Andeavor	UBS	1.439.335	(588)	Lam Research Corp	Goldman Sachs	335
(6.884)	Andeavor Logistics LP	Citibank	5.571	(4.082)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Morgan Stanley	9.780
(14.063)	Antero Midstream Partners LP	Citibank	(6.802)	(7.111)	Magellan Midstream Partners LP	Citibank	(7.534)
21.193	Anthem Inc	Citibank	(76.085)	(363.162)	Marathon Petroleum Corp	UBS	(1.178.823)
(4.990)	Applied Materials Inc	Citibank	(6.113)	(80.440)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs	(320.023)
(2.658)	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	6.078	(1.942)	Martin Marietta Materials Inc	Morgan Stanley	(9.489)
(3.689)	Archer-Daniels-Midland Co	Citibank	2.595	(6.948)	Marvell Technology Group Ltd	Citibank	1.112
(1.045)	ASML Holding NV Reg	Citibank	4.734	(852.113)	Marvell Technology Group Ltd	JP Morgan	155.338
(834)	ASML Holding NV Reg	Goldman Sachs	1.147	(582.857)	Marvell Technology Group Ltd	Goldman Sachs	54.495
(329.962)	AT&T Inc	Citibank	47.844	(5.802)	Maxim Integrated Products Inc	Citibank	(3.481)
(489.962)	AT&T Inc	Morgan Stanley	64.491	(1.654)	Maxim Integrated Products Inc	Goldman Sachs	(1.849)
(3.988)	Avery Dennison Corp	Morgan Stanley	9.886	199.291	MB Financial Inc	Morgan Stanley	(275.022)
(3.791)	Ball Corp	Citibank	2.901	267.300	MB Financial Inc	UBS	(59.760)
(11.834)	Ball Corp	Morgan Stanley	4.895	(3.601)	Microchip Technology Inc	Citibank	(13.072)
1.476	Ball Corp	Morgan Stanley	8.829	(1.310)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	(5.054)
(52.126)	Boardwalk Pipeline Partners LP	Citibank	20.347	(5.941)	Micron Technology Inc	Citibank	(713)
(2.067)	Boeing Co/The	Citibank	879	(2.186)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs	(8.158)
(8.401)	Buckeye Partners LP	Citibank	10.959	(770)	MKS Instruments Inc	Citibank	(3.350)
(4.389)	Caterpillar Inc	Citibank	11.961	(590)	Monolithic Power Systems Inc	Citibank	(2.484)
267.894	Cavium Inc	Goldman Sachs	(267.747)	140.494	Monsanto Co	JP Morgan	369.499
391.650	Cavium Inc	JP Morgan	859.024	317.609	Monsanto Co	Morgan Stanley	242.166
54.797	CBS Corp 'B non-voting share'	Citibank	(61.375)	100.552	Monsanto Co	Goldman Sachs	228.253
(3.099)	Church & Dwight Co Inc	Citibank	(1.402)	318.718	Monsanto Co	Citibank	583.254
(55.982)	Cigna Corp	Goldman Sachs	185.453	(17.135)	Mosaic Co/The	Morgan Stanley	120
(1.153)	Clorox Co/The	Citibank	(2.416)	(13.869)	MPLX LP	Citibank	14.303
(3.412)	Coca-Cola Co/The	Citibank	(1.250)	(10.990)	Newmont Mining Corp	Morgan Stanley	(1.891)
(222.044)	Concho Resources Inc	Goldman Sachs	1.396.063	(1.962)	Northrop Grumman Corp	Citibank	(8.998)
(883)	Costco Wholesale Corp	Citibank	27	(6.914)	Nucor Corp	Morgan Stanley	(3.601)
(3.751)	Cummins Inc	Citibank	12.938	(812)	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	(6.041)
(395.399)	CVS Health Corp	Morgan Stanley	333.662	725.257	NXP Semiconductors NV	JP Morgan	8.015.630
(5.005)	Cypress Semiconductor Corp	Citibank	(1.627)	405.167	NXP Semiconductors NV	Citibank	(202.584)
(4.173)	Deere & Co	Citibank	13.657	(5.988)	ON Semiconductor Corp	Citibank	(9.341)
(3.609)	DowDuPont Inc	Citibank	8.558	(1.370)	PepsiCo Inc	Citibank	614
129.632	DowDuPont Inc	Morgan Stanley	(313.773)	(1.486)	Philip Morris International Inc	Citibank	698
(4.386)	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	12.836	(7.551)	Phillips 66 Partners LP	Citibank	(4.455)
(3.030)	Ecolab Inc	Morgan Stanley	8.163	(3.738)	PPG Industries Inc	Morgan Stanley	4.599
(9.058)	Emerson Electric Co	Citibank	14.051	(2.827)	Praxair Inc	Morgan Stanley	4.393
(22.775)	Enbridge Inc	Citibank	8.531	(1.806)	Procter & Gamble Co/The	Citibank	537
(1.976)	Entegris Inc	Citibank	(1.680)	(1.784)	Qorvo Inc	Citibank	(250)
(33.828)	Enterprise Products Partners LP	Citibank	(10.816)				
(7.257)	EQT Midstream Partners LP	Citibank	288				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Event Driven Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(3.101)	Qualcomm Inc	Goldman Sachs	(6.231)	359.057	Tribune Media Co 'A'	Goldman Sachs	(549.357)
(3.153)	Raytheon Co	Citibank	(11.420)	(41.786)	Tribune Media Co 'A'	Morgan Stanley	45.129
(2.922)	Rockwell Automation Inc	Citibank	7.793	428.946	Tribune Media Co 'A'	JP Morgan	(94.368)
791.719	Rockwell Collins Inc	Goldman Sachs	2.146.341	734.735	Twenty-First Century Fox Inc 'A'	Goldman Sachs	285.292
693.694	RSP Permian Inc	Goldman Sachs	(1.329.245)	(4.837)	Union Pacific Corp	Citibank	(9.255)
(9.156)	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	3.974	(5.322)	United Parcel Service Inc 'B'	Citibank	(7.327)
54.600	SHIRE Plc (ADR's)	UBS	12.951	(4.785)	United Technologies Corp	Citibank	10.035
(82.577)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Goldman Sachs	243.602	(167.700)	United Technologies Corp	Goldman Sachs	20.760
9.610	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(23.545)	(16.017)	UnitedHealth Group Inc	Citibank	22.670
(98.656)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	JP Morgan	(29.597)	530.457	Validus Holdings Ltd	Goldman Sachs	190.965
(2.568)	Skyworks Solutions Inc	Citibank	2.131	452.941	Validus Holdings Ltd	JP Morgan	39.180
(982)	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs	(963)	609.133	VeriFone Systems Inc	Goldman Sachs	(34.048)
(10.452)	Spectra Energy Partners LP	Citibank	4.846	(3.335)	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	(1.159)
(3.447)	Stanley Black & Decker Inc	Citibank	15.248	(1.829)	Walmart Inc	Citibank	(387)
(2.759)	Sysco Corp	Citibank	(4.557)	(201.682)	Walt Disney Co/The	Goldman Sachs	524.991
(6.613)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	Citibank	7.307	(8.205)	Western Gas Partners LP	Citibank	(1.002)
(10.038)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	Goldman Sachs	5.748	(724)	Westlake Chemical Corp	Citibank	2.697
(274.909)	Takada Pharmaceutic SP (ADR's)	UBS	(33.236)	(6.833)	WestRock Co	Morgan Stanley	9.692
(5.628)	Tallgrass Energy Partners LP	Citibank	3.498	228.101	Williams Cos Inc/The	Citibank	(93.948)
(2.793)	Teradyne Inc	Citibank	(1.452)	77.455	Williams Partners LP	Citibank	(53.728)
(3.067)	Texas Instruments Inc	Citibank	(5.245)	(152.679)	Worldpay Inc 'A'	Morgan Stanley	(490.338)
(1.572)	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs	(4.702)	(3.585)	Xilinx Inc	Citibank	13.874
385.639	Time Warner Inc	Citibank	(389.495)	(347)	Xilinx Inc	Goldman Sachs	801
347.189	Time Warner Inc	Morgan Stanley	(257.483)	1.111.530	XL Group Ltd	Goldman Sachs	400.151
				576.771	XL Group Ltd	JP Morgan	177.098
							6.253.945
				Total (exposition brute sous-jacente – 1.439.193.627 USD)			3.392.261

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 5.000.000	Fund receives default protection on Kraft Heinz Co/The and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	34.541	(5.701)
CDS	USD 5.000.000	Fund receives default protection on Kraft Heinz Co/The and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	43.152	(5.701)
CDS	USD 14.500.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.30 and pays Fixed 5,000%	Credit Suisse	20/6/2023	(30.736)	(915.236)
CDS	USD 7.500.000	Fund receives default protection on Newell Brands Inc and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	(35.105)	56.362
CDS	USD 2.000.000	Fund receives default protection on JC Penney Corp Inc and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2020	68.297	83.297
CDS	USD 2.500.000	Fund receives default protection on Bombardier Inc and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	(59.178)	(262.013)
CDS	USD 4.000.000	Fund receives default protection on CSC Holdings LLC and pays Fixed 5,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	(1.507)	(331.657)
CDS	USD 4.000.000	Fund receives default protection on Macy's Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	(38.104)	148.991
CDS	USD 2.000.000	Fund receives default protection on Tenet Healthcare Corp and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2023	(29.028)	(111.033)
Total (exposition brute sous-jacente – 47.842.691 USD)					(47.668)	(1.342.691)

CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
13	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	1.766.050	24.050
(119)	USD	US Treasury 5 Year Note	Juin 2018	11.419.240	8.649
Total				13.185.290	32.699

BlackRock Global Event Driven Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	65.671.352	USD	65.616.686	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	1.055.076
USD	4.034.012	CHF	4.032.387	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(59.803)
						995.273
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	802.214.968	USD	949.882.337	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(14.611.376)
USD	34.197.287	EUR	28.815.190	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	602.787
						(14.008.589)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	97.175.607	USD	131.897.828	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(2.672.328)
USD	6.246.588	GBP	4.603.637	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	124.606
						(2.547.722)
Catégorie d'Actions couverte en yens japonais						
JPY	6.833.517.830	USD	62.818.718	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	199.919
USD	152	JPY	16.659	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1)
						199.918
Total (exposition brute sous-jacente – 1.237.997.309 USD)						(15.361.120)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	41,83
Biens de consommation cyclique	9,42
Biens de consommation non cyclique	6,48
Communications	5,60
Organismes de placement collectif	4,15
Gouvernement	3,93
Énergie	3,13
Technologie	2,48
Valeurs industrielles	1,59
Matériaux de base	0,51
Services aux collectivités	0,42
Portefeuille de titres à la valeur de marché	79,54
Autres éléments de l'actif net	20,46
	100,00

BlackRock Global Long/Short Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS				Etats-Unis suite			
USD 3.000.000	Fannie Mae Discount Notes 11/6/2018 (Zero Coupon)	2.998.533	2,39	USD 4.000.000	United States Treasury Bill 12/7/2018 (Zero Coupon)	3.991.982	3,18
USD 3.000.000	Fannie Mae Discount Notes 18/6/2018 (Zero Coupon)	2.997.507	2,39	USD 10.000.000	United States Treasury Bill 19/7/2018 (Zero Coupon)	9.976.960	7,94
USD 3.750.000	Fannie Mae Discount Notes 19/6/2018 (Zero Coupon)	3.746.516	2,98	USD 6.000.000	United States Treasury Bill 26/7/2018 (Zero Coupon)	5.983.683	4,76
USD 3.000.000	Federal Farm Credit Discount Notes 5/9/2018 (Zero Coupon)	2.984.320	2,38	USD 4.000.000	United States Treasury Note 1,25% 31/10/2018	3.986.719	3,17
USD 3.400.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 1/6/2018 (Zero Coupon)	3.400.000	2,71			97.383.237	77,55
USD 4.000.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 7/6/2018 (Zero Coupon)	3.998.632	3,18	Total des obligations		97.383.237	77,55
USD 10.500.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 11/6/2018 (Zero Coupon)	10.494.867	8,36	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		97.383.237	77,55
USD 5.250.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 18/6/2018 (Zero Coupon)	5.245.637	4,18	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
USD 6.000.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 20/8/2018 (Zero Coupon)	5.974.400	4,76	OBLIGATIONS			
USD 5.000.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 19/10/2018 (Zero Coupon)	4.960.835	3,95	Etats-Unis			
USD 4.200.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 22/10/2018 (Zero Coupon)	4.166.633	3,32	USD 3.250.000	Fannie Mae Discount Notes 4/6/2018 (Zero Coupon)	3.249.363	2,59
USD 750.000	Federal Home Loan Banks Variable FRN 15/10/2018	749.990	0,60	USD 2.400.000	Federal Farm Credit Discount Notes 4/6/2018 (Zero Coupon)	2.399.648	1,91
USD 6.800.000	Freddie Mac Discount Notes 25/6/2018 (Zero Coupon)	6.792.353	5,41			5.649.011	4,50
USD 2.000.000	United States Treasury Bill 7/6/2018 (Zero Coupon)	1.999.462	1,59	Total des obligations		5.649.011	4,50
USD 1.000.000	United States Treasury Bill 14/6/2018 (Zero Coupon)	999.402	0,80	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		5.649.011	4,50
USD 950.000	United States Treasury Bill 21/6/2018 (Zero Coupon)	949.127	0,76	Portefeuille de titres à la valeur de marché		103.032.248	82,05
USD 10.000.000	United States Treasury Bill 28/6/2018 (Zero Coupon)	9.987.325	7,95	Autres éléments de l'actif net		22.547.270	17,95
USD 1.000.000	United States Treasury Bill 5/7/2018 (Zero Coupon)	998.354	0,79	Total de l'actif net (USD)		125.579.518	100,00

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Australie				Autriche			
(24.487)	Alumina Ltd	Bank of America		(1.518)	Andritz AG	Bank of America	
(9.800)	Alumina Ltd	Merrill Lynch	2.411	(2.516)	Andritz AG	Merrill Lynch	1.072
(2.035)	Amcor Ltd/Australia	Morgan Stanley	594	(10.873)	Lenzing AG	Goldman Sachs	3.042
(3.360)	Amcor Ltd/Australia	Bank of America		(3.557)	Lenzing AG	Bank of America	
16.201	Aristocrat Leisure Ltd	Merrill Lynch	(324)	(5.300)	Raiffeisen Bank	Merrill Lynch	–
(214.639)	Atlas Arteria	Morgan Stanley	(789)	(19.280)	International AG	Goldman Sachs	–
(133.052)	Atlas Arteria	Morgan Stanley	18.531		Raiffeisen Bank	Bank of America	
(84.365)	Atlas Arteria	Bank of America			International AG	Merrill Lynch	18.588
(2.749)	Australia & New Zealand	Merrill Lynch	(94.181)		International AG	Goldman Sachs	67.617
(96.638)	Banking Group Ltd	Goldman Sachs	(58.456)				90.319
(41.481)	Boral Ltd	Merrill Lynch	(39.622)	Belgique			
(85.276)	Boral Ltd	Bank of America	1.091	(6.410)	bpost SA	Bank of America	
(129.790)	Healthscope Ltd	Goldman Sachs	24.157	(2.793)	bpost SA	Merrill Lynch	5.079
(86.412)	Healthscope Ltd	Goldman Sachs	10.369	(236)	Ontex Group NV	Goldman Sachs	2.213
(13.432)	Healthscope Ltd	Morgan Stanley	4.522	(11.999)	Ontex Group NV	Morgan Stanley	135
(87.718)	Independence Group NL	Bank of America		(13.290)	Ontex Group NV	Goldman Sachs	(17.255)
(146.695)	Independence Group NL	Merrill Lynch	15.730	(3.436)	Umicore SA	Bank of America	
(117.291)	Independence Group NL	Goldman Sachs	10.473	(6.730)	Umicore SA	Merrill Lynch	(17.806)
(4.086)	Link Administration	Morgan Stanley	509			Bank of America	
(1.266)	Link Administration	Merrill Lynch	6.645			Merrill Lynch	(2.402)
(51.733)	Nufarm Ltd/Australia	Bank of America	11.112			Goldman Sachs	(4.705)
(14.454)	Nufarm Ltd/Australia	Merrill Lynch	8.885				(34.741)
28.749	Oil Search Ltd	Bank of America Holdings Ltd	681	Canada			
2.721	Oil Search Ltd	278		(4.677)	Alimentation	Bank of America	
197	Perpetual Ltd	Merrill Lynch		(6.198)	Couche-Tard Inc 'B'	Merrill Lynch	(2.022)
2.434	Perpetual Ltd	Bank of America	(5.052)	(2.362)	Alimentation	Morgan Stanley	(10.335)
7.089	Perpetual Ltd	Merrill Lynch	(1.381)	(2.681)	Couche-Tard Inc 'B'	Bank of America	
21.377	Platinum Asset	Goldman Sachs	(4.356)	(2.362)	Atco Ltd/Canada 'I'	Merrill Lynch	(1.036)
28.936	Management Ltd	Morgan Stanley	(577)	2.681	BlackBerry Ltd	Goldman Sachs	869
24.486	Qantas Airways Ltd	Merrill Lynch	(331)	8.153	BlackBerry Ltd	Morgan Stanley	3.902
133.392	Qantas Airways Ltd	Goldman Sachs	(4.093)	537	CAE Inc	Morgan Stanley	1.298
(5.639)	QBE Insurance Group Ltd	Morgan Stanley	(6.551)	485	Canfor Corp	Morgan Stanley	(36)
(28.055)	QBE Insurance Group Ltd	Bank of America		750	Canfor Corp	Bank of America	
(22.818)	QBE Insurance Group Ltd	Merrill Lynch	14.296	974	Canfor Corp	Merrill Lynch	314
29.099	Santos Ltd	Goldman Sachs	14.142	(788)	CCL Industries Inc 'B'	Goldman Sachs	20
15.786	Santos Ltd	Merrill Lynch	(5.662)	(41.656)	Cenovus Energy Inc	Morgan Stanley	73
11.327	Santos Ltd	Goldman Sachs	(118)	2.559	Enerplus Corp	Goldman Sachs	23.153
574	Sims Metal Management Ltd	Morgan Stanley	(4.977)	22.476	Enerplus Corp	Bank of America	237
4.477	Sims Metal Management Ltd	Bank of America		6.487	Enerplus Corp	Merrill Lynch	2.082
(69.887)	Tabcorp Holdings Ltd	Merrill Lynch	(1.628)	(10.952)	First Quantum Minerals Ltd	Morgan Stanley	(2.904)
(845)	Tabcorp Holdings Ltd	Goldman Sachs	10.149	166	Genworth MI Canada Inc	Bank of America	17.416
(99.184)	Tabcorp Holdings Ltd	Morgan Stanley	130	1.817	Imperial Oil Ltd	Merrill Lynch	(37)
(43.275)	TPG Telecom Ltd	Morgan Stanley	11.196	220	Imperial Oil Ltd	Bank of America	
(64.379)	Vocus Group Ltd	Goldman Sachs	(5.244)	(50.709)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Merrill Lynch	(14)
(17.944)	Vocus Group Ltd	Bank of America	8.778	(44.974)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Bank of America	174
(34.374)	Vocus Group Ltd	Merrill Lynch	2.447	3.399	Lundin Mining Corp	Merrill Lynch	(3.523)
23.066	Whitehaven Coal Ltd	Goldman Sachs	(781)	(165)	Maxar Technologies Ltd	Goldman Sachs	(3.125)
39.928	Whitehaven Coal Ltd	Morgan Stanley	4.718	(145)	Maxar Technologies Ltd	Morgan Stanley	(1.522)
41.374	Whitehaven Coal Ltd	Bank of America	8.166	(547)	Maxar Technologies Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	627	759	Methanex Corp	Merrill Lynch	(211)
			(39.380)	2.285	Methanex Corp	Goldman Sachs	(196)
				8.094	Methanex Corp	Morgan Stanley	270
				923	Norbord Inc	Bank of America	
				127	Norbord Inc	Merrill Lynch	492
				1.728	Norbord Inc	Goldman Sachs	1.482
				(4.591)	OceanaGold Corp	Morgan Stanley	(6.561)
				(29.438)	OceanaGold Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	1.382
						Goldman Sachs	190
						Morgan Stanley	2.895
						Bank of America	
						Merrill Lynch	514
						Goldman Sachs	3.295

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Canada suite				France			
(19.168) (334)	OceanaGold Corp Onex Corp	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	222 284	(19.201)	Air France-KLM	Bank of America Merrill Lynch	 7.529
748	Parex Resources Inc	Goldman Sachs	(300)	(6.236)	Air France-KLM	Goldman Sachs	2.883
3.345	Parex Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (1.448)	(5.303)	Air France-KLM	Morgan Stanley	3.176
2.280	Parex Resources Inc	Morgan Stanley	(925)	4.858	Arkema SA	Bank of America Merrill Lynch	 (29.033)
(1.099)	Pretium Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (356)	1.817	Arkema SA	Goldman Sachs	(11.787)
(16.927)	Pretium Resources Inc	Morgan Stanley	(6.664)	5.632	Arkema SA	Morgan Stanley	(33.400)
34.789	Quebecor Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	 (3.692)	(551)	Bollere SA	Bank of America Merrill Lynch	 140
31.457	Quebecor Inc 'B'	Goldman Sachs	(3.365)	(292)	Bollere SA	Morgan Stanley	88
26.805	Quebecor Inc 'B'	Morgan Stanley	10.346	1.035	Capgemini SE	Morgan Stanley	(1.447)
(24.472)	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (33.816)	62	Capgemini SE	Bank of America Merrill Lynch	 (133)
(203)	Saputo Inc	Bank of America Merrill Lynch	 (97)	210	Capgemini SE	Goldman Sachs	(350)
(5.094)	Saputo Inc	Goldman Sachs	(5.033)	635	Christian Dior SE	Bank of America Merrill Lynch	 2.945
(4.554)	Saputo Inc	Morgan Stanley	(7.453)	1.054	Christian Dior SE	Goldman Sachs	1.508
(1.405)	SNC-Lavalin Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	 566	806	Christian Dior SE	Morgan Stanley	(2.470)
(8.458)	SNC-Lavalin Group Inc	Morgan Stanley	(5.419)	2.800	Cie de Saint-Gobain	Goldman Sachs	(6.084)
(698)	Stantec Inc	Bank of America Merrill Lynch	 140	8.667	Cie de Saint-Gobain	Bank of America Merrill Lynch	 (18.833)
(714)	Stantec Inc	Morgan Stanley	(33)	5.303	Cie de Saint-Gobain	Morgan Stanley	(15.416)
552	TFI International Inc	Bank of America Merrill Lynch	 281	3.312	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Bank of America Merrill Lynch	 (32.030)
1.907	TFI International Inc	Goldman Sachs	1.140	1.722	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA		
5.402	TFI International Inc	Morgan Stanley	2.667	6.795	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Goldman Sachs	(16.653)
(5.194)	Turquoise Hill Resources Ltd	Morgan Stanley	762	(32.217)	Elis SA	Morgan Stanley	(46.711)
163	Vermilion Energy Inc	Goldman Sachs	(94)	(28.481)	Elis SA	Morgan Stanley	38.288
527	Vermilion Energy Inc	Morgan Stanley	(638)			Bank of America	
10	WSP Global Inc	Goldman Sachs	(2)			Merrill Lynch	31.234
679	WSP Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	 483	(26.692)	Elis SA	Goldman Sachs	28.393
			(23.908)	(199)	Essilor International Cie Generale d'Optique SA		
Danemark				7.304	Faurecia SA	Goldman Sachs Bank of America Merrill Lynch	 349 21.105
(463)	Ambu A/S	Bank of America Merrill Lynch	 (519)	8.027	Faurecia SA	Morgan Stanley	(20.015)
(1.724)	Ambu A/S	Goldman Sachs	(2.833)	448	Faurecia SA	Goldman Sachs	1.294
(7.926)	Ambu A/S	Morgan Stanley	(18.862)	(840)	Ingenico Group SA	Morgan Stanley	915
(143)	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Bank of America Merrill Lynch	 12.234	(1.320)	Ingenico Group SA	Bank of America Merrill Lynch	 938
(46)	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Goldman Sachs	3.996	(305)	Ingenico Group SA	Goldman Sachs	(139)
(129)	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Morgan Stanley	(235)	488	Kering SA	Morgan Stanley	5.319
(87)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	 7.283	487	Kering SA	Bank of America Merrill Lynch	 8.646
347	H Lundbeck A/S	Bank of America Merrill Lynch	 2.167	702	Kering SA	Goldman Sachs	14.035
2.213	H Lundbeck A/S	Morgan Stanley	8.574	(109)	Lagardere SCA	Bank of America Merrill Lynch	 12
(890)	Orsted A/S '144A'	Morgan Stanley	458	(227)	Lagardere SCA	Goldman Sachs	19
(1.633)	Orsted A/S '144A'	Bank of America Merrill Lynch	 2.960	(1.498)	Lagardere SCA	Morgan Stanley	17
(3.530)	Pandora A/S	Goldman Sachs	(4.895)	627	Pernod Ricard SA	Bank of America Merrill Lynch	 2.059
(989)	Pandora A/S	Morgan Stanley	1.573	1.367	Pernod Ricard SA	Goldman Sachs	6.951
(147)	SimCorp A/S	Bank of America Merrill Lynch	 (1.482)	137	Pernod Ricard SA	Morgan Stanley	437
(335)	SimCorp A/S	Morgan Stanley	(682)	(2.187)	SPIE SA	Bank of America Merrill Lynch	 3.747
			9.737	(1.943)	SPIE SA	Goldman Sachs	3.713
Finlande				(5.832)	SPIE SA	Morgan Stanley	6.215
7.509	Amer Sports OYJ	Bank of America Merrill Lynch	 18.635	(13.841)	Suez	Bank of America Merrill Lynch	 1.855
8.325	Amer Sports OYJ	Goldman Sachs	20.661	(17.005)	Suez	Goldman Sachs	2.721
9.449	Amer Sports OYJ	Morgan Stanley	6.936	(15.341)	Suez	Morgan Stanley	3.754
(20.173)	Konecranes OYJ	Goldman Sachs	(26.325)	3.082	Ubisoft Entertainment SA	Morgan Stanley	13.975
			19.907	2.608	Ubisoft Entertainment SA	Bank of America Merrill Lynch	 21.129
				4.162	Ubisoft Entertainment SA	Goldman Sachs	33.627

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

suite

« *Contracts for difference* » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
France suite				Allemagne suite			
(4.357)	Valeo SA	Bank of America		172	Puma SE	Goldman Sachs	12.131
		Merrill Lynch	18.140	250	Puma SE	Morgan Stanley	8.156
(4.160)	Valeo SA	Goldman Sachs	12.344	460	Salzgitter AG	Bank of America	
(5.268)	Valeo SA	Morgan Stanley	22.207			Merrill Lynch	(1.220)
			87.206	208	Salzgitter AG	Goldman Sachs	(160)
				1.424	SAP SE	Bank of America	
						Merrill Lynch	1.842
(2.555)	1&1 Drillisch AG	Bank of America		4	Sartorius AG (Pref)	Goldman Sachs	7
		Merrill Lynch	3.007	289	Sartorius AG (Pref)	Bank of America	
(1.679)	1&1 Drillisch AG	Morgan Stanley	4.264			Merrill Lynch	(101)
(1.249)	1&1 Drillisch AG	Goldman Sachs	1.778	20	Sartorius AG (Pref)	Morgan Stanley	(93)
(7)	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	93	83	Siltronic AG	Bank of America	
269	Bayerische Motoren Werke AG	Goldman Sachs	(375)			Merrill Lynch	(519)
33	Cancom SE	Bank of America		342	Siltronic AG	Goldman Sachs	(2.570)
		Merrill Lynch	(88)	215	Siltronic AG	Morgan Stanley	(1.848)
313	Cancom SE	Goldman Sachs	(839)	2.139	Software AG	Morgan Stanley	(1.766)
111	Cancom SE	Morgan Stanley	239	2.172	Software AG	Goldman Sachs	(1.681)
(568)	Carl Zeiss Meditec AG	Bank of America		1.842	Software AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.003)			Merrill Lynch	(1.255)
(787)	Carl Zeiss Meditec AG	Goldman Sachs	(2.017)	14.694	Suedzucker AG	Bank of America	
(699)	Carl Zeiss Meditec AG	Morgan Stanley	(937)			Merrill Lynch	20.031
3.570	Covestro AG '144A'	Goldman Sachs	(3.161)	24.691	Suedzucker AG	Goldman Sachs	33.659
1.699	Covestro AG '144A'	Morgan Stanley	(3.553)	32.730	Suedzucker AG	Morgan Stanley	12.585
294	Covestro AG '144A'	Bank of America		(1.042)	Walt Disney Co/The	Goldman Sachs	11.993
		Merrill Lynch	(260)	2.778	Wirecard AG	Bank of America	
10	Delivery Hero AG	Goldman Sachs	(9)			Merrill Lynch	26.351
1.080	Delivery Hero AG	Bank of America		2.031	Wirecard AG	Goldman Sachs	18.996
		Merrill Lynch	(809)	2.089	Wirecard AG	Morgan Stanley	10.337
(38.966)	Deutsche Bank AG Reg	Bank of America		(5.992)	Zalando SE '144A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	91.166			Merrill Lynch	(16.477)
(64.864)	Deutsche Bank AG Reg	Morgan Stanley	114.715	(100)	Zalando SE '144A'	Morgan Stanley	(81)
(54.642)	Deutsche Bank AG Reg	Goldman Sachs	127.702				416.805
2.638	Deutsche Boerse AG	Bank of America		Hong Kong			
		Merrill Lynch	(5.379)	(3.500)	ASM Pacific Technology Ltd	Morgan Stanley	1.249
745	Deutsche Boerse AG	Morgan Stanley	3.168	16.000	Champion (Reit)	Morgan Stanley	(41)
20.993	Deutsche Lufthansa AG Reg	Bank of America		60.000	Champion (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(45.985)			Merrill Lynch	153
3.320	Deutsche Lufthansa AG Reg	Goldman Sachs	(7.272)	56.000	Champion (Reit)	Goldman Sachs	(1.142)
39.276	Deutsche Lufthansa AG Reg	Morgan Stanley	(85.576)	(92.000)	First Pacific Co Ltd/		
10.364	Dialog Semiconductor Plc	Morgan Stanley	(6.642)		Hong Kong	Morgan Stanley	(352)
8.450	Dialog Semiconductor Plc	Goldman Sachs	591	9.000	Haitong International	Bank of America	
9.151	E.ON SE	Morgan Stanley	(3.774)		Securities Group Ltd	Merrill Lynch	(206)
2.628	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Bank of America		12.000	Haitong International		
		Merrill Lynch	2.450		Securities Group Ltd	Goldman Sachs	(275)
2.307	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Goldman Sachs	2.150	7.000	Haitong International		
					Securities Group Ltd	Morgan Stanley	(89)
2.026	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA			(12.000)	Hang Lung Group Ltd	Morgan Stanley	76
(4.522)	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Morgan Stanley	(236)	12.000	Hutchison Telecommunications	Bank of America	
		Bank of America			Hong Kong Holdings Ltd	Merrill Lynch	(31)
(2.386)	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Merrill Lynch	(105)	(2.000)	Johnson Electric Holdings Ltd	Morgan Stanley	319
(7.177)	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Goldman Sachs	(56)	7.000	Kerry Properties Ltd	Bank of America	
(7.688)	GEA Group AG	Morgan Stanley	3.847			Merrill Lynch	936
		Bank of America		25.000	Kerry Properties Ltd	Morgan Stanley	8.759
		Merrill Lynch	3.493	(100.000)	Li & Fung Ltd	Bank of America	
(1.553)	GEA Group AG	Goldman Sachs	706			Merrill Lynch	17.200
(30.321)	GEA Group AG	Morgan Stanley	36.388	(83.000)	Melco International		
283	Hella GmbH & Co KGaA	Goldman Sachs	(263)		Development Ltd	Morgan Stanley	(13.747)
88	Hella GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	(169)	(1.200)	MGM China Holdings Ltd	Goldman Sachs	31
286	Hella GmbH & Co KGaA	Bank of America		(10.000)	Minth Group Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(57)			Merrill Lynch	3.058
843	Hochtief AG	Goldman Sachs	3.732	(3.000)	NWS Holdings Ltd	Morgan Stanley	(61)
7.715	Hochtief AG	Morgan Stanley	19.776	(7.500)	Power Assets Holdings Ltd	Morgan Stanley	143
4.238	Hochtief AG	Bank of America		(42.000)	SJM Holdings Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	18.764			Merrill Lynch	(10.274)
(2.042)	Jungheinrich AG (Pref)	Bank of America		(16.500)	Yue Yuen Industrial	Bank of America	
		Merrill Lynch	4.596		Holdings Ltd	Merrill Lynch	(4.204)
(3.078)	Jungheinrich AG (Pref)	Goldman Sachs	6.687				1.502
49	Puma SE	Bank of America					
		Merrill Lynch	7.741				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Irlande				Japon suite			
(8.970)	Kingspan Group Plc	Goldman Sachs	6.271	16.000	Daicel Corp	Morgan Stanley	(9.586)
			6.271	(600)	Daikyo Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(238)
Israël				(200)	Daikyo Inc	Goldman Sachs	(79)
(455)	Elbit Systems Ltd	Bank of America		(100)	Daishi Bank Ltd/The	Morgan Stanley	272
		Merrill Lynch	(2.791)	(2)	Daiwa House Investment Corp (Reit)	Bank of America	
(505)	Frutarom Industries Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	66
		Merrill Lynch	(198)	1.000	DMG Mori Co Ltd	Bank of America	
(9.079)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(1.832)
		Merrill Lynch	(12.308)	2.600	DMG Mori Co Ltd	Goldman Sachs	(5.820)
			(15.297)	800	DMG Mori Co Ltd	Morgan Stanley	(1.110)
Italie				(1.900)	Dowa Holdings Co Ltd	Bank of America	
(10.991)	Banco BPM SpA	Bank of America				Merrill Lynch	6.320
		Merrill Lynch	10.693	(2.800)	Dowa Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	10.097
(24.371)	Banco BPM SpA	Goldman Sachs	23.711	(5.500)	Dowa Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	16.222
1.862	Ferrari NV	Morgan Stanley	(3.037)	300	East Japan Railway Co	Bank of America	
(21.199)	Fondiaria-Sai SpA	Bank of America				Merrill Lynch	(221)
		Merrill Lynch	4.291	400	East Japan Railway Co	Morgan Stanley	203
7.235	Moncler SpA	Bank of America		1.600	en-japan Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	6.697			Merrill Lynch	(8.406)
10.986	Moncler SpA	Goldman Sachs	17.202	1.500	en-japan Inc	Goldman Sachs	(7.716)
6.078	Moncler SpA	Morgan Stanley	9.261	900	en-japan Inc	Morgan Stanley	(3.069)
174	Pirelli & C SpA '144A'	Goldman Sachs	(10)	17.000	Fujitsu Ltd	Goldman Sachs	(644)
5.730	Pirelli & C SpA '144A'	Morgan Stanley	(1.463)	13.000	Fujitsu Ltd	Morgan Stanley	(3.619)
(151)	Rizzoli Corriere Della Sera Mediagroup SpA	Bank of America		25.000	Fujitsu Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(67)			Merrill Lynch	(1.306)
151	Rizzoli Corriere Della Sera Mediagroup SpA	Bank of America		(100)	Furukawa Electric Co Ltd	Morgan Stanley	562
		Merrill Lynch	44	(600)	Furukawa Electric Co Ltd	Goldman Sachs	4.203
1.746	Saipem SpA	Goldman Sachs	326	2.400	Glory Ltd	Morgan Stanley	(3.871)
23.061	Saipem SpA	Morgan Stanley	(9.942)	6.000	Glory Ltd	Goldman Sachs	(16.314)
(55.530)	Telecom Italia SpA/Milano	Goldman Sachs	6.043	(100)	GMO Payment Gateway Inc	Morgan Stanley	(74)
(155.287)	Unione di Banche Italiane SpA	Goldman Sachs	218.243	3.700	Gree Inc	Bank of America	
			281.992			Merrill Lynch	(341)
Japon				500	Gree Inc	Goldman Sachs	(46)
(1.700)	Acom Co Ltd	Bank of America		10.000	Gree Inc	Morgan Stanley	(2.581)
		Merrill Lynch	37	(600)	Hachijuni Bank Ltd/The	Goldman Sachs	163
500	Aica Kogyo Co Ltd	Bank of America		(1.600)	Hachijuni Bank Ltd/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	(207)			Merrill Lynch	846
900	Aica Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(373)	(8.500)	Hachijuni Bank Ltd/The	Morgan Stanley	3.682
600	Aica Kogyo Co Ltd	Morgan Stanley	55	(300)	Hikari Tsushin Inc	Goldman Sachs	(3.761)
1.000	Alfresa Holdings Corp	Bank of America		(500)	Hikari Tsushin Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	406			Merrill Lynch	(6.268)
2.200	Alfresa Holdings Corp	Goldman Sachs	892	(200)	Hikari Tsushin Inc	Morgan Stanley	74
1.300	Alfresa Holdings Corp	Morgan Stanley	(635)	100	HIS Co Ltd	Bank of America	
13.000	Amada Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(17.134)			Merrill Lynch	23
3.800	Amada Holdings Co Ltd	Bank of America		20.300	Hokuriku Electric Power Co	Goldman Sachs	(6.736)
		Merrill Lynch	(5.009)	29.200	Hokuriku Electric Power Co	Bank of America	
12.800	Amada Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(12.624)			Merrill Lynch	(9.689)
(100)	Ariake Japan Co Ltd	Goldman Sachs	129	28.500	Hokuriku Electric Power Co	Morgan Stanley	(6.042)
(100)	Ariake Japan Co Ltd	Morgan Stanley	148	(34.200)	Ichigo Inc	Morgan Stanley	(5.359)
(400)	ASKUL Corp	Morgan Stanley	(166)	(5.600)	Ichigo Inc	Bank of America	
(1.000)	Awa Bank Ltd/The	Morgan Stanley	221			Merrill Lynch	(1.032)
(500)	Bank of Kyoto Ltd/The	Bank of America		(9)	Invincible Investment Corp (Reit)	Morgan Stanley	66
		Merrill Lynch	3.134	(7)	Invincible Investment Corp (Reit)	Bank of America	
(100)	Bank of Kyoto Ltd/The	Morgan Stanley	433			Merrill Lynch	—
(600)	Bic Camera Inc	Goldman Sachs	127	3.600	Itochu Techno-Solutions Corp	Morgan Stanley	(1.595)
(16.900)	Bic Camera Inc	Morgan Stanley	(1.402)	4.200	Itochu Techno-Solutions Corp	Bank of America	
300	Capcom Co Ltd	Morgan Stanley	(294)			Merrill Lynch	(2.885)
700	Chugoku Bank Ltd/The	Goldman Sachs	(499)	6.800	Itochu Techno-Solutions Corp	Goldman Sachs	(4.855)
800	Chugoku Bank Ltd/The	Bank of America		200	Jafco Co Ltd	Morgan Stanley	(765)
		Merrill Lynch	(568)	(15)	Japan Hotel Investment Corp (Reit)	Morgan Stanley	152
700	Chugoku Bank Ltd/The	Morgan Stanley	(465)	(18)	Japan Hotel Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	(166)
200	Credit Saison Co Ltd	Morgan Stanley	(72)	(18)	Japan Hotel Investment Corp (Reit)	Bank of America	
1.000	CyberAgent Inc	Goldman Sachs	(2.555)			Merrill Lynch	(101)
10.500	Daicel Corp	Goldman Sachs	(3.000)	(9.200)	Japan Lifeline Co Ltd	Bank of America	
5.100	Daicel Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(14.670)
		Merrill Lynch	(1.457)	(13.200)	Japan Lifeline Co Ltd	Morgan Stanley	(10.828)
				(200)	Japan Lifeline Co Ltd	Goldman Sachs	(319)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
4.400	Japan Tobacco Inc	Bank of America		(8.700)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.872)			Merrill Lynch	12.429
3.200	Japan Tobacco Inc	Goldman Sachs	(1.501)	(12.900)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	18.429
2.200	Japan Tobacco Inc	Morgan Stanley	(2.017)	(14.000)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	70.326
17.400	JTEKT Corp	Morgan Stanley	(33.679)	100	Nippon Shokubai Co Ltd	Bank of America	
(5.100)	Kagome Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	691
		Merrill Lynch	1.880	(200)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America	
(1.500)	Kagome Co Ltd	Goldman Sachs	553			Merrill Lynch	295
(1.400)	Kagome Co Ltd	Morgan Stanley	645	(200)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Morgan Stanley	74
(5.700)	Kansai Paint Co Ltd	Bank of America		10.000	NTN Corp	Morgan Stanley	(5.991)
		Merrill Lynch	1.839	3.800	NTN Corp	Bank of America	
8.200	Kirin Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	6.677			Merrill Lynch	(946)
8.800	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America		16.800	NTN Corp	Goldman Sachs	(4.181)
		Merrill Lynch	8.621	3.300	NTT Data Corp	Goldman Sachs	606
7.300	Kirin Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	7.077	3.100	NTT Data Corp	Morgan Stanley	514
700	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America		400	NTT Data Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.226			Merrill Lynch	118
(3.100)	Koito Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(2.000)	(5.000)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(783)
(7.000)	Koito Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	12.259	(10.000)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	7.097
(2.800)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America		(4.000)	Oriental Land Co Ltd/Japan	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.806)			Merrill Lynch	5.899
1.700	Konami Holdings Corp	Morgan Stanley	(5.327)	(500)	Oriental Land Co Ltd/Japan	Goldman Sachs	737
2.300	Konami Holdings Corp	Goldman Sachs	(5.936)	(6.600)	Oriental Land Co Ltd/Japan	Morgan Stanley	6.387
(300)	Kumagai Gumi Co Ltd	Morgan Stanley	401	1.100	ORIX Corp	Morgan Stanley	(581)
(1.400)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Bank of America		600	Otsuka Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.290)			Merrill Lynch	474
(700)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(645)	200	Otsuka Corp	Goldman Sachs	206
(300)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(1.383)	600	Otsuka Corp	Morgan Stanley	553
(200)	Kyocera Corp	Bank of America		1.900	Pola Orbis Holdings Inc	Morgan Stanley	4.553
		Merrill Lynch	403	(44.000)	Renesas Electronics Corp	Bank of America	
(100)	Kyocera Corp	Goldman Sachs	273			Merrill Lynch	(12.097)
(400)	Kyocera Corp	Morgan Stanley	950	(26.000)	Renesas Electronics Corp	Goldman Sachs	(7.248)
(900)	Kyudenko Corp	Bank of America		(34.400)	Renesas Electronics Corp	Morgan Stanley	(5.073)
		Merrill Lynch	1.410	700	Sanwa Holdings Corp	Bank of America	
(300)	Kyudenko Corp	Goldman Sachs	470			Merrill Lynch	(428)
(600)	Kyudenko Corp	Morgan Stanley	1.548	(3.300)	SBI Holdings Inc/Japan	Goldman Sachs	(456)
(600)	Kyushu Financial Group Inc	Goldman Sachs	162	(11.600)	SBI Holdings Inc/Japan	Bank of America	
(500)	Kyushu Financial Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	160
		Merrill Lynch	161	(3.800)	SBI Holdings Inc/Japan	Morgan Stanley	7.215
(8.900)	Kyushu Financial Group Inc	Morgan Stanley	3.415	2.400	SG Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	912
(200)	LINE Corp	Goldman Sachs	221	100	Shikoku Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	–
4.700	Miraca Holdings Inc	Bank of America		300	Shikoku Electric Power Co Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(911)			Merrill Lynch	–
5.700	Miraca Holdings Inc	Goldman Sachs	(1.215)	13.300	Shikoku Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	(5.394)
4.900	Miraca Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.529)	(100)	Shima Seiki Manufacturing Ltd	Bank of America	
700	Mitsubishi Motors Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(112)
		Merrill Lynch	(316)	400	Showa Denko KK	Bank of America	
(400)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Goldman Sachs	863			Merrill Lynch	1.843
(200)	Mixi Inc	Goldman Sachs	340	(100)	SMS Co Ltd	Bank of America	
(1.300)	Mixi Inc	Morgan Stanley	5.452			Merrill Lynch	55
(1.100)	Morinaga & Co Ltd/Japan	Bank of America		(5.200)	SoftBank Group Corp	Goldman Sachs	39.014
		Merrill Lynch	3.954	(3.100)	SoftBank Group Corp	Bank of America	
(300)	Morinaga & Co Ltd/Japan	Morgan Stanley	1.051			Merrill Lynch	23.258
(400)	Morinaga & Co Ltd/Japan	Goldman Sachs	1.438	(13.900)	SoftBank Group Corp	Morgan Stanley	83.276
(500)	Nabtesco Corp	Bank of America		76.800	Sojitz Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	853			Merrill Lynch	(24.775)
(400)	Nabtesco Corp	Goldman Sachs	682	2.700	Sojitz Corp	Goldman Sachs	(871)
(200)	Nabtesco Corp	Morgan Stanley	608	43.000	Sojitz Corp	Morgan Stanley	(15.061)
5.400	Nagase & Co Ltd	Bank of America		(100)	Start Today Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.864)			Merrill Lynch	18
1.200	Nagase & Co Ltd	Goldman Sachs	(1.748)	(5.000)	Start Today Co Ltd	Goldman Sachs	922
6.700	Nagase & Co Ltd	Morgan Stanley	(7.843)	(1.700)	Start Today Co Ltd	Morgan Stanley	940
(2.900)	Nidec Corp	Bank of America		9.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	19.245			Merrill Lynch	498
(3.100)	Nidec Corp	Morgan Stanley	17.572	4.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	221
200	Nihon M&A Center Inc	Goldman Sachs	313	11.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	(912)
1.200	Nihon M&A Center Inc	Morgan Stanley	1.161	(3.700)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America	
14.800	Nippon Kayaku Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	14.391
		Merrill Lynch	(14.460)	(5.200)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Goldman Sachs	20.038
16.900	Nippon Kayaku Co Ltd	Goldman Sachs	(16.511)	(11.400)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Morgan Stanley	44.131
12.400	Nippon Kayaku Co Ltd	Morgan Stanley	(12.115)				

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Pays-Bas			
18.100	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24.190)	1.599	Aalberts Industries NV	Bank of America Merrill Lynch	367
1.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Goldman Sachs	(1.336)	853	Aalberts Industries NV	Goldman Sachs	190
5.700	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Morgan Stanley	(9.667)	722	Aalberts Industries NV	Morgan Stanley	(589)
3.900	Suruga Bank Ltd	Goldman Sachs	(9.094)	(585)	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Bank of America Merrill Lynch	(1.595)
4.300	Suruga Bank Ltd	Morgan Stanley	(3.210)	(156)	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Goldman Sachs	(425)
1.200	Suruga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.798)	(450)	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Morgan Stanley	1.190
500	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Morgan Stanley	(968)	10.386	BE Semiconductor Industries NV	Bank of America Merrill Lynch	(34.367)
400	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Bank of America Merrill Lynch	(442)	3.882	BE Semiconductor Industries NV	Goldman Sachs	(12.846)
25.500	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(39.249)	26.819	BE Semiconductor Industries NV	Morgan Stanley	(66.871)
9.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd (700)	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(16.387)	(13.820)	Boskalis Westminster	Bank of America Merrill Lynch	1.932
(100)	TDK Corp	Goldman Sachs	298	(5.539)	Boskalis Westminster	Morgan Stanley	2.259
(100)	TechnoPro Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29)	(19.055)	Boskalis Westminster Flow Traders '144A'	Goldman Sachs	2.664
(400)	TechnoPro Holdings Inc	Morgan Stanley	(258)	695	Flow Traders '144A'	Bank of America Merrill Lynch	3.174
1.100	TIS Inc	Bank of America Merrill Lynch	811	274	Flow Traders '144A'	Goldman Sachs	1.252
300	TIS Inc	Goldman Sachs	221	389	Flow Traders '144A'	Morgan Stanley	1.296
1.400	TIS Inc	Morgan Stanley	(516)	(4.658)	GrandVision NV '144A'	Bank of America Merrill Lynch	3.473
3.200	Tokai Carbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15.573	(1.941)	GrandVision NV '144A'	Goldman Sachs	1.447
9.600	Tokai Carbon Co Ltd	Goldman Sachs	46.719	(1.622)	GrandVision NV '144A'	Morgan Stanley	983
5.200	Tokai Carbon Co Ltd	Morgan Stanley	16.535	1.839	Koninklijke DSM NV	Bank of America Merrill Lynch	(2.614)
800	Tokyo Century Corp	Morgan Stanley	(4.203)	214	Koninklijke DSM NV	Goldman Sachs	(188)
5.100	Toppan Forms Co Ltd	Goldman Sachs	(4.184)	20.119	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	(59.558)
2.400	Toppan Forms Co Ltd	Morgan Stanley	(1.106)	204.843	Koninklijke KPN NV	Bank of America Merrill Lynch	(22.995)
5.000	Toppan Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.331)	268.552	Koninklijke KPN NV	Goldman Sachs	(32.622)
3.000	Toppan Printing Co Ltd	Goldman Sachs	(659)	106.228	Koninklijke KPN NV	Morgan Stanley	(14.230)
5.000	Toppan Printing Co Ltd	Morgan Stanley	(899)	1.613	Wolters Kluwer NV	Bank of America Merrill Lynch	1.946
(77.000)	Toshiba Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.684)	63	Wolters Kluwer NV	Morgan Stanley	64
(102.000)	Toshiba Corp	Morgan Stanley	5.641				(226.663)
200	Toyota Boshoku Corp	Bank of America Merrill Lynch	(392)	Nouvelle-Zélande			
(100)	Tsuruha Holdings Inc	Goldman Sachs	277	1.113	a2 Milk Co Ltd	Morgan Stanley	(381)
(500)	Tsuruha Holdings Inc	Morgan Stanley	(230)	402	a2 Milk Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48
2.000	Ulvac Inc	Goldman Sachs	(15.761)	5.177	a2 Milk Co Ltd	Goldman Sachs	(8.039)
4.800	Ulvac Inc	Morgan Stanley	(23.227)	(21.768)	Mercury NZ Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.787)
5.900	Ulvac Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46.495)				(10.159)
(100)	Universal Entertainment Corp	Goldman Sachs	(406)	Norvège			
(500)	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	369	104	Aker BP ASA	Bank of America Merrill Lynch	5
(300)	Welcia Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	221	1.310	Aker BP ASA	Goldman Sachs	(128)
(500)	Welcia Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(323)	(855)	Norwegian Air Shuttle ASA	Goldman Sachs	1.354
400	West Japan Railway Co	Morgan Stanley	(225)	(7.991)	Schibsted ASA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	—
500	West Japan Railway Co	Goldman Sachs	(661)	(3.361)	Schibsted ASA 'B'	Goldman Sachs	(58)
1.500	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(1.854)	(8.540)	Schibsted ASA 'B'	Morgan Stanley	6.257
25.000	Yahoo Japan Corp	Morgan Stanley	(922)	12.826	Statoil ASA	Goldman Sachs	(10.024)
57.900	Yahoo Japan Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.668)	7.815	Telenor ASA	Goldman Sachs	664
31.900	Yahoo Japan Corp	Goldman Sachs	(1.512)	5.516	Telenor ASA	Morgan Stanley	1.163
(1.300)	Yokohama Rubber Co Ltd/The	Goldman Sachs	2.456	5.098	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Bank of America Merrill Lynch	125
10.200	Zeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.268)	13.503	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Goldman Sachs	330
6.400	Zeon Corp	Goldman Sachs	(4.012)	16.410	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Morgan Stanley	(10.822)
22.500	Zeon Corp	Morgan Stanley	(13.116)				
			(32.390)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Norvège suite				Suède			
(12.303)	Yara International ASA	Bank of America		7.387	Electrolux AB 'B'	Bank of America	
		Merrill Lynch	9.596			Merrill Lynch	(7.286)
(4.766)	Yara International ASA	Goldman Sachs	330	390	Electrolux AB 'B'	Goldman Sachs	(385)
(23.538)	Yara International ASA	Morgan Stanley	(93)	1.107	Electrolux AB 'B'	Morgan Stanley	(979)
			(1.301)	897	Fabege AB	Goldman Sachs	238
				(135)	Getinge AB 'B'	Bank of America	
Portugal						Merrill Lynch	2
(1.195.326)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	Goldman Sachs	39.426	(4.664)	Getinge AB 'B'	Goldman Sachs	58
				(382)	Getinge AB 'B'	Morgan Stanley	24
(148.247)	EDP - Energias de Portugal SA	Goldman Sachs	11.918	(2.102)	Hennes & Mauritz AB 'B'	Goldman Sachs	2.729
			51.344	(1.230)	Investment AB Latour 'B'	Morgan Stanley	197
				(17.519)	Nibe Industrier AB 'B'	Goldman Sachs	6.396
				(68.751)	Nibe Industrier AB 'B'	Morgan Stanley	17.927
				(11.792)	Nibe Industrier AB 'B'	Bank of America	
Singapour						Merrill Lynch	4.305
(3.000)	City Developments Ltd	Bank of America		11.854	SSAB AB 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.450			Merrill Lynch	(4.018)
(400)	City Developments Ltd	Goldman Sachs	302	9.458	SSAB AB 'A'	Goldman Sachs	(3.206)
5.900	Dairy Farm International Holdings Ltd	Bank of America		37.532	SSAB AB 'A'	Morgan Stanley	(15.106)
		Merrill Lynch	1.144	11.998	Swedish Match AB	Bank of America	
(132.100)	Golden Agri-Resources Ltd	Morgan Stanley	2.303			Merrill Lynch	2.566
(1.100)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Morgan Stanley	204	17.940	Swedish Match AB	Goldman Sachs	3.661
(3.800)	Jardine Strategic Holdings Ltd	Goldman Sachs	4.619	17.908	Swedish Match AB	Morgan Stanley	(1.624)
(7.000)	Jardine Strategic Holdings Ltd	Morgan Stanley	5.110				5.499
(2.400)	Jardine Strategic Holdings Ltd	Bank of America		Suisse			
		Merrill Lynch	3.230				
(900)	SATS Ltd	Goldman Sachs	269	(11.130)	ABB Ltd Reg	Bank of America	
(30.900)	Sembcorp Industries Ltd	Goldman Sachs	3.617			Merrill Lynch	15.018
(118.500)	Sembcorp Industries Ltd	Morgan Stanley	12.386	(4.094)	ams AG	Bank of America	
(42.000)	Sembcorp Industries Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	26.582
		Merrill Lynch	4.987	(1.679)	ams AG	Goldman Sachs	10.901
(2.400)	SIA Engineering Co Ltd	Goldman Sachs	223	(6.142)	ams AG	Morgan Stanley	38.384
(1.300)	SIA Engineering Co Ltd	Morgan Stanley	155	45	Barry Callebaut AG Reg	Bank of America	
(25.300)	Singapore Post Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(2.785)
		Merrill Lynch	590	143	Barry Callebaut AG Reg	Goldman Sachs	(8.850)
(52.300)	Singapore Press Holdings Ltd	Bank of America		75	Barry Callebaut AG Reg	Morgan Stanley	(2.587)
		Merrill Lynch	3.539	(2.810)	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America	
(1.400)	Singapore Telecommunications Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	2.990
		Merrill Lynch	58	(15.113)	Credit Suisse Group AG Reg	Goldman Sachs	25.431
(2.300)	Singapore Telecommunications Ltd	Goldman Sachs	188	(100.057)	Credit Suisse Group AG Reg	Morgan Stanley	179.383
(23.700)	Singapore Telecommunications Ltd	Morgan Stanley	2.675	54	Georg Fischer AG Reg	Bank of America	
100	Venture Corp Ltd	Goldman Sachs	30			Merrill Lynch	274
3.200	Venture Corp Ltd	Morgan Stanley	860	131	Georg Fischer AG Reg	Goldman Sachs	664
(9.700)	Wilmar International Ltd	Goldman Sachs	(288)	331	Georg Fischer AG Reg	Morgan Stanley	(28.207)
(69.000)	Wilmar International Ltd	Morgan Stanley	(1.463)	(4.476)	LafargeHolcim Ltd Reg	Morgan Stanley	11.897
(137.700)	Wilmar International Ltd	Bank of America		(3.124)	LafargeHolcim Ltd Reg	Goldman Sachs	5.768
		Merrill Lynch	(5.737)	(5.002)	Lonza Group AG Reg	Morgan Stanley	(12.686)
			40.451	1.315	OC Oerlikon Corp AG Reg	Morgan Stanley	(1.307)
				(184)	Panalpina Welttransport Holding AG Reg		
Espagne						Morgan Stanley	765
(3.842)	Bankia SA	Bank of America		332	Temenos Group AG Reg	Goldman Sachs	1.344
		Merrill Lynch	1.786	(3.054)	Vifor Pharma AG	Bank of America	
(25.031)	Bankia SA	Goldman Sachs	12.918			Merrill Lynch	20.794
(3.841)	Gas Natural SDG SA	Bank of America		(2.378)	Vifor Pharma AG	Morgan Stanley	15.652
		Merrill Lynch	4.576	(902)	Vifor Pharma AG	Goldman Sachs	7.000
(1.451)	Gas Natural SDG SA	Goldman Sachs	1.707				306.425
674	International Consolidated Airlines Group SA	Morgan Stanley	(163)	Royaume-Uni			
3.332	Mediaset Espana Comunicacion SA	Bank of America		20.736	Ashmore Group Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.879)			Merrill Lynch	(8.435)
16.412	Mediaset Espana Comunicacion SA	Goldman Sachs	(9.255)	27.399	Ashmore Group Plc	Goldman Sachs	(10.891)
134.387	Mediaset Espana Comunicacion SA	Morgan Stanley	(89.564)	32.617	Ashmore Group Plc	Morgan Stanley	(13.296)
(14.243)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Bank of America		3.403	Ashtead Group Plc	Goldman Sachs	3.660
		Merrill Lynch	11.865	6.561	Ashtead Group Plc	Morgan Stanley	(2.180)
(11.883)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Goldman Sachs	9.651	2.645	Ashtead Group Plc	Bank of America	
			(58.358)			Merrill Lynch	2.763
				5.165	ASOS Plc	Bank of America	
						Merrill Lynch	25.678
				4.836	ASOS Plc	Goldman Sachs	24.043
				5.669	ASOS Plc	Morgan Stanley	1.206
				41.362	Auto Trader Group Plc '144A'	Goldman Sachs	(8.907)

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
57.144	Auto Trader Group Plc '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(12.306)	9.815 (16.667)	Legal & General Group Plc Micro Focus International Plc	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(1.644) (14.290)
40.986 (18.206)	Auto Trader Group Plc '144A' B&M European Value Retail SA	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch	(13.675) (5.203)	(29.174) 9.761	Micro Focus International Plc Moneysupermarket.com Group Plc	Morgan Stanley Goldman Sachs	20.360 324
(74.031)	B&M European Value Retail SA	Goldman Sachs	(21.235)	26.444	Moneysupermarket.com Group Plc	Morgan Stanley	(35)
(294.517)	B&M European Value Retail SA	Morgan Stanley	(72.819)	14.234	Moneysupermarket.com Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	473
(15.595)	British American Tobacco Plc	Morgan Stanley	(7.567)	994	NMC Health Plc	Morgan Stanley	(1.401)
1.369	British Land Co Plc/The (Reit)	Morgan Stanley	(324)	(4.078)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.293)
1.578	British Land Co Plc/The (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(408)	(1.619)	Ocado Group Plc	Morgan Stanley	(632)
595	British Land Co Plc/The (Reit)	Goldman Sachs	(65)	(22.951)	Old Mutual Plc	Morgan Stanley	3.661
(2.314)	BT Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	75	2.120	Pennon Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.206
(4.977)	BT Group Plc	Goldman Sachs	294	7.842	Pennon Group Plc	Morgan Stanley	1.772
(43.672)	BT Group Plc	Morgan Stanley	1.277	30.883	Petrofac Ltd	Goldman Sachs	(19.460)
15.645	Burberry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	51.283	64.478	Petrofac Ltd	Morgan Stanley	(25.731)
3.281	Burberry Group Plc	Goldman Sachs	10.339	44.725	Petrofac Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(30.885)
18.859	Burberry Group Plc	Morgan Stanley	15.794	1.476	Plus500 Ltd	Morgan Stanley	(118)
(25.074)	CAPITA Plc	Goldman Sachs	(2.266)	(43.873)	Prudential Plc	Goldman Sachs	61.820
(21.964)	Capita Plc	Goldman Sachs	(1.195)	(33.122)	Prudential Plc	Morgan Stanley	52.835
6.669	Centamin Plc	Goldman Sachs	298	(2.425)	Reckitt Benckiser Group Plc	Morgan Stanley	484
(511)	Cobham Plc	Goldman Sachs	(27)	(2.329)	Royal Bank of Scotland Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	533
(29.169)	Cobham Plc	Morgan Stanley	(2.326)	(1.905)	Royal Bank of Scotland Group Plc	Morgan Stanley	524
(320)	Cobham Plc	Bank of America Merrill Lynch	(30)	1.447	Severn Trent Plc	Goldman Sachs	365
228	Coca-Cola HBC AG	Goldman Sachs	(200)	1.403	Severn Trent Plc	Morgan Stanley	(1.427)
162	Coca-Cola HBC AG	Bank of America Merrill Lynch	(32)	(2.314)	Sports Direct International Plc	Morgan Stanley	171
1.769	Compass Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.505	(71.107)	Sports Direct International Plc	Goldman Sachs	4.632
284	Croda International Plc	Bank of America Merrill Lynch	521	17.397	SSP Group Plc	Goldman Sachs	(1.781)
53	Croda International Plc	Goldman Sachs	97	2.294	SSP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	765
443	Dechra Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	230	16.958	SSP Group Plc	Morgan Stanley	684
103	Dechra Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	47	17.048	Tate & Lyle Plc	Goldman Sachs	20.928
597	Derwent London Plc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(587)	42.888	Tate & Lyle Plc	Bank of America Merrill Lynch	52.798
809	Derwent London Plc (Reit)	Goldman Sachs	(796)	102.284	Tate & Lyle Plc	Morgan Stanley	113.586
210	Derwent London Plc (Reit)	Morgan Stanley	(151)	376	Victrex Plc	Morgan Stanley	189
68.700	Direct Line Insurance Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11.141)	53.863	Vodafone Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.238)
75.825	Direct Line Insurance Group Plc	Goldman Sachs	(12.297)	26.427	Vodafone Group Plc	Goldman Sachs	(2.090)
6.394	Direct Line Insurance Group Plc	Morgan Stanley	(1.538)	11.360	William Hill Plc	Goldman Sachs	740
8.838	Domino's Pizza Group Plc	Goldman Sachs	2.079	700	William Hill Plc	Morgan Stanley	(111)
7.957	Domino's Pizza Group Plc	Morgan Stanley	719	138.514	Wm Morrison Supermarkets Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7.549)
(125.106)	Greencore Group Plc	Goldman Sachs	(35.173)	143.313	Wm Morrison Supermarkets Plc	Goldman Sachs	(7.373)
(175.985)	Greencore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(49.804)	392.753	Wm Morrison Supermarkets Plc	Morgan Stanley	(44.899)
(158.523)	Greencore Group Plc	Morgan Stanley	(58.784)	(1.163)	WPP Plc	Goldman Sachs	1.397
6.201	IG Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	412	Etats-Unis			
31.605	IG Group Holdings Plc	Goldman Sachs	2.101	2.829	8x8 Inc	Goldman Sachs	(8.427)
8.442	IG Group Holdings Plc	Morgan Stanley	(2.020)	(2.529)	AAR Corp	Goldman Sachs	3.184
(2.861)	IMI Plc	Goldman Sachs	(1.510)	798	Aaron's Inc	Goldman Sachs	221
(260)	IMI Plc	Morgan Stanley	90	1	Abiomed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7)
348	Intertek Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.054	115	Abiomed Inc	Goldman Sachs	869
2.780	Intertek Group Plc	Goldman Sachs	16.408	3.018	ABM Industries Inc	Goldman Sachs	(3.670)
4.758	Intertek Group Plc	Morgan Stanley	17.709	586	ABM Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(492)
(138.759)	Kingfisher Plc	Bank of America Merrill Lynch	(29.697)	(571)	Acacia Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	137
(99.369)	Kingfisher Plc	Goldman Sachs	(21.267)				
(235.253)	Kingfisher Plc	Morgan Stanley	(22.829)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie	USD	Nombre	Description	Contrepartie	USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(84)	Acacia Communications Inc	Goldman Sachs	13	(4.257)	Allegiant Travel Co	Morgan Stanley	(2.129)
163	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs	(268)	218	Allegion Plc	Goldman Sachs	321
171	Accenture Plc 'A'	Bank of America		(23)	Alliance Data Systems Corp	Goldman Sachs	11
		Merrill Lynch	393	(1.621)	Allison Transmission Holdings Inc	Goldman Sachs	1.848
1.905	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	3.813	6.484	Ally Financial Inc	Bank of America	
2.267	ACCO Brands Corp	Goldman Sachs	2.607			Merrill Lynch	(4.222)
258	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs	15	9.408	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	(9.528)
(6.456)	Actuant Corp 'A'	Goldman Sachs	2.905	7.546	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	(8.206)
821	Acuity Brands Inc	Goldman Sachs	3.638	7	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	194
629	Acxiom Corp	Goldman Sachs	1.402	1.288	Alta Mesa Resources Inc	Bank of America	
548	Adecoagro SA	Goldman Sachs	115			Merrill Lynch	(127)
(3.689)	Adient Plc	Goldman Sachs	12.137	1.784	Alta Mesa Resources Inc	Goldman Sachs	(1.032)
(5.301)	Adient Plc	Morgan Stanley	18.129	93	Altair Engineering Inc 'A'	Bank of America	
(206)	Adtalem Global Education Inc	Bank of America				Merrill Lynch	16
		Merrill Lynch	(402)	122	Altair Engineering Inc 'A'	Goldman Sachs	73
(3.059)	Adtalem Global Education Inc	Goldman Sachs	(4.606)	(205)	Alteryx Inc 'A'	Goldman Sachs	(35)
(2.444)	Advance Auto Parts Inc	Bank of America		1.151	Altice USA Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.499)
		Merrill Lynch	(15.642)	61	Altra Industrial Motion Corp	Bank of America	
(462)	Advance Auto Parts Inc	Goldman Sachs	(2.995)			Merrill Lynch	(46)
(1.664)	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	(18.287)	(164)	Altria Group Inc	Bank of America	
1.225	Advanced Drainage Systems Inc	Goldman Sachs	6.296			Merrill Lynch	(218)
605	Aegon NV Reg	Bank of America		(4.308)	Altria Group Inc	Goldman Sachs	(4.826)
		Merrill Lynch	(40)	(123)	Ambarella Inc	Goldman Sachs	32
772	Aegon NV Reg	Goldman Sachs	42	526	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(947)
(202)	AerCap Holdings NV	Bank of America		(85)	AMERCO	Goldman Sachs	2.028
		Merrill Lynch	89	3.331	Ameren Corp	Goldman Sachs	3.597
(3.770)	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs	1.354	733	American Campus Communities Inc (Reit)	Morgan Stanley	(155)
(986)	Aerovironment Inc	Goldman Sachs	(3.694)	3.590	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs	2.153
(3.308)	AES Corp/VA	Bank of America		7.784	American Eagle Outfitters Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.240)			Merrill Lynch	6.246
(30.750)	AES Corp/VA	Goldman Sachs	(12.236)	2.101	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	(708)
466	Affiliated Managers Group Inc	Bank of America		2.207	American Financial Group Inc/OH	Morgan Stanley	132
		Merrill Lynch	(3.343)	678	American Financial Group Inc/OH	Bank of America	
8	Affiliated Managers Group Inc	Goldman Sachs	(56)			Merrill Lynch	389
299	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	(2.909)	3.609	American Financial Group Inc/OH	Goldman Sachs	(247)
(1.852)	Aflac Inc	Goldman Sachs	185	(2.106)	American International Group Inc	Goldman Sachs	1.474
(1.430)	AGCO Corp	Goldman Sachs	56	(2.854)	American States Water Co	Goldman Sachs	(7.420)
14.772	Agilent Technologies Inc	Bank of America		288	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs	631
		Merrill Lynch	2.476	404	American Woodmark Corp	Goldman Sachs	6.980
11.776	Agilent Technologies Inc	Morgan Stanley	(10.199)	(2.622)	Americold Realty Trust (Reit)	Bank of America	
7.544	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs	1.358			Merrill Lynch	(1.311)
(88)	Air Lease Corp	Bank of America		5.868	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs	1.723
		Merrill Lynch	28	966	Ameriprise Financial Inc	Bank of America	
(2.435)	Air Lease Corp	Goldman Sachs	909			Merrill Lynch	225
1.353	Air Products & Chemicals Inc	Goldman Sachs	(4.478)	2.225	Ameriprise Financial Inc	Morgan Stanley	(6.858)
3.819	Air Transport Services Group Inc	Bank of America		(282)	Ameris Bancorp	Goldman Sachs	189
		Merrill Lynch	(1.757)	6.798	AMETEK Inc	Bank of America	
1.197	Air Transport Services Group Inc	Goldman Sachs	(551)			Merrill Lynch	1.056
(1.481)	Akamai Technologies Inc	Goldman Sachs	1.214	4.931	AMETEK Inc	Goldman Sachs	(350)
(194)	Akcea Therapeutics Inc	Bank of America		6.917	AMETEK Inc	Morgan Stanley	(5.980)
		Merrill Lynch	(140)	(876)	Amneal Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.989)
(681)	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.198)	2.540	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	(533)
(1.134)	Albany International Corp 'A'	Goldman Sachs	(1.928)	420	Anadarko Petroleum Corp	Goldman Sachs	84
(1.079)	Alcoa Corp	Goldman Sachs	1.392	(485)	Analog Devices Inc	Bank of America	
55	Alexander & Baldwin Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.838)
		Merrill Lynch	1.196	(209)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	(490)
175	Alexander & Baldwin Inc	Goldman Sachs	82	596	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	1.815
1.128	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Morgan Stanley	1.134	(347)	AnaptysBio Inc	Bank of America	
483	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	4.108
		Merrill Lynch	444	(344)	AnaptysBio Inc	Goldman Sachs	4.073
4.313	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Goldman Sachs	5.630	605	Antero Resources Corp	Goldman Sachs	6
(185)	Align Technology Inc	Goldman Sachs	(4.973)	2.591	Antero Resources Corp	Bank of America	
(1.882)	Allegheny Technologies Inc	Goldman Sachs	(452)			Merrill Lynch	26
(2.787)	Allegheny Technologies Inc	Morgan Stanley	(334)	8.061	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	(4.353)
(3.816)	Allegiant Travel Co	Goldman Sachs	14.306	(1.844)	Aon Plc	Goldman Sachs	2.539
(297)	Allegiant Travel Co	Bank of America					
		Merrill Lynch	1.114				

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(2.163)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (Reit)	Goldman Sachs	(735)	584	Black Hills Corp	Bank of America	
(220)	Apple Inc	Goldman Sachs	47			Merrill Lynch	1.143
5.798	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	(13.860)	1.174	Black Hills Corp	Goldman Sachs	1.951
(500)	Apptio Inc 'A'	Goldman Sachs	(595)	326	Blackbaud Inc	Goldman Sachs	(69)
(2.117)	AptarGroup Inc	Goldman Sachs	(550)	153	Bloomin' Brands Inc	Bank of America	
116	Aptiv Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(26)
		Merrill Lynch	62	3.350	Bloomin' Brands Inc	Goldman Sachs	(569)
552	Aqua America Inc	Goldman Sachs	1.186	(1.685)	Blucora Inc	Goldman Sachs	(8.506)
(3.162)	Aramark	Goldman Sachs	(2.688)	(284)	Boeing Co/The	Goldman Sachs	923
(6.089)	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	2.828	(355)	Bofl Holding Inc	Goldman Sachs	(52)
(477)	Arch Capital Group Ltd	Bank of America		(242)	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs	(9.561)
		Merrill Lynch	312	279	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America	
(4.483)	Arch Capital Group Ltd	Goldman Sachs	(766)			Merrill Lynch	1.161
(475)	Arconic Inc	Goldman Sachs	77	9.123	BorgWarner Inc	Bank of America	
664	Asbury Automotive Group Inc	Goldman Sachs	(117)			Merrill Lynch	(16.787)
(1.974)	Ashland Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(99)	14.152	BorgWarner Inc	Goldman Sachs	(24.432)
(1.209)	Ashland Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(3.504)	7.240	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(19.957)
(4.501)	Ashland Global Holdings Inc	Bank of America		1.910	Boston Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	5.042
		Merrill Lynch	(9.765)	332	Boyd Gaming Corp	Goldman Sachs	470
165	ASML Holding NV Reg	Goldman Sachs	(110)	71	Boyd Gaming Corp	Bank of America	
(1.174)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Goldman Sachs	(411)			Merrill Lynch	108
(741)	Aspen Technology Inc	Goldman Sachs	(529)	326	Brandywine Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	84
(734)	Associated Banc-Corp	Goldman Sachs	(307)	6.330	Brandywine Realty Trust (Reit)	Goldman Sachs	862
(620)	Assurant Inc	Goldman Sachs	(3.156)	(454)	Brighthouse Financial Inc	Goldman Sachs	640
(590)	Astec Industries Inc	Goldman Sachs	(1.776)	1.686	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs	1.163
90	At Home Group Inc	Bank of America		3.121	Bristol-Myers Squibb Co	Morgan Stanley	780
		Merrill Lynch	13	(2.595)	Brixmor Property Group Inc (Reit)	Bank of America	
640	At Home Group Inc	Goldman Sachs	(596)			Merrill Lynch	(3.839)
88	athenahealth Inc	Goldman Sachs	233	697	Broadcom Inc	Goldman Sachs	8.158
(554)	Athene Holding Ltd 'A'	Goldman Sachs	1.215	(1.200)	Brooks Automation Inc	Goldman Sachs	(4.680)
751	Atkore International Group Inc	Bank of America		5.482	Brown & Brown Inc	Goldman Sachs	2.302
		Merrill Lynch	776	79	Brown-Forman Corp 'B'	Bank of America	
951	Atkore International Group Inc	Goldman Sachs	1.048			Merrill Lynch	24
135	Atlantica Yield Plc	Bank of America		1.461	Brown-Forman Corp 'B'	Goldman Sachs	(1.422)
		Merrill Lynch	(124)	1.761	Brown-Forman Corp 'B'	Morgan Stanley	(3.522)
2.417	Atlantica Yield Plc	Goldman Sachs	(1.649)	2.214	Brucker Corp	Goldman Sachs	2.170
(1.053)	Atlasian Corp Plc 'A'	Goldman Sachs	(2.169)	184	Brunswick Corp/DE	Bank of America	
77	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	243			Merrill Lynch	34
(905)	Autoliv Inc	Goldman Sachs	(1.617)	842	Brunswick Corp/DE	Goldman Sachs	1.554
1.761	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	4.884	(4.108)	Buckle Inc/The	Bank of America	
(854)	AutoNation Inc	Goldman Sachs	46			Merrill Lynch	(521)
1.052	Avery Dennison Corp	Goldman Sachs	558	321	Bunge Ltd	Bank of America	
(5.698)	Avnet Inc	Goldman Sachs	8.262			Merrill Lynch	(214)
(391)	AxoGen Inc	Goldman Sachs	(1.720)	1.083	Burlington Stores Inc	Bank of America	
(6.955)	Ball Corp	Goldman Sachs	1.739			Merrill Lynch	12.022
(978)	BancorpSouth Bank	Goldman Sachs	489	2.013	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	17.781
421	Baxter International Inc	Bank of America		345	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	3.041
		Merrill Lynch	77	(554)	C&J Energy Services Inc	Goldman Sachs	709
4.499	Baxter International Inc	Goldman Sachs	(481)	3.140	Cabot Corp	Morgan Stanley	(3.109)
(6.821)	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America		1.150	Cabot Corp	Goldman Sachs	(862)
		Merrill Lynch	(8.842)	(15.133)	Caesars Entertainment Corp	Morgan Stanley	12.106
(3.932)	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs	(6.196)	(24.760)	Caesars Entertainment Corp	Bank of America	
(5.888)	Beacon Roofing Supply Inc	Morgan Stanley	(10.295)			Merrill Lynch	8.666
(3.213)	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	555	(13.488)	Caesars Entertainment Corp	Goldman Sachs	4.721
(3.312)	Becton Dickinson and Co	Bank of America		247	Calavo Growers Inc	Goldman Sachs	(852)
		Merrill Lynch	464	40	Calavo Growers Inc	Bank of America	
(3.736)	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	3.474			Merrill Lynch	13
(448)	Bed Bath & Beyond Inc	Goldman Sachs	(75)	670	Caleres Inc	Goldman Sachs	336
1.452	Bemis Co Inc	Goldman Sachs	142	282	California Resources Corp	Goldman Sachs	95
627	Bemis Co Inc	Bank of America		18	California Resources Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(192)			Merrill Lynch	(33)
2.378	Bemis Co Inc	Morgan Stanley	(428)	(25.303)	Callon Petroleum Co	Bank of America	
(670)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Goldman Sachs	2.955			Merrill Lynch	43.268
(1.942)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Morgan Stanley	8.817	(33.564)	Callon Petroleum Co	Goldman Sachs	57.394
596	Big Lots Inc	Goldman Sachs	(930)	(26.917)	Callon Petroleum Co	Morgan Stanley	39.299
(634)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	Goldman Sachs	(3.297)	344	Camden Property Trust (Reit)	Bank of America	
584	Black Hills Corp	Morgan Stanley	1.200			Merrill Lynch	1.256
				1.619	Camden Property Trust (Reit)	Goldman Sachs	5.982
				(266)	Campbell Soup Co	Bank of America	
						Merrill Lynch	1.415

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(1.689)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	4.272	(375)	Cimpress NV	Bank of America	
613	Camping World Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.765)			Merrill Lynch	(251)
1.469	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	(4.800)	(342)	Cimpress NV	Goldman Sachs	(389)
854	Capital One Financial Corp	Bank of America		23	Cintas Corp	Goldman Sachs	45
		Merrill Lynch	(3.066)	11.547	Citigroup Inc	Morgan Stanley	(51.843)
5.673	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs	(13.540)	7.623	Citigroup Inc	Bank of America	
172	Cardinal Health Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(23.626)
		Merrill Lynch	(95)	7.592	Citigroup Inc	Goldman Sachs	(16.677)
7.111	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs	786	8.663	Citizens Financial Group Inc	Bank of America	
(193)	Cardtronics Plc 'A'	Goldman Sachs	614			Merrill Lynch	(14.176)
8.463	CareTrust Inc (Reit)	Goldman Sachs	12.695	1.776	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs	(2.064)
(877)	CarMax Inc	Bank of America		1.051	Citizens Financial Group Inc	Morgan Stanley	(1.567)
		Merrill Lynch	(607)	(254)	Citrix Systems Inc	Goldman Sachs	(300)
24.660	Carnival Corp	Goldman Sachs	(52.192)	(379)	Clean Harbors Inc	Goldman Sachs	(676)
598	Carnival Corp	Morgan Stanley	(1.112)	1.431	Clorox Co/The	Goldman Sachs	6.704
(111)	Carrizo Oil & Gas Inc	Goldman Sachs	199	2.559	CNA Financial Corp	Goldman Sachs	(4.743)
(592)	Carvana Co	Morgan Stanley	(1.267)	(13.825)	CNH Industrial NV	Goldman Sachs	9.125
(446)	Casa Systems Inc	Bank of America		(254)	CNX Resources Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	673			Merrill Lynch	11
1.677	Casey's General Stores Inc	Goldman Sachs	(3.472)	(1.630)	CNX Resources Corp	Goldman Sachs	165
(1.684)	Caterpillar Inc	Goldman Sachs	(113)	169	Coca-Cola Bottling Co		
(3.565)	Cboe Global Markets Inc	Goldman Sachs	29.124		Consolidated	Goldman Sachs	365
(4.392)	Cboe Global Markets Inc	Bank of America		7.198	Coca-Cola European	Bank of America	
		Merrill Lynch	41.724		Partners Plc	Merrill Lynch	(1.224)
(13.215)	Cboe Global Markets Inc	Morgan Stanley	123.807	1.375	Coca-Cola European		
(1.280)	CBRE Group Inc 'A'	Goldman Sachs	575		Partners Plc	Goldman Sachs	(102)
2.089	CDW Corp/DE	Goldman Sachs	5.601	7.287	Coca-Cola European		
362	CDW Corp/DE	Bank of America			Partners Plc	Morgan Stanley	(2.623)
		Merrill Lynch	1.075	(1.512)	Coherent Inc	Bank of America	
186	CDW Corp/DE	Morgan Stanley	402			Merrill Lynch	15.342
137	Celanese Corp 'A'	Goldman Sachs	923	(654)	Coherent Inc	Morgan Stanley	292
(23.451)	Centennial Resource			(662)	Coherent Inc	Goldman Sachs	1.575
	Development Inc/DE 'A'	Goldman Sachs	32.128	(7.475)	Colony NorthStar	Bank of America	
16.226	CenterPoint Energy Inc	Bank of America			Inc 'A' (Reit)	Merrill Lynch	673
		Merrill Lynch	2.696	(7.741)	Colony NorthStar		
17.132	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs	252		Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(968)
2.616	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	547	(200)	Columbia Banking System Inc	Goldman Sachs	26
548	Central Garden & Pet Co 'A'	Goldman Sachs	376	249	Comerica Inc	Goldman Sachs	(1.067)
(201)	Century Aluminum Co	Goldman Sachs	(141)	710	Comfort Systems USA Inc	Goldman Sachs	2.024
(11.071)	CenturyLink Inc	Bank of America		(3.385)	Commercial Metals Co	Goldman Sachs	(3.719)
		Merrill Lynch	12.178	(5.501)	Commercial Metals Co	Morgan Stanley	(2.667)
(15.887)	CenturyLink Inc	Goldman Sachs	17.476	(3.806)	Commercial Metals Co	Bank of America	
(38.518)	CenturyLink Inc	Morgan Stanley	39.288			Merrill Lynch	(2.606)
90	Ceridian HCM Holding Inc	Bank of America		(2.415)	CommScope Holding Co Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	65			Merrill Lynch	291
(505)	CH Robinson Worldwide Inc	Goldman Sachs	(1.646)	(7.851)	CommScope Holding Co Inc	Goldman Sachs	838
3.876	Charles Schwab Corp/The	Goldman Sachs	(12.691)	(674)	CommScope Holding Co Inc	Morgan Stanley	202
(19)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America		(4.910)	Compass Minerals		
		Merrill Lynch	36		International Inc	Goldman Sachs	10.769
(1.696)	Check Point Software			(5.548)	Compass Minerals		
	Technologies Ltd	Goldman Sachs	(1.136)		International Inc	Morgan Stanley	14.714
(313)	Chegg Inc	Bank of America		1.727	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs	404
		Merrill Lynch	(1.055)	589	Concho Resources Inc	Goldman Sachs	(5.205)
(1.452)	Chegg Inc	Goldman Sachs	(4.692)	(1.703)	Conduent Inc	Goldman Sachs	87
152	Chemical Financial Corp	Goldman Sachs	9	(194)	CONMED Corp	Goldman Sachs	(112)
62	Chemours Co/The	Morgan Stanley	(51)	1.916	ConocoPhillips	Morgan Stanley	(6.112)
756	Chemours Co/The	Goldman Sachs	(1.786)	2.199	Consolidated Communications		
(3.346)	Chesapeake Energy Corp	Goldman Sachs	(148)		Holdings Inc	Goldman Sachs	64
(3.540)	Chimera Investment			1.315	Constellation Brands Inc 'A'	Morgan Stanley	5.618
	Corp (Reit)	Goldman Sachs	(637)	309	Constellation Brands Inc 'A'	Bank of America	
(334)	China Biologic Products					Merrill Lynch	1.456
	Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.352)	2.178	Constellation Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	5.461
(21)	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs	16	7.533	Constellium NV 'A'	Goldman Sachs	4.064
(3.806)	Choice Hotels International Inc	Goldman Sachs	(6.661)	1.587	Continental Resources Inc/OK	Bank of America	
237	Chubb Ltd	Goldman Sachs	119			Merrill Lynch	259
5.267	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	2.946	1.200	Continental Resources Inc/OK	Goldman Sachs	(306)
(25)	Churchill Downs Inc	Goldman Sachs	(174)	285	Continental Resources Inc/OK	Morgan Stanley	(336)
607	Ciena Corp	Bank of America		(551)	Cooper-Standard Holdings Inc	Goldman Sachs	356
		Merrill Lynch	(710)	811	Copart Inc	Goldman Sachs	539
1.158	Ciena Corp	Goldman Sachs	(1.380)	(353)	Corcept Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(106)

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
2.610	Core-Mark Holding Co Inc	Goldman Sachs	689	(883)	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs	9.248
(685)	CoreLogic Inc/United States	Goldman Sachs	(1.062)	430	Domino's Pizza Inc	Bank of America	
1.457	CoreSite Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	2.483			Merrill Lynch	1.329
293	Cornerstone OnDemand Inc	Bank of America		1.140	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs	3.531
		Merrill Lynch	982	1.201	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	4.372
619	Cornerstone OnDemand Inc	Goldman Sachs	2.074	(281)	Domtar Corp	Goldman Sachs	(694)
490	Cornerstone OnDemand Inc	Morgan Stanley	1.215	(531)	Dorman Products Inc	Goldman Sachs	202
(5.427)	Coming Inc	Goldman Sachs	2.136	(4.687)	DowDuPont Inc	Goldman Sachs	13.959
305	Cosan Ltd 'A'	Bank of America		1.015	DR Horton Inc	Morgan Stanley	1.045
		Merrill Lynch	(281)	212	DR Horton Inc	Bank of America	
17.958	Cosan Ltd 'A'	Goldman Sachs	(16.521)			Merrill Lynch	390
(11.101)	Coty Inc 'A'	Bank of America		817	DR Horton Inc	Goldman Sachs	1.503
		Merrill Lynch	8.743	(284)	Dril-Quip Inc	Goldman Sachs	(349)
(10.976)	Coty Inc 'A'	Morgan Stanley	7.816	(1.357)	DSW Inc 'A'	Goldman Sachs	977
(4.612)	Coty Inc 'A'	Goldman Sachs	3.509	(1.161)	Duke Energy Corp	Goldman Sachs	70
(710)	Coupa Software Inc	Goldman Sachs	312	809	Duke Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	149
828	Cousins Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	402	1.067	Duke Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	375
(439)	Covanta Holding Corp	Goldman Sachs	(406)	1.044	Dun & Bradstreet Corp/The	Morgan Stanley	(1.639)
159	Crane Co	Bank of America		946	Dun & Bradstreet Corp/The	Goldman Sachs	501
		Merrill Lynch	(98)	(1.923)	Dycom Industries Inc	Goldman Sachs	32.980
1.056	Crane Co	Goldman Sachs	(1.166)	(1.295)	Dycom Industries Inc	Bank of America	
(391)	Cray Inc	Goldman Sachs	48			Merrill Lynch	22.167
(3.728)	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs	(20.644)	(2.732)	Dycom Industries Inc	Morgan Stanley	(6.775)
(168)	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	2.121	(428)	E*TRADE Financial Corp	Goldman Sachs	358
(4.932)	Cree Inc	Goldman Sachs	(8.840)	1.531	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	(5.619)
(970)	Cree Inc	Morgan Stanley	(2.086)	458	Eastman Chemical Co	Bank of America	
(1.089)	Cree Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.232)
		Merrill Lynch	(1.998)	140	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs	(377)
(6.773)	Crown Holdings Inc	Goldman Sachs	(302)	4.714	eBay Inc	Bank of America	
154	CubeSmart (Reit)	Morgan Stanley	168			Merrill Lynch	(2.593)
(183)	Cubic Corp	Goldman Sachs	(87)	197	eBay Inc	Morgan Stanley	(171)
519	Cullen/Frost Bankers Inc	Goldman Sachs	(1.723)	5.616	eBay Inc	Goldman Sachs	(3.089)
(943)	Customers Bancorp Inc	Goldman Sachs	(1.063)	(101)	Edgewell Personal Care Co	Bank of America	
(113)	CVR Energy Inc	Morgan Stanley	614			Merrill Lynch	(39)
228	Dana Inc	Bank of America		(3.446)	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs	(840)
		Merrill Lynch	(407)	(2.720)	Edison International	Goldman Sachs	(55)
3.693	Dana Inc	Goldman Sachs	(5.596)	(741)	Eldorado Resorts Inc	Goldman Sachs	(1.369)
462	Dana Inc	Morgan Stanley	(808)	(252)	Eldorado Resorts Inc	Morgan Stanley	(370)
474	Danaher Corp	Goldman Sachs	(14)	(1.269)	Electronics For Imaging Inc	Goldman Sachs	(783)
68	Danaher Corp	Bank of America		(152)	Ellie Mae Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(43)			Merrill Lynch	(613)
382	Darden Restaurants Inc	Bank of America		(680)	Ellie Mae Inc	Goldman Sachs	(3.921)
		Merrill Lynch	1.097	(87)	Ellie Mae Inc	Morgan Stanley	(477)
529	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	(285)	(116)	Energizer Holdings Inc	Bank of America	
2.853	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs	4.177			Merrill Lynch	(614)
(1.486)	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs	(290)	(1.771)	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs	(8.806)
(588)	Deere & Co	Goldman Sachs	2.670	(1.303)	EnerSys	Goldman Sachs	(8.769)
(173)	Delphi Technologies Plc	Goldman Sachs	444	100	EnPro Industries Inc	Goldman Sachs	66
(3.656)	Delta Air Lines Inc	Goldman Sachs	(411)	(1.088)	Enstar Group Ltd	Goldman Sachs	5.494
382	Deluxe Corp	Goldman Sachs	(551)	(925)	Envision Healthcare Corp	Goldman Sachs	(1.208)
(66)	Dentsply Sirona Inc	Goldman Sachs	46	(174)	EOG Resources Inc	Goldman Sachs	216
250	Despegar.com Corp	Bank of America		(307)	ePlus Inc	Goldman Sachs	(1.366)
		Merrill Lynch	(427)	(1.791)	EPR Properties (Reit)	Goldman Sachs	(2.785)
1.511	Despegar.com Corp	Goldman Sachs	(2.584)	(3.017)	EQT Corp	Bank of America	
(7.931)	Deutsche Bank AG Reg	Goldman Sachs	19.762			Merrill Lynch	(1.445)
(4.132)	Diamondback Energy Inc	Bank of America		(1.426)	EQT Corp	Goldman Sachs	851
		Merrill Lynch	28.924	(440)	EQT Corp	Morgan Stanley	(32)
(624)	Diamondback Energy Inc	Goldman Sachs	4.368	(124)	Equinix Inc (Reit)	Goldman Sachs	(1.660)
(3.616)	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	38.691	(13.959)	Equity Commonwealth (Reit)	Goldman Sachs	(6.114)
556	Dick's Sporting Goods Inc	Goldman Sachs	3.856	691	Equity LifeStyle Properties		
86	Dick's Sporting Goods Inc	Bank of America			Inc (Reit)	Morgan Stanley	2.383
		Merrill Lynch	613	1.098	Equity LifeStyle Properties	Bank of America	
(1.789)	Diebold Nixdorf Inc	Goldman Sachs	1.029		Inc (Reit)	Merrill Lynch	2.975
213	Dillard's Inc 'A'	Goldman Sachs	1.936	989	Essent Group Ltd	Bank of America	
998	Diodes Inc	Goldman Sachs	1.248			Merrill Lynch	(339)
(296)	Diplomat Pharmacy Inc	Goldman Sachs	288	730	Etsy Inc	Bank of America	
(7.387)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	2.010
		Merrill Lynch	22.375	(547)	Euronet Worldwide Inc	Goldman Sachs	(33)
(155)	DISH Network Corp 'A'	Goldman Sachs	473	(1.261)	Evercore Inc 'A'	Goldman Sachs	3.531
(33.408)	DISH Network Corp 'A'	Morgan Stanley	101.226				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
16	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)	3.304	Fortune Brands Home & Security Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.667
127	Everest Re Group Ltd	Goldman Sachs	(242)	6.227	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldman Sachs	6.863
1.709	EW Scripps Co/The 'A'	Goldman Sachs	(256)	2.982	Fortune Brands Home & Security Inc	Morgan Stanley	239
(1.898)	Exelon Corp	Goldman Sachs	(590)	(572)	Forum Energy Technologies Inc	Goldman Sachs	286
(114)	Expeditors International of Washington Inc	Bank of America Merrill Lynch	(396)	1.667	Fox Factory Holding Corp	Goldman Sachs	5.084
(1.554)	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs	(4.651)	75	Fresh Del Monte Produce Inc	Goldman Sachs	(28)
1.859	Extended Stay America Inc (Unit)	Morgan Stanley	1.895	(274)	FTI Consulting Inc	Goldman Sachs	(508)
1.345	Extended Stay America Inc (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	1.775	689	G-III Apparel Group Ltd	Goldman Sachs	2.960
1.890	Extended Stay America Inc (Unit)	Goldman Sachs	2.404	(1.448)	Gannett Co Inc	Goldman Sachs	840
(424)	Exxon Mobil Corp	Bank of America Merrill Lynch	441	(2.117)	Gap Inc/The	Goldman Sachs	5.009
(4.985)	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs	536	(3.630)	Gartner Inc	Morgan Stanley	539
(302)	F5 Networks Inc	Goldman Sachs	153	(2.507)	Gartner Inc	Goldman Sachs	(385)
(193)	Fabrinet	Goldman Sachs	124	(2.965)	Gartner Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.559
(724)	Facebook Inc 'A'	Goldman Sachs	(3.511)	145	GasLog Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(49)
(2.149)	Fastenal Co	Goldman Sachs	329	1.247	GasLog Ltd	Goldman Sachs	(1)
881	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	3.233	986	Gatx Corp	Goldman Sachs	(594)
428	FedEx Corp	Goldman Sachs	811	(8.494)	General Electric Co	Morgan Stanley	10.490
224	Ferrari NV	Goldman Sachs	(853)	(3.932)	General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	2.575
139	Ferro Corp	Bank of America Merrill Lynch	(54)	(23.249)	General Electric Co	Goldman Sachs	15.228
191	Ferro Corp	Goldman Sachs	(139)	(2.879)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Goldman Sachs	(4.750)
235	Ferroglobe Plc	Goldman Sachs	(158)	(11.742)	Gentex Corp	Goldman Sachs	(1.960)
(850)	Fiat Chrysler Automobiles NV	Goldman Sachs	(204)	(208)	Gentherm Inc	Bank of America Merrill Lynch	(135)
2.947	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	(1.799)	(5.583)	Gentherm Inc	Goldman Sachs	(3.146)
6.947	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs	(10.910)	(1.464)	GEO Group Inc/The (Reit)	Goldman Sachs	(2.723)
1.106	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(697)	(698)	Gibraltar Industries Inc	Goldman Sachs	(1.836)
(2.455)	Finisar Corp	Goldman Sachs	516	(590)	Global Payments Inc	Goldman Sachs	1.381
6.385	First American Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.662)	1.941	Globant SA	Goldman Sachs	3.358
9.296	First American Financial Corp	Morgan Stanley	(5.689)	625	GoDaddy Inc 'A'	Goldman Sachs	2.156
6.280	First American Financial Corp	Goldman Sachs	(1.516)	322	Golar LNG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.410)
(587)	First BanCorp/Puerto Rico	Goldman Sachs	12	3.186	Golar LNG Ltd	Goldman Sachs	(14.144)
4.019	First Majestic Silver Corp	Goldman Sachs	723	375	Goldman Sachs Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(5.734)
857	FirstCash Inc	Goldman Sachs	1.340	(1.736)	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Goldman Sachs	2.257
(211)	FirstEnergy Corp	Goldman Sachs	(160)	13	Graham Holdings Co 'B'	Goldman Sachs	(91)
439	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.242)	(5.696)	Graphic Packaging Holding Co	Goldman Sachs	(3.930)
3.093	Five Below Inc	Goldman Sachs	(8.817)	2.095	Gray Television Inc	Goldman Sachs	(1.938)
297	Five9 Inc	Goldman Sachs	1.268	641	Gray Television Inc	Bank of America Merrill Lynch	(593)
126	Five9 Inc	Bank of America Merrill Lynch	538	576	Great Plains Energy Inc	Goldman Sachs	846
(903)	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs	(761)	886	Great Western Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	992
(2.390)	Floor & Decor Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(848)	566	Great Western Bancorp Inc	Goldman Sachs	634
(510)	Floor & Decor Holdings Inc	Goldman Sachs	587	842	Greenbrier Cos Inc/The	Goldman Sachs	2.231
(966)	Floor & Decor Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.488)	176	Group 1 Automotive Inc	Goldman Sachs	192
745	Flowers Foods Inc	Goldman Sachs	(478)	61	Group 1 Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53)
2.369	Flowers Foods Inc	Morgan Stanley	1.919	10.288	H&R Block Inc	Morgan Stanley	2.058
(16.599)	Flowserve Corp	Bank of America Merrill Lynch	31.206	10.479	H&R Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.467
(21.084)	Flowserve Corp	Goldman Sachs	39.713	12.331	H&R Block Inc	Goldman Sachs	1.326
(5.723)	Flowserve Corp	Morgan Stanley	16.883	3.777	Hain Celestial Group Inc/The	Goldman Sachs	(2.634)
(110)	FNF Group	Goldman Sachs	52	1.080	Halliburton Co	Goldman Sachs	(2.655)
(291)	Foot Locker Inc	Bank of America Merrill Lynch	114	340	Halliburton Co	Bank of America Merrill Lynch	(921)
(707)	Foot Locker Inc	Goldman Sachs	167	(1.079)	Hamilton Lane Inc 'A'	Goldman Sachs	(854)
(6.692)	Ford Motor Co	Goldman Sachs	(2.476)	689	Hanesbrands Inc	Goldman Sachs	245
(207)	FormFactor Inc	Goldman Sachs	(36)	72	Hanover Insurance Group Inc/The	Morgan Stanley	(24)
329	Fortinet Inc	Goldman Sachs	1.042	148	Hanover Insurance Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	389
357	Fortinet Inc	Morgan Stanley	432				

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie	USD	Nombre	Description	Contrepartie	USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
888	Hanover Insurance Group Inc/The	Goldman Sachs	1.659	(1.612)	Howard Hughes Corp/The	Bank of America	
182	Harris Corp	Goldman Sachs	(635)	(1.972)	Howard Hughes Corp/The	Merrill Lynch	5.336
2.370	Hartford Financial Services Group Inc/The	Goldman Sachs	(237)	(1.263)	Howard Hughes Corp/The	Goldman Sachs	6.524
5.873	Hartford Financial Services Group Inc/The	Morgan Stanley	(3.759)	2.216	HP Inc	Morgan Stanley	5.860
2.362	Hartford Financial Services Group Inc/The	Bank of America		160	HP Inc	Goldman Sachs	499
(3.584)	Hasbro Inc	Merrill Lynch	(236)	(2.088)	HRG Group Inc	Morgan Stanley	(6)
(1.571)	Hasbro Inc	Goldman Sachs	2.314	(291)	Hub Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(238)
(1.767)	Hasbro Inc	Morgan Stanley	1.681	(879)	Hudson Ltd 'A'	Goldman Sachs	(1.036)
(1.512)	HCA Healthcare Inc	Bank of America		510	Humana Inc	Bank of America	(35)
3.287	HD Supply Holdings Inc	Merrill Lynch	896			Merrill Lynch	2.157
22.626	HD Supply Holdings Inc	Goldman Sachs	(5.095)	694	Humana Inc	Goldman Sachs	2.936
14.450	HD Supply Holdings Inc	Bank of America		413	Humana Inc	Morgan Stanley	1.536
(1.142)	Healthcare Realty Trust Inc (Reit)	Merrill Lynch	691	(2.203)	Huntsman Corp	Goldman Sachs	(327)
632	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs	6.059	(133)	IAC/InterActiveCorp	Bank of America	
(9.165)	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs	(8.670)	357	Icon Plc	Merrill Lynch	(386)
(7.709)	Healthcare Services Group Inc	Morgan Stanley		318	Icon Plc	Bank of America	
(2.554)	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs	(822)	27	Icon Plc	Merrill Lynch	1.353
(1.453)	HealthEquity Inc	Merrill Lynch	112	(779)	ICU Medical Inc	Goldman Sachs	1.205
(710)	HealthEquity Inc	Goldman Sachs	5.591	(114)	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	95
(418)	HealthEquity Inc	Morgan Stanley	1.079			Morgan Stanley	(14.957)
2.654	Hecla Mining Co	Bank of America		642	IDACORP Inc	Bank of America	(2.608)
15.199	Hecla Mining Co	Merrill Lynch	1.558	6.410	IDACORP Inc	Bank of America	
3	HEICO Corp	Goldman Sachs	(7.809)	1.850	IDACORP Inc	Merrill Lynch	2.026
2.052	HEICO Corp	Morgan Stanley	(1.405)	143	IDEX Corp	Goldman Sachs	20.192
1.702	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	(890)	351	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	8.103
1.408	Helmerich & Payne Inc	Bank of America				Goldman Sachs	325
2.400	Helmerich & Payne Inc	Merrill Lynch	(80)	1.150	IDEXX Laboratories Inc	Merrill Lynch	1.283
(553)	Henry Schein Inc	Goldman Sachs	(550)	465	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	3.364
(1.802)	Henry Schein Inc	Bank of America		(9.196)	II-VI Inc	Morgan Stanley	6.409
89	Herc Holdings Inc	Merrill Lynch	8	(11.610)	II-VI Inc	Goldman Sachs	2.312
(1.032)	Herman Miller Inc	Goldman Sachs	4.373	(11.690)	II-VI Inc	Morgan Stanley	5.327
2.073	Hershey Co/The	Merrill Lynch	(8.147)			Bank of America	
(802)	Hess Corp	Goldman Sachs	(15.703)	(243)	ILG Inc	Merrill Lynch	2.725
3.321	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs	835	355	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs	(167)
(553)	HFF Inc 'A'	Merrill Lynch	(81)	(138)	IMAX Corp	Goldman Sachs	(131)
1.953	Highwoods Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	1.823	(822)	IMAX Corp	Bank of America	
1.305	Highwoods Properties Inc (Reit)	Bank of America		(110)	Independent Bank Corp/ Rockland MA	Merrill Lynch	380
2.198	Hill-Rom Holdings Inc	Merrill Lynch	(823)	(2.127)	Infinera Corp	Goldman Sachs	2.332
1.334	Hill-Rom Holdings Inc	Goldman Sachs	(823)	467	Ingersoll-Rand Plc	Merrill Lynch	(478)
1.983	Hill-Rom Holdings Inc	Goldman Sachs	(3.628)	(61)	Inogen Inc	Goldman Sachs	1.087
(1.421)	Hilton Grand Vacations Inc	Goldman Sachs	2.374	(1.390)	Inphi Corp	Goldman Sachs	(1.096)
165	Hollysys Automation Technologies Ltd	Goldman Sachs	(1.983)	533	Insight Enterprises Inc	Goldman Sachs	(266)
971	Hollysys Automation Technologies Ltd	Goldman Sachs	(91)	4.341	Insperty Inc	Goldman Sachs	(2.224)
(102)	Hologic Inc	Bank of America		2.104	Insperty Inc	Bank of America	1.306
(2.205)	Hologic Inc	Merrill Lynch	(114)	1.475	Insperty Inc	Bank of America	
(80)	Home Depot Inc/The	Goldman Sachs	(1.806)	498	Integer Holdings Corp	Merrill Lynch	16.618
(2.255)	Home Depot Inc/The	Morgan Stanley	3.108	(138)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Goldman Sachs	7.856
1.924	Hortonworks Inc	Bank of America	11.056	(527)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Morgan Stanley	2.246
1.293	Houghton Mifflin Harcourt Co	Merrill Lynch	6.710	(641)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Goldman Sachs	226
		Goldman Sachs	5.652	(940)	Integrated Device Technology Inc	Bank of America	(203)
		Goldman Sachs	(1.819)	(305)	Intelsat SA	Merrill Lynch	(775)
		Goldman Sachs	(111)			Goldman Sachs	(744)
		Goldman Sachs	(651)			Goldman Sachs	(1.262)
		Bank of America		1.402	Intercontinental Exchange Inc	Bank of America	(702)
		Merrill Lynch	(114)	(1.381)	International Business Machines Corp	Merrill Lynch	(521)
		Goldman Sachs	(1.806)	(277)	International Business Machines Corp	Goldman Sachs	2.879
		Bank of America			International Business Machines Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	110	502	International Flavors & Fragrances Inc	Merrill Lynch	429
		Goldman Sachs	2.739				
		Goldman Sachs	635			Goldman Sachs	(358)
		Goldman Sachs	291				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
5.345	International Game Technology Plc	Morgan Stanley	(6.730)	3.551	Kohl's Corp	Bank of America	
2.565	International Game Technology Plc	Bank of America		7.687	Kohl's Corp	Merrill Lynch	15.376
9.032	International Game Technology Plc	Merrill Lynch	(7.376)	18.815	Kohl's Corp	Goldman Sachs	33.664
104	Intersect ENT Inc	Goldman Sachs	(32.338)	3.837	Koninklijke Philips NV Reg	Morgan Stanley	71.497
358	Intersect ENT Inc	Bank of America		546	Koninklijke Philips NV Reg	Goldman Sachs	(3.737)
(464)	Intra-Cellular Therapies Inc	Merrill Lynch	143	(2.976)	Kosmos Energy Ltd	Bank of America	(126)
105	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs	154	(2.645)	Kraft Heinz Co/The	Merrill Lynch	(786)
4.111	Invesco Ltd	Goldman Sachs	(1.086)	3.070	Kroger Co/The	Goldman Sachs	(578)
3.141	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Goldman Sachs	493	(517)	Kronos Worldwide Inc	Goldman Sachs	1.062
(195)	Invitation Homes Inc (Reit)	Goldman Sachs	(4.399)	(333)	Kulicke & Soffa Industries Inc	Goldman Sachs	116
(2.872)	Invitation Homes Inc (Reit)	Goldman Sachs	895	143	Laboratory Corp of America Holdings	Goldman Sachs	(693)
(193)	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs	(42)	2.343	Ladder Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	919
1.230	Iridium Communications Inc	Morgan Stanley	371	86	Lamb Weston Holdings Inc	Bank of America	1.336
1.906	ITT Inc	Goldman Sachs	(1.449)	1.143	Landstar System Inc	Merrill Lynch	(40)
1.358	Jabil Inc	Goldman Sachs	4.305	2.873	Landstar System Inc	Bank of America	
8.794	Jabil Inc	Bank of America	(1.161)	7.577	Landstar System Inc	Merrill Lynch	6.058
(27.049)	Janus Henderson Group Plc	Merrill Lynch	1.104	8.706	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	15.227
(9.367)	Janus Henderson Group Plc	Goldman Sachs	8.119	3.609	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	29.171
274	Jazz Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	49.770	8.867	Las Vegas Sands Corp	Bank of America	19.302
51	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs	19.368	(396)	Laureate Education Inc	Merrill Lynch	7.426
(92)	JB Hunt Transport Services Inc	Bank of America	614	7	LCI Industries	Goldman Sachs	20.327
4.001	Jefferies FinancialL Group In	Merrill Lynch	189	372	LCI Industries	Bank of America	(725)
(7.831)	JELD-WEN Holding Inc	Goldman Sachs	(159)	1.473	Legg Mason Inc	Merrill Lynch	9
(12.317)	JELD-WEN Holding Inc	Morgan Stanley	(473)	1.396	Legg Mason Inc	Goldman Sachs	986
(11.345)	JELD-WEN Holding Inc	Bank of America	(902)	2.046	Leggett & Platt Inc	Goldman Sachs	(2.357)
354	JM Smucker Co/The	Merrill Lynch	(1.475)	39	LendingTree Inc	Morgan Stanley	(2.485)
676	JM Smucker Co/The	Goldman Sachs	6.560	(4.664)	Lennar Corp 'A'	Goldman Sachs	1.607
(931)	John Bean Technologies Corp	Bank of America	(1.292)	(509)	Lennar Corp 'A'	Merrill Lynch	59
4.323	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldman Sachs	(2.133)	(18.497)	Lennar Corp 'A'	Bank of America	
49	Johnson & Johnson	Goldman Sachs	(2.752)	(1)	Lennar Corp 'B'	Merrill Lynch	(4.034)
2.957	Johnson & Johnson	Bank of America	3.185	39	Lennox International Inc	Goldman Sachs	(307)
(22.632)	Johnson Controls International Plc	Merrill Lynch	(27)	(138)	Liberty Broadband Corp 'C'	Morgan Stanley	(15.848)
(2.686)	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs	(12.190)	(1.327)	Liberty Broadband Corp 'C'	Bank of America	(16)
1.391	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	52.293	(422)	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	47
649	Jones Lang LaSalle Inc	Bank of America		(6.082)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Goldman Sachs	2.204
1.774	Jones Lang LaSalle Inc	Merrill Lynch	(3.672)	(8.302)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Morgan Stanley	(876)
(1.624)	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs	(1.713)	(8.779)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America	(373)
(1.606)	Kaman Corp	Morgan Stanley	(6.422)	140	Liberty Oilfield Services 'A'	Merrill Lynch	(6.955)
436	Keane Group Inc	Goldman Sachs	(3.292)	1	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(8.531)
1.240	Kearny Financial Corp/MD	Goldman Sachs	(641)	(792)	LifePoint Health Inc	Bank of America	(6)
(1.143)	Kemet Corp	Goldman Sachs	558	(33)	Lincoln Electric Holdings Inc	Merrill Lynch	
(356)	Kemper Corp	Goldman Sachs	272	(947)	Lincoln Electric Holdings Inc	Goldman Sachs	2
1.090	Kennametal Inc	Goldman Sachs	(1.798)	8.003	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	1.368
1.915	KeyCorp	Goldman Sachs	(1.090)	3.441	Lincoln National Corp	Bank of America	(19)
845	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs	(2.038)	2.174	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Goldman Sachs	(1.469)
2.966	Kimco Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	5.480	914	Lithia Motors Inc 'A'	Goldman Sachs	(14.165)
5.209	Kimco Realty Corp (Reit)	Bank of America	3.945	6.361	Lithia Motors Inc 'A'	Morgan Stanley	(8.981)
6.361	Kinder Morgan Inc/DE	Merrill Lynch	6.565	2.083	Lithia Motors Inc 'A'	Goldman Sachs	
379	Kite Realty Group Trust (Reit)	Goldman Sachs	572	(34)	Littelfuse Inc	Merrill Lynch	110
590	Kite Realty Group Trust (Reit)	Bank of America	209	(833)	LKQ Corp	Goldman Sachs	763
(906)	KLA-Tencor Corp	Merrill Lynch	673			Morgan Stanley	(3.166)
(1.199)	Knowles Corp	Goldman Sachs	(2.584)				(150)
		Goldman Sachs	(623)				85

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
216	Loews Corp	Bank of America		3.676	Meritage Homes Corp	Goldman Sachs	13.417
		Merrill Lynch	(336)	181	Meritor Inc	Bank of America	
5.373	Loews Corp	Goldman Sachs	(16.342)			Merrill Lynch	(227)
(640)	Louisiana-Pacific Corp	Goldman Sachs	(1.169)	1.078	Meritor Inc	Goldman Sachs	(604)
(1.904)	Lowe's Cos Inc	Bank of America		(39)	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	773
		Merrill Lynch	(22.315)	(3.382)	MGIC Investment Corp	Bank of America	
(4.399)	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs	(51.556)			Merrill Lynch	315
(153)	Lowe's Cos Inc	Morgan Stanley	(124)	(8.830)	MGM Growth Properties		
970	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	1.015		LLC 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(11.424)
441	Lululemon Athletica Inc	Bank of America		(1.672)	MGM Resorts International	Goldman Sachs	(201)
		Merrill Lynch	153	149	Michael Kors Holdings Ltd	Bank of America	
2.365	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs	5.953			Merrill Lynch	(946)
(5.742)	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs	17.648	2.784	Michael Kors Holdings Ltd	Goldman Sachs	(14.934)
(740)	LyondellBasell Industries			2.175	Michael Kors Holdings Ltd	Morgan Stanley	(16.387)
	NV 'A'	Goldman Sachs	(584)	409	Michaels Cos Inc/The	Goldman Sachs	32
329	M&T Bank Corp	Goldman Sachs	(1.953)	(15.943)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	(72.136)
825	Macerich Co/The (Reit)	Bank of America		(5.439)	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(19.435)
		Merrill Lynch	1.144	(392)	Micron Technology Inc	Bank of America	
230	Macerich Co/The (Reit)	Goldman Sachs	277			Merrill Lynch	(2.015)
774	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	1.098	(1.937)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs	5.617
(727)	Macquarie Infrastructure Corp	Bank of America		(1.655)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	(199)
		Merrill Lynch	(772)	(58)	MicroStrategy Inc 'A'	Goldman Sachs	15
(316)	Macquarie Infrastructure Corp	Goldman Sachs	(325)	(806)	Middleby Corp/The	Goldman Sachs	3.337
(30)	Magellan Health Inc	Goldman Sachs	(27)	(3.827)	Middleby Corp/The	Morgan Stanley	12.438
(516)	MakeMyTrip Ltd	Goldman Sachs	(619)	(1.224)	Middleby Corp/The	Bank of America	
175	Manitowoc Co Inc/The	Bank of America				Merrill Lynch	5.067
		Merrill Lynch	(324)	622	Milacron Holdings Corp	Goldman Sachs	152
561	ManpowerGroup Inc	Bank of America		942	Modine Manufacturing Co	Goldman Sachs	(1.235)
		Merrill Lynch	(666)	730	Modine Manufacturing Co	Bank of America	
272	ManpowerGroup Inc	Goldman Sachs	(471)			Merrill Lynch	9
858	ManpowerGroup Inc	Morgan Stanley	(1.346)	74	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs	(86)
4.377	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs	788	(1.019)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Goldman Sachs	273
(164)	Markel Corp	Goldman Sachs	3.062	(1.637)	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs	(2.427)
(47)	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs	(36)	(750)	Moog Inc 'A'	Goldman Sachs	722
(132)	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	(836)	4.850	Morgan Stanley	Bank of America	
664	Marriott International					Merrill Lynch	(16.678)
	Inc/MD 'A'	Goldman Sachs	(1.872)	5.998	Morgan Stanley	Goldman Sachs	(21.115)
(139)	Marriott Vacations Worldwide			(4.049)	Mosaic Co/The	Goldman Sachs	(1.448)
	Corp	Goldman Sachs	(363)	1.113	Motorola Solutions Inc	Bank of America	
2.676	Marvell Technology Group Ltd	Goldman Sachs	161			Merrill Lynch	403
(807)	MasTec Inc	Goldman Sachs	1.049	1.031	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs	314
150	Matador Resources Co	Bank of America		1.595	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	2.515
		Merrill Lynch	(604)	1.527	MRC Global Inc	Goldman Sachs	(188)
1.602	Matador Resources Co	Goldman Sachs	(5.765)	(1.555)	MSCI Inc	Goldman Sachs	(5.695)
(1.366)	MaxLinear Inc	Goldman Sachs	478	(96)	MSCI Inc	Bank of America	
(3.537)	McDermott International Inc	Goldman Sachs	2.186			Merrill Lynch	(363)
(8.948)	McDermott International Inc	Morgan Stanley	4.385	495	Murphy Oil Corp	Bank of America	
(414)	McDermott International Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(384)
		Merrill Lynch	(1.929)	11.976	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs	(3.265)
1.244	MDU Resources Group Inc	Goldman Sachs	229	1.446	Murphy Oil Corp	Morgan Stanley	(1.865)
686	Media General Inc-CVR***	Bank of America		(1.209)	Mylan NV	Goldman Sachs	105
		Merrill Lynch	93	(318)	MyoKardia Inc	Goldman Sachs	(223)
39	Medifast Inc	Bank of America		616	National General		
		Merrill Lynch	192		Holdings Corp	Goldman Sachs	869
149	Medifast Inc	Goldman Sachs	2.025	(1.814)	National Oilwell Varco Inc	Goldman Sachs	482
1.483	Melco Resorts &			6.783	National Retail Properties		
	Entertainment Ltd ADR	Morgan Stanley	1.757		Inc (Reit)	Goldman Sachs	15.063
7.898	Melco Resorts &	Bank of America		4.546	National Retail Properties	Bank of America	
	Entertainment Ltd ADR	Merrill Lynch	9.130		Inc (Reit)	Merrill Lynch	10.229
662	Melco Resorts &			3.137	National Retail Properties		
	Entertainment Ltd ADR	Goldman Sachs	543		Inc (Reit)	Morgan Stanley	4.812
685	Mellanox Technologies Ltd	Goldman Sachs	2.247	(1.578)	National Vision Holdings Inc	Goldman Sachs	(4.917)
(172)	MercadoLibre Inc	Goldman Sachs	596	(569)	Natus Medical Inc	Goldman Sachs	(568)
153	Merck & Co Inc	Bank of America		808	Navistar International Corp	Goldman Sachs	(595)
		Merrill Lynch	181	551	Nektar Therapeutics	Goldman Sachs	(189)
190	Merck & Co Inc	Goldman Sachs	126	15	Nektar Therapeutics	Bank of America	
(198)	Mercury General Corp	Goldman Sachs	(194)			Merrill Lynch	53
(73)	Mercury Systems Inc	Goldman Sachs	(135)	2.893	NetApp Inc	Goldman Sachs	(1.426)
1.668	Meredith Corp	Goldman Sachs	1.299	(58)	Netflix Inc	Bank of America	
120	Meredith Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(228)
		Merrill Lynch	(12)	(344)	Netflix Inc	Goldman Sachs	(9.060)

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

** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(1.531)	Netflix Inc	Morgan Stanley	(28.280)	76	Overstock.com Inc	Bank of America	
(323)	NetScout Systems Inc	Goldman Sachs	147			Merrill Lynch	(270)
(541)	NetScout Systems Inc	Morgan Stanley	168	349	Overstock.com Inc	Goldman Sachs	(1.260)
(215)	Nevro Corp	Bank of America		2.835	Owens & Minor Inc	Goldman Sachs	(539)
		Merrill Lynch	(444)	5.290	Owens Corning	Bank of America	
(665)	Nevro Corp	Morgan Stanley	(4.582)			Merrill Lynch	(4.658)
(100)	Nevro Corp	Goldman Sachs	(102)	4.942	Owens Corning	Goldman Sachs	(4.570)
(344)	New Jersey Resources Corp	Goldman Sachs	60	8.209	Owens Corning	Morgan Stanley	(7.252)
285	New Relic Inc	Goldman Sachs	4.309	(2.463)	Owens-Illinois Inc	Goldman Sachs	(1.502)
(355)	New York Times Co/The 'A'	Goldman Sachs	60	5.200	PACCAR Inc	Goldman Sachs	(2.651)
(9.684)	Newell Brands Inc	Goldman Sachs	22.117	(543)	Pacific Premier Bancorp Inc	Goldman Sachs	227
(20.325)	Newell Brands Inc	Bank of America		(269)	Pacira Pharmaceuticals Inc/DE	Goldman Sachs	(390)
		Merrill Lynch	42.185	5.266	Packaging Corp of America	Goldman Sachs	7.760
(18.552)	Newell Brands Inc	Morgan Stanley	48.006	319	Packaging Corp of America	Bank of America	
(150)	NewMarket Corp	Goldman Sachs	(3.042)			Merrill Lynch	(2)
2.731	Newmont Mining Corp	Bank of America		1.005	Packaging Corp of America	Morgan Stanley	(1.909)
		Merrill Lynch	(980)	2.983	Pageseguro Digital Ltd 'A'	Goldman Sachs	7.070
13.866	Newmont Mining Corp	Goldman Sachs	(5.656)	(506)	Pandora Media Inc	Goldman Sachs	(122)
1.119	Newmont Mining Corp	Morgan Stanley	(212)	(518)	Papa John's International Inc	Bank of America	
(3.816)	News Corp 'A'	Goldman Sachs	1.984			Merrill Lynch	43
166	Nexstar Media Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(108)	(892)	Papa John's International Inc	Goldman Sachs	(205)
(2.573)	Nielsen Holdings Plc	Goldman Sachs	2.091	685	Parsley Energy Inc 'A'	Bank of America	
(3.067)	NIKE Inc 'B'	Goldman Sachs	(7.606)			Merrill Lynch	(1.281)
(410)	NMI Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	67	2.484	Parsley Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	(3.790)
179	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	(353)	331	Party City Holdco Inc	Bank of America	
2.825	Nordstrom Inc	Goldman Sachs	(2.372)			Merrill Lynch	(4)
774	Nordstrom Inc	Bank of America		2.890	Party City Holdco Inc	Goldman Sachs	773
		Merrill Lynch	467	3.148	Pattern Energy Group Inc	Goldman Sachs	1.291
167	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	459	373	Pattern Energy Group Inc	Bank of America	
639	Northern Trust Corp	Bank of America				Merrill Lynch	153
		Merrill Lynch	(3.575)	643	Paychex Inc	Goldman Sachs	202
567	Northrop Grumman Corp	Goldman Sachs	5.235	(985)	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs	(2.612)
(790)	Novanta Inc	Goldman Sachs	(1.993)	(70)	PBF Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	(65)
336	NRG Yield Inc 'C'	Bank of America		(37)	Peabody Energy Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	41			Merrill Lynch	(125)
(537)	Nutanix Inc 'A'	Goldman Sachs	1.258	(1.648)	Peabody Energy Corp	Goldman Sachs	(5.235)
1.464	Nutrisystem Inc	Goldman Sachs	5.563	2.253	Penske Automotive Group Inc	Goldman Sachs	1.149
420	Nutrisystem Inc	Bank of America		(54)	Penumbra Inc	Goldman Sachs	(232)
		Merrill Lynch	1.596	1.877	People's United Financial Inc	Goldman Sachs	(300)
(20)	O'Reilly Automotive Inc	Bank of America		1.136	PepsiCo Inc	Goldman Sachs	1.530
		Merrill Lynch	71	5.566	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs	(4.431)
(262)	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs	(406)	4.818	Perrigo Co Plc	Bank of America	
784	Oasis Petroleum Inc	Goldman Sachs	808			Merrill Lynch	(3.246)
67	Occidental Petroleum Corp	Bank of America		7.264	Perrigo Co Plc	Morgan Stanley	(7.046)
		Merrill Lynch	131	(8.392)	Pfizer Inc	Goldman Sachs	(3.176)
755	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs	1.428	1.226	Pilgrim's Pride Corp	Goldman Sachs	(1.144)
(6.681)	Office Depot Inc	Goldman Sachs	(367)	591	Pilgrim's Pride Corp	Bank of America	
(76)	Okta Inc	Goldman Sachs	(577)			Merrill Lynch	(544)
(203)	Olin Corp	Goldman Sachs	79	4.621	Pinnacle West Capital Corp	Goldman Sachs	9.192
(59)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Bank of America		3.724	Pinnacle West Capital Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6)			Merrill Lynch	7.782
(463)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	35	3.770	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	11.212
(533)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Goldman Sachs	(695)	(75)	Piper Jaffray Cos	Bank of America	
(279)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Goldman Sachs	(650)			Merrill Lynch	98
(2.122)	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs	7.890	(448)	Piper Jaffray Cos	Goldman Sachs	619
1.743	ON Semiconductor Corp	Goldman Sachs	3.710	619	Pivotal Software Inc 'A'	Goldman Sachs	338
1.977	ONE Gas Inc	Goldman Sachs	8.086	(330)	Plantronics Inc	Goldman Sachs	(1.181)
212	OneMain Holdings Inc	Bank of America		(1.108)	Platform Specialty Products Corp	Goldman Sachs	(200)
		Merrill Lynch	(282)			Goldman Sachs	(909)
560	OneMain Holdings Inc	Goldman Sachs	(896)	(1.386)	Plexus Corp	Bank of America	
(7.388)	Oracle Corp	Goldman Sachs	(1.533)	(34)	Pool Corp	Merrill Lynch	119
(488)	OraSure Technologies Inc	Goldman Sachs	(683)	(208)	Pool Corp	Goldman Sachs	873
1.487	Orion Engineered Carbons SA	Goldman Sachs	1.190	(2.435)	Popular Inc	Bank of America	
(3.088)	Ormat Technologies Inc	Goldman Sachs	1.403			Merrill Lynch	2.673
289	Oshkosh Corp	Goldman Sachs	(295)	402	Portland General Electric Co	Bank of America	
935	Outfront Media Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	724
		Merrill Lynch	(206)	3.522	Portland General Electric Co	Goldman Sachs	6.573
3.054	Outfront Media Inc (Reit)	Goldman Sachs	(672)	(2.372)	Post Holdings Inc	Goldman Sachs	(3.558)
				2.295	Potlatch Corp (Reit)	Goldman Sachs	8.421
				262	PPL Corp	Goldman Sachs	(16)

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(291)	PRA Group Inc	Goldman Sachs	175	688	RPC Inc	Morgan Stanley	(1.858)
(92)	PRA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	(652)	(185)	Rush Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	6
(1.693)	PriceSmart Inc	Goldman Sachs	(8.380)	1.466	Ryder System Inc	Bank of America	
(162)	Primerica Inc	Goldman Sachs	126			Merrill Lynch	352
2.845	Principal Financial Group Inc	Goldman Sachs	(6.077)	12.221	Ryder System Inc	Goldman Sachs	2.920
(5.517)	Procter & Gamble Co/The	Goldman Sachs	(4.420)	11.125	Ryder System Inc	Morgan Stanley	(657)
101	Progress Software Corp	Bank of America		113	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	55			Merrill Lynch	327
4.043	Progress Software Corp	Goldman Sachs	2.332	297	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	764
9.281	Prologis Inc (Reit)	Bank of America		(12.150)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.063			Merrill Lynch	(10.328)
20.060	Prologis Inc (Reit)	Goldman Sachs	9.285	(16.822)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Goldman Sachs	(14.299)
13.807	Prologis Inc (Reit)	Morgan Stanley	17.535	(22.500)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Morgan Stanley	(26.859)
1.134	Prudential Financial Inc	Goldman Sachs	(4.343)	(223)	Sally Beauty Holdings Inc	Bank of America	
956	Prudential Financial Inc	Bank of America				Merrill Lynch	45
		Merrill Lynch	(3.661)	(2.128)	Sally Beauty Holdings Inc	Goldman Sachs	218
(179)	PS Business Parks Inc (Reit)	Goldman Sachs	(572)	486	Sanmina Corp	Goldman Sachs	(49)
261	PVH Corp	Goldman Sachs	1.014	(1.226)	SBA Communications Corp (Reit)	Bank of America	
(4.443)	QEP Resources Inc	Goldman Sachs	2.710			Merrill Lynch	(449)
(246)	QIAGEN NV	Goldman Sachs	(379)	(281)	SBA Communications Corp (Reit)	Morgan Stanley	(174)
(4.013)	Qorvo Inc	Bank of America		(1.424)	SBA Communications Corp (Reit)	Goldman Sachs	(1.410)
		Merrill Lynch	(3.050)	(1.533)	Schweitzer-Mauduit International Inc	Goldman Sachs	(1.307)
(6.928)	Qorvo Inc	Goldman Sachs	(5.470)	(560)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Goldman Sachs	(1.243)
(8.097)	Qorvo Inc	Morgan Stanley	(1.134)	(2.543)	Seacoast Banking Corp of Florida	Goldman Sachs	(1.376)
(313)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(2)	(1.676)	Seagate Technology Plc	Goldman Sachs	(771)
(365)	Quaker Chemical Corp	Goldman Sachs	(1.679)	1.147	Select Income (Reit)	Goldman Sachs	1.621
10.394	Quest Diagnostics Inc	Goldman Sachs	59.766	(750)	Senior Housing Properties Trust (Reit)	Goldman Sachs	(1.155)
1.581	Quest Diagnostics Inc	Morgan Stanley	9.755	57	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America	
46	Quidel Corp	Bank of America		(263)	Seritage Growth Properties 'A' (Reit)	Merrill Lynch	(19)
		Merrill Lynch	12	3.621	Service Corp International/US	Goldman Sachs	(34)
65	Quidel Corp	Goldman Sachs	58	619	ServiceMaster Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(393)
(643)	Rambus Inc	Goldman Sachs	(257)	(504)	Shenandoah Telecommunications Co	Goldman Sachs	(317)
(3.690)	Range Resources Corp	Goldman Sachs	(3.690)	(775)	Sherwin-Williams Co/The	Bank of America	(454)
(3.278)	Range Resources Corp	Morgan Stanley	(1.115)	(1.744)	Sherwin-Williams Co/The	Merrill Lynch	(4.960)
2.146	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	4.678	(3.126)	Sherwin-Williams Co/The	Goldman Sachs	(10.600)
321	Raytheon Co	Goldman Sachs	651	2.820	Ship Finance International Ltd	Morgan Stanley	(17.709)
(401)	RBC Bearings Inc	Goldman Sachs	(2.234)	(108)	Shutterstock Inc	Goldman Sachs	(134)
(1.419)	Realogy Holdings Corp	Goldman Sachs	543	(1.467)	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs	(115)
(718)	Redfin Corp	Goldman Sachs	(693)	(1.389)	Silgan Holdings Inc	Goldman Sachs	(583)
2.853	Regency Centers Corp (Reit)	Goldman Sachs	3.949	(1.078)	Silicon Laboratories Inc	Goldman Sachs	(3.747)
862	Reliance Steel & Aluminum Co	Goldman Sachs	2.425	(4.275)	Simmons First National Corp	Goldman Sachs	(3.014)
4.538	Republic Services Inc	Goldman Sachs	4.303	1.981	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Bank of America	
945	Republic Services Inc	Morgan Stanley	1.663			Merrill Lynch	(5.844)
(447)	ResMed Inc	Goldman Sachs	(603)	(1.856)	SiteOne Landscape Supply Inc	Bank of America	
1.524	Retail Opportunity Investments Corp (Reit)	Goldman Sachs	1.363	(2.044)	SiteOne Landscape Supply Inc	Merrill Lynch	2.789
(9.276)	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(8.256)	(1.735)	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	678
350	REV Group Inc	Goldman Sachs	(145)	(1.017)	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs	3.461
701	Revance Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1.227)	158	SL Green Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	(1.716)
(1.827)	Rexnord Corp	Goldman Sachs	(913)	240	SL Green Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	71
183	RH	Bank of America		556	SL Green Realty Corp (Reit)	Bank of America	566
		Merrill Lynch	(263)			Merrill Lynch	250
768	RingCentral Inc 'A'	Goldman Sachs	1.594	(146)	SMART Global Holdings Inc	Bank of America	
1.506	RLI Corp/DE	Goldman Sachs	159	(286)	SMART Global Holdings Inc	Merrill Lynch	(80)
(4.844)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Bank of America		690	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(157)
		Merrill Lynch	(10.851)			Bank of America	
(6.903)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Goldman Sachs	(13.423)	5.087	Snap Inc 'A'	Merrill Lynch	478
1.494	Robert Half International Inc	Bank of America				Goldman Sachs	3.695
		Merrill Lynch	1.808				
573	Robert Half International Inc	Goldman Sachs	693				
136	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	33				
(346)	Rogers Corp	Goldman Sachs	373				
3.140	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	(6.120)				
7.297	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America					
		Merrill Lynch	(13.724)				
10.906	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs	(14.316)				
(310)	Royal Gold Inc	Goldman Sachs	(381)				
1.908	RPC Inc	Goldman Sachs	(4.579)				
399	RPC Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(958)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
1.708	Snap-on Inc	Goldman Sachs	(2.876)	615	Synovus Financial Corp	Goldman Sachs	(237)
120	Sohu.com Inc	Bank of America		749	Syntel Inc	Goldman Sachs	1.039
		Merrill Lynch	(107)	(2.320)	Sysco Corp	Goldman Sachs	(6.118)
216	Sohu.com Inc	Goldman Sachs	(58)	(28)	T Rowe Price Group Inc	Bank of America	
400	Sonic Automotive Inc 'A'	Goldman Sachs	500			Merrill Lynch	(122)
857	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	591	(2.294)	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs	(8.566)
3.534	Sotheby's	Goldman Sachs	(4.488)	(4.320)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	2.419
7.106	Sotheby's	Bank of America		(699)	Take-Two Interactive		
		Merrill Lynch	(9.129)		Software Inc	Goldman Sachs	1.350
2.756	Sotheby's	Morgan Stanley	(6.504)	102	Talos Energy Inc	Bank of America	
(335)	South Jersey Industries Inc	Goldman Sachs	(234)			Merrill Lynch	193
(4.455)	Southern Co/The	Goldman Sachs	(2.613)	702	TALOS ENERGY Inc	Goldman Sachs	903
(684)	Southern Copper Corp	Goldman Sachs	1.273	1.734	Tanger Factory Outlet		
236	Southwest Airlines Co	Bank of America			Centers Inc (Reit)	Goldman Sachs	2.377
		Merrill Lynch	(146)	(7.306)	Tapestry Inc	Goldman Sachs	9.406
3.864	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	(2.770)	(564)	Tapestry Inc	Morgan Stanley	305
(688)	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs	(5.353)	(4.267)	Targa Resources Corp	Morgan Stanley	2.134
(1.432)	Spectrum Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.659)	6.883	Target Corp	Bank of America	
1.460	Spirit AeroSystems Holdings				Merrill Lynch	7.444	
	Inc 'A'	Goldman Sachs	880	6.374	Target Corp	Goldman Sachs	2.909
(12.109)	Spirit Realty Capital Inc			10.070	Target Corp	Morgan Stanley	(133)
	(Reit)	Goldman Sachs	(5.290)	(289)	Taubman Centers Inc (Reit)	Goldman Sachs	(436)
970	Splunk Inc	Goldman Sachs	(1.300)	(963)	Taylor Morrison Home Corp 'A'	Goldman Sachs	294
1.139	Spotify Technology SA	Goldman Sachs	(834)	(256)	Taylor Morrison Home Corp 'A'	Bank of America	
42.415	Sprint Corp	Goldman Sachs	518			Merrill Lynch	42
2.187	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs	(66)	(2.400)	TCF Financial Corp	Goldman Sachs	(1.560)
39	SPS Commerce Inc	Bank of America		8.510	TE Connectivity Ltd	Goldman Sachs	(7.148)
		Merrill Lynch	(14)	9.467	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	(13.159)
(1.243)	SPX Corp	Goldman Sachs	(1.330)	44	Tech Data Corp	Bank of America	
(148)	Square Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	434
		Merrill Lynch	(547)	2.115	TechnipFMC Plc	Bank of America	
(136)	Square Inc 'A'	Goldman Sachs	(391)			Merrill Lynch	1.305
(3.175)	SRC Energy Inc	Goldman Sachs	(3.175)	563	Tegna Inc	Bank of America	
68	Stamps.com Inc	Goldman Sachs	195			Merrill Lynch	(191)
2.374	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	(6.411)	797	Tegna Inc	Goldman Sachs	(271)
(6.564)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	3.622	(59)	Teladoc Inc	Bank of America	
(6.027)	Starbucks Corp	Goldman Sachs	(246)			Merrill Lynch	(38)
(9.711)	Starbucks Corp	Bank of America		(410)	Teleflex Inc	Goldman Sachs	(3.756)
		Merrill Lynch	(1.741)	(256)	Teleflex Inc	Bank of America	
(19.779)	Starwood Property Trust					Merrill Lynch	(2.345)
	Inc (Reit)	Goldman Sachs	(6.112)	(2.230)	Teleflex Inc	Morgan Stanley	(14.094)
670	State Street Corp	Goldman Sachs	(1.382)	7.910	Telephone & Data Systems Inc	Bank of America	
(318)	Steel Dynamics Inc	Goldman Sachs	171			Merrill Lynch	(3.053)
4.524	Steelcase Inc 'A'	Goldman Sachs	2.262	14.414	Telephone & Data Systems Inc	Goldman Sachs	(5.847)
(80)	Stericycle Inc	Bank of America		12.818	Telephone & Data Systems Inc	Morgan Stanley	(5.512)
		Merrill Lynch	(50)	(319)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs	181
(1.251)	Stericycle Inc	Goldman Sachs	(1.022)	(345)	Tennant Co	Goldman Sachs	(973)
(25.822)	Sterling Bancorp/DE	Bank of America		2.301	Tenneco Inc	Goldman Sachs	(5.914)
		Merrill Lynch	(11.620)	8.828	Tenneco Inc	Morgan Stanley	(33.546)
(32.704)	Sterling Bancorp/DE	Goldman Sachs	(14.485)	3.836	Teradata Corp	Morgan Stanley	3.222
(14.274)	Sterling Bancorp/DE	Morgan Stanley	-	6.100	Teradata Corp	Goldman Sachs	10.370
(1.117)	Stratasys Ltd	Goldman Sachs	1.586	3.965	Teradata Corp	Bank of America	
(27)	Strayer Education Inc	Goldman Sachs	7			Merrill Lynch	6.741
298	Stryker Corp	Goldman Sachs	1.221	(5.620)	Teradyne Inc	Goldman Sachs	(16.691)
(734)	Sun Hydraulics Corp	Goldman Sachs	(1.417)	4.074	Terex Corp	Goldman Sachs	(6.600)
(3.009)	Sunrun Inc	Goldman Sachs	(1.679)	4.654	Terex Corp	Bank of America	
(440)	Super Micro Computer Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(7.539)
		Merrill Lynch	(220)	7.079	Terex Corp	Morgan Stanley	(15.574)
(4.559)	Super Micro Computer Inc	Goldman Sachs	(2.229)	1.113	TerraForm Power Inc 'A'	Bank of America	
3.037	Superior Energy Services Inc	Goldman Sachs	(1.488)			Merrill Lynch	56
342	SVB Financial Group	Goldman Sachs	(2.907)	16.807	TerraForm Power Inc 'A'	Goldman Sachs	1.356
210	Switch Inc 'A'	Goldman Sachs	69	(253)	Tesla Inc	Goldman Sachs	(1.336)
(11.767)	Symantec Corp	Bank of America		206	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	677
		Merrill Lynch	15.768	65	Texas Roadhouse Inc	Bank of America	
(23.532)	Symantec Corp	Goldman Sachs	30.779			Merrill Lynch	115
(32.139)	Symantec Corp	Morgan Stanley	12.213	671	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs	1.412
(3.112)	Syneos Health Inc	Bank of America		2.361	TherapeuticsMD Inc	Goldman Sachs	(344)
		Merrill Lynch	(5.436)	(2.463)	Third Point Reinsurance Ltd	Bank of America	
(858)	Syneos Health Inc	Morgan Stanley	(815)			Merrill Lynch	(246)
(2.342)	Syneos Health Inc	Goldman Sachs	(5.497)	688	Timken Co/The	Goldman Sachs	(654)
1.774	Synopsys Inc	Goldman Sachs	(497)	2.054	Tivity Health Inc	Goldman Sachs	(2.032)

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(285)	TiVo Corp	Goldman Sachs	(19)	(96)	Universal Corp/VA	Bank of America	
(664)	TJX Cos Inc/The	Goldman Sachs	(974)			Merrill Lynch	(1.949)
(5.136)	Torchmark Corp	Goldman Sachs	2.919	(512)	Universal Corp/VA	Goldman Sachs	(4.133)
1.156	Tower Semiconductor Ltd	Goldman Sachs	369	(174)	Universal Display Corp	Morgan Stanley	1.561
(62)	TransDigm Group Inc	Goldman Sachs	(684)	900	Unum Group	Morgan Stanley	(765)
4.828	Transocean Ltd	Morgan Stanley	(6.373)	2.607	Unum Group	Bank of America	
198	TransUnion	Bank of America				Merrill Lynch	(397)
		Merrill Lynch	95	4.126	Unum Group	Goldman Sachs	(1.104)
(508)	Trimble Inc	Goldman Sachs	325	175	Urban Edge Properties (Reit)	Goldman Sachs	257
782	Trinseo SA	Bank of America		3.719	Urban Outfitters Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.877)			Merrill Lynch	1.701
1.011	Trinseo SA	Goldman Sachs	(2.426)	14.584	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs	2.002
1.333	Trinseo SA	Morgan Stanley	(4.066)	7.959	Urban Outfitters Inc	Morgan Stanley	(6.073)
(1.391)	Triton International Ltd/ Bermuda			2.298	US Bancorp	Goldman Sachs	(4.004)
141	Triumph Group Inc	Goldman Sachs	31	(154)	US Foods Holding Corp	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	(151)
		Merrill Lynch	(278)	(4.786)	US Foods Holding Corp	Goldman Sachs	(4.392)
1.749	Triumph Group Inc	Goldman Sachs	(2.450)	(542)	US Silica Holdings Inc	Goldman Sachs	320
(1.474)	Tronox Ltd 'A'	Goldman Sachs	(1.400)	284	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	1.146
(1.668)	Tronox Ltd 'A'	Morgan Stanley	(183)	(136)	USG Corp	Goldman Sachs	(4)
(302)	TrueBlue Inc	Goldman Sachs	(241)	(3.586)	Valero Energy Corp	Goldman Sachs	(28.626)
(1.623)	Tupperware Brands Corp	Goldman Sachs	984	(55)	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	115
(1.576)	Twenty-First Century Fox Inc 'B'	Bank of America		(303)	Valmont Industries Inc	Bank of America	
(5.498)	Twenty-First Century Fox Inc 'B'	Merrill Lynch	(754)			Merrill Lynch	(701)
(8.841)	Twenty-First Century Fox Inc 'B'	Morgan Stanley	(2.089)	(507)	Valmont Industries Inc	Goldman Sachs	(1.549)
				(1.918)	Valvoline Inc	Goldman Sachs	589
(318)	Twilio Inc 'A'	Goldman Sachs	(6.820)	(960)	Varex Imaging Corp	Goldman Sachs	(326)
192	Twitter Inc	Goldman Sachs	(214)	1.803	Varian Medical Systems Inc	Morgan Stanley	562
		Bank of America		570	Varian Medical Systems Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	359			Merrill Lynch	658
499	Twitter Inc	Goldman Sachs	933	2.701	Varian Medical Systems Inc	Goldman Sachs	3.425
2.179	Twitter Inc	Morgan Stanley	4.445	(6.170)	Vectren Corp	Goldman Sachs	(6.972)
(2.940)	Tyson Foods Inc 'A'	Goldman Sachs	(1.987)	1.473	Veeva Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	2.489
561	UDR Inc (Reit)	Bank of America		814	Veeva Systems Inc 'A'	Morgan Stanley	1.099
		Merrill Lynch	571	958	Venator Materials Plc	Goldman Sachs	38
479	UDR Inc (Reit)	Goldman Sachs	575	(5.413)	VEREIT Inc (Reit)	Goldman Sachs	(758)
244	UDR Inc (Reit)	Morgan Stanley	192	(301)	VeriSign Inc	Goldman Sachs	(1.324)
5.272	UGI Corp	Goldman Sachs	5.956	(809)	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs	(1.010)
515	UGI Corp	Morgan Stanley	(395)	(487)	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	165
22	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Bank of America		448	VF Corp	Bank of America	
105	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Merrill Lynch	(26)			Merrill Lynch	816
(2.473)	Under Armour Inc 'A'	Goldman Sachs	(55)	634	VF Corp	Morgan Stanley	789
(13.575)	Under Armour Inc 'A'	Goldman Sachs	(5.827)	1.156	VF Corp	Goldman Sachs	3.190
(1.034)	Under Armour Inc 'A'	Morgan Stanley	(22.263)	2.000	Viacom Inc 'B'	Goldman Sachs	(1.338)
		Bank of America		197	Viacom Inc 'B'	Bank of America	
(26.313)	Under Armour Inc 'C'	Merrill Lynch	(2.688)			Merrill Lynch	(172)
(10.236)	Under Armour Inc 'C'	Bank of America	(55.784)	(11.945)	ViaSat Inc	Goldman Sachs	(14.213)
(248)	UniFirst Corp/MA	Merrill Lynch	(21.700)	(1.511)	Viavi Solutions Inc	Goldman Sachs	449
365	Union Bankshares Corp	Goldman Sachs	(1.005)	(189)	Virtu Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(76)
384	Unit Corp	Goldman Sachs	219	8.252	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	-
442	United Community Banks Inc/GA	Bank of America	(100)	8.079	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America	
2.653	United Community Banks Inc/GA	Merrill Lynch	(62)			Merrill Lynch	(1.616)
3.506	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs	(371)	4.292	Vishay Intertechnology Inc	Goldman Sachs	(858)
(1.263)	United Technologies Corp	Goldman Sachs	2.349	(476)	Visteon Corp	Goldman Sachs	1.130
61	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs	(799)	340	VMware Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(83)			Merrill Lynch	746
104	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs	410	2.335	VMware Inc 'A'	Goldman Sachs	(616)
(38.902)	Uniti Group Inc (Reit)	Bank of America		657	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	999
		Merrill Lynch	(32.678)	667	Voya Financial Inc	Goldman Sachs	(900)
(28.325)	Uniti Group Inc (Reit)	Goldman Sachs	(23.724)	1.643	Wabash National Corp	Goldman Sachs	(144)
(30.815)	Uniti Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	(21.879)	(599)	WABCO Holdings Inc	Goldman Sachs	3.846
400	Univar Inc	Bank of America		(1.384)	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(720)
		Merrill Lynch	151	(4.690)	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs	8.583
1.802	Univar Inc	Goldman Sachs	402	(316)	Walker & Dunlop Inc	Goldman Sachs	(651)
				769	Walmart Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	537
				2.240	Walmart Inc	Goldman Sachs	(1.560)
				3.047	Walmart Inc	Morgan Stanley	(2.910)
				(1.324)	Walt Disney Co/The	Goldman Sachs	4.142

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(994)	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs	(825)	(469)	WisdomTree Investments Inc	Bank of America	
1.108	Washington Federal Inc	Goldman Sachs	164			Merrill Lynch	314
(3.688)	Washington Prime Group Inc (Reit)	Goldman Sachs	(2.102)	(2.582)	WisdomTree Investments Inc	Goldman Sachs	1.513
(364)	Waters Corp	Goldman Sachs	(1.350)	879	Wix.com Ltd	Bank of America	
104	Watts Water Technologies Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	4.131
140	Watts Water Technologies Inc 'A'	Merrill Lynch	52	1.588	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	7.464
(1.486)	Wayfair Inc 'A'	Goldman Sachs	(44)	1.278	Wix.com Ltd	Morgan Stanley	(1.534)
(3.561)	Wayfair Inc 'A'	Morgan Stanley	(37.284)	696	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs	1.253
(178)	WD-40 Co	Goldman Sachs	(997)	537	Wolverine World Wide Inc	Bank of America	
4.487	WEC Energy Group Inc	Goldman Sachs	8.602			Merrill Lynch	967
(58)	Weight Watchers International Inc	Bank of America		481	Wolverine World Wide Inc	Morgan Stanley	649
(222)	Weight Watchers International Inc	Merrill Lynch	211	(216)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Goldman Sachs	(76)
6.303	Weingarten Realty Investors (Reit)	Goldman Sachs	1.081	(966)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Morgan Stanley	(719)
1.394	WellCare Health Plans Inc	Bank of America		(71)	WP Carey Inc (Reit)	Goldman Sachs	24
2.349	WellCare Health Plans Inc	Merrill Lynch	11.933	(3.938)	WPX Energy Inc	Bank of America	
1.766	WellCare Health Plans Inc	Goldman Sachs	20.107			Merrill Lynch	(1.063)
(382)	Welltower Inc (Reit)	Morgan Stanley	10.949	(5.959)	WPX Energy Inc	Goldman Sachs	(2.068)
(1.460)	Welltower Inc (Reit)	Bank of America		(567)	WR Grace & Co	Goldman Sachs	(42)
6.176	Werner Enterprises Inc	Merrill Lynch	(966)	159	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	(658)
(1.059)	Wester Energy Inc	Goldman Sachs	(3.594)	348	WW Grainger Inc	Bank of America	
(121)	Western Alliance Bancorp	Goldman Sachs	94			Merrill Lynch	1.134
(1.484)	Western Union Co/The	Goldman Sachs	178	748	WW Grainger Inc	Goldman Sachs	2.324
28.768	Western Union Co/The	Bank of America		(2.244)	Wyndham Worldwide Corp	Goldman Sachs	2.885
18.105	Western Union Co/The	Merrill Lynch	(3.134)	(120)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs	(462)
10.903	Western Union Co/The	Goldman Sachs	(2.758)	(819)	Xenia Hotels & Resorts Inc (Reit)	Goldman Sachs	(1.867)
3	Westlake Chemical Corp	Morgan Stanley	(2.265)	1.650	Xilinx Inc	Goldman Sachs	(4.323)
375	Westlake Chemical Corp	Bank of America		607	Xperi Corp	Goldman Sachs	(812)
332	WEX Inc	Merrill Lynch	(394)	411	XPO Logistics Inc	Goldman Sachs	950
(4.778)	Weyerhaeuser Co (Reit)	Goldman Sachs	(825)	3.186	Yelp Inc	Morgan Stanley	(2.142)
1.337	Whiting Petroleum Corp	Goldman Sachs	(6.211)	1.598	Yelp Inc	Bank of America	
90	Whiting Petroleum Corp	Merrill Lynch	137			Merrill Lynch	(279)
(478)	WildHorse Resource Development Corp	Goldman Sachs	(231)	2.332	Yelp Inc	Goldman Sachs	(1.419)
143	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	1.055	(307)	Yum China Holdings Inc	Goldman Sachs	(282)
461	Williams-Sonoma Inc	Bank of America		244	Zendesk Inc	Bank of America	
(225)	Willis Towers Watson Plc	Merrill Lynch	3.697			Merrill Lynch	451
(2.175)	Willis Towers Watson Plc	Bank of America		1.034	Zendesk Inc	Morgan Stanley	1.685
130	Wingstop Inc	Merrill Lynch	374	(9.513)	Zillow Group Inc 'C'	Goldman Sachs	(55.402)
		Goldman Sachs	2.882	(9.784)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldman Sachs	15.779
		Goldman Sachs	(170)	(988)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	1.110
				(8.144)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Morgan Stanley	11.646
				(1.511)	Zions Bancorporation	Goldman Sachs	1.609
				6.760	Zoetis Inc	Goldman Sachs	9.261
				8.842	Zoetis Inc	Morgan Stanley	12.732
				(572)	Zogenix Inc	Goldman Sachs	(1.620)
							285.768
				Total (exposition brute sous-jacente – 309.277.348 USD)			1.086.020

BlackRock Global Long/Short Equity Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
33	EUR	Amsterdam Index	Juin 2018	4.272.172	(47.101)
20	EUR	CAC 40 Index	Juin 2018	1.256.730	(21.418)
(3)	EUR	DAX Index	Juin 2018	1.106.703	16.789
(62)	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	8.422.700	(53.533)
(51)	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	5.210.667	(94.595)
43	EUR	FTSE MIB Index	Juin 2018	5.443.520	(366.556)
9	HKD	Hang Seng Index	Juin 2018	1.748.525	22.437
(23)	EUR	IBEX 35 Index	Juin 2018	2.538.348	186.124
(45)	SGD	MSCI Singapore Index	Juin 2018	1.315.328	4.499
(28)	SEK	OMX Stockholm 30 Index	Juin 2018	493.070	18.318
(19)	CAD	S&P/TSX 60 Index	Juin 2018	2.777.397	(13.031)
(5)	AUD	SPI 200 Index	Juin 2018	569.640	(505)
62	CHF	Swiss Market Index	Juin 2018	5.372.872	(95.754)
(5)	JPY	Topix Index	Juin 2018	803.954	(3.871)
Total				41.331.626	(448.197)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	94.601.339	USD	112.441.440	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(2.149.450)
USD	5.166.655	EUR	4.344.457	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	101.623
						(2.047.827)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	351.523	USD	477.095	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(9.634)
USD	68.948	GBP	51.161	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	914
						(8.720)
Catégorie d'Actions couverte en couronnes suédoises						
SEK	649.996	USD	74.513	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(773)
USD	795	SEK	6.804	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	23
						(750)
Total (exposition brute sous-jacente – 115.967.029 USD)						(2.057.297)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	82,05
Portefeuille de titres à la valeur de marché	82,05
Autres éléments de l'actif net	17,95
	100,00

BlackRock Global Real Asset Securities Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie				Japon suite			
48.926	Atlas Arteria Ltd (Unit)	246.459	4,82	170	Invincible Investment Corp	78.345	1,53
63.241	New South Resources Ltd	75.929	1,49	98	Japan Rental Housing Investments Inc (Reit)	78.945	1,55
22.766	Scentre Group (Reit)	72.085	1,41	6	Kenedix Office Investment Corp (Reit)	37.329	0,73
26.856	Spark Infrastructure Group (Unit)	44.756	0,88	2.400	Kyushu Railway Co	76.649	1,50
13.557	Sydney Airport (Unit)	74.761	1,46			435.603	8,52
26.114	Transurban Group (Unit)	234.805	4,59				
		748.795	14,65				
Autriche				Jersey			
1.373	EVN AG	27.068	0,53	19.037	Target Healthcare Ltd (Reit)	28.027	0,55
		27.068	0,53			28.027	0,55
Belgique				Luxembourg			
634	Elia System Operator SA/NV	39.225	0,77	7.956	Aroundtown SA	65.956	1,29
		39.225	0,77			65.956	1,29
Bermudes				Nouvelle-Zélande			
14.000	CK Infrastructure Holdings Ltd	105.597	2,07	10.154	Auckland International Airport Ltd	46.972	0,92
		105.597	2,07			46.972	0,92
Canada				Norvège			
1.412	Enbridge Inc	43.807	0,86	7.425	Entra ASA	104.819	2,05
5.979	First Capital Realty Inc	97.758	1,91			104.819	2,05
1.491	Pembina Pipeline Corp	51.622	1,01	Singapour			
1.112	TransCanada Corp	46.355	0,91	65.975	Fraser Logistics & Industrial Trust (Reit)	52.213	1,02
		239.542	4,69	131.400	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	36.135	0,71
Îles Caïmans				114.800	Keppel Infrastructure Trust (Unit)	43.712	0,85
6.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	46.288	0,91			132.060	2,58
		46.288	0,91	Espagne			
France				4.930	Ferrovial SA	100.523	1,97
575	Unibail-Rodamco SE (Reit)	127.929	2,50			100.523	1,97
950	Vinci SA	93.045	1,82	Royaume-Uni			
		220.974	4,32	47.304	Assura Plc (Reit)	35.654	0,70
Allemagne				68.746	Capital & Regional Plc	48.973	0,96
7.953	E.ON SE	83.991	1,64	10.426	Hammerson Plc (Reit)	76.697	1,50
675	LEG Immobilien AG	73.677	1,44	34.245	PRS Plc/The (Reit)	45.699	0,90
3.658	Vonovia SE	172.914	3,39	14.314	Secure Income Plc (Reit)	74.208	1,45
		330.582	6,47	27.948	Tritax Big Box Plc (Reit)	55.764	1,09
Hong Kong						336.995	6,60
8.500	Link (Reit)	75.159	1,47	Etats-Unis			
5.500	Power Assets Holdings Ltd	38.226	0,75	687	AvalonBay Communities Inc (Reit)	113.121	2,21
		113.385	2,22	892	Boston Properties Inc (Reit)	108.503	2,12
Italie				2.523	CMS Energy Corp	116.134	2,27
20.031	A2A SpA	33.538	0,66	1.905	Community Healthcare Trust Inc (Reit)	53.569	1,05
2.562	Atlantia SpA	74.538	1,46	444	Crown Castle International Corp (Reit)	46.034	0,90
15.817	Snam SpA	65.295	1,28	1.474	EPR Properties (Reit)	90.430	1,77
17.133	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	90.750	1,77	546	Extra Space Storage Inc (Reit)	52.684	1,03
		264.121	5,17	3.047	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	66.211	1,30
Japon				2.600	Macquarie Infrastructure Corp	100.698	1,97
27	Canadian Solar Infrastructure Fund Inc (Unit)	26.205	0,51	567	ONEOK Inc	38.601	0,76
54	GLP J (Reit)	60.523	1,18	4.708	Plains GP Holdings LP 'A'	114.969	2,25
100	Ichigo Office Investment (Reit)	77.607	1,52	2.405	PPL Corp	65.368	1,28
				1.558	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	58.783	1,15
				525	Simon Property Group Inc (Reit)	84.383	1,65
				9.472	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	82.738	1,62
				2.084	Targa Resources Corp	100.178	1,96

BlackRock Global Real Asset Securities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				DROITS			
600	WEC Energy Group Inc	37.884	0,74	3.330	Singapour		
1.370	Williams Cos Inc/The	37.209	0,73		Frasers Logistics & Industrial		
1.062	Xcel Energy Inc	48.279	0,95		Trust (Right)	231	0,01
		1.415.776	27,71			231	0,01
Total des actions ordinaires		4.802.308	93,99		Droits entiers	231	0,01
EXCHANGE TRADED FUNDS					Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	231	0,01
Guernesey					Portefeuille de titres à la valeur de marché	4.947.764	96,84
43.652	HICL Infrastructure Co Ltd/Fund	81.934	1,60		Autres éléments de l'actif net	161.470	3,16
		81.934	1,60		Total de l'actif net (USD)	5.109.234	100,00
Jersey							
20.977	3i Infrastructure Plc	63.291	1,24				
		63.291	1,24				
Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		145.225	2,84				
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		4.947.533	96,83				

BlackRock Global Real Asset Securities Fund suite

Options vendues au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
(600)	Call	Community Healthcare Trust (Reit)	Barclays Bank	USD 28,11	12/7/2018	(81)	(550)
(5.000)	Call	Secure Income Plc (Reit)	Citibank	GBP 3,96	12/6/2018	254	(39)
(2)	Call	ONEOK Inc	Credit Suisse	USD 60,50	1/6/2018	(1.280)	(1.480)
(4)	Call	Williams Cos Inc/The	Credit Suisse	USD 26,00	1/6/2018	(205)	(466)
(9)	Call	CMS Energy Corp	Credit Suisse	USD 46,51	12/6/2018	516	(105)
(2)	Call	Crown Castle International Corp (Reit)	Credit Suisse	USD 105,00	15/6/2018	101	(145)
(2)	Call	Extra Space Storage Inc (Reit)	Credit Suisse	USD 95,00	15/6/2018	(7)	(505)
(8)	Call	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Credit Suisse	USD 20,00	15/6/2018	(1.180)	(1.500)
(16)	Call	Plains GP Holdings LP	Credit Suisse	USD 25,00	15/6/2018	1.168	(480)
(8)	Call	PPL Corp	Credit Suisse	USD 27,00	15/6/2018	(16)	(320)
(2)	Call	Simon Property Group Inc (Reit)	Credit Suisse	USD 155,00	15/6/2018	(817)	(1.305)
(2)	Call	Targa Resources Corp	Credit Suisse	USD 50,00	15/6/2018	45	(75)
(3)	Call	Xcel Energy Inc	Credit Suisse	USD 45,00	15/6/2018	(150)	(210)
(1)	Call	ONEOK Inc	Credit Suisse	USD 67,50	22/6/2018	(58)	(170)
(2)	Call	AvalonBay Communities Inc (Reit)	Credit Suisse	USD 165,00	20/7/2018	(308)	(640)
(1)	Call	Boston Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	USD 120,00	20/7/2018	(202)	(390)
(5)	Call	EPR Properties (Reit)	Credit Suisse	USD 56,25	20/7/2018	(2.114)	(2.639)
(20)	Call	First Capital Realty Inc	Credit Suisse	CAD 21,00	20/7/2018	(230)	(618)
(9)	Call	Macquarie Infrastructure Corp	Credit Suisse	USD 37,50	20/7/2018	(877)	(1.822)
(5)	Call	Pembina Pipeline Corp	Credit Suisse	CAD 44,00	20/7/2018	(191)	(554)
(2)	Call	Targa Resources Corp	Credit Suisse	USD 50,00	20/7/2018	45	(215)
(3)	Call	TransCanada Corp	Credit Suisse	CAD 56,00	20/7/2018	125	(103)
(2)	Call	WEC Energy Group Inc	Credit Suisse	USD 61,90	20/7/2018	(232)	(420)
(330)	Call	Vinci SA	Goldman Sachs	EUR 83,81	31/5/2018	655	(104)
(2.600)	Call	Entra ASA	Goldman Sachs	NOK 114,04	6/6/2018	(466)	(786)
(9.300)	Call	Spark Infrastructure Group (Unit)	Goldman Sachs	AUD 2,29	6/6/2018	277	(27)
(5.900)	Call	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Goldman Sachs	EUR 4,99	6/6/2018	551	-
(1.100)	Call	Vonovia SE	Goldman Sachs	EUR 40,36	7/6/2018	(154)	(596)
(37)	Call	Ichigo Office Investment (Reit)	Goldman Sachs	JPY 82.315,00	13/6/2018	(582)	(834)
(3.700)	Call	Hammerson Plc (Reit)	Goldman Sachs	GBP 5,57	19/6/2018	250	(611)
(2.800)	Call	E.ON SE	Goldman Sachs	EUR 9,18	26/6/2018	(7)	(435)
(220)	Call	Elia System Operator SA/NV	Goldman Sachs	EUR 53,11	26/6/2018	(144)	(255)
(520)	Call	EVN AG	Goldman Sachs	EUR 17,18	26/6/2018	46	(239)
(5.500)	Call	Snam SpA	Goldman Sachs	EUR 4,04	26/6/2018	184	(1)
(7.000)	Call	A2A SpA	Goldman Sachs	EUR 1,52	11/7/2018	293	(31)
(16.600)	Call	Assura Group Ltd	Goldman Sachs	GBP 0,57	11/7/2018	(66)	(295)
(25)	Call	GLP J (Reit)	Goldman Sachs	JPY 123.220,00	11/7/2018	69	(330)
(47)	Call	Japan Rental Housing Investments Inc (Reit)	Goldman Sachs	JPY 86.832,00	11/7/2018	(326)	(914)
(2)	Call	Kenedix Office Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	JPY 686.415,00	11/7/2018	119	(161)
(40.200)	Call	Keppel Infrastructure Trust (Unit)	Goldman Sachs	SGD 0,54	11/7/2018	175	(88)
(800)	Call	Kyushu Railway Co	Goldman Sachs	JPY 3.502,43	11/7/2018	142	(497)
(2.000)	Call	Power Assets Holdings Ltd	Goldman Sachs	HKD 56,50	11/7/2018	27	(89)
(8.000)	Call	Scentre Group (Reit)	JP Morgan	AUD 3,99	6/6/2018	(813)	(1.167)
(11.500)	Call	3i Infrastructure Plc	JP Morgan	GBP 2,26	26/6/2018	13	(333)
(15.270)	Call	HICL Infrastructure Co Ltd/Fund	JP Morgan	GBP 1,47	26/6/2018	275	(84)
(3.000)	Call	Link (Reit)	JP Morgan	HKD 70,80	11/7/2018	142	(233)
(72.300)	Call	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	Morgan Stanley	USD 0,35	6/6/2018	362	-
(9.200)	Call	Transurban Group (Unit)	Morgan Stanley	AUD 11,60	6/6/2018	(966)	(2.207)
(9.700)	Call	Tritax Big Box Plc (Reit)	Morgan Stanley	GBP 1,49	12/6/2018	(82)	(309)
(4.000)	Call	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Morgan Stanley	HKD 55,91	12/6/2018	(1.772)	(2.384)
(3.400)	Call	Aroundtown SA	Morgan Stanley	EUR 6,75	13/6/2018	(1.187)	(1.546)
(6.400)	Call	Sydney Airport	Morgan Stanley	AUD 7,12	21/6/2018	(320)	(980)
(1.800)	Call	Ferrovial SA	Morgan Stanley	EUR 18,26	26/6/2018	155	(237)
(6.624)	Call	Target Healthcare Ltd (Reit)	Morgan Stanley	GBP 1,11	26/6/2018	(23)	(216)
(24.000)	Call	Capital & Regional Plc (Reit)	Morgan Stanley	GBP 0,55	10/7/2018	87	(363)
(3.600)	Call	Auckland International Airport Ltd	Morgan Stanley	NZD 6,58	11/7/2018	(195)	(480)
(5.000)	Call	CK Infrastructure Holdings Ltd	Morgan Stanley	HKD 59,57	11/7/2018	(261)	(658)
(61)	Call	Invincible Investment Corp (Reit)	Morgan Stanley	JPY 50.904,00	11/7/2018	(277)	(365)
Total (exposition brute sous-jacente – 736.324 USD)						(9.513)	(32.606)

BlackRock Global Real Asset Securities Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
AUD	99.000	USD	74.729	Bank of America	13/7/2018	281
AUD	50.000	USD	37.736	Merrill Lynch	13/7/2018	148
AUD	101.000	USD	76.048	Barclays Bank	13/7/2018	
				Royal Bank	13/7/2018	478
				of Scotland	13/7/2018	
CAD	3.000	USD	2.335	Bank of America	13/7/2018	(16)
				Merrill Lynch	13/7/2018	(45)
CAD	3.000	USD	2.363	Goldman Sachs	13/7/2018	(86)
CAD	8.000	USD	6.268	Morgan Stanley	13/7/2018	
CHF	83.000	USD	86.588	Bank of America	13/7/2018	(2.091)
				Merrill Lynch	13/7/2018	(72)
DKK	39.000	USD	6.196	Barclays Bank	13/7/2018	
DKK	114.000	USD	19.022	Royal Bank	13/7/2018	(1.122)
				of Scotland	13/7/2018	
EUR	13.000	USD	15.737	Bank of America	13/7/2018	(545)
				Merrill Lynch	13/7/2018	(137)
EUR	4.000	USD	4.812	Barclays Bank	13/7/2018	(150)
EUR	4.000	USD	4.824	Morgan Stanley	13/7/2018	
EUR	58.000	USD	72.064	Royal Bank	13/7/2018	(4.281)
				of Scotland	13/7/2018	
GBP	2.000	USD	2.693	Bank of America	13/7/2018	(29)
				Merrill Lynch	13/7/2018	(1.269)
GBP	32.000	USD	43.890	Morgan Stanley	13/7/2018	(4)
HKD	35.000	USD	4.468	Barclays Bank	13/7/2018	(2)
HKD	17.000	USD	2.170	Citibank	13/7/2018	(3)
HKD	118.000	USD	15.053	Morgan Stanley	13/7/2018	
HKD	1.517.000	USD	193.588	Royal Bank	13/7/2018	(111)
				of Scotland	13/7/2018	
ILS	17.000	USD	4.855	Bank of America	13/7/2018	(80)
				Merrill Lynch	13/7/2018	
JPY	7.734.000	USD	69.904	Bank of America	13/7/2018	1.574
				Merrill Lynch	13/7/2018	(2.384)
JPY	16.333.000	USD	153.333	Morgan Stanley	13/7/2018	
JPY	3.587.000	USD	32.972	Royal Bank	13/7/2018	179
				of Scotland	13/7/2018	
KRW	22.231.000	USD	20.831	Bank of America	13/7/2018	(180)
				Merrill Lynch	13/7/2018	(19)
KRW	7.189.000	USD	6.697	Goldman Sachs	13/7/2018	(460)
MYR	117.000	USD	29.827	Barclays Bank	13/7/2018	(29)
NOK	16.000	USD	1.986	Goldman Sachs	13/7/2018	
NZD	5.000	USD	3.669	Bank of America	13/7/2018	(164)
				Merrill Lynch	13/7/2018	
NZD	1.000	USD	706	Royal Bank	13/7/2018	(5)
				of Scotland	13/7/2018	
SEK	507.000	USD	60.646	Bank of America	13/7/2018	(2.987)
				Merrill Lynch	13/7/2018	

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
SEK	51.000	USD	5.905	Goldman Sachs	13/7/2018	(105)
SGD	1.000	USD	748	Barclays Bank	13/7/2018	0
SGD	106.000	USD	81.060	Royal Bank	13/7/2018	(1.863)
				of Scotland	13/7/2018	
USD	170.276	AUD	222.000	Bank of America	13/7/2018	2.071
				Merrill Lynch	13/7/2018	972
USD	38.856	AUD	50.000	Barclays Bank	13/7/2018	(848)
USD	101.439	AUD	135.000	Goldman Sachs	13/7/2018	
USD	25.515	AUD	34.000	Royal Bank	13/7/2018	(246)
				of Scotland	13/7/2018	
USD	1.557	CAD	2.000	Bank of America	13/7/2018	11
				Merrill Lynch	13/7/2018	53
USD	3.917	CAD	5.000	Barclays Bank	13/7/2018	0
USD	2.319	CAD	3.000	Goldman Sachs	13/7/2018	670
USD	21.536	CAD	27.000	Morgan Stanley	13/7/2018	
USD	59.820	CAD	75.000	Royal Bank	13/7/2018	1.859
				of Scotland	13/7/2018	274
USD	27.153	EUR	23.000	Barclays Bank	13/7/2018	2.223
USD	39.620	EUR	32.000	Goldman Sachs	13/7/2018	573
USD	47.319	EUR	40.000	Morgan Stanley	13/7/2018	
USD	8.339	EUR	7.000	Royal Bank	13/7/2018	158
				of Scotland	13/7/2018	2.132
USD	48.749	GBP	35.000	Barclays Bank	13/7/2018	72
USD	6.732	GBP	5.000	Goldman Sachs	13/7/2018	
USD	139.171	GBP	97.000	Royal Bank	13/7/2018	9.976
				of Scotland	13/7/2018	2
USD	10.333	HKD	81.000	Goldman Sachs	13/7/2018	
USD	20.675	HKD	162.000	Royal Bank	13/7/2018	14
				of Scotland	13/7/2018	
USD	368	JPY	40.000	Bank of America	13/7/2018	(2)
				Merrill Lynch	13/7/2018	2.553
USD	163.992	JPY	17.468.000	Goldman Sachs	13/7/2018	
USD	836	JPY	89.000	Royal Bank	13/7/2018	13
				of Scotland	13/7/2018	679
USD	30.046	MYR	117.000	Morgan Stanley	13/7/2018	5.184
USD	99.240	NOK	769.000	Goldman Sachs	13/7/2018	
USD	1.159	NOK	9.000	Royal Bank	13/7/2018	58
				of Scotland	13/7/2018	
USD	734	NZD	1.000	Royal Bank	13/7/2018	33
				of Scotland	13/7/2018	
USD	27.611	SGD	37.000	Bank of America	13/7/2018	(33)
				Merrill Lynch	13/7/2018	(59)
USD	26.838	SGD	36.000	Morgan Stanley	13/7/2018	
USD	45.119	SGD	59.000	Royal Bank	13/7/2018	1.037
				of Scotland	13/7/2018	
Total (exposition brute sous-jacente – 2.267.984 USD)						13.850

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	45,86
Services aux collectivités	14,37
Biens de consommation non cyclique	13,55
Valeurs industrielles	9,74
Énergie	8,99
Exchange Traded Funds	2,84
Matériaux de base	1,49
Portefeuille de titres à la valeur de marché	96,84
Autres éléments de l'actif net	3,16
	100,00

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Impact World Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Australie				Îles Caïmans			
3.647	Aristocrat Leisure Ltd	82.989	0,04	901	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	29.156	0,02
13.827	ASX Ltd	635.036	0,33	283.500	WH Group Ltd '144A'	290.771	0,15
96.349	Beach Energy Ltd	119.694	0,06			319.927	0,17
19.516	Caltex Australia Ltd	434.927	0,23	Curaçao			
897	CIMIC Group Ltd	28.008	0,01	14.401	Schlumberger Ltd	988.485	0,52
835	CSL Ltd	117.553	0,06			988.485	0,52
1.286	Flight Centre Travel Group Ltd	60.027	0,03	Danemark			
62.141	Orora Ltd	161.927	0,09	4.364	Danske Bank A/S	144.545	0,08
14.440	OZ Minerals Ltd	107.633	0,06	19.816	Novo Nordisk A/S 'B'	940.628	0,49
158.051	Qantas Airways Ltd	760.245	0,40			1.085.173	0,57
54.546	Santos Ltd	242.127	0,13	Finlande			
23.492	Sims Metal Management Ltd	283.833	0,15	3.359	Sampo OYJ 'A'	165.199	0,09
37.472	Telstra Corp Ltd	79.478	0,04			165.199	0,09
5.171	Westpac Banking Corp	109.089	0,06	France			
2.407	Woodside Petroleum Ltd	59.093	0,03	3.653	Arkema SA	445.208	0,23
		3.281.659	1,72	890	Atos SE	120.342	0,06
Autriche				14.494	AXA SA	360.721	0,19
3.644	Erste Group Bank AG	151.490	0,08	8.303	Cie de Saint-Gobain	416.718	0,22
3.432	OMV AG	196.741	0,10	3.772	CNP Assurances	87.547	0,05
		348.231	0,18	2.484	Danone SA	190.990	0,10
Belgique				3.217	Faurecia SA	274.824	0,14
1.668	KBC Group NV	128.152	0,07	418	Hermes International	298.843	0,16
		128.152	0,07	2.544	Ipsen SA	405.050	0,21
Bermudes				1.206	Kering SA	688.393	0,36
2.791	Bunge Ltd	194.365	0,10	3.647	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.272.665	0,66
4.100	Dairy Farm International Holdings Ltd	35.137	0,02	14.188	Natixis SA	102.692	0,05
6.600	Hongkong Land Holdings Ltd	47.916	0,03	11.915	Peugeot SA	279.043	0,15
15.530	Invesco Ltd	424.590	0,22	1.657	Rubis SCA	115.936	0,06
15.500	Kerry Properties Ltd	82.845	0,04	5.747	Sanofi	440.537	0,23
		784.853	0,41	376	Thales SA	47.753	0,02
Îles Vierges britanniques				8.086	Total SA	488.971	0,26
1.638	Nomad Foods Ltd	28.731	0,02	318	Unibail-Rodamco SE (Reit)	70.750	0,04
		28.731	0,02			6.106.983	3,19
Canada				Allemagne			
16.483	B2Gold Corp*	45.553	0,02	705	adidas AG	160.138	0,08
17.978	Bank of Nova Scotia/The	1.078.347	0,56	1.818	Aurubis AG	148.446	0,08
9.172	BCE Inc	382.698	0,20	14.506	BASF SE	1.432.246	0,75
3.933	Brookfield Asset Management Inc 'A'	156.573	0,08	3.972	Bayer AG Reg	471.590	0,25
1.757	Canfor Corp	44.271	0,02	5.502	Bayerische Motoren Werke AG	548.624	0,29
366	Dollarama Inc	42.042	0,02	255	Continental AG	64.979	0,03
2.377	Franco-Nevada Corp	167.403	0,09	11.804	Daimler AG Reg	853.125	0,45
20.661	Lundin Mining Corp	128.712	0,07	1.042	Delivery Hero AG	47.665	0,03
3.200	Magna International Inc	204.984	0,11	12.590	Deutsche Telekom AG Reg	195.321	0,10
29.134	Manulife Financial Corp	546.066	0,29	34.455	E.ON SE	363.876	0,19
4.497	Quebecor Inc 'B'	86.961	0,05	1.365	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	137.127	0,07
7.280	Rogers Communications Inc 'B'	340.677	0,18	2.549	Hochtief AG	457.969	0,24
19.908	Royal Bank of Canada	1.486.415	0,78	162	Puma SE	96.076	0,05
2.864	Seven Generations Energy Ltd 'A'	37.408	0,02	13.649	SAP SE	1.536.401	0,80
256	Shopify Inc 'A'	37.746	0,02	256	Sartorius AG (Pref)	38.537	0,02
12.489	Sun Life Financial Inc	515.410	0,27	13.043	Suedzucker AG	234.794	0,12
4.635	TFI International Inc	140.474	0,07	27.132	Vonovia SE	1.282.533	0,67
20.805	Toronto-Dominion Bank/The	1.214.187	0,63			8.069.447	4,22
5.898	Wheaton Precious Metals Corp	129.033	0,07	Hong Kong			
602	WSP Global Inc	31.192	0,02	48.800	AIA Group Ltd	447.666	0,23
		6.816.152	3,57	74.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	374.460	0,20

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

BlackRock Impact World Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Hong Kong suite				Japon suite			
15.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	131.965	0,07	7.000	Pola Orbis Holdings Inc	347.758	0,18
45.000	Hang Lung Properties Ltd	102.055	0,05	900	Recruit Holdings Co Ltd	25.135	0,01
123.000	New World Development Co Ltd	188.683	0,10	186.000	Resona Holdings Inc	1.040.448	0,54
35.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	564.552	0,30	10.700	Seven & i Holdings Co Ltd	475.457	0,25
9.000	Wharf Holdings Ltd/The	29.069	0,01	1.900	SG Holdings Co Ltd	43.220	0,02
		1.838.450	0,96	1.700	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	170.635	0,09
Irlande				2.300	Sony Corp	109.388	0,06
10.412	Accenture Plc 'A'	1.628.124	0,85	33.800	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	1.402.842	0,73
218	CRH Plc	8.085	0,00	7.900	Suruga Bank Ltd	91.455	0,05
8.458	Eaton Corp Plc	655.918	0,34	6.700	Suzuki Motor Corp	386.703	0,20
11.989	Ingersoll-Rand Plc	1.060.667	0,56	28.200	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	1.157.163	0,61
4.004	Medtronic Plc	345.045	0,18	12.900	Toho Gas Co Ltd	408.420	0,21
1.352	Smurfit Kappa Group Plc	55.229	0,03	300	Tokyo Century Corp	18.111	0,01
		3.753.068	1,96	2.100	Tokyo Electron Ltd	394.857	0,21
Île de Man				12.900	Tokyo Gas Co Ltd	352.537	0,19
40.600	Genting Singapore Plc	38.193	0,02	5.100	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	85.881	0,05
		38.193	0,02	17.800	Toyota Motor Corp	1.135.479	0,59
Israël				3.800	West Japan Railway Co	274.173	0,14
1.441	Wix.com Ltd	125.007	0,07	28.300	Yahoo Japan Corp	103.293	0,05
		125.007	0,07	23.100	Zeon Corp	294.246	0,15
Italie						17.508.416	9,16
6.158	Atlantia SpA	179.159	0,09	Jersey			
15.146	Hera SpA	46.660	0,02	7.305	Ferguson Plc	570.202	0,30
30.730	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA*	286.655	0,15	127.189	Glencore Plc	632.922	0,33
9.173	Moncler SpA	419.287	0,22	15.353	WPP Plc	252.354	0,13
5.575	Pirelli & Call SpA'144A'	47.575	0,03			1.455.478	0,76
		979.336	0,51	Liberia			
Japon				3.669	Royal Caribbean Cruises Ltd	387.006	0,20
23.200	Amada Holdings Co Ltd	253.180	0,13			387.006	0,20
41.700	Astellas Pharma Inc	639.750	0,34	Pays-Bas			
3.000	Credit Saison Co Ltd	49.965	0,03	13.970	Aalberts Industries NV	686.081	0,36
800	CyberAgent Inc	41.956	0,02	2.370	BE Semiconductor Industries NV	79.308	0,04
6.400	Dai-ichi Life Holdings Inc	119.777	0,06	3.486	Ferrari NV	452.881	0,24
1.600	Daito Trust Construction Co Ltd	262.058	0,14	50.463	ING Groep NV	734.021	0,38
7.300	East Japan Railway Co	723.642	0,38	11.900	Koninklijke DSM NV	1.193.246	0,62
5.000	Fujitsu Ltd	30.725	0,02	12.253	Unilever NV - CVA	687.488	0,36
2.400	HIS Co Ltd	83.174	0,04			3.833.025	2,00
53.000	Hitachi Ltd	389.140	0,20	Nouvelle-Zélande			
7.200	Hokuhoku Financial Group Inc	102.530	0,05	1.772	a2 Milk Co Ltd	13.501	0,01
18.700	Honda Motor Co Ltd	594.119	0,31	11.549	Fletcher Building Ltd	53.344	0,03
12.000	Inpex Corp	134.273	0,07			66.845	0,04
7.700	Japan Post Holdings Co Ltd	88.501	0,05	Norvège			
6.200	Japan Tobacco Inc	167.779	0,09	1.370	Aker BP ASA	50.057	0,02
195.750	JXTG Holdings Inc	1.268.194	0,66	46.805	Orkla ASA*	423.544	0,22
2.700	KDDI Corp	73.302	0,04	40.802	Statoil ASA	1.068.302	0,56
5.200	Kirin Holdings Co Ltd	148.339	0,08	18.460	Telenor ASA	376.475	0,20
200	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	17.715	0,01			1.918.378	1,00
3.000	Komatsu Ltd	99.184	0,05	Panama			
4.000	Konami Holdings Corp	188.396	0,10	3.116	Carnival Corp	196.183	0,10
700	Kose Corp	152.717	0,08			196.183	0,10
700	Miraca Holdings Inc	22.840	0,01	Portugal			
4.000	Mitsubishi Corp	111.747	0,06	27.261	Galp Energia SGPS SA	505.352	0,26
42.600	Mitsubishi Estate Co Ltd	775.866	0,41			505.352	0,26
2.500	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	64.081	0,03	Singapour			
55.100	Mitsui & Co Ltd	973.563	0,51	8.500	DBS Group Holdings Ltd	180.040	0,10
1.400	Nippon Shokubai Co Ltd	108.263	0,06	1.000	Jardine Cycle & Carriage Ltd	25.653	0,01
11.100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	522.389	0,27				
100	Nitto Denko Corp	7.889	0,00				
22.500	NTT DOCOMO Inc	584.405	0,31				
17.900	Osaka Gas Co Ltd*	391.756	0,21				

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Impact World Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Singapour suite				Royaume-Uni suite			
20.400	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	190.993	0,10	6.383	Rio Tinto Plc	360.864	0,19
9.400	United Overseas Bank Ltd	197.488	0,10	10.692	Royal Dutch Shell Plc 'A'	371.809	0,19
6.200	Venture Corp Ltd	97.671	0,05	7.988	Royal Dutch Shell Plc 'B'	285.424	0,15
		691.845	0,36	25.197	Royal Mail Plc	171.692	0,09
Espagne				6.239	SSP Group Plc	54.115	0,03
2.492	Acciona SA	189.544	0,10	58.067	Standard Life Aberdeen Plc	271.472	0,14
2.770	Aena SME SA '144A'	529.465	0,28	38.461	Taylor Wimpey Plc	97.472	0,05
9.210	Amadeus IT Group SA	729.066	0,38	10.087	TechnipFMC Plc	315.521	0,17
176.423	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1.202.521	0,63	8.279	Unilever Plc	460.240	0,24
33.032	Mediaset Espana Comunicacion SA	296.967	0,15	178.678	Vodafone Group Plc	456.839	0,24
7.804	Melia Hotels International SA	106.750	0,06			10.080.319	5,27
5.928	NH Hotel Group SA	43.929	0,02	Etats-Unis			
		3.098.242	1,62	3.431	3M Co	679.475	0,36
Suède				2.684	Abbott Laboratories	166.569	0,09
6.868	Atlas Copco AB 'A'	275.329	0,15	8.854	AbbVie Inc	893.103	0,47
6.976	JM AB	132.237	0,07	170	ABIOMED Inc	65.962	0,03
3.676	Sandvik AB	64.097	0,03	6.141	Activision Blizzard Inc	439.143	0,23
44.557	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	404.731	0,21	1.186	Adobe Systems Inc	294.780	0,15
851	Swedish Match AB	40.502	0,02	1.642	Aetna Inc	290.831	0,15
67.047	Volvo AB 'B'	1.163.001	0,61	432	AGCO Corp	27.920	0,01
		2.079.897	1,09	18.379	Agilent Technologies Inc	1.151.996	0,60
Suisse				2.872	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	359.201	0,19
172	Barry Callebaut AG Reg	303.971	0,16	5.434	Allstate Corp/The	507.753	0,27
9.671	Coca-Cola HBC AG - DI	334.247	0,18	12.082	Ally Financial Inc	313.649	0,16
4.237	Nestle SA Reg	322.901	0,17	1.506	Alphabet Inc 'A'	1.648.934	0,86
5.849	OC Oerlikon Corp AG Reg	94.289	0,05	1.657	Alphabet Inc 'C'	1.795.691	0,94
8.113	Roche Holding AG	1.756.431	0,92	9.217	Altria Group Inc	514.769	0,27
162	Sika AG*	1.307.406	0,68	1.595	Amazon.com Inc	2.595.783	1,36
9.066	Swiss Re AG*	792.643	0,41	6.621	American Eagle Outfitters Inc	149.304	0,08
13.911	TE Connectivity Ltd	1.308.190	0,68	14.684	American Express Co	1.448.283	0,76
388	Temenos Group AG Reg	57.863	0,03	979	American Financial Group Inc/OH	108.091	0,06
		6.277.941	3,28	461	American Water Works Co Inc	38.779	0,02
Royaume-Uni				6.380	Ameriprise Financial Inc	884.140	0,46
11.404	Anglo American Plc	273.171	0,14	4.591	AmerisourceBergen Corp	382.706	0,20
2.234	Associated British Foods Plc	79.438	0,04	6.274	AMETEK Inc	467.162	0,24
12.158	AstraZeneca Plc	888.889	0,46	3.508	Amgen Inc	631.896	0,33
34.580	Auto Trader Group Plc '144A'	163.505	0,09	1.897	Anthem Inc	435.779	0,23
19.426	Aviva Plc	132.214	0,07	25.647	Apple Inc	4.808.043	2,51
18.579	BAE Systems Plc	159.543	0,08	24.893	Applied Materials Inc	1.281.367	0,67
76.275	BP Plc	582.195	0,30	10.083	AT&T Inc	325.530	0,17
1.415	British American Tobacco Plc	72.445	0,04	1.952	Automatic Data Processing Inc	254.736	0,13
2.525	Bunzl Plc	77.635	0,04	562	AutoNation Inc	25.880	0,01
772	Carnival Plc	49.803	0,03	10.610	Avery Dennison Corp	1.133.891	0,59
249.686	Centrica Plc	479.772	0,25	29.664	Bank of America Corp	858.031	0,45
13.399	Coca-Cola European Partners Plc	508.626	0,27	5.439	Baxter International Inc	392.152	0,20
11.829	Compass Group Plc	255.205	0,13	777	Bemis Co Inc	33.271	0,02
4.619	Croda International Plc	289.134	0,15	471	Berkshire Hathaway Inc 'B'	90.879	0,05
2.590	Diageo Plc	95.058	0,05	1.643	Best Buy Co Inc	112.841	0,06
2.612	Dialog Semiconductor Plc	57.489	0,03	343	Biogen Inc	102.464	0,05
4.090	Fevertree Drinks Plc	163.540	0,09	2.618	Boeing Co /The	928.709	0,49
45.248	GlaxoSmithKline Plc	919.906	0,48	12.922	BorgWarner Inc	632.273	0,33
57.914	Hays Plc	142.038	0,07	10.329	Bristol-Myers Squibb Co	547.334	0,29
5.338	Imperial Brands Plc	192.420	0,10	1.233	Brown-Forman Corp 'B'	70.182	0,04
1.402	Intertek Group Plc	103.173	0,05	2.318	Burlington Stores Inc	343.713	0,18
18.310	Investec Plc	135.279	0,07	17.066	Cadence Design Systems Inc	727.524	0,38
10.102	Johnson Matthey Plc*	468.658	0,25	14.369	Capital One Financial Corp	1.337.467	0,70
434.366	Lloyds Banking Group Plc	366.939	0,19	3.717	CDW Corp/DE	301.337	0,16
32.632	National Grid Plc	363.939	0,19	4.144	Celgene Corp	323.605	0,17
1.143	NMC Health Plc	54.212	0,03	14.821	CenterPoint Energy Inc	386.235	0,20
18.289	Pagegroup Plc	128.851	0,07	2.683	Charles Schwab Corp/The	149.202	0,08
841	Persimmon Plc	31.794	0,02	5.856	Chevron Corp	725.851	0,38
				2.909	Cigna Corp	501.337	0,26
				721	Cimarex Energy Co	67.904	0,04
				28.898	Cisco Systems Inc	1.242.614	0,65
				28.584	Citigroup Inc	1.886.544	0,99

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

BlackRock Impact World Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
4.158	CME Group Inc	684.365	0,36	2.675	Lululemon Athletica Inc	279.324	0,15
50.862	Comcast Corp 'A'	1.578.248	0,83	7.281	ManpowerGroup Inc	668.323	0,35
8.747	ConocoPhillips	590.160	0,31	11.174	Marathon Petroleum Corp	907.887	0,47
10.376	Consolidated Edison Inc	789.406	0,41	1.352	McCormick & Co Inc/MD 'non-voting share'	138.296	0,07
780	Constellation Brands Inc 'A'	173.823	0,09	2.099	McKesson Corp	299.548	0,16
1.338	Copart Inc	74.848	0,04	41.088	Microsoft Corp	4.084.969	2,14
6.550	Costco Wholesale Corp	1.302.336	0,68	14.743	Morgan Stanley	743.342	0,39
3.570	Cummins Inc	516.615	0,27	608	Nektar Therapeutics	50.500	0,03
293	CVS Health Corp	18.986	0,01	450	Netflix Inc	159.633	0,08
2.612	Dana Inc	58.430	0,03	3.422	Newfield Exploration Co	100.436	0,05
13.548	Danaher Corp	1.366.858	0,71	7.112	Newmont Mining Corp	277.724	0,15
7.085	Darden Restaurants Inc	626.456	0,33	8.023	Nordstrom Inc	392.646	0,21
2.837	DR Horton Inc	120.346	0,06	883	Northrop Grumman Corp	290.949	0,15
13.996	Duke Realty Corp (Reit)	394.687	0,21	2.589	NVIDIA Corp	657.101	0,34
525	Dun & Bradstreet Corp/The	65.042	0,03	259	Old Dominion Freight Line Inc	40.901	0,02
2.064	EastGroup Properties Inc (Reit)	192.778	0,10	2.448	ON Semiconductor Corp	63.012	0,03
9.516	Ecolab Inc	1.361.644	0,71	6.911	Oshkosh Corp	510.999	0,27
1.852	Electronic Arts Inc	243.890	0,13	5.585	Outfront Media Inc (Reit)	110.360	0,06
11.655	Eli Lilly & Co	983.565	0,51	3.173	Penske Automotive Group Inc	152.590	0,08
4.821	Equity Residential (Reit)	307.917	0,16	15.371	PepsiCo Inc	1.533.565	0,80
4.754	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	714.954	0,37	6.730	Philip Morris International Inc	533.487	0,28
661	Eversource Energy	37.723	0,02	8.109	Phillips 66	973.080	0,51
1.631	Exelixis Inc	34.463	0,02	4.584	Pinnacle West Capital Corp	363.924	0,19
1.711	Expeditors International of Washington Inc	129.181	0,07	3.815	Pioneer Natural Resources Co	748.465	0,39
550	Express Scripts Holding Co	41.836	0,02	1.635	Principal Financial Group Inc	91.037	0,05
7.046	Exxon Mobil Corp	568.965	0,30	4.093	Procter & Gamble Co/The	301.900	0,16
7.619	Facebook Inc 'A'	1.441.286	0,75	2.911	Progressive Corp/The	181.967	0,10
5.793	Fidelity National Information Services Inc	596.273	0,31	20.371	Prologis Inc (Reit)	1.314.948	0,69
8.635	First American Financial Corp	459.037	0,24	9.678	Prudential Financial Inc	935.959	0,49
3.047	Fortune Brands Home & Security Inc	173.892	0,09	4.293	PVH Corp	683.145	0,36
150	Franklin Resources Inc	5.018	0,00	1.448	Raytheon Co	306.628	0,16
10.032	General Electric Co	141.000	0,07	14.561	Realty Income Corp (Reit)	774.354	0,40
21.995	Gilead Sciences Inc	1.491.701	0,78	9.515	Reliance Steel & Aluminum Co	909.539	0,48
962	GoDaddy Inc 'A'	69.841	0,04	2.065	Robert Half International Inc	132.098	0,07
186	Goldman Sachs Group Inc /The	42.086	0,02	3.779	Rockwell Automation Inc	671.906	0,35
8.107	Graco Inc	373.571	0,20	985	Ross Stores Inc	78.268	0,04
15.968	H&R Block Inc	446.146	0,23	8.467	Ryder System Inc	580.582	0,30
7.168	Hartford Financial Services Group Inc/The	377.252	0,20	514	Skyworks Solutions Inc	50.994	0,03
315	Hill-Rom Holdings Inc	29.178	0,02	969	Sotheby's	53.547	0,03
2.807	Home Depot Inc/The	523.814	0,27	427	Stanley Black & Decker Inc	60.783	0,03
9.250	Honeywell International Inc	1.382.967	0,72	6.680	Stryker Corp	1.174.878	0,61
40.922	HP Inc	911.128	0,48	7.252	Synchrony Financial	251.209	0,13
3.929	Humana Inc	1.157.641	0,61	9.660	Synopsys Inc	853.751	0,45
60	IDACORP Inc	5.545	0,00	582	Synovus Financial Corp	31.509	0,02
6.329	Illinois Tool Works Inc	921.439	0,48	11.266	Target Corp	825.460	0,43
2.502	Insperty Inc	228.433	0,12	17.460	Taylor Morrison Home Corp 'A'	380.803	0,20
24.478	Intel Corp	1.361.711	0,71	6.286	Telephone & Data Systems Inc	160.607	0,08
9.853	International Business Machines Corp	1.400.998	0,73	597	Tenneco Inc	26.459	0,01
2.245	Intuit Inc	452.614	0,24	15.804	Texas Instruments Inc	1.779.056	0,93
167	Intuitive Surgical Inc	77.294	0,04	786	Thermo Fisher Scientific Inc	165.312	0,09
35.971	Jefferies Financial Group Inc	793.880	0,42	6.363	Tiffany & Co	836.353	0,44
547	JM Smucker Co/The	58.726	0,03	4.019	Time Warner Inc	375.455	0,20
12.035	Johnson & Johnson	1.456.235	0,76	2.756	Travelers Cos Inc/The	353.237	0,18
6.784	JPMorgan Chase & Co	725.956	0,38	105	Twilio Inc 'A'	5.725	0,00
3.260	Kellogg Co	210.172	0,11	3.176	UDR Inc (Reit)	115.448	0,06
1.081	Keysight Technologies Inc	64.795	0,03	5.916	UGI Corp	298.876	0,16
7.276	Kohl's Corp	491.276	0,26	272	Ultimate Software Group Inc/The	72.415	0,04
901	Lam Research Corp	181.795	0,10	6.681	UnitedHealth Group Inc	1.626.423	0,85
5.080	Landstar System Inc	580.898	0,30	11.189	Unum Group	425.294	0,22
1.667	Las Vegas Sands Corp	134.160	0,07	1.247	US Bancorp	61.564	0,03
2.580	Lear Corp	510.324	0,27	1.294	Valero Energy Corp	160.456	0,08
1.808	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	83.041	0,04	463	Veeva Systems Inc 'A'	35.883	0,02
1.055	Lincoln National Corp	70.063	0,04	11.361	Ventas Inc (Reit)	619.175	0,32
355	Lithia Motors Inc 'A'	34.275	0,02	11.893	Verizon Communications Inc	571.934	0,30
				90	Vertex Pharmaceuticals Inc	14.118	0,01
				3.921	VF Corp	320.189	0,17
				1.539	VMware Inc 'A'	213.921	0,11
				20.714	Walmart Inc	1.729.619	0,90

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Impact World Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite			
2.375	WellCare Health Plans Inc	532.950	0,28
14.296	Wells Fargo & Co	771.269	0,40
1.216	Western Digital Corp	104.199	0,05
499	Westlake Chemical Corp	58.857	0,03
490	WW Grainger Inc	149.014	0,08
8.006	Xilinx Inc	542.807	0,28
457	XPO Logistics Inc	49.818	0,03
179	Xylem Inc/NY	12.739	0,01
1.601	Zendesk Inc	90.841	0,05
5.626	Zoetis Inc	474.778	0,25
		105.806.715	55,34
Total des actions ordinaires et privilégiées		188.762.688	98,73
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		188.762.688	98,73
Portefeuille de titres à la valeur de marché		188.762.688	98,73
Autres éléments de l'actif net		2.429.000	1,27
Total de l'actif net (USD)		191.191.688	100,00

BlackRock Impact World Equity Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
9	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	1.222.650	1.802
7	EUR	EURO STOXX 50 Index	Juin 2018	278.447	(583)
1	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	102.170	7.843
2	JPY	Nikkei 225 Index	Juin 2018	203.604	770
1	AUD	SPI 200 Index	Juin 2018	113.928	322
1	CHF	Swiss Market Index	Juin 2018	86.659	(2.212)
Total				2.007.458	7.942

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	17.139.970	USD	20.394.619	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(411.801)
USD	1.368.526	EUR	1.158.551	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	17.818
						(393.983)
Catégorie d'Actions couverte en yens japonais						
JPY	76.183.206	USD	695.865	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	6.696
USD	37.389	JPY	4.092.449	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(352)
						6.344
Total (exposition brute sous-jacente – 22.073.829 USD)						(387.639)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	20,49
Finance	19,95
Technologie	13,61
Biens de consommation cyclique	12,67
Valeurs industrielles	10,71
Communications	8,70
Énergie	6,26
Matériaux de base	4,01
Services aux collectivités	2,32
Diversifiés	0,01
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,73
Autres éléments de l'actif net	1,27
	100,00

BlackRock Latin American Opportunities Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES / PRIVILEGIEES ET WARRANTS				Mexique suite			
Argentine				105.000	Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	551.095	3,00
4.392	Central Puerto	59.424	0,32	657.000	Grupo GICSA SA de CV	304.047	1,65
17.000	Grupo Supervielle SA ADR	291.890	1,59			3.174.548	17,25
29.000	Loma Negra Cia Industrial Argentina SA ADR	374.100	2,03	50.000	Antofagasta Plc	700.900	3,81
		725.414	3,94			700.900	3,81
Brésil				Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants			
30.000	Arezzo Industria e Comercio SA	344.383	1,87			17.877.463	97,16
35.000	Azul SA ADR	748.300	4,07	OBLIGATIONS			
80.000	B2W Cia Digital	544.568	2,96	Brésil			
140.000	BR Malls Participacoes	387.213	2,10	BRL 66	Hypermarcas SA 11,30% 15/10/2018	1.500	0,01
90.000	Bradespar SA (Pref)	752.810	4,09	BRL 490.000	Lupatech SA (Defaulted) 6,50% 15/4/2018***	–	0,00
28.000	Cia de Saneamento do Parana	376.536	2,05			1.500	0,01
82.192	Cia Energetica de Sao Paulo 'B' (Pref)	364.827	1,98			1.500	0,01
120.000	Eneva SA	419.221	2,28	Total des obligations			
100.000	Fleury	660.034	3,59			1.500	0,01
61.000	Gerdau	239.730	1,30	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
61.000	Gerdau SA (Pref)	242.424	1,32			17.878.963	97,17
44.000	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	371.230	2,02	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
9.387	lochpe Maxion SA (Wts 3/6/2019)	27.677	0,15	WARRANTS			
130.000	lochpe Maxion SA	830.467	4,51	Brésil			
155.985	Klabn SA (Unit)	879.184	4,78	14.703	Klabn SA (Wts 15/6/2020)***	–	0,00
75.000	Linx SA	382.648	2,08			–	0,00
70.000	Localiza Rent a Car SA	464.843	2,52	Total des warrants			
162.000	Lojas Americanas (Pref)	773.013	4,20			–	0,00
70.000	Lojas Renner SA	557.699	3,03	OBLIGATIONS			
23.000	Magazine Luiza SA	669.610	3,64	Brésil			
170.000	Minerva SA/Brazil	323.197	1,76	BRL 10.179	Klabn SA 1,00% 15/6/2022	57.373	0,31
200.000	MRV Engenharia e Participacoes	723.406	3,93	BRL 14.703	Klabn SA 7,25% 15/6/2020	82.871	0,45
250.000	Rumo SA	927.082	5,04			140.244	0,76
		12.010.102	65,27	Total des obligations			
Colombie						140.244	0,76
100.000	Organizacion Terpel SA	431.782	2,35	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
		431.782	2,35			140.244	0,76
Luxembourg				Portefeuille de titres à la valeur de marché			
38.000	Corp America Airports	453.720	2,47			18.019.207	97,93
7.398	Globant	380.997	2,07	Autres éléments de l'actif net			
		834.717	4,54			381.489	2,07
Mexique				Total de l'actif net (USD)			
200.000	Alsea SAB de CV	651.403	3,54			18.400.696	100,00
75.000	Arca Continental SAB de CV	451.249	2,45				
375.000	Banco del Bajío SA'144A'	708.084	3,85				
405.000	Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	508.670	2,76				

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

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

*** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock Latin American Opportunities Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
BRL	11.073	USD	2.962	State Street Bank & Trust Company	1/6/2018	11
BRL	35.067	USD	9.402	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	14
USD	7.289	BRL	27.187	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(10)
Total (exposition brute sous-jacente – 19.690 USD)						15

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Biens de consommation cyclique	28,94
Finance	18,06
Biens de consommation non cyclique	12,80
Matériaux de base	11,97
Valeurs industrielles	10,07
Services aux collectivités	6,63
Technologie	4,15
Communications	2,96
Énergie	2,35
Portefeuille de titres à la valeur de marché	97,93
Autres éléments de l'actif net	2,07
	100,00

BlackRock Macro Opportunities Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS							
Argentine				Japon			
ARS 13.000.000	Argentina Bonar Bonds FRN 11/3/2019	514.744	0,30	USD 200.000	Mizuho Bank Ltd '144A' 2,40% 26/3/2020	197.480	0,11
ARS 14.983.422	Argentina Bonos del Tesoro 21,20% 19/9/2018	580.858	0,33			197.480	0,11
USD 985.000	Argentina Republic Government International Bond 5,875% 11/1/2028	867.293	0,50	Luxembourg			
		1.962.895	1,13	USD 200.000	Allergan Funding SCS 2,45% 15/6/2019	198.879	0,11
Australie				USD 200.000	Allergan Funding SCS 3,00% 12/3/2020	199.335	0,12
USD 300.000	Commonwealth Bank of Australia 2,30% 12/3/2020	296.203	0,17			398.214	0,23
		296.203	0,17	Arabie Saoudite			
Égypte				USD 1.780.000	Saudi Government International Bond '144A' 3,625% 4/3/2028	1.686.559	0,97
EGP 550.000	Egypt Treasury Bills 3/7/2018 (Zero Coupon)	30.300	0,02			1.686.559	0,97
EGP 6.450.000	Egypt Treasury Bills 10/7/2018 (Zero Coupon)	353.269	0,20	Supranational			
EGP 3.125.000	Egypt Treasury Bills 17/7/2018 (Zero Coupon)	170.901	0,10	USD 5.250.000	European Bank for Reconstruction & Development 1,625% 15/11/2018	5.235.886	3,01
EGP 4.100.000	Egypt Treasury Bills 24/7/2018 (Zero Coupon)	223.007	0,13	ARS 12.920.000	European Bank for Reconstruction & Development 22,00% 21/12/2018	496.010	0,28
EGP 1.375.000	Egypt Treasury Bills 31/7/2018 (Zero Coupon)	74.532	0,04	USD 3.250.000	European Investment Bank RegS 2,125% 15/3/2019	3.246.035	1,87
EGP 3.725.000	Egypt Treasury Bills 4/9/2018 (Zero Coupon)	198.622	0,11	USD 2.000.000	International Finance Corp 0,875% 15/6/2018	1.999.317	1,15
EGP 12.500.000	Egypt Treasury Bills 25/9/2018 (Zero Coupon)	659.902	0,38			10.977.248	6,31
EGP 2.575.000	Egypt Treasury Bills 9/10/2018 (Zero Coupon)	135.048	0,08	Suède			
EGP 13.000.000	Egypt Treasury Bills 16/10/2018 (Zero Coupon)	679.557	0,39	USD 250.000	Svenska Handelsbanken AB '144A' 5,125% 30/3/2020	259.114	0,15
EGP 1.350.000	Egypt Treasury Bills 23/10/2018 (Zero Coupon)	70.339	0,04			259.114	0,15
EGP 15.975.000	Egypt Treasury Bills 6/11/2018 (Zero Coupon)	826.947	0,47	Suisse			
EGP 575.000	Egypt Treasury Bills 25/12/2018 (Zero Coupon)	29.105	0,02	USD 250.000	UBS AG/Stamford CT 2,375% 14/8/2019	248.889	0,14
EGP 14.100.000	Egypt Treasury Bills 8/1/2019 (Zero Coupon)	710.062	0,41			248.889	0,14
		4.161.591	2,39	Royaume-Uni			
Allemagne				USD 200.000	Barclays Plc 2,75% 8/11/2019	199.016	0,11
USD 2.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,00% 11/6/2018	1.999.686	1,15			199.016	0,11
USD 4.800.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 4,50% 16/7/2018	4.814.059	2,77	Etats-Unis			
		6.813.745	3,92	USD 783.000	Abbott Laboratories 2,35% 22/11/2019	778.794	0,45
Indonésie				USD 150.000	AbbVie Inc 2,00% 6/11/2018	149.718	0,09
USD 1.780.000	Indonesia Government International Bond 4,10% 24/4/2028	1.757.011	1,01	USD 550.000	AbbVie Inc 2,50% 14/5/2020	545.279	0,31
		1.757.011	1,01	USD 150.000	Air Lease Corp 2,625% 4/9/2018	149.976	0,09
Irlande				USD 200.000	Air Lease Corp 2,125% 15/1/2020	196.494	0,11
USD 150.000	AerCap Ireland Capital DAC Via AerCap Global Aviation Trust 3,75% 15/5/2019	151.081	0,09	USD 150.000	American International Group Inc 2,30% 16/7/2019	149.294	0,09
USD 350.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1,90% 23/9/2019	345.372	0,20	USD 510.000	Americredit Automobile Receivables Trust '2018-1 A2A' 2,71% 19/7/2021	510.058	0,29
		496.453	0,29	USD 150.000	Amgen Inc FRN 10/5/2019	150.374	0,09
				USD 400.000	AT&T Inc FRN 15/1/2020	402.451	0,23
				USD 132.066	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2016-UB10 A1' 1,559% 15/7/2049	130.025	0,07
				USD 150.000	Bank of America Corp 2,65% 1/4/2019	150.022	0,09
				USD 100.000	Bank of America Corp FRN 1/4/2019	100.685	0,06
				USD 250.000	Capital One NA 2,35% 17/8/2018	249.940	0,14

BlackRock Macro Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 303.551	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C3 A1' 1,793% 10/1/2048	299.709	0,17	USD 122.000	Honda Auto Receivables Owner Trust '2016-4 A3' 1,21% 18/12/2020	120.697	0,07
USD 600.000	Chase Issuance Trust '2016-A5 A5' 1,27% 15/7/2021	590.460	0,34	USD 500.000	HSBC USA Inc 2,375% 13/11/2019	497.698	0,29
USD 509.000	Citibank Credit Card Issuance Trust '2014-A6 A6' 2,15% 15/7/2021	506.021	0,29	USD 250.000	Huntington National Bank /The 2,20% 6/11/2018	249.686	0,14
USD 93.064	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC21 A1' 1,242% 10/5/2047	92.698	0,05	USD 120.000	International Lease Finance Corp '144A' 7,125% 1/9/2018	121.206	0,07
USD 613.498	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC23 A2' 2,851% 10/7/2047	614.747	0,35	USD 171.726	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2003-C1 F' '144A' FRN 12/1/2037	174.690	0,10
USD 217.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-GC27 A2' 2,687% 10/2/2048	216.883	0,12	USD 310.000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C27 A2' 2,734% 15/2/2048	309.792	0,18
USD 60.742	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-GC36 A1' 1,613% 10/2/2049	59.938	0,03	USD 350.000	JPMorgan Chase & Co 2,20% 22/10/2019	347.511	0,20
USD 154.205	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-GC37 A1' 1,635% 10/4/2049	152.100	0,09	USD 200.000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/1/2020	202.328	0,12
USD 120.000	Citigroup Inc 2,50% 29/7/2019	119.731	0,07	USD 250.000	KeyBank NA 2,25% 16/3/2020	246.729	0,14
USD 350.000	Citigroup Inc 2,45% 10/1/2020	346.864	0,20	USD 120.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 2,65% 1/2/2019	119.661	0,07
USD 250.000	Citizens Bank NA 2,30% 3/12/2018	249.604	0,14	USD 300.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 6,85% 15/2/2020	317.627	0,18
USD 300.000	Citizens Bank NA 2,25% 2/3/2020	295.669	0,17	USD 12.660	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C6 AM' FRN 15/7/2040	12.719	0,01
USD 28.680	Comm Mortgage Trust '2012-CR2 ASB' 2,752% 15/8/2045	28.768	0,02	USD 221.129	Mercedes-Benz Auto Receivables Trust '2016-1 A3' 1,26% 16/2/2021	219.190	0,13
USD 225.190	Comm Mortgage Trust '2012-CR5 ASB' 2,388% 10/12/2045	224.280	0,13	USD 100.000	Morgan Stanley 2,45% 1/2/2019	99.827	0,06
USD 224.957	Comm Mortgage Trust '2014-CR15 A2' 2,928% 10/2/2047	225.556	0,13	USD 150.000	Morgan Stanley FRN 1/2/2019	151.216	0,09
USD 225.000	COMM Mortgage Trust '2014-PAT A' '144A' FRN 13/8/2027	225.659	0,13	USD 150.000	Morgan Stanley 2,375% 23/7/2019	149.498	0,09
USD 325.828	Comm Mortgage Trust '2016-DC2 A1' 1,82% 10/2/2049	320.104	0,18	USD 200.000	Morgan Stanley FRN 27/1/2020	202.911	0,12
USD 137.114	Commercial Mortgage Pass Through Certificates '2016-CR28 A1' 1,77% 10/2/2049	135.623	0,08	USD 657.085	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014-C14 A2' 2,916% 15/2/2047	658.515	0,38
USD 200.000	CVS Health Corp 2,25% 5/12/2018	199.657	0,11	USD 159.591	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015-C22 A1' 1,433% 15/4/2048	157.974	0,09
USD 250.000	CVS Health Corp 3,125% 9/3/2020	250.283	0,14	USD 117.866	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015-C26 A1' 1,591% 15/10/2048	116.698	0,07
USD 300.000	Discovery Communications LLC FRN 20/9/2019	301.523	0,17	USD 225.000	Nissan Auto Receivables Owner Trust '2017-C A2A' 1,89% 15/10/2020	224.046	0,13
USD 410.000	Drive Auto Receivables Trust '2018-2 A3' 2,88% 15/6/2021	410.195	0,24	USD 190.000	Nissan Master Owner Trust Receivables '2016-A A2' 1,54% 15/6/2021	187.715	0,11
USD 526.827	Enterprise Fleet Financing LLC '2016-2 A2' '144A' 1,74% 22/2/2022	524.277	0,30	USD 145.115	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A A' '144A' 3,19% 18/3/2026	145.283	0,08
USD 3.300.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 13/6/2018 (Zero Coupon)	3.298.064	1,90	USD 148.000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A B' '144A' 3,10% 18/7/2025	147.652	0,08
USD 3.300.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes 4/9/2018 (Zero Coupon)	3.282.932	1,89	USD 500.000	Penske Truck Leasing Co Lp Via PTL Finance Corp '144A' 2,50% 15/6/2019	497.422	0,29
USD 200.000	Ford Motor Credit Co LLC 2,875% 1/10/2018	200.217	0,11	USD 130.000	Prestige Auto Receivables Trust '2016-2A A3' '144A' 1,76% 15/1/2021	129.325	0,07
USD 410.000	Ford Motor Credit Co LLC 2,375% 12/3/2019	408.846	0,23	USD 100.000	Reynolds American Inc 2,30% 12/6/2018	99.995	0,06
USD 440.000	General Motors Financial Co Inc 3,50% 10/7/2019	442.295	0,25	USD 100.000	Ryder System Inc 2,45% 15/11/2018	99.934	0,06
USD 100.000	Goldman Sachs Group Inc/The 2,55% 23/10/2019	99.723	0,06	USD 350.000	Ryder System Inc 2,65% 2/3/2020	348.207	0,20
USD 209.940	GS Mortgage Securities Corp II '2013-KING A' '144A' 2,706% 10/12/2027	210.286	0,12	USD 60.000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2017-3 A3' 1,87% 15/6/2021	59.630	0,03
USD 84.708	GS Mortgage Securities Trust '2012-GC6 AAB' 3,314% 10/1/2045	85.717	0,05	USD 65.000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2018-1 A2' 2,10% 16/11/2020	64.860	0,04
USD 100.000	Hewlett Packard Enterprise Co 2,85% 5/10/2018	100.101	0,06	USD 125.000	Sempra Energy FRN 15/7/2019	125.067	0,07

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Macro Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Pays-Bas			
USD 312.714	SLM Private Education Loan Trust '2013-B A2A' '144A' 1,85% 17/6/2030	310.025	0,18	USD 1.220.000	Cooperatieve Rabobank UA 1,72% 19/10/2018	1.216.499	0,70
USD 181.030	SMB Private Education Loan Trust '2017-B A1' '144A' FRN 17/6/2024	180.932	0,10			1.216.499	0,70
USD 367.339	Sofi Professional Loan Program LLC '2017-C A2A' '144A' 1,75% 25/7/2040	364.285	0,21	Royaume-Uni			
USD 83.383	Sofi Professional Loan Program LLC '2017-F A1FX' '144A' 2,05% 25/1/2041	82.706	0,05	USD 1.220.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 2,25% 26/7/2018	1.220.000	0,70
USD 175.000	Springleaf Funding Trust '2016-AA A' '144A' 2,90% 15/11/2029	174.294	0,10			1.220.000	0,70
USD 300.000	SunTrust Bank/Atlanta FRN 31/1/2020	301.583	0,17	Etats-Unis			
USD 4.800.000	United States Treasury Bill 26/7/2018 (Zero Coupon)	4.787.046	2,75	USD 700.000	Bank of Nova Scotia/The 2,45% 15/2/2019	700.000	0,40
USD 5.000.000	United States Treasury Bill 2/8/2018 (Zero Coupon)	4.985.357	2,87	USD 600.000	BNP Paribas SA 2,545% 28/12/2018	600.000	0,35
USD 4.800.000	United States Treasury Bill 9/8/2018 (Zero Coupon)	4.783.302	2,75	USD 430.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,41% 10/10/2018	430.000	0,25
USD 5.000.000	United States Treasury Bill 16/8/2018 (Zero Coupon)	4.980.662	2,86	USD 650.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,66% 16/4/2019	650.000	0,37
USD 5.000.000	United States Treasury Bill 30/8/2018 (Zero Coupon)	4.976.937	2,86	USD 890.000	Credit Suisse Group AG 2,13% 1/6/2018	890.000	0,51
USD 5.000.000	United States Treasury Bill 6/9/2018 (Zero Coupon)	4.974.228	2,86	USD 220.000	Natixis SA 2,15% 5/6/2018	220.000	0,13
USD 24.168.416	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,50% 15/1/2028	23.593.398	13,56	USD 220.000	Natixis SA 2,35% 5/9/2018	220.000	0,13
USD 200.000	Verizon Communications Inc 1,375% 15/8/2019	196.913	0,11	USD 600.000	Royal Bank of Canada 2,41% 24/9/2018	600.000	0,34
USD 250.000	Wells Fargo & Co FRN 22/4/2019	250.820	0,14	USD 430.000	Royal Bank of Canada 2,41% 10/10/2018	430.000	0,25
USD 350.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-LC20 A2' 2,678% 15/4/2050	348.585	0,20	USD 440.000	Societe Generale SA 2,599% 28/2/2019	440.000	0,25
USD 360.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS1 A2' 2,632% 15/5/2048	359.548	0,21	USD 450.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 2,30% 20/6/2018	450.000	0,26
USD 742.000	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C19 A2' 2,895% 15/3/2047	743.229	0,43	USD 450.000	Svenska Handelsbanken AB 2,18% 15/6/2018	450.000	0,26
USD 819.010	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-LC14 A2' 2,862% 15/3/2047	820.486	0,47	USD 400.000	The Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd 1,63% 9/8/2018	400.000	0,23
USD 241.253	Wheels SPV 2 LLC '2017-1A A2' '144A' 1,88% 20/4/2026	239.373	0,14	USD 650.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,30% 30/7/2018	650.000	0,37
USD 250.000	Wm Wrigley Jr Co '144A' 2,90% 21/10/2019	250.376	0,14	USD 865.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,38% 21/2/2019	865.000	0,50
		82.491.034	47,41	USD 600.000	Wells Fargo Bank NA 2,425% 28/9/2018	600.000	0,34
Total des obligations		111.945.452	64,34	USD 650.000	Wells Fargo Bank NA 2,70% 16/4/2019	650.000	0,37
EXCHANGE TRADED FUNDS						9.245.000	5,31
	Irlande			Total des certificats de dépôt		13.376.555	7,69
70.262	iShares JP Morgan \$ Emerging Markets Bond UCITS ETF (Dist) ¹	7.534.897	4,33	BILLET DE TRÉSORERIE			
		7.534.897	4,33	Canada			
Total des Exchange Traded Funds		7.534.897	4,33	USD 660.000	CDP Financial Inc 20/7/2018 (Zero Coupon)	657.952	0,38
CERTIFICATS DE DÉPÔT						657.952	0,38
	France			Japon			
USD 815.000	Natixis SA 2,50% 31/10/2018	815.000	0,47	USD 815.000	Mitsubishi UFJ Trust And Banking Corp 24/7/2018 (Zero Coupon)	812.204	0,47
		815.000	0,47			812.204	0,47
	Japon			Royaume-Uni			
USD 880.000	Mizuho Bank Ltd 2,29% 31/8/2018	880.056	0,51	USD 850.000	Santander UK Plc 1/8/2018 (Zero Coupon)	846.688	0,48
		880.056	0,51			846.688	0,48
				Etats-Unis			
				USD 450.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd 14/6/2018 (Zero Coupon)	449.642	0,26

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Macro Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 450.000	Bank of Nova Scotia/The 14/6/2018 (Zero Coupon)	449.646	0,26	USD 440.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 6/6/2018 (Zero Coupon)	439.869	0,25
USD 450.000	Barclays Bank Plc 14/9/2018 (Zero Coupon)	446.693	0,26	USD 1.290.000	Toyota Motor Credit Corp 16/7/2018 (Zero Coupon)	1.286.275	0,74
USD 450.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 14/6/2018 (Zero Coupon)	449.646	0,26	USD 445.000	United Overseas Bank Ltd 6/9/2018 (Zero Coupon)	442.218	0,25
USD 445.000	DBS Bank Ltd 1/6/2018 (Zero Coupon)	445.000	0,26			11.137.155	6,40
USD 820.000	Enbridge Inc 25/6/2018 (Zero Coupon)	818.382	0,47	Total des billets de trésorerie		13.453.999	7,73
USD 835.000	Ford Motor Credit Co LLC 14/8/2018 (Zero Coupon)	830.846	0,48	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		146.310.903	84,09
USD 445.000	Gotham Funding Corp 4/9/2018 (Zero Coupon)	442.240	0,25	Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
USD 650.000	HSBC Bank Plc 16/4/2019 (Zero Coupon)	634.852	0,37	OBLIGATIONS			
USD 600.000	Hyundai Capital America 19/6/2018 (Zero Coupon)	599.190	0,34	Etats-Unis			
USD 820.000	ING US Funding LLC 6/8/2018 (Zero Coupon)	816.527	0,47	USD 97.727	Comm Mortgage Trust '2013-CR9 A2' 3,055% 10/7/2045	98.037	0,06
USD 440.000	Mizuho Corporate Bank 7/6/2018 (Zero Coupon)	439.842	0,25			98.037	0,06
USD 600.000	National Australia Bank Ltd 29/6/2018 (Zero Coupon)	598.950	0,34	Total des obligations		98.037	0,06
USD 650.000	Qualcomm Inc 18/7/2018 (Zero Coupon)	648.048	0,37	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		98.037	0,06
USD 450.000	Royal Bank of Canada 14/6/2018 (Zero Coupon)	449.646	0,26	Portefeuille de titres à la valeur de marché		146.408.940	84,15
USD 450.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 14/6/2018 (Zero Coupon)	449.643	0,26	Autres éléments de l'actif net		27.574.975	15,85
				Total de l'actif net (USD)		173.983.915	100,00

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Macro Opportunities Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
CCCDs	EUR 29.377.500	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	186.686	(538.458)
CCCDs	EUR 14.990.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 29 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(158.755)	140.344
CCCDs	USD 54.437.500	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(86.017)	867.831
CCCDs	USD 2.251.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.30	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(15.342)	142.083
CCILS	USD 18.610.000	Fund receives Fixed 2,290% and pays Floating USD 12 Month US CPI	Bank of America Merrill Lynch	29/5/2023	88.096	88.376
CCIRS	USD 550.000	Fund receives Fixed 2,862% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	12/1/2021	(248)	(243)
CCIRS	USD 1.890.000	Fund receives Fixed 2,863% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	12/1/2021	(834)	(819)
CCIRS	USD 7.830.000	Fund receives Fixed 3,001% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	12/1/2021	6.743	6.808
CCIRS	USD 6.350.000	Fund receives Fixed 3,072% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	13/1/2021	9.758	9.810
CCIRS	USD 550.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,854%	Bank of America Merrill Lynch	12/1/2022	122	128
CCIRS	USD 1.890.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,855%	Bank of America Merrill Lynch	12/1/2022	410	430
CCIRS	USD 7.830.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,020%	Bank of America Merrill Lynch	12/1/2022	(10.225)	(10.146)
CCIRS	USD 6.350.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,078%	Bank of America Merrill Lynch	12/1/2022	(11.662)	(11.599)
CCIRS	USD 525.000	Fund receives Fixed 2,733% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	1/12/2022	(1.423)	(1.417)
CCIRS	USD 38.500	Fund receives Fixed 2,739% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	27/12/2022	(96)	(96)
CCIRS	USD 6.000.000	Fund receives Fixed 2,638% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	12/2/2023	(44.641)	(44.563)
CCIRS	USD 420.000	Fund receives Fixed 2,740% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	12/2/2023	(1.214)	(1.208)
CCIRS	USD 2.900.000	Fund receives Fixed 3,010% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	26/10/2023	21.918	21.960
CCIRS	USD 5.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,750%	Bank of America Merrill Lynch	3/12/2023	24.103	24.175
CCIRS	USD 350.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,750%	Bank of America Merrill Lynch	3/12/2023	1.111	1.116
CCIRS	USD 224.000	Fund receives Fixed 2,834% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/3/2024	(397)	(394)
CCIRS	USD 3.200.000	Fund receives Fixed 2,984% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	25/3/2024	16.309	16.356
CCIRS	EUR 8.150.000	Fund receives Fixed 0,904% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	15/2/2027	104.401	104.585
CDS	USD 8.970.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	Credit Suisse	20/6/2023	(2.029)	142.998
CDS	USD 4.485.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.30	Goldman Sachs	20/6/2023	9.059	283.092
CDS	USD 2.695.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.30	Goldman Sachs	20/6/2023	(4.259)	170.108
CDS	USD 11.825.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	JP Morgan	20/6/2023	(21.648)	188.511
CDS	USD 10.250.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	JP Morgan	20/6/2023	(20.077)	163.403
CDS	USD 850.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.30	Morgan Stanley	20/6/2023	(5.105)	53.652
IRS	USD 27.000.000	Fund receives Fixed 2,501% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Citibank	12/1/2021	(103.947)	(103.947)
IRS	USD 27.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,540%	Citibank	12/1/2022	84.516	84.516

BlackRock Macro Opportunities Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
IRS	USD 2.500.000	Fund receives Fixed 2,180% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Citibank	1/12/2022	(63.414)	(65.448)
IRS	USD 550.000	Fund receives Fixed 2,280% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Citibank	27/12/2022	(12.291)	(12.291)
IRS	USD 5.000.000	Fund receives Fixed 2,180% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Morgan Stanley	1/12/2022	(130.895)	(130.895)
Total (exposition brute sous-jacente – 292.177.440 USD)					(141.287)	1.588.758

CCCDs : Centrally Cleared Credit Default Swaps ou swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale
 CCILS : Swaps liés à l'inflation faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Inflation Linked Swaps)
 CCIRS : Swaps sur taux d'intérêt faisant l'objet d'une compensation centrale (Centrally Cleared Interest Rate Swaps)
 CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance
 IRS (interest rate swaps) : swaps sur taux d'intérêt

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
215	USD	90 Day Euro	Mars 2019	215.000.000	14.463
(324)	USD	90 Day Euro	Mars 2020	324.000.000	(91.525)
27	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	3.667.950	63.570
(54)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	6.343.519	(189.383)
(4)	USD	US Long Bond	Septembre 2018	490.364	(12.494)
(347)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	34.932.146	(211.453)
(7)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	695.156	928
(9)	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	875.682	3.244
(3)	USD	US Ultra Bond	Septembre 2018	341.259	(12.063)
Total				586.346.076	(434.713)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
ARS	16.832.000	USD	800.000	Bank of America	1/6/2018	(124.897)
ARS	4.770.480	USD	228.000	Merrill Lynch	1/6/2018	(36.664)
ARS	21.221.400	USD	1.045.000	BNP Paribas	1/6/2018	(193.846)
ARS	7.293.280	USD	353.000	JP Morgan	1/6/2018	(60.479)
ARS	29.040.000	USD	1.500.000	Morgan Stanley	1/6/2018	(335.255)
ARS	5.319.941	USD	209.035	Royal Bank of Scotland	1/6/2018	112
ARS	15.358.302	USD	605.004	BNP Paribas	26/6/2018	(1.211)
ARS	23.450.000	USD	1.000.000	JP Morgan	26/6/2018	(112.730)
ARS	8.924.250	USD	365.000	BNP Paribas	8/8/2018	(28.827)
ARS	132.725	USD	5.000	Deutsche Bank	13/8/2018	(5)
ARS	40.948.400	USD	1.670.000	JP Morgan	14/8/2018	(128.853)
ARS	10.051.370	USD	389.588	JP Morgan	14/8/2018	(11.625)
AUD	3.821.000	USD	2.891.146	Citibank	15/8/2018	3.261
AUD	300.000	USD	234.780	JP Morgan	1/6/2018	(7.530)
AUD	1.811.000	USD	1.378.827	Morgan Stanley	1/6/2018	(6.994)
AUD	1.518.000	USD	1.150.284	Royal Bank of Scotland	1/6/2018	(399)
BRL	5.003.052	USD	1.380.000	HSBC	1/6/2018	(45.600)
CAD	355.844	USD	278.000	Bank of America	13/8/2018	(3.287)
EUR	2.120.000	GBP	1.872.096	Merrill Lynch	4/6/2018	(17.578)
EUR	30.000	SEK	306.726	Deutsche Bank	18/6/2018	180
EUR	750.000	SEK	7.567.198	Morgan Stanley	1/6/2018	15.926

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
EUR	155.000	USD	185.184	Goldman Sachs	4/6/2018	(4.586)
EUR	358.000	USD	422.006	Royal Bank of Scotland	4/6/2018	(4.882)
EUR	2.955.000	USD	3.491.208	Deutsche Bank	18/6/2018	(44.676)
GBP	30.845	EUR	35.000	BNP Paribas	18/6/2018	207
GBP	972.371	EUR	1.095.000	Credit Suisse	18/6/2018	16.283
GBP	148.269	EUR	170.000	Deutsche Bank	18/6/2018	(1.053)
GBP	429.356	EUR	490.000	JP Morgan	18/6/2018	(386)
GBP	288.623	EUR	330.000	Morgan Stanley	18/6/2018	(973)
GBP	906.882	USD	1.226.000	Goldman Sachs	4/6/2018	(20.482)
GBP	2.176	USD	3.048	JP Morgan	15/6/2018	(154)
GBP	102.824	USD	144.105	Royal Bank of Scotland	15/6/2018	(7.354)
JPY	394.650.564	USD	3.560.000	Deutsche Bank	1/6/2018	77.500
MXN	1.293.609	USD	66.000	JP Morgan	4/6/2018	(1.306)
MXN	284.753	USD	15.000	BNP Paribas	15/6/2018	(787)
MXN	1.632.928	USD	90.000	Citibank	15/6/2018	(8.495)
MXN	12.575.335	USD	680.508	Deutsche Bank	15/6/2018	(52.834)
MXN	41.965.398	USD	2.259.492	JP Morgan	15/6/2018	(164.868)
MXN	5.086.017	USD	270.000	Morgan Stanley	15/6/2018	(16.141)
MXN	2.969.424	USD	150.000	Bank of America	15/6/2018	(3.278)
MXN	26.232.660	USD	1.397.000	Merrill Lynch	13/8/2018	(100.816)
MXN	61.939.821	USD	3.250.000	Deutsche Bank	13/8/2018	(189.488)
MXN	30.960.895	USD	1.605.000	Goldman Sachs	13/8/2018	(75.189)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Macro Opportunities Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
SEK	303.115	EUR	30.000	JP Morgan	1/6/2018	(589)
SEK	352.548	EUR	35.000	BNP Paribas	15/6/2018	(810)
SEK	7.238.146	EUR	715.000	JP Morgan	15/6/2018	(12.450)
USD	2.806.000	ARS	58.422.100	BNP Paribas	1/6/2018	462.789
USD	1.000.000	ARS	19.090.000	Citibank	1/6/2018	234.333
USD	5.000	ARS	124.850	Deutsche Bank	1/6/2018	(12)
USD	115.000	ARS	2.358.650	Royal Bank of Scotland	1/6/2018	20.399
USD	1.650.000	ARS	36.258.750	BNP Paribas	26/6/2018	224.531
USD	493.000	ARS	10.375.658	JP Morgan	26/6/2018	85.094
USD	485.000	ARS	10.180.150	Royal Bank of Scotland	26/6/2018	84.780
USD	550.000	ARS	17.512.000	JP Morgan	31/5/2019	3.253
USD	195.415	AUD	250.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	1/6/2018	6.040
USD	38.977	AUD	50.000	Goldman Sachs	1/6/2018	1.102
USD	5.369.929	AUD	7.150.000	Royal Bank of Scotland	1/6/2018	(46.196)
USD	49.036	AUD	65.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(201)
USD	2.892.893	AUD	3.821.000	Citibank	27/8/2018	(3.109)
USD	1.380.000	BRL	4.989.569	JP Morgan	13/8/2018	49.196
USD	518.268	CAD	665.000	Goldman Sachs	4/6/2018	4.885
USD	130.953	CAD	168.000	JP Morgan	4/6/2018	1.257
USD	531.160	EUR	439.000	Citibank	4/6/2018	19.659
USD	122.192	EUR	105.000	Deutsche Bank	4/6/2018	(149)
USD	25.220	EUR	21.000	Royal Bank of Scotland	4/6/2018	752
USD	57.478	EUR	49.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	386
USD	215.911	EUR	180.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/6/2018	5.969
USD	43.448	EUR	35.000	BNP Paribas	18/6/2018	2.626
USD	2.814.828	EUR	2.354.000	Deutsche Bank	18/6/2018	69.265
USD	87.997	EUR	71.000	HSBC	18/6/2018	5.187
USD	5.682.712	EUR	4.660.000	JP Morgan	18/6/2018	247.570
USD	407.414	EUR	330.000	Morgan Stanley	18/6/2018	22.522
USD	2.625.424	GBP	1.961.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	4/6/2018	18.668
USD	2.533.133	GBP	1.900.000	Deutsche Bank	4/6/2018	7.464
USD	1.350.423	GBP	982.000	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	45.051
USD	148.272	GBP	105.000	State Street Bank & Trust Company	15/6/2018	8.627
USD	2.626.763	GBP	1.971.000	State Street Bank & Trust Company	18/6/2018	4.985
USD	2.644.096	GBP	1.987.000	Citibank	5/7/2018	(1.415)
USD	80.000	JPY	8.755.808	Bank of America		
				Merrill Lynch	1/6/2018	(702)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	250.000	JPY	26.890.179	Deutsche Bank	1/6/2018	2.153
USD	1.883.400	JPY	206.252.698	Goldman Sachs	1/6/2018	(17.634)
USD	750.000	JPY	81.641.924	JP Morgan	1/6/2018	(2.495)
USD	540.000	JPY	57.145.281	Morgan Stanley	1/6/2018	13.291
USD	56.600	JPY	6.002.806	State Street Bank & Trust Company	1/6/2018	1.272
USD	7.435	MXN	141.000	Goldman Sachs	4/6/2018	383
USD	3.315.000	MXN	64.791.675	JP Morgan	15/6/2018	81.046
USD	2.155.000	MXN	42.687.964	JP Morgan	13/8/2018	45.743
						(5.543)
Catégorie d'Actions couverte en BRL						
BRL	318.563.523	USD	86.572.549	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(1.030.324)
BRL	303.838.623	USD	81.413.331	State Street Bank & Trust Company	3/7/2018	(49.144)
USD	85.654.430	BRL	318.563.523	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	112.205
USD	915.231	BRL	3.418.707	State Street Bank & Trust Company	3/7/2018	(256)
						(967.519)
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	5.159	USD	5.148	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	90
USD	262	CHF	262	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(4)
						86
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	31.051.572	USD	36.949.280	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(747.470)
USD	1.117.455	EUR	938.639	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	23.132
						(724.338)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	5.817.430	USD	7.896.709	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(160.608)
USD	18.363	GBP	13.751	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	78
						(160.530)
Total (exposition brute sous-jacente – 391.459.932 USD)						(1.857.844)

BlackRock Macro Opportunities Fund suite

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	(Moins-valeur) non réalisée USD	Valeur de marché USD
1.280.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17,66	10/7/2018	(12.381)	687
30.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17,66	10/7/2018	(346)	16
60.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17,66	10/7/2018	(187)	32
250.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17,66	10/7/2018	(666)	134
5.375.000	Put	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 12,20	19/7/2018	(10.486)	30.202
2.470.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17,75	13/8/2018	(26.419)	2.653
120.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17,75	13/8/2018	(494)	129
470.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17,75	13/8/2018	(1.906)	505
65.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18,30	13/8/2018	(1.517)	158
20.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18,30	13/8/2018	(528)	49
90.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18,50	13/8/2018	(2.526)	293
30.000	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18,50	13/8/2018	(950)	98
4.610.000	Put	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,14	31/8/2018	(4.523)	35.263
100	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.600,00	15/6/2018	(14.623)	932
350	Call	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 130,00	15/6/2018	(41.502)	1.019
10	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.760,00	15/6/2018	(15.980)	6.300
6.400.000	Put	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3,55	19/7/2018	(16.755)	24.845
1.280.000	Put	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 17,90	11/6/2018	(8.920)	246
30.000	Put	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 17,90	11/6/2018	(277)	6
60.000	Put	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 17,90	11/6/2018	(110)	11
250.000	Put	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 17,90	11/6/2018	(430)	48
Total (exposition brute sous-jacente – 3.293.788 USD)						(161.526)	103.626

Options vendues au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/(moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
(1.280.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19,79	10/7/2018	(26.318)	(40.501)
(30.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19,79	10/7/2018	(734)	(949)
(60.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19,79	10/7/2018	(897)	(1.898)
(250.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19,79	10/7/2018	(4.178)	(7.910)
(905.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20,70	13/8/2018	(3.816)	(16.568)
(65.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20,70	13/8/2018	(654)	(1.190)
(20.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20,70	13/8/2018	(267)	(366)
(50.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20,70	13/8/2018	(393)	(915)
(190.000)	Call	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20,70	13/8/2018	(1.565)	(3.478)
(85.000)	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18,30	13/8/2018	1.786	(207)
(120.000)	Put	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18,50	13/8/2018	3.098	(391)
(1.280.000)	Call	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 19,60	11/7/2018	(32.945)	(48.659)
(30.000)	Call	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 19,60	11/7/2018	(887)	(1.140)
(60.000)	Call	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 19,60	11/7/2018	(1.164)	(2.281)
(250.000)	Call	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 19,60	11/7/2018	(5.076)	(9.504)
Total (exposition brute sous-jacente – 1.818.511 USD)						(74.010)	(135.957)

BlackRock Macro Opportunities Fund suite

Swaptions achetées au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
6.310.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/3/2019; and pays 2,9% Fixed semi-annually from 3/12/2018	Bank of America Merrill Lynch	USD 2,90	29/11/2018	(21.064)	48.761
21.750.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/3/2019; and pays 2,9% Fixed semi-annually from 3/12/2018	Citibank	USD 2,90	29/11/2018	(10.329)	168.075
1.960.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/3/2019; and pays 2,9% Fixed semi-annually from 3/12/2019	Citibank	USD 2,90	29/11/2018	4.196	15.146
5.100.000	Put	Fund purchases an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 3/3/2019; and pays 2,9% Fixed semi-annually from 3/12/2018	Deutsche Bank	USD 2,90	29/11/2018	(24.589)	39.411
Total (exposition brute sous-jacente – 15.772.800 USD)						(51.786)	271.393

Swaptions vendues au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
(7.250.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 28/1/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 24/4/2020	Bank of America Merrill Lynch	USD 2,85	24/1/2020	9.718	(50.607)
(25.000.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 28/1/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/4/2020	Citibank	USD 2,85	24/1/2020	(53.882)	(174.507)
(2.258.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 28/1/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/4/2020	Citibank	USD 2,85	24/1/2020	(4.812)	(15.762)
(5.900.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 28/1/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/4/2020	Deutsche Bank	USD 2,85	24/1/2020	11.816	(41.184)
Total (exposition brute sous-jacente – 20.710.506 USD)						(37.160)	(282.060)

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 mai 2018

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis			
USD (3.920.000)	Fannie Mae Pool 4,00% TBA	(4.007.435)	(2,30)
USD 15.700.000	Fannie Mae Pool 4,00% TBA	16.028.105	9,21
		12.020.670	6,91
Total (exposition brute sous-jacente – 20.301.339 USD)		12.020.670	6,91

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	46,11
Finance	20,90
Exchange Traded Funds	4,33
Titres hypothécaires	3,92
Biens de consommation non cyclique	3,04
Titres adossés à des actifs	2,98
Énergie	0,72
Biens de consommation cyclique	0,59
Valeurs industrielles	0,55
Communications	0,51
Technologie	0,43
Services aux collectivités	0,07
Portefeuille de titres à la valeur de marché	84,15
Autres éléments de l'actif net	15,85
	100,00

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
EXCHANGE TRADED FUNDS				Irlande suite			
90.201	iShares \$ Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF (Dist)	7.514.375	7,29	9.067	iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF (Acc)	1.884.757	1,83
19.690	iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	1.880.789	1,82	8.434	iShares France Government Bond UCITS ETF (Dist)	1.263.582	1,23
42.135	iShares \$ High Yield Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	3.645.099	3,54	4.319	iShares Italy Government Bond UCITS ETF (Dist)	646.943	0,63
20.846	iShares \$ TIPS UCITS ETF (Acc)	3.648.050	3,54	11.499	iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc)	1.267.420	1,23
64.674	iShares \$ Treasury Bond 1-3 UCITS ETF (Dist)	7.250.602	7,03	40.426	iShares MSCI EMU UCITS ETF (Acc)	4.627.968	4,49
674.316	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF (Dist)	2.632.327	2,55	3.863	iShares Spain Government Bond UCITS ETF (Dist)	629.572	0,61
49.233	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF (Acc)	5.172.173	5,02	1.532.820	iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF (Dist)	6.311.305	6,12
5.715	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF (Dist)	918.400	0,89			96.029.482	93,14
3.804	iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	620.949	0,60	Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		96.029.482	93,14
167.267	iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF (Acc)	4.208.939	4,08	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		96.029.482	93,14
60.850	iShares Core S&P 500 UCITS ETF (Acc)	13.743.581	13,33				
282.550	iShares Core UK Gilts UCITS ETF (Dist)	4.263.114	4,13	Organismes de placement collectif			
232.365	iShares Edge MSCI USA Value Factor UCITS ETF	1.336.331	1,30	Luxembourg			
110.888	iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF (Acc)	3.802.066	3,69	31.129	BlackRock Global Index Funds - iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (LU) X2 (USD)	3.290.162	3,19
66.540	iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF (Acc)	1.982.809	1,92	16.809	BlackRock Global Index Funds - iShares Euro Government Bond Index Fund (LU) X2 (EUR)	2.096.582	2,03
70.872	iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF (Acc)	2.085.742	2,02	12.946	BlackRock Global Index Funds - iShares Japan Equity Index Fund (LU) X2 (EUR)	1.976.941	1,92
35.213	iShares Edge S&P 500 Minimum Volatility UCITS ETF (Acc)	1.529.125	1,48	14.461	BlackRock Global Index Funds - iShares Pacific ex Japan Equity Index Fund (LU) X2 (EUR)	1.667.741	1,62
12.221	iShares EUR Covered Bond UCITS ETF (Dist)	1.886.434	1,83			9.031.426	8,76
7.366	iShares EUR Government Bond 15-30yr UCITS ETF EUR (Dist)	1.681.142	1,63	Total des organismes de placement collectif		9.031.426	8,76
38.640	iShares Euro Government Bond 0-1yr UCITS ETF (Dist)	3.826.906	3,71	Portefeuille de titres à la valeur de marché		105.060.908	101,90
12.313	iShares Euro Government Bond 7-10yr UCITS ETF (Dist)	2.566.522	2,49	Autres éléments du passif net		(1.962.130)	(1,90)
30.784	iShares Euro High Yield Corporate Bond UCITS ETF (Dist)*	3.202.460	3,11	Total de l'actif net (EUR)		103.098.778	100,00

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

BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
AUD	855.548	EUR	556.573	Morgan Stanley	4/6/2018	(355)
CAD	1.411.411	EUR	943.659	HSBC	4/6/2018	(8.538)
EUR	533.993	AUD	855.548	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(22.226)
EUR	555.374	AUD	855.548	Morgan Stanley	3/7/2018	351
EUR	906.722	CAD	1.411.411	State Street Bank		
				& Trust Company	4/6/2018	(28.399)
EUR	942.292	CAD	1.411.411	HSBC	3/7/2018	8.530
EUR	5.121.776	GBP	4.497.921	HSBC	4/6/2018	(9.826)
EUR	535.238	GBP	471.066	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(2.193)
EUR	4.694.745	GBP	4.110.329	Toronto		
				Dominion Bank	3/7/2018	9.102
EUR	2.834.145	JPY	373.580.416	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(121.095)
EUR	572.837	USD	680.653	Goldman Sachs	4/6/2018	(11.339)
EUR	3.622.450	USD	4.268.139	Morgan Stanley	4/6/2018	(40.719)
EUR	52.082.842	USD	63.057.738	State Street Bank		
				& Trust Company	4/6/2018	(2.037.030)
EUR	4.056.080	USD	4.790.938	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(55.785)
EUR	62.289.002	USD	72.797.468	Toronto		
				Dominion Bank	3/7/2018	(49.458)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
GBP	858.658	EUR	978.416	Morgan Stanley	4/6/2018	1.213
GBP	4.110.329	EUR	4.698.550	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(9.145)
JPY	373.580.416	EUR	2.857.983	Morgan Stanley	4/6/2018	97.257
USD	72.797.468	EUR	62.433.506	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	45.576
						(2.234.079)

Catégorie d'Actions couverte en livres sterling

EUR	27	GBP	23	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	0
GBP	4.944	EUR	5.642	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	(4)
						(4)

Catégorie d'Actions couverte en dollars US

USD	11.323.175	EUR	9.515.659	State Street Bank		
				& Trust Company	13/6/2018	196.625
						196.625
Total (exposition brute sous-jacente – 223.420.230 EUR)						(2.037.458)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Exchange Traded Funds	93,14
Organismes de placement collectif	8,76
Portefeuille de titres à la valeur de marché	101,90
Autres éléments du passif net	(1,90)
	100,00

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
EXCHANGE TRADED FUNDS¹				Irlande suite			
	Irlande			26.852	iShares Euro Government Bond 7-10yr UCITS ETF (Dist)*	5.597.031	4,77
141.316	iShares \$ Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF (Dist)	11.772.612	10,03	21.166	iShares Euro High Yield Corporate Bond UCITS ETF (Dist)*	2.201.899	1,88
44.017	iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	4.204.504	3,58	3.040	iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF (Acc)	631.925	0,54
60.468	iShares \$ High Yield Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	5.231.087	4,46	122.232	iShares Index-Linked Gilts UCITS ETF (Dist)	2.473.189	2,11
31.776	iShares \$ TIPS UCITS ETF (Acc)*	5.560.800	4,74	20.314	iShares MSCI EMU UCITS ETF (Acc)	2.325.547	1,98
57.666	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist)	6.464.935	5,51	9.284	iShares MSCI UK UCITS ETF (Acc)	1.164.480	0,99
417.039	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF (Dist)	1.627.995	1,39	9.827	iShares Spain Government Bond UCITS ETF (Dist)	1.601.555	1,36
40.357	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF (Acc)	4.239.705	3,61	2.620.439	iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF (Dist)	10.789.519	9,19
18.605	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF (Dist)	2.989.823	2,55			107.855.890	91,91
18.966	iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF (Dist)*	3.095.929	2,64	Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		107.855.890	91,91
97.337	iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF (Acc)	2.449.291	2,09	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
39.179	iShares Core S&P 500 UCITS ETF (Acc)*	8.848.969	7,54			107.855.890	91,91
309.987	iShares Core UK Gilts UCITS ETF (Dist)	4.677.084	3,99	Organismes de placement collectif¹			
16.801	iShares Edge MSCI Europe Minimum Volatility UCITS ETF (Acc)	703.458	0,60	Luxembourg			
129.515	iShares Edge MSCI USA Value Factor UCITS ETF (Acc)	744.841	0,63	47.338	BlackRock Global Index Funds - iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (LU) X2 (USD)	5.003.349	4,26
57.995	iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF (Acc)	1.988.500	1,69	23.632	BlackRock Global Index Funds - iShares Euro Government Bond Index Fund (LU) X2 (EUR)	2.947.611	2,51
37.481	iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF (Acc)	1.116.887	0,95	13.526	BlackRock Global Index Funds - iShares Japan Equity Index Fund (LU) X2 (EUR)	2.065.458	1,76
39.346	iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF (Acc)	1.157.941	0,99	8.622	BlackRock Global Index Funds - iShares Pacific ex Japan Equity Index Fund (LU) X2 (EUR)	994.403	0,85
2.455	iShares Edge S&P 500 Minimum Volatility UCITS ETF (Acc)	106.608	0,09			11.010.821	9,38
13.717	iShares EUR Bond 10-15yr UCITS ETF (Dist)	2.357.952	2,01	Total des organismes de placement collectif		11.010.821	9,38
15.210	iShares EUR Bond 5-7yr UCITS ETF (Dist)	2.346.599	2,00	Portefeuille de titres à la valeur de marché		118.866.711	101,29
38.346	iShares EUR Covered Bond UCITS ETF (Dist)	5.919.089	5,04	Autres éléments du passif net		(1.510.601)	(1,29)
5.684	iShares EUR Government Bond 15-30yr UCITS ETF EUR (Dist)	1.297.259	1,11	Total de l'actif net (EUR)		117.356.110	100,00
21.899	iShares Euro Government Bond 0-1yr UCITS ETF (Dist)	2.168.877	1,85				

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

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

BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
AUD	476.395	EUR	309.939	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(220)
EUR	297.343	AUD	476.395	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(12.376)
EUR	309.270	AUD	476.395	Toronto		
				Dominion Bank	3/7/2018	216
EUR	10.127.457	GBP	8.893.889	HSBC	4/6/2018	(19.431)
EUR	986.270	GBP	865.577	Morgan Stanley	4/6/2018	(1.252)
EUR	561.682	GBP	493.279	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(1.091)
EUR	11.710.504	GBP	10.252.745	Toronto		
				Dominion Bank	3/7/2018	22.703
EUR	1.853.382	JPY	244.764.293	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(82.847)
EUR	1.664.583	USD	1.964.687	Goldman Sachs	4/6/2018	(21.628)
EUR	1.981.388	USD	2.334.563	Morgan Stanley	4/6/2018	(22.272)
EUR	62.330.072	USD	75.464.265	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(2.437.812)
EUR	782.947	USD	938.042	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(22.136)
EUR	69.052.119	USD	80.701.557	Toronto		
				Dominion Bank	3/7/2018	(54.830)
GBP	10.252.745	EUR	11.719.995	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(22.811)
JPY	244.764.293	EUR	1.872.507	Morgan Stanley	4/6/2018	63.722
USD	80.701.557	EUR	69.212.313	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	50.525
USD	5.044	EUR	4.239	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	87
						(2.561.453)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	1.022.190	EUR	859.589	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	30.537
EUR	6.971	CHF	8.303	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(259)
						30.278
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
EUR	225.955	GBP	197.778	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	365
GBP	7.770.936	EUR	8.869.724	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(5.994)
						(5.629)
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
EUR	1.087.737	USD	1.283.924	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(13.529)
USD	41.428.044	EUR	34.819.635	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	714.653
						701.124
Total (exposition brute sous-jacente – 294.142.300 EUR)						(1.835.680)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Exchange Traded Funds	91,91
Organismes de placement collectif	9,38
Portefeuille de titres à la valeur de marché	101,29
Autres éléments du passif net	(1,29)
	100,00

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
EXCHANGE TRADED FUNDS¹				Irlande suite			
50.350	iShares \$ Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF (Dist)	4.194.507	2,73	58.435	iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc)	6.440.706	4,20
4.418	iShares \$ TIPS UCITS ETF (Acc)	773.150	0,50	107.339	iShares MSCI EMU UCITS ETF (Acc)	12.288.169	8,01
27.915	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist)	3.129.551	2,04	20.275	iShares MSCI UK UCITS ETF (Acc)	2.543.067	1,66
331.006	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF (Dist)	1.292.148	0,84	112.413	iShares MSCI USA UCITS ETF (Acc)	24.738.729	16,12
49.517	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF (Acc)	5.202.008	3,39			145.061.191	94,53
9.331	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF (Dist)	1.499.492	0,98	Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		145.061.191	94,53
6.697	iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF (Dist)*	1.093.190	0,71	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
483.652	iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF (Acc)	12.170.135	7,93			145.061.191	94,53
121.318	iShares Core S&P 500 UCITS ETF (Acc)	27.400.883	17,86	Organismes de placement collectif¹			
105.332	iShares Core UK Gilts UCITS ETF (Dist)	1.589.249	1,04	Luxembourg			
683.292	iShares Edge MSCI USA Value Factor UCITS ETF (Acc)	3.929.612	2,56	17.603	BlackRock Global Index Funds - iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (LU) X2 (USD)	1.860.583	1,21
322.357	iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF (Acc)	11.052.798	7,20	43.808	BlackRock Global Index Funds - iShares Japan Equity Index Fund (LU) X2 (EUR)	6.689.404	4,36
197.308	iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF (Acc)	5.879.532	3,83	23.735	BlackRock Global Index Funds - iShares Pacific ex Japan Equity Index Fund (LU) X2 (EUR)	2.737.411	1,79
208.779	iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF (Acc)	6.144.304	4,00			11.287.398	7,36
104.346	iShares Edge S&P 500 Minimum Volatility UCITS ETF (Acc)	4.531.225	2,95	Total des organismes de placement collectif		11.287.398	7,36
28.602	iShares Euro Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF (Dist)	2.743.504	1,79	Portefeuille de titres à la valeur de marché		156.348.589	101,89
48.426	iShares Euro Government Bond 0-1yr UCITS ETF (Dist)	4.796.111	3,13	Autres éléments du passif net		(2.898.556)	(1,89)
4.088	iShares Euro Government Bond 7-10yr UCITS ETF (Dist)	852.103	0,55	Total de l'actif net (EUR)		153.450.033	100,00
3.738	iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF (Acc)	777.018	0,51				

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

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

BlackRock Managed Index Portfolios – Growth suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
AUD	1.145.300	EUR	745.123	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(528)
CAD	9.482.473	EUR	6.340.081	Royal Bank of Canada	4/6/2018	(57.529)
EUR	714.842	AUD	1.145.300	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(29.753)
EUR	743.516	AUD	1.145.300	Toronto		
				Dominion Bank	3/7/2018	520
EUR	1.519.031	CAD	2.285.907	Morgan Stanley	4/6/2018	4.517
EUR	4.623.207	CAD	7.196.566	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(144.832)
EUR	6.330.913	CAD	9.482.473	Royal Bank of Canada	3/7/2018	57.493
EUR	8.284.682	GBP	7.275.571	HSBC	4/6/2018	(15.895)
EUR	762.707	GBP	666.270	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	2.570
EUR	5.048.160	GBP	4.419.750	Toronto		
				Dominion Bank	3/7/2018	9.787
EUR	9.139.407	JPY	1.206.982.946	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(408.535)
EUR	80.558.882	USD	97.534.250	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(3.150.766)
EUR	5.404.742	USD	6.418.519	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(104.010)
EUR	50	USD	58	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	0
EUR	88.946.970	USD	103.952.769	Toronto		
				Dominion Bank	3/7/2018	(70.624)
GBP	3.522.091	EUR	4.013.319	Morgan Stanley	4/6/2018	4.975
GBP	4.419.750	EUR	5.052.251	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	(9.833)
JPY	1.206.982.946	EUR	9.233.718	Morgan Stanley	4/6/2018	314.224

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
USD	103.952.769	EUR	89.153.318	Toronto		
				Dominion Bank	4/6/2018	65.081
USD	5.189	EUR	4.361	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	90
						(3.533.048)
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	526.928	EUR	443.123	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	15.727
EUR	8.572	CHF	10.054	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(183)
						15.544
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
EUR	183.053	GBP	160.683	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(227)
GBP	6.772.167	EUR	7.728.998	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(4.489)
						(4.716)
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
EUR	436.440	USD	515.121	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(5.397)
USD	26.625.171	EUR	22.382.498	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	454.846
						449.449
Total (exposition brute sous-jacente – 362.439.861 EUR)						(3.072.771)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Exchange Traded Funds	94,53
Organismes de placement collectif	7,36
Portefeuille de titres à la valeur de marché	101,89
Autres éléments du passif net	(1,89)
	100,00

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
EXCHANGE TRADED FUNDS¹				Irlande suite			
244.804	Irlande iShares \$ Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF (Dist)	20.393.887	4,87	27.536	iShares Euro Inflation Linked Government Bond UCITS ETF (Acc)	5.723.908	1,37
167.552	iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	16.004.567	3,82	233.021	iShares Index-Linked Gilts UCITS ETF (Dist)	4.714.845	1,13
88.028	iShares \$ High Yield Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	7.615.302	1,82	81.316	iShares MSCI Canada UCITS ETF (Acc)	8.962.650	2,14
35.828	iShares \$ TIPS UCITS ETF (Acc)	6.269.900	1,50	231.285	iShares MSCI EMU UCITS ETF (Acc)	26.477.507	6,32
159.588	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (Dist)	17.891.411	4,27	33.813	iShares MSCI UK UCITS ETF (Acc)	4.241.120	1,01
949.417	iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF (Dist)	3.706.239	0,89	151.683	iShares MSCI USA UCITS ETF (Acc)	33.380.878	7,97
81.605	iShares \$ Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF (Acc)	8.573.013	2,05	16.294	iShares Spain Government Bond UCITS ETF (Dist)	2.655.515	0,63
35.192	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF (Dist)	5.655.354	1,35	4.164.501	iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF (Dist)	17.147.113	4,10
26.890	iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF (Dist)	4.389.409	1,05			401.398.920	95,87
1.015.586	iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF (Acc)	25.555.191	6,10	Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		401.398.920	95,87
312.899	iShares Core S&P 500 UCITS ETF (Acc)	70.671.368	16,88	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
755.627	iShares Core UK Gilts UCITS ETF (Dist)	11.400.900	2,72			401.398.920	95,87
1.316.047	iShares Edge MSCI USA Value Factor UCITS ETF (Acc)	7.568.586	1,81	Organismes de placement collectif¹			
628.700	iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF (Acc)	21.556.518	5,15	Luxembourg			
385.196	iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF (Acc)	11.478.360	2,74	107.566	BlackRock Global Index Funds - iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund (LU) X2 (USD)	11.369.147	2,71
415.417	iShares Edge MSCI World Size Factor UCITS ETF (Acc)	12.225.598	2,92	34.286	BlackRock Global Index Funds - iShares Euro Government Bond Index Fund (LU) X2 (EUR)	4.276.537	1,02
212.727	iShares Edge S&P 500 Minimum Volatility UCITS ETF (Acc)	9.237.670	2,21	59.148	BlackRock Global Index Funds - iShares Japan Equity Index Fund (LU) X2 (EUR)	9.031.849	2,16
55.314	iShares EUR Bond 5-7yr UCITS ETF (Dist)	8.533.844	2,04			24.677.533	5,89
55.365	iShares EUR Covered Bond UCITS ETF (Dist)	8.546.141	2,04	Total des organismes de placement collectif		24.677.533	5,89
26.889	iShares EUR Government Bond 15-30yr UCITS ETF EUR (Dist)	6.136.877	1,47	Portefeuille de titres à la valeur de marché		426.076.453	101,76
21.557	iShares Euro Corporate Bond Interest Rate Hedged UCITS ETF (Dist)	2.067.748	0,49	Autres éléments du passif net		(7.365.010)	(1,76)
79.531	iShares Euro Government Bond 0-1yr UCITS ETF (Dist)	7.876.750	1,88	Total de l'actif net (EUR)		418.711.443	100,00
45.571	iShares Euro High Yield Corporate Bond UCITS ETF (Dist)*	4.740.751	1,13				

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

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

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
CAD	12.491.697	EUR	8.351.856	HSBC	4/6/2018	(75.562)
EUR	8.024.948	CAD	12.491.697	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(251.346)
EUR	8.339.737	CAD	12.491.697	HSBC	3/7/2018	75.473
EUR	28.568.725	GBP	25.088.957	HSBC	4/6/2018	(54.843)
EUR	2.157.323	GBP	1.898.671	Toronto	4/6/2018	(8.838)
EUR	24.144.236	GBP	21.138.689	Dominion Bank Toronto	4/6/2018	(8.838)
EUR	2.072.460	JPY	269.787.025	Dominion Bank	3/7/2018	46.808
EUR	6.538.183	JPY	863.456.009	Goldman Sachs Toronto	4/6/2018	(61.714)
EUR	2.454.502	USD	2.911.689	Dominion Bank	4/6/2018	(292.260)
EUR	4.435.005	USD	5.269.732	Citibank	4/6/2018	(44.481)
EUR	11.837.691	USD	13.947.718	Goldman Sachs	4/6/2018	(87.790)
EUR	226.799.143	USD	274.590.258	Morgan Stanley	4/6/2018	(133.063)
EUR	4.767.171	USD	5.614.458	State Street Bank & Trust Company Toronto	4/6/2018	(8.870.418)
EUR	256.357.545	USD	299.606.345	Dominion Bank Toronto	4/6/2018	(51.488)
GBP	5.848.939	EUR	6.664.694	Dominion Bank	3/7/2018	(203.549)
GBP	21.138.689	EUR	24.163.804	Morgan Stanley Toronto	4/6/2018	8.262
JPY	1.133.243.034	EUR	8.669.589	Dominion Bank	4/6/2018	(47.030)
USD	2.727.510	EUR	2.247.970	Morgan Stanley	4/6/2018	295.027
USD	299.606.345	EUR	256.952.268	Societe Generale	4/6/2018	92.938
USD	5.119	EUR	4.302	Toronto	4/6/2018	187.574
				Dominion Bank	4/6/2018	187.574
				State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	89
						(9.476.211)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	2.070.432	EUR	1.741.016	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	61.922
EUR	16.001	CHF	19.058	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(595)
						61.327
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
EUR	498.627	GBP	436.859	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	335
GBP	72.665.474	EUR	82.935.817	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(51.703)
						(51.368)
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
EUR	841.523	USD	991.672	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(9.069)
USD	82.053.592	EUR	68.962.148	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	1.418.097
						1.409.028
Total (exposition brute sous-jacente – 1.060.382.738 EUR)						(8.057.224)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Exchange Traded Funds	95,87
Organismes de placement collectif	5,89
Portefeuille de titres à la valeur de marché	101,76
Autres éléments du passif net	(1,76)
	100,00

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Australie				Allemagne suite			
6.179	Flight Centre Travel Group Ltd	288.418	0,11	12.393	Infineon Technologies AG	341.499	0,13
		288.418	0,11	33.436	Innogy SE	1.397.421	0,55
Bermudes				4.530	MAN SE	491.394	0,19
11.484	Axalta Coating Systems Ltd	357.956	0,14	29.055	RWE AG	660.988	0,26
5.039	Lazard Ltd 'A'	259.811	0,10	5.694	SAP SE	640.946	0,25
5.545	Validus Holdings Ltd	375.785	0,15	3.121	Uniper SE	96.802	0,04
8.000	XL Group Ltd	444.640	0,17			5.935.632	2,32
		1.438.192	0,56	Inde			
Canada				14.205	Infosys Ltd ADR	258.176	0,10
8.083	Aecon Group Inc	92.973	0,04			258.176	0,10
3.000	Bank of Montreal	231.566	0,09	Indonésie			
3.700	Bank of Nova Scotia/The	221.931	0,09	1.727.600	Adaro Energy Tbk PT	234.367	0,09
6.871	BCE Inc	286.658	0,11	53.600	Bank Central Asia Tbk PT	87.565	0,03
8.400	BRP Inc	399.315	0,16	774.800	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	196.279	0,08
3.000	CAE Inc	63.826	0,03	55.800	Unilever Indonesia Tbk PT	183.122	0,07
1.400	Canadian Imperial Bank of Commerce	121.800	0,05			701.333	0,27
8.200	Canadian Utilities Ltd 'A'	197.689	0,08	Île de Man			
2.804	Concordia International Corp	696	0,00	187.903	Playtech Plc	1.970.509	0,77
10.000	Great-West Lifeco Inc	252.354	0,10			1.970.509	0,77
16.600	Husky Energy Inc	237.454	0,09	Israël			
6.400	Imperial Oil Ltd	207.800	0,08	2.758	Taro Pharmaceutical Industries Ltd	321.997	0,12
13.300	Lundin Mining Corp	82.855	0,03	4.014	Wix.com Ltd	348.214	0,14
37.916	Mitel Networks Corp	417.266	0,16			670.211	0,26
6.100	Norbord Inc	257.345	0,10	Italie			
8.700	Power Corp of Canada	201.214	0,08	14.487	Banca Generali SpA	347.718	0,14
13.400	Quebecor Inc 'B'	259.125	0,10	3.102	Buzzi Unicem SpA	74.563	0,03
6.600	Rogers Communications Inc 'B'	308.856	0,12	20.343	Cerved Group SpA	210.124	0,08
2.500	Royal Bank of Canada	186.660	0,07	34.094	Enel SpA	185.832	0,07
4.000	Toronto-Dominion Bank/The	233.441	0,09	40.452	Gamenet Group SpA '144A'	367.634	0,14
		4.260.824	1,67	35.499	Prysmian SpA	983.580	0,39
Îles Caïmans						2.169.451	0,85
16.350	Alibaba Group Holding Ltd ADR	3.247.110	1,27	Japon			
18.399	Changyou.com Ltd ADR	334.126	0,13	19.100	Hakuhodo DY Holdings Inc	290.826	0,11
14.091	Global Cord Blood Corp	134.005	0,05	5.400	Japan Post Insurance Co Ltd	120.597	0,05
4.464	Herbalife Nutrition Ltd	222.128	0,09	5.300	Nippon Telegraph & Telephone Corp	249.429	0,10
43.031	iKang Healthcare Group Inc ADR	875.681	0,34	900	Shimamura Co Ltd	92.244	0,04
5.799	Momo Inc ADR	262.869	0,11			753.096	0,30
1.906	YY Inc ADR	225.480	0,09	Jersey			
		5.301.399	2,08	988	Shire Plc ADR	162.072	0,06
Chine						162.072	0,06
290.205	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'H' '144A'	226.656	0,09	Luxembourg			
		226.656	0,09	20.013	Befesa SA	952.546	0,37
Danemark						952.546	0,37
10.064	ISS A/S	342.319	0,13	Malaisie			
5.120	Novo Nordisk A/S 'B'	243.037	0,10	4.500	Kuala Lumpur Kepong Bhd	28.153	0,01
		585.356	0,23	13.400	Nestle Malaysia Bhd	498.291	0,19
France				111.200	Petronas Chemicals Group Bhd	224.915	0,09
3.300	Danone SA	253.731	0,10	159.300	Sime Darby Plantation Bhd	221.739	0,09
24.991	Vivendi SA	626.916	0,25			973.098	0,38
		880.647	0,35	Pays-Bas			
Allemagne				61.634	Altice NV 'B'	217.449	0,09
9.801	BASF SE	967.699	0,38	9.543	EXOR NV	686.933	0,27
2.989	Brenntag AG	172.982	0,07				
12.875	Covestro AG '144A'	1.165.901	0,45				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Pays-Bas suite				Etats-Unis suite			
6.018	Fiat Chrysler Automobiles NV	136.199	0,05	1.869	CNA Financial Corp	87.993	0,04
5.099	Gemalto NV	297.649	0,12	13.414	Comcast Corp 'A'	416.236	0,16
5.022	LyondellBasell Industries NV 'A'	567.938	0,22	2.549	Consolidated Edison Inc	193.928	0,08
6.750	NXP Semiconductors NV	775.980	0,30	6.809	Dell Technologies Inc 'V'	552.414	0,22
		2.682.148	1,05	3.667	DowDuPont Inc	236.045	0,09
Nouvelle-Zélande				97	Duke Energy Corp	7.456	0,00
15.085	a2 Milk Co Ltd	113.469	0,04	43	Dun & Bradstreet Corp/The	5.327	0,00
		113.469	0,04	5.477	Edgewell Personal Care Co	245.096	0,10
Norvège				3.270	EMCOR Group Inc	253.327	0,10
1.919	Otello Corp ASA	5.003	0,00	4.386	Encompass Health Corp	286.143	0,11
		5.003	0,00	38	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	5.715	0,00
Espagne				3.363	Evercore Inc 'A'	353.451	0,14
2.207	Hispania Activos Inmobiliarios SOCIMI SA (Reit)	45.258	0,02	4.662	Expeditors International of Washington Inc	351.981	0,14
		45.258	0,02	1.624	F5 Networks Inc	281.894	0,11
Suède				888	Facebook Inc 'A'	167.983	0,07
14.874	Atlas Copco AB 'A'	13.452	0,01	48.000	Fannie Mae (Pref)	302.400	0,12
8.742	Atlas Copco AB 'A'	350.455	0,14	6.126	Fortinet Inc	378.280	0,15
20.847	Haldex AB	219.095	0,08	1.330	General Cable Corp	39.701	0,02
		583.002	0,23	10.158	Gentex Corp	239.221	0,09
Suisse				20.027	GGP Inc (Reit)	410.754	0,16
10.604	Nestle SA Reg	808.129	0,32	6.788	Graco Inc	312.791	0,12
		808.129	0,32	9.259	Halliburton Co	463.043	0,18
Thaïlande				8.360	HD Supply Holdings Inc	335.403	0,13
15.400	Advanced Info Service PCL NVDR	91.707	0,03	1.566	Home Depot Inc/The	292.231	0,12
23.800	Bumrungrad Hospital PCL NVDR	143.216	0,06	354	Humana Inc	104.303	0,04
15.000	Siam Cement PCL/The NVDR	209.128	0,08	1.949	IDACORP Inc	180.127	0,07
		444.051	0,17	1.760	Ingredion Inc	199.549	0,08
Royaume-Uni				10.873	Interpublic Group of Cos Inc/The	244.642	0,10
7.693	BHP Billiton Plc ADR	351.109	0,14	6.151	KLX Inc	457.081	0,18
11.060	Liberty Global Plc 'A'	314.325	0,12	4.565	Ladder Capital Corp (Reit)	70.940	0,03
19.122	Royal Dutch Shell Plc 'A'	664.835	0,26	5.269	Live Nation Entertainment Inc	226.514	0,09
		1.330.269	0,52	66.672	Mandatory Exchangeable Trust (Pref)'144A'	14.898.458	5,83
Etats-Unis				247	ManpowerGroup Inc	22.672	0,01
1.719	Aetna Inc	304.469	0,12	2.440	MAXIMUS Inc	149.743	0,06
35.000	Akorn Inc	494.200	0,19	8.460	MDU Resources Group Inc	236.034	0,09
2.300	Albemarle Corp	215.625	0,09	451	Mettler-Toledo International Inc	249.435	0,10
451	Alphabet Inc 'A'	493.804	0,19	566	Moelis & Co 'A'	33.819	0,01
310	Amazon.com Inc	504.509	0,20	11.729	Monsanto Co	1.496.151	0,59
739	Analogic Corp	61.817	0,02	5.758	National Fuel Gas Co	303.101	0,12
3.718	Andeavor	551.826	0,22	30.000	NII Holdings Inc	71.700	0,03
1.040	Arista Networks Inc	264.566	0,10	2.927	Omnicom Group Inc	207.202	0,08
2.769	ARMO BioSciences Inc	138.450	0,05	4.558	Paratek Pharmaceuticals Inc	47.859	0,02
2.943	ASGN Inc	228.289	0,09	2.432	Phillips 66	291.840	0,11
67.995	Avaya Holdings Corp	1.517.648	0,59	2.505	Procter & Gamble Co/The	184.769	0,07
4.658	AXA Equitable Holdings Inc	98.470	0,04	328	Prudential Financial Inc	31.721	0,01
32.132	Berry Petroleum Corp	384.251	0,15	1.850	Public Service Enterprise Group Inc	97.255	0,04
51.284	Berry Petroleum Corp (Pref)	720.130	0,28	2.815	Ralph Lauren Corp	384.163	0,15
4.054	Best Buy Co Inc	278.429	0,11	1.776	Red Hat Inc	293.004	0,12
118.000	Blue Ridge Mountain Resources Inc	973.500	0,38	9.071	Rent-A-Center Inc/TX	86.537	0,03
86	BWX Technologies Inc	5.773	0,00	4.904	Robert Half International Inc	313.709	0,12
2.431	Cadence Design Systems Inc	103.634	0,04	2.913	Ross Stores Inc	231.467	0,09
34.398	Caesars Entertainment Corp	424.815	0,17	36.016	Sirius XM Holdings Inc	256.794	0,10
2.471	Cargurus Inc	82.680	0,03	968	Southern Copper Corp	48.216	0,02
1.650	Carter's Inc	183.133	0,07	2.093	Teradata Corp	83.092	0,03
2.495	Charles River Laboratories International Inc	267.664	0,11	2.444	Thor Industries Inc	222.819	0,09
480	Cigna Corp	82.723	0,03	2.977	TJX Cos Inc/The	268.555	0,11
				2.978	Tribune Media Co 'A'	106.553	0,04
				3.104	Ubiquiti Networks Inc	260.891	0,10
				3.705	UGI Corp	187.177	0,07
				6.155	Umpqua Holdings Corp	146.366	0,06
				4.576	Unum Group	173.934	0,07
				2.553	Valero Energy Corp	316.572	0,12
				5.171	Vanguard Natural Resources Inc	28.182	0,01
				2.521	Varian Medical Systems Inc	298.965	0,12
				58.311	Vistra Energy Corp	1.425.704	0,56
				2.046	VMware Inc 'A'	284.394	0,11
				11.012	Walgreens Boots Alliance Inc	691.333	0,27
				387	Waste Management Inc	32.612	0,01

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé					
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net		
Etats-Unis suite				Italie					
1.286	Waters Corp	249.111	0,10	USD 700.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5,71% 15/1/2026	636.981	0,25		
1.566	WEC Energy Group Inc	98.877	0,04			636.981	0,25		
1.492	WellCare Health Plans Inc	334.805	0,13						
5.827	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	342.628	0,13						
1.039	WW Grainger Inc	315.970	0,12						
		41.886.563	16,40	USD 415.000	Îles Marshall Scorpio Tankers Inc '144A' 2,375% 1/7/2019	401.598	0,16		
Total des actions ordinaires et privilégiées		75.425.508	29,52			401.598	0,16		
OBLIGATIONS									
Bermudes				Mexique					
USD 336.000	Oaktown Re Ltd '2017-1A M2' '144A' FRN 25/4/2027	346.080	0,13	EUR 900.000	America Movil SAB de CV RegS 28/5/2020 (Zero Coupon)	1.035.977	0,40		
USD 1.003.000	Weatherford International Ltd 5,875% 1/7/2021	992.369	0,39			1.035.977	0,40		
		1.338.449	0,52	Pays-Bas					
Brésil				EUR 300.000	Bayer Capital Corp BV RegS 5,625% 22/11/2019	390.625	0,15		
EUR 297.000	Telemar Norte Leste SA RegS (Defaulted) 5,125% 15/12/2017	21.204	0,01	USD 748.000	Oi Brasil Holdings Cooperatief UA RegS (Defaulted) 5,75% 10/2/2022	52.831	0,02		
USD 1.249.000	Telemar Norte Leste SA RegS (Defaulted) 5,50% 23/10/2020	600.145	0,23	EUR 246.000	Portugal Telecom International Finance BV (Defaulted) 4,375% 24/3/2049	20.546	0,01		
		621.349	0,24	EUR 123.000	Portugal Telecom International Finance BV RegS (Defaulted) 4,625% 8/5/2020	15.455	0,01		
Îles Caïmans						479.457	0,19		
USD 500.000	AMMC CLO XII Ltd '2013-12A ER' '144A' FRN 10/11/2030	500.637	0,20	Porto Rico					
USD 862.000	Atlas Senior Loan Fund V Ltd '2014-1A ER2' '144A' FRN 16/7/2029	879.770	0,34	USD 175.000	Government Development Bank for Puerto Rico 'A' 4,375% 1/2/2019	70.437	0,03		
USD 2.844.000	Goldentree Loan Management US Clo 2 Ltd '2017-2A E' '144A' FRN 28/11/2030	2.766.548	1,08	USD 149.000	Government Development Bank for Puerto Rico 'A' 5,50% 1/8/2020	59.973	0,02		
USD 400.000	GPMT Ltd '2018-FL1 D' '144A' FRN 21/11/2035	400.126	0,16	USD 210.000	Government Development Bank for Puerto Rico 'H' 5,00% 1/8/2023	84.525	0,03		
USD 1.985.000	HSH N Funding II Via Banque de Luxembourg RegS (Flat Trading) 7,25% (Perpetual)	946.785	0,37	USD 130.000	Government Development Bank for Puerto Rico 'H' 5,20% 1/8/2026	52.325	0,02		
USD 1.500.000	Longfellow Place CLO Ltd '2013-1A CRR' '144A' FRN 15/4/2029	1.510.923	0,59	USD 1.700.000	Puerto Rico Electric Power Authority 5,00% 1/7/2032	675.750	0,27		
USD 1.075.000	Parallel Ltd '2015-1A E' '144A' FRN 20/7/2027	1.067.465	0,42	USD 1.250.000	Puerto Rico Electric Power Authority 6,05% 1/7/2032	462.500	0,18		
USD 227.597	Resource Capital Corp Ltd '2017-CRE5 B' '144A' FRN 15/7/2034	227.426	0,09			1.405.510	0,55		
USD 5.419.000	Sound Point CLO XVI Ltd '2017-2X D' RegS FRN 25/7/2030	5.483.548	2,15	Supranational					
USD 741.000	Transocean Inc '144A' 7,50% 15/1/2026	752.115	0,29	USD 1.000.000	Eagle Intermediate Global Holding BV/Ruyi US Finance LLC '144A' 7,50% 1/5/2025	1.022.500	0,40		
		14.535.343	5,69	USD 312.000	Hexion Inc Via Hexion Nova Scotia Finance ULC 9,00% 15/11/2020	259.740	0,10		
Chypre						1.282.240	0,50		
GBP 1.000.000	Volcan Holdings II Plc RegS 3,875% 10/10/2020	1.670.843	0,66	Royaume-Uni					
GBP 500.000	Volcan Holdings Plc RegS 4,125% 11/4/2020	902.381	0,35	USD 1.080.000	Algeco Global Finance Plc '144A' 8,00% 15/2/2023	1.085.400	0,43		
		2.573.224	1,01	GBP 2.800.000	Vodafone Group Plc RegS 2,00% 25/2/2019	3.734.656	1,46		
Grèce						4.820.056	1,89		
EUR 168.499	Hellenic Republic Government Bond RegS 3,50% 30/1/2023	193.509	0,07	Etats-Unis					
EUR 189.935	Hellenic Republic Government Bond RegS 4,00% 30/1/2037	193.806	0,08	USD 741.000	Albertsons Cos LLC Via Safeway Inc Via New Albertson's Inc Via Albertson's LLC 6,625% 15/6/2024	702.098	0,27		
		387.315	0,15	USD 1.822.759	Alternative Loan Trust '2006-21CB A5' FRN 25/7/2036	1.232.355	0,48		

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
USD 1.500.000	Ashland LLC 6,875% 15/5/2043	1.552.500	0,61	USD 100.000	Prosper Marketplace Issuance Trust Series '2018-1A D' '144A' 5,70% 17/6/2024	99.566	0,04
USD 1.500.000	Avantor Inc '144A' 9,00% 1/10/2025	1.550.625	0,61	USD 202.000	PRPM LLC '2018 1A A2' '144A' FRN 25/4/2023	200.949	0,08
USD 2.919.000	Avaya Inc 7,00% 1/4/2019***	—	0,00	USD 125.000	RCO V Mortgage LLC '2018-1 A2' (Step-up coupon) '144A' FRN 25/5/2023	125.000	0,05
USD 170.000	Avaya Inc 9,00% 1/4/2019**	—	0,00	USD 797.000	Rite Aid Corp '144A' 6,125% 1/4/2023	817.921	0,32
USD 741.000	Berry Petroleum Co LLC '144A' 7,00% 15/2/2026	755.820	0,30	USD 667.000	Starwood Waypoint Homes Trust '2017-1 E' '144A' FRN 17/1/2035	675.485	0,26
USD 3.050.000	BX Trust '2017-SLCT F' '144A' FRN 15/7/2034	3.080.872	1,21	USD 2.465.000	Texas Competitive Electric Holdings Co LLC Via TCEH Finance Inc 11,50% 1/10/2020**	49.300	0,02
USD 377.000	Cheniere Energy Inc 4,25% 15/3/2045	300.660	0,12	USD 2.000.000	United States Treasury Bill 7/6/2018 (Zero Coupon)	1.999.502	0,78
USD 900.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc 7,625% 15/3/2020	900.000	0,35	USD 9.000.000	United States Treasury Bill 14/6/2018 (Zero Coupon)	8.995.056	3,52
USD 741.000	Cleveland-Cliffs Inc 5,75% 1/3/2025	709.508	0,28	USD 2.500.000	United States Treasury Bill 21/6/2018 (Zero Coupon)	2.497.689	0,98
USD 125.000	DBJPM Mortgage Trust '2017-C6 D' '144A' FRN 10/6/2050	103.011	0,04	USD 3.000.000	United States Treasury Bill 28/6/2018 (Zero Coupon)	2.996.124	1,17
USD 1.500.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2016-C04 1M2' FRN 25/1/2029	1.698.175	0,66	USD 8.500.000	United States Treasury Bill 19/7/2018 (Zero Coupon)	8.479.968	3,32
USD 1.701.905	FREMF Mortgage Trust '2014-KS02 B' '144A' FRN 25/8/2023	1.778.547	0,70	USD 500.000	United States Treasury Bill 16/8/2018 (Zero Coupon)	498.051	0,19
USD 2.877.490	FREMF Mortgage Trust '2016-KS05 B' '144A' FRN 25/1/2023	2.881.904	1,13	USD 4.000.000	United States Treasury Bill 30/8/2018 (Zero Coupon)	3.981.175	1,56
USD 741.000	Guitar Center Escrow Issuer Inc '144A' 9,50% 15/10/2021	716.918	0,28	USD 4.000.000	United States Treasury Bill 20/9/2018 (Zero Coupon)	3.976.628	1,56
USD 608.000	iHeartCommunications Inc (Defaulted) 11,25% 1/3/2021	481.840	0,19	USD 4.000.000	United States Treasury Bill 27/9/2018 (Zero Coupon)	3.975.204	1,56
USD 45.000	iHeartCommunications Inc (Defaulted) 9,00% 15/9/2022	35.550	0,01	USD 4.000.000	United States Treasury Bill 4/10/2018 (Zero Coupon)	3.973.299	1,55
USD 2.596.000	iHeartCommunications Inc (Defaulted) 10,625% 15/3/2023	2.050.840	0,80	USD 794.000	Uniti Group LP Via Uniti Group Finance Inc Via CSL Capital LLC '144A' 6,00% 15/4/2023	778.120	0,30
USD 861.000	Invitation Homes Trust '2015-SFR3 F' '144A' FRN 17/8/2032	867.652	0,34	USD 1.222.000	Uniti Group LP Via Uniti Group Finance Inc Via CSL Capital LLC 8,25% 15/10/2023	1.185.340	0,46
USD 740.000	Jefferies Finance LLC Via JFIN Co-Issuer Corp '144A' 7,25% 15/8/2024	732.600	0,29	USD 1.450.000	Veritas US Inc Via Veritas Bermuda Ltd '144A' 10,50% 1/2/2024	1.243.375	0,49
USD 741.000	Jones Energy Holdings LLC Via Jones Energy Finance Corp '144A' 9,25% 15/3/2023	728.032	0,28	USD 731.000	Werner FinCo LP Via Werner FinCo Inc '144A' 8,75% 15/7/2025	738.310	0,29
USD 1.422.471	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-BXH E' '144A' FRN 15/4/2027	1.425.142	0,56			83.759.829	32,79
USD 962.000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 10,00% 15/7/2022	1.019.720	0,40	Venezuela			
USD 277.000	Leonardo US Holdings Inc '144A' 7,375% 15/7/2039	328.245	0,13	USD 1.271.000	Venezuela Government International Bond RegS (Defaulted) 9,00% 7/5/2023	366.366	0,14
USD 128.000	Leonardo US Holdings Inc '144A' 6,25% 15/1/2040	139.520	0,05			366.366	0,14
USD 213.000	Leonardo US Holdings Inc RegS 7,375% 15/7/2039	252.405	0,10	Total des obligations		113.643.694	44,48
USD 1.986.053	Liberty Interactive LLC 4,00% 15/11/2029	1.370.814	0,54	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		189.069.202	74,00
USD 1.000.000	McDermott Technology Americas Inc Via McDermott Technology US Inc '144A' 10,625% 1/5/2024	1.047.500	0,41	ACTIONS ORDINAIRES/DROITS			
USD 1.000.000	Microsoft Corp 1,30% 3/11/2018	995.861	0,39	Pays-Bas			
USD 3.904.000	National Collegiate Student Loan Trust '2006-1 A5' FRN 25/3/2033	3.603.592	1,41	61.634	Altice NV (Right)***	418.166	0,16
USD 3.521.000	National Collegiate Student Loan Trust '2007-1 A4' FRN 25/10/2033	3.083.283	1,21			418.166	0,16
USD 400.000	National Collegiate Student Loan Trust '2007-2 A4' FRN 25/1/2033	348.178	0,14				

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

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

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				Organismes de placement collectif			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis				Irlande			
20.140	PaperWorks Industries Holding***	463.220	0,18	5.714.814	Institutional Cash Series Plc - Institutional US Dollar Liquidity Fund Premium Dis ¹		
47.381	Vanguard Natural Resources Inc**	245.315	0,10			5.714.814	2,24
		708.535	0,28			5.714.814	2,24
Total des actions ordinaires/droits		1.126.701	0,44	Total des organismes de placement collectif		5.714.814	2,24
OBLIGATIONS				Portefeuille de titres à la valeur de marché		197.842.865	77,44
Etats-Unis				Autres éléments de l'actif net		57.626.657	22,56
USD 1.966.120	Applebee's Funding LLC Via IHOP Funding LLC '2014-1 A2' '144A' 4,277% 5/9/2044***	1.932.148	0,76	Total de l'actif net (USD)		255.469.522	100,00
USD 800.000	Berry Petroleum Corp 6,75% 1/11/2020**	—	0,00				
USD 1.280.000	Peabody Energy Corp 6,25% 15/11/2021***	—	0,00				
		1.932.148	0,76				
Total des obligations		1.932.148	0,76				
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		3.058.849	1,20				

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

*** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Australie				Autriche			
4.072	AGL Energy Ltd	Bank of America		(2.792)	Andritz AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	602			Merrill Lynch	5.340
936	Altium Ltd	Bank of America		8.656	BAWAG Group AG '144A'	JP Morgan	(17.215)
		Merrill Lynch	202	(920)	DO & CO AG	Bank of America	
14	Ansell Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	1.248
		Merrill Lynch	2	(8.066)	Erste Group Bank AG	JP Morgan	40.944
136.950	AusNet Services	Bank of America		7.204	FACC AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.745)			Merrill Lynch	(27.939)
(179)	Australia & New Zealand	Bank of America		(1.746)	Raiffeisen Bank	JP Morgan	4.998
	Banking Group Ltd	Merrill Lynch	84		International AG	Bank of America	
(7.801)	Bapcor Ltd	Bank of America		335	Verbund AG	Merrill Lynch	71
		Merrill Lynch	(4.623)			Bank of America	
(3.174)	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Bank of America		(11.066)	Zumtobel Group AG	Merrill Lynch	5.415
		Merrill Lynch	(366)				12.862
(9.766)	BHP Billiton Ltd	Bank of America					
		Merrill Lynch	2.122				
4.657	BHP Billiton Ltd	Bank of America					
		Merrill Lynch	(381)				
(1)	carsales.com Ltd*	Bank of America		(15.942)	Ageas	JP Morgan	34.912
		Merrill Lynch	–	(1.349)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	Bank of America	
4.118	Coca-Cola Amatil Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	1.907
		Merrill Lynch	776	(346)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	JP Morgan	859
(206)	Cochlear Ltd	Bank of America		(345)	Biocartis NV	Bank of America	
		Merrill Lynch	(206)			Merrill Lynch	121
(6.541)	Corporate Travel	Bank of America		767	Cie d'Entreprises CFE	Bank of America	
	Management Ltd	Merrill Lynch	(3.494)			Merrill Lynch	3.038
11.982	Crown Resorts Ltd	Bank of America		2.239	Greenyard NV	Bank of America	
		Merrill Lynch	2.527			Merrill Lynch	(7.234)
(3.400)	DuluxGroup Ltd	Bank of America		(5.074)	Ion Beam Applications	Bank of America	
		Merrill Lynch	480			Merrill Lynch	(35.875)
6.249	Harvey Norman Holdings Ltd	Bank of America		(10.886)	KBC Group NV	JP Morgan	61.632
		Merrill Lynch	299	5.805	Proximus SADP	Bank of America	
(2.693)	IOOF Holdings Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(29.396)
		Merrill Lynch	880	(3.674)	Proximus SADP	JP Morgan	7.919
(7.214)	James Hardie Industries	Bank of America		1.944	Recticel SA	Bank of America	
	Plc -CDI	Merrill Lynch	4.806			Merrill Lynch	(412)
(8.060)	Link Administration	Bank of America		(1.654)	Solvay SA	JP Morgan	(1.833)
	Holdings Ltd	Merrill Lynch	8.171	(3.165)	Solvay SA	Morgan Stanley	3.503
7.613	Mineral Resources Ltd	Bank of America		501	Tessenderlo Group SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.694)			Merrill Lynch	(311)
(21.579)	NEXTDC Ltd	Bank of America		1.713	UCB SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	(7.216)			Merrill Lynch	5.550
(14.766)	Nufarm Ltd/Australia	Bank of America					44.380
		Merrill Lynch	(13.707)				
(184)	Perpetual Ltd	Bank of America					
		Merrill Lynch	167				
25.564	Platinum Asset	Bank of America		(31.400)	B2W Cia Digital	Bank of America	
	Management Ltd	Merrill Lynch	7.939			Merrill Lynch	34.364
19.855	Qantas Airways Ltd	Bank of America		(85)	Banco Bradesco SA (Pref)*	Bank of America	
		Merrill Lynch	8.723			Merrill Lynch	–
50.978	Qantas Airways Ltd	Bank of America		(46.700)	BRF SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.310			Merrill Lynch	31.169
(399)	Rio Tinto Ltd	Bank of America		(12.100)	Cia Siderurgica Nacional SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	211			Merrill Lynch	(5)
110.892	South32 Ltd	Bank of America		(72)	Cielo SA*	Bank of America	
		Merrill Lynch	(17.650)			Merrill Lynch	–
20.654	Super Retail Group Ltd	Bank of America		7.900	CVC Brasil Operadora e	Bank of America	
		Merrill Lynch	16.702		Agencia de Viagens SA	Merrill Lynch	22
(12.251)	TPG Telecom Ltd	Bank of America		800	Hypera SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.011			Merrill Lynch	1
(3)	Webjet Ltd	Bank of America		(14.600)	Localiza Rent a Car SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2)			Merrill Lynch	29.314
11.308	Westfield Corp (Reit)	Morgan Stanley	(158)	3.800	Magazine Luiza SA	Bank of America	
(1)	Westpac Banking Corp	Bank of America				Merrill Lynch	22
		Merrill Lynch	1	(22.500)	Natura Cosmeticos SA	Bank of America	
10.767	Woolworths Group Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	12.195
		Merrill Lynch	(557)	(1.700)	Raia Drogasil SA	Bank of America	
(3.709)	Xero Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(6)
		Merrill Lynch	(6.903)	(57.700)	Rumo SA	Bank of America	
			2.313			Merrill Lynch	24.130
							131.206
				Brésil			

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

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

			Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Canada				Finlande			
100	Constellation Software Inc/Canada	Bank of America Merrill Lynch	7.671	(2.016)	Ahlistrom-Munksjo OYJ	Bank of America Merrill Lynch	1.456
(26)	Detour Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3)	(10.012)	Caverion OYJ	Bank of America Merrill Lynch	(3.052)
1.200	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	926	(3.137)	Cramo OYJ	Bank of America Merrill Lynch	2.760
8.700	Enerplus Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.550	3.053	DNA OYJ	Bank of America Merrill Lynch	416
(7.800)	First Quantum Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.747)	(3.352)	Elisa OYJ	JP Morgan	(5.194)
2.400	Methanex Corp	Bank of America Merrill Lynch	22.918	9.363	Finnair OYJ	Bank of America Merrill Lynch	(7.603)
(2.500)	Shopify Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7.793)	(10.597)	Fortum OYJ	JP Morgan	(8.026)
(2.100)	SNC-Lavalin Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	292	10.896	Fortum OYJ	Bank of America Merrill Lynch	(4.746)
28	Suncor Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	53	(2.813)	Kone OYJ 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(480)
200	West Fraser Timber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.096	1.337	Neste OYJ	Bank of America Merrill Lynch	544
(3.900)	Whitecap Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(618)	46.400	Nokia OYJ	Credit Suisse	(2.487)
			25.345	16.231	Nokia OYJ	JP Morgan	(6.241)
				(10.694)	Oriola OYJ 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1.994)
				(817)	Orion OYJ 'B'	Bank of America Merrill Lynch	176
				1.882	Orion OYJ 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(666)
				8.513	Raisio OYJ 'V'	Bank of America Merrill Lynch	893
				9.341	Rovio Entertainment OYJ '144A'	Bank of America Merrill Lynch	6.577
				(5.288)	Sampo OYJ 'A'	JP Morgan	12.138
				5.552	Stora Enso OYJ 'R'	Bank of America Merrill Lynch	(1.058)
				(1)	Terveystalo OYJ '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(2)
				1	Tokmanni Group Corp*	Bank of America Merrill Lynch	-
				7.083	UPM-Kymmene OYJ	Bank of America Merrill Lynch	(2.796)
							(19.385)
Danemark				France			
(920)	ALK-Abello A/S	Bank of America Merrill Lynch	(35.256)	455	ABC arbitrage	Bank of America Merrill Lynch	(49)
(11.798)	Ambu A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	7.201	779	Aeroports de Paris	Morgan Stanley	(1.264)
(5.186)	Ambu A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(17.636)	(2.626)	Air Liquide SA	JP Morgan	6.731
(7)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1.284	(1.840)	Airbus SE	JP Morgan	5.017
2.513	Carlsberg A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(7.349)	22.919	ALD SA '144A'	Morgan Stanley	(31.778)
2.781	Coloplast A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1.389	(7.688)	ALD SA '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.254)
(4.101)	D/S Norden A/S	Bank of America Merrill Lynch	(7.278)	(9.468)	Altran Technologies SA	JP Morgan	16.082
1.024	Danske Bank A/S	Credit Suisse	(817)	2.767	Arkema SA	Morgan Stanley	(19.989)
19.183	Danske Bank A/S	JP Morgan	(15.052)	(158)	Arkema SA	JP Morgan	405
3.828	DSV A/S	Bank of America Merrill Lynch	3.556	51.205	Aroundtown SA	Morgan Stanley	61.750
1.267	Genmab A/S	Bank of America Merrill Lynch	(59.883)	14.710	Atos SE	JP Morgan	62.983
917	H Lundbeck A/S	Bank of America Merrill Lynch	1.965	67.879	AXA SA	JP Morgan	(82.780)
6.053	ISS A/S	Bank of America Merrill Lynch	(8.483)	8.919	Beneteau SA	Bank of America Merrill Lynch	(1.455)
6.116	Novo Nordisk A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(4.045)	5.265	BNP Paribas SA	Morgan Stanley	(4.770)
(1.660)	Novo Nordisk A/S 'B'	JP Morgan	743	11.457	BNP Paribas SA	Credit Suisse	(100.936)
4.185	Novozymes A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	22.666	38.577	BNP Paribas SA	JP Morgan	(364.240)
355	Per Aarsleff Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	(480)	(743)	Capgemini SE	JP Morgan	1.712
586	Rockwool International A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	33.873	(11.836)	Carrefour SA	Morgan Stanley	13.722
(3.628)	Zealand Pharma A/S	Bank of America Merrill Lynch	(1.737)	(1.028)	Collectis SA	Bank of America Merrill Lynch	(2.276)
			(85.339)	595.453	CGG SA	Credit Suisse	115.863
				(35.883)	CGG SA	Bank of America Merrill Lynch	4.386
				342	Christian Dior SE	Bank of America Merrill Lynch	6.515

* Les investissements inférieurs à 0.5 USD ont été arrondis à zéro.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
France suite				France suite			
8.433	Cie de Saint-Gobain	Credit Suisse	(4.734)	(297)	Poxel SA	Bank of America	
1.304	Cie de Saint-Gobain	JP Morgan	(1.407)			Merrill Lynch	(118)
(2.795)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	JP Morgan	20.842	3.054	Publicis Groupe SA	JP Morgan	(8.425)
(8.854)	CNP Assurances	JP Morgan	7.052	(3.228)	Publicis Groupe SA	Morgan Stanley	8.651
23.886	Credit Agricole SA	Morgan Stanley	(3.854)	15.000	Publicis Groupe SA	Credit Suisse	(4.628)
49.294	Credit Agricole SA	JP Morgan	(75.006)	6.211	Renault SA	Credit Suisse	(44.940)
2.795	Danone SA	JP Morgan	2.134	1.736	Renault SA	JP Morgan	(9.055)
7.900	Danone SA	Credit Suisse	5.707	2.300	Safran SA	Credit Suisse	26.664
8.547	Danone SA	Morgan Stanley	(1.268)	541	Safran SA	JP Morgan	2.364
(4.176)	DBV Technologies SA	Bank of America		(1.380)	Sanofi	JP Morgan	(241)
		Merrill Lynch	(9.031)	3.146	Schneider Electric SE	JP Morgan	(15.249)
20.546	Derichebourg SA	Bank of America		14.684	Societe Generale SA	JP Morgan	(72.700)
		Merrill Lynch	(50.871)	(65)	Soitec	Bank of America	
(971)	Direct Energie	Bank of America				Merrill Lynch	(52)
		Merrill Lynch	(8.593)	309	STMicroelectronics NV	Bank of America	
382	Eiffage SA	Bank of America				Merrill Lynch	82
		Merrill Lynch	(846)	(3.344)	Tarkett SA	Bank of America	
49.888	Electricite de France SA	Morgan Stanley	(61.148)			Merrill Lynch	2.918
(31.792)	Engie SA	Morgan Stanley	25.374	(68.690)	Technicolor SA Reg	Bank of America	
7.196	Engie SA	Bank of America				Merrill Lynch	(6.556)
		Merrill Lynch	(9.290)	(1.265)	TechnipFMC Plc	JP Morgan	88
(9.786)	Engie SA	JP Morgan	12.827	4.413	Thales SA	JP Morgan	(5.656)
1.110	Eramet	Bank of America		4.162	Valeo SA	JP Morgan	(9.150)
		Merrill Lynch	8.665	(33.864)	Vallourec SA	Morgan Stanley	28.567
(4.015)	Essilor International Cie Generale d'Optique SA	JP Morgan	(8.654)	238	Vilmorin & Cie SA	Bank of America	
1.748	Euronext NV '144A'	Bank of America				Merrill Lynch	(333)
		Merrill Lynch	1.957	6.041	Vinci SA	Morgan Stanley	(22.524)
(12.982)	Europcar Groupe SA '144A'	Bank of America		576	Vinci SA	JP Morgan	(786)
		Merrill Lynch	6.067	4.600	Vinci SA	Credit Suisse	322
2.351	Faurecia SA	Bank of America		31.705	Vivendi SA	JP Morgan	(51.793)
		Merrill Lynch	15.071	1.400	Vivendi SA	Credit Suisse	(2.610)
750	Gaztransport Et Technigaz SA	Bank of America		275	Worldline SA '144A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.127)			Merrill Lynch	75
4.425	Gecina SA (Reit)	Morgan Stanley	—				(583.927)
(7.074)	Genfit	Bank of America		Allemagne			
		Merrill Lynch	(4.616)	651	adidas AG	JP Morgan	1.024
(934)	Iliad SA	Bank of America		9.308	AIXTRON SE	Bank of America	
		Merrill Lynch	20.019			Merrill Lynch	9.974
(133)	JCDecaux SA	JP Morgan	409	(2.380)	Allianz SE Reg	JP Morgan	60.597
(5.669)	JCDecaux SA	Morgan Stanley	1.850	28.855	Aroundtown SA	Morgan Stanley	24.711
141	Kaufman & Broad SA	Bank of America		5.774	BASF SE	JP Morgan	(14.621)
		Merrill Lynch	(572)	143	Basler AG	Bank of America	
96	Kering SA	JP Morgan	492			Merrill Lynch	1.615
182	Kering SA	Bank of America		3.961	Bauer AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	618			Merrill Lynch	(12.922)
(6.316)	Klepierre SA (Reit)	Morgan Stanley	6.844	7.500	Bayer AG Reg	Credit Suisse	27.323
(2.246)	L'Oreal SA	JP Morgan	(18.842)	3.032	Bayer AG Reg	JP Morgan	(5.005)
129	Lectra	Bank of America		(4.823)	Bayerische Motoren Werke AG	JP Morgan	35.740
		Merrill Lynch	(203)	45	Befesa SA	Bank of America	
6.147	Legrand SA	JP Morgan	(4.441)			Merrill Lynch	(52)
421	LNA Sante SA	Bank of America		(235)	Beiersdorf AG	JP Morgan	(416)
		Merrill Lynch	49	125	Cancom SE	Bank of America	
(773)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	JP Morgan	(7.070)			Merrill Lynch	275
(9)	Marie Brizard Wine & Spirits SA	Bank of America		1.533	Continental AG	JP Morgan	(10.503)
		Merrill Lynch	20	4.220	Covestro AG '144A'	JP Morgan	5.900
2	MGI Coutier	Bank of America		(4.751)	Daimler AG Reg	JP Morgan	27.623
		Merrill Lynch	(1)	(2.363)	Daimler AG Reg	Bank of America	
(28.972)	Natixis SA	JP Morgan	21.914			Merrill Lynch	9.554
(26.410)	Natixis SA	Bank of America		(1.845)	Delivery Hero AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	27.763			Merrill Lynch	1.596
(19.349)	Orange SA	JP Morgan	220	(21.258)	Deutsche Bank AG Reg	Bank of America	
(4.684)	Parrot SA	Bank of America				Merrill Lynch	65.992
		Merrill Lynch	5.239	(6.835)	Deutsche Bank AG Reg	Bank of America	
4.304	Peugeot SA	JP Morgan	(1.053)			Merrill Lynch	11.794
6.399	Peugeot SA	Bank of America		(2.762)	Deutsche Boerse AG	Morgan Stanley	(11.746)
		Merrill Lynch	(1.723)	7.912	Deutsche Lufthansa AG Reg	Bank of America	
						Merrill Lynch	(8.481)
				(62.077)	Deutsche Telekom AG Reg	JP Morgan	86.071

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

			Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Allemagne suite				Allemagne suite			
4.326	Deutz AG	Bank of America		2.611	Volkswagen AG (Pref)	Credit Suisse	(37.297)
		Merrill Lynch	(5.091)	(1.744)	Voltabox AG	Bank of America	
(78)	Diebold Nixdorf AG	Bank of America				Merrill Lynch	(2.398)
		Merrill Lynch	18	(887)	Vossloh AG	Bank of America	
671	Draegerwerk AG & Co KGaA (Pref)	Bank of America				Merrill Lynch	930
		Merrill Lynch	(951)	853	Wacker Chemie AG	Bank of America	
(15.271)	E.ON SE	Bank of America				Merrill Lynch	(11.656)
		Merrill Lynch	142	(2.170)	Wirecard AG	Morgan Stanley	(15.550)
(2.779)	Evonik Industries AG	JP Morgan	3.702	960	Wirecard AG	Bank of America	
(1)	Ferratum OYJ	Bank of America				Merrill Lynch	5.717
		Merrill Lynch	4	926	Zeal Network SE	Bank of America	
65	First Sensor AG	Bank of America				Merrill Lynch	323
		Merrill Lynch	48	(717)	zooplus AG	Bank of America	
(1.254)	H&R GmbH & Co KGaA	Bank of America				Merrill Lynch	5.180
		Merrill Lynch	1.490				291.329
7.268	Hamburger Hafen und Logistik AG	Bank of America					
		Merrill Lynch	8.214				
(2.654)	Hapag-Lloyd AG '144A'	Bank of America					
		Merrill Lynch	(2.969)	58.000	3SBio Inc '144A'	Bank of America	
(2.340)	Hella GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	4.499			Merrill Lynch	53.576
(1.357)	Hugo Boss AG	Morgan Stanley	1.012	64.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H'	Bank of America	
8	Isra Vision AG	Bank of America				Merrill Lynch	(3.262)
		Merrill Lynch	(34)	(24.000)	Air China Ltd 'H'	Bank of America	
(11.444)	Kloeckner & Co SE	Bank of America				Merrill Lynch	4.008
		Merrill Lynch	(2.800)	(218.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	Bank of America	
(23)	KWS Saat SE	Bank of America				Merrill Lynch	(89.436)
		Merrill Lynch	(89)	134.000	Angang Steel Co Ltd 'H'	Bank of America	
(2)	Manz AG	Bank of America				Merrill Lynch	(12.634)
		Merrill Lynch	(2)	27.500	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	Bank of America	
(7.546)	MLP SE	Bank of America				Merrill Lynch	(4.555)
		Merrill Lynch	(4.306)	(2.200)	ASM Pacific Technology Ltd	Bank of America	
(2.401)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	JP Morgan	35.437			Merrill Lynch	322
1.537	OHB SE	Bank of America		(254.000)	AviChina Industry & Technology Co Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.686)			Merrill Lynch	(8.090)
(2.228)	OSRAM Licht AG	Bank of America		138.500	BAIC Motor Corp Ltd 'H' '144A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	6.985			Merrill Lynch	(14)
(4.107)	OSRAM Licht AG	Morgan Stanley	14.930	(228.000)	BBMG Corp 'H'	Bank of America	
2.701	ProSiebenSat.1 Media SE	Bank of America				Merrill Lynch	4.938
		Merrill Lynch	(9.671)	(112.000)	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	Bank of America	
3.382	ProSiebenSat.1 Media SE	Bank of America				Merrill Lynch	(11.987)
		Merrill Lynch	(18.007)	(2.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Bank of America	
4.008	PVA TePla AG	Bank of America				Merrill Lynch	(78)
		Merrill Lynch	(5.604)	(116.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Bank of America	
17.818	RWE AG	JP Morgan	(6.800)			Merrill Lynch	(626)
4.600	SAP SE	Credit Suisse	13.989	(76.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Bank of America	
801	SAP SE	JP Morgan	93			Merrill Lynch	(4.842)
9.768	Schaeffler AG (Pref)	Bank of America		(19.000)	BYD Co Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(854)			Merrill Lynch	10.288
(1.404)	Siemens AG Reg	Bank of America		(74.000)	Cathay Pacific Airways Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(10.862)			Merrill Lynch	(1.092)
(1.259)	Siemens AG Reg	Morgan Stanley	8.097	(311.000)	CGN Power Co Ltd 'H' '144A'	Bank of America	
103	Sixt SE	Bank of America				Merrill Lynch	(3.170)
		Merrill Lynch	(19)	(173.000)	China Coal Energy Co Ltd 'H'	Bank of America	
(12)	SLM Solutions Group AG	Bank of America				Merrill Lynch	(832)
		Merrill Lynch	8	(26.000)	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H'	Bank of America	
2.940	SMA Solar Technology AG	Bank of America				Merrill Lynch	994
		Merrill Lynch	1.503	(191.092)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Bank of America	
(7.093)	thyssenkrupp AG	Morgan Stanley	6.198			Merrill Lynch	5.937
2.067	Tom Tailor Holding SE	Bank of America		795	China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(765)			Merrill Lynch	4
(309)	Vapiano SE '144A'	Bank of America		(15.800)	China Literature Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	450			Merrill Lynch	(19.024)
(52)	Varta AG	Bank of America		42.000	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(38)			Merrill Lynch	(12.308)
685	Volkswagen AG (Pref)	JP Morgan	(8.866)	36.000	China Molybdenum Co Ltd 'H'	Bank of America	
(1.111)	Volkswagen AG (Pref)	Bank of America				Merrill Lynch	(4.633)
		Merrill Lynch	19.632	34.000	China Oriental Group Co Ltd	Bank of America	
						Merrill Lynch	(49)
				10.400	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	Bank of America	
						Merrill Lynch	(1.391)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
18.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Bank of America Merrill Lynch	1.030	300.000	Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(3.822)
(14.000)	China Resources Beer Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14.091)	43.000	Melco International Development Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.931)
136.000	China Resources Cement Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15.942	(16.400)	MGM China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.298)
(7.000)	China Resources Phoenix Healthcare Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	232	64.000	MMG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.712)
72.165	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	9.562	43.000	MTR Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.083)
(100.000)	China State Construction International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.491	14.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(1.159)
126.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(1.275)	27.000	Power Assets Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16.480)
198	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10	(13.000)	Power Assets Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.460
69.500	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.224	(6.900)	Samsonite International SA	Bank of America Merrill Lynch	7.736
(18.000)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.651	(101.000)	Semiconductor Manufacturing International Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.514
27.500	CK Infrastructure Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13.104)	(342.000)	Shanghai Electric Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(6.036)
25.500	CLP Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	205	122.000	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.865
5.000	CNOOC Ltd	Bank of America Merrill Lynch	218	(12.000)	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(505)
(170.500)	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(6.498)	(5.600)	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(1.249)
(5.000)	CRRC Corp Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(19)	105.500	Sinotruk Hong Kong Ltd	Bank of America Merrill Lynch	24.733
167.000	Dongyue Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12.341	(32.000)	Skyworth Digital Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(644)
40.554	Genscript Biotech Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.692	(16.000)	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(13.658)
(140.500)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	10.383	(1.000)	Value Partners Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	60
32.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(4.893)	118.074	Weichai Power Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	20.150
4.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	5.453	119.000	WH Group Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(25.017)
(236.000)	Guotai Junan International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.774	37.500	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	13.836
(5)	Haitong International Securities Group Ltd*	Bank of America Merrill Lynch	—	(56.000)	Zhaojin Mining Industry Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(2.640)
(11.600)	Haitong Securities Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	1.448	20.000	Zhejiang Expressway Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(131)
3.000	Hang Seng Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.014)	23.500	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.560
(200)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)	(23.700)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	7.952
120.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.876	(114.200)	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(2.619)
(12.000)	IGG Inc	Bank of America Merrill Lynch	(550)				(118.609)
186.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(11.375)	Irlande			
11.500	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12.528)	(32.711)	AIB Group Plc	JP Morgan	8.280
89.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.268)	(2)	Glanbia Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
(368.000)	Lenovo Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19.224)	(33.294)	Glenveagh Properties Plc '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(290)
244.000	Li & Fung Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(39.150)	(3.761)	Permanent TSB Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
2.700	Livzon Pharmaceutical Group Inc 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(120)	1.802	Smurfit Kappa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.086)
144.000	Lonking Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6.055				5.891

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

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Israël				Italie suite			
(107)	Delek Automotive Systems Ltd	Bank of America		(20.343)	Poste Italiane SpA '144A'	JP Morgan	14.635
(1.309)	Elbit Systems Ltd	Merrill Lynch	109	30.536	Reno de Medici SpA	Bank of America	
23	IDI Insurance Co Ltd	Merrill Lynch	(634)	1.239	SAES Getters SpA	Merrill Lynch	(835)
1	Jerusalem Oil Exploration	Bank of America	43	(8.372)	Safilo Group SpA	Bank of America	(4.071)
430	Nova Measuring Instruments Ltd	Merrill Lynch	(3)	(10.963)	Saipem SpA	Merrill Lynch	(585)
184.121	Oil Refineries Ltd	JP Morgan	560	(10.581)	Saipem SpA	JP Morgan	(5.608)
(7.719)	Shikun & Binui Ltd	Bank of America	722	(63.140)	Snam SpA	Bank of America	(3.668)
36	Tower Semiconductor Ltd	Merrill Lynch	759	3.152	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	JP Morgan	28.544
		Merrill Lynch	39	5.251	Societa Sportiva Lazio SpA	Bank of America	
			1.595	(215.202)	Telecom Italia SpA/Milano	Merrill Lynch	(99)
				(220.270)	Telecom Italia SpA/Milano	Morgan Stanley	11.685
				(11.509)	Tenaris SA	JP Morgan	32.049
				(15.847)	Tenaris SA	Bank of America	(2.816)
(36.774)	A2A SpA	JP Morgan	4.658	(19.097)	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Bank of America	17.630
4	Ascopiave SpA	Bank of America	(2)	(50.305)	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Merrill Lynch	
(85.168)	Assicurazioni Generali SpA	Merrill Lynch	139.652	12.000	UniCredit SpA	Morgan Stanley	5.986
7.628	ASTM SpA	JP Morgan	(31.091)	139.352	UniCredit SpA	JP Morgan	25.966
(5.849)	Atlantia SpA	Bank of America	7.329	(76.648)	Unione di Banche Italiane SpA	Credit Suisse	(47.566)
8.815	Atlantia SpA	Merrill Lynch	(25.734)	(61.654)	Unipol Gruppo SpA	JP Morgan	(429.855)
1.908	Banca Farmafactoring SpA '144A'	JP Morgan	(167)			Morgan Stanley	72.713
(4.179)	Banca Sistema SpA '144A'	Bank of America	1.607				26.436
(25.765)	Banco BPM SpA	Merrill Lynch	14.395				29.546
185.987	Banco BPM SpA	Morgan Stanley	(141.291)				
123	Biesse SpA	JP Morgan	(889)				
(45.445)	BPER Banca	Bank of America	51.426	(3.400)	Ai Holdings Corp	Bank of America	
(10.882)	Brembo SpA	Merrill Lynch	(507)	(15.600)	Aiful Corp	Merrill Lynch	11.076
(9.319)	Buzzi Unicem SpA	JP Morgan	16.939	(3.700)	AltPlus Inc	Bank of America	
(16.776)	CNH Industrial NV	Merrill Lynch	15.026	7.600	ANA Holdings Inc	Merrill Lynch	1.438
1	Digital Bros SpA*	Bank of America	—			Bank of America	2.877
84.375	Enel SpA	Merrill Lynch	(21.825)	(200)	AnGes Inc	Merrill Lynch	21.224
(17.991)	Esprinet SpA	JP Morgan	12.809	(75)	ASKUL Corp	Bank of America	129
29.689	Falck Renewables SpA	Bank of America	(1.903)	(1.200)	Ateam Inc	Merrill Lynch	183
(6.009)	Fiat Chrysler Automobiles NV	Merrill Lynch	(2.156)	5.700	Azbil Corp	Bank of America	
(24.607)	Fiat Chrysler Automobiles NV	JP Morgan	(2.122)	4.500	BayCurrent Consulting Inc	Merrill Lynch	18.580
(121)	Fila SpA	Morgan Stanley	78	(30)	Bic Camera Inc	Bank of America	12.028
(63.313)	GEDI Gruppo Editoriale SpA	Bank of America	5.150	(1.900)	BrightPath Biotherapeutics Co Ltd 'C'	Merrill Lynch	22
1.905	Gefran SpA	Merrill Lynch	(1.293)	700	Ciz Holdings Co Ltd	Bank of America	6.427
(324.182)	Intesa Sanpaolo SpA	JP Morgan	234.865	(14.500)	Clarion Co Ltd	Merrill Lynch	5.775
50.051	Iren SpA	Bank of America	(20.234)	3.900	Comture Corp	Bank of America	3.207
(32.040)	Italgas SpA	Merrill Lynch	13.281	(8)	Cookpad Inc	Merrill Lynch	(8.929)
(2.704)	Landi Renzo SpA	Morgan Stanley	290	7.400	CyberAgent Inc	Bank of America	4
(901)	Luxottica Group SpA	JP Morgan	(903)	(244)	Cyberdyne Inc	Merrill Lynch	(8.006)
(5.124)	Luxottica Group SpA	Morgan Stanley	5.731	5.100	DA Consortium Holdings Inc	Bank of America	(15)
24.110	Mediaset SpA	Bank of America	(15.271)	2.800	Daicel Corp	Merrill Lynch	23.374
(15.351)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Merrill Lynch	35.129			Bank of America	
(41.860)	Molecular Medicine SpA	JP Morgan	781			Merrill Lynch	
(917)	Moncler SpA	JP Morgan	(2.938)				81

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(300)	Daido Steel Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	558	(39)	Istyle Inc	Bank of America Merrill Lynch	92
2.600	Daifuku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.512)	6.600	Itochu Techno-Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.392)
3.400	Daiichi Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.500)	7.200	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18.284
9.000	Daiichi Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24.810)	(3.437)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16.486)
400	Digital Garage Inc	Bank of America Merrill Lynch	162	(77.300)	Japan Display Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.237
6.900	DMG Mori Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16.624)	(700)	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.704
1.700	Eisai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9.657	(10.300)	Japan Post Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.888
2.400	en-japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.309	(13)	Japan Post Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	26
(23)	Eneres Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	20	(4.500)	Japan Tobacco Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.964
(7.100)	eRex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10.264)	(60)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(653)
(1.200)	FANUC Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.132	4.300	Justsystems Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.587)
400	Fast Retailing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.883	2.100	K's Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(905)
1.200	Foster Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.191)	17.600	Kakaku.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.396
48.000	Fujitsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.368)	(6.300)	Kansai Paint Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.433
6.700	FULLCAST Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	27.666	10.600	KDDI Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.015
8.300	Geo Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16.309)	(4.500)	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.014)
84.300	GungHo Online Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.627	1.900	Keihin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(593)
6.400	Gunosy Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.360	(8.500)	Keikyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	13.632
(2.800)	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America Merrill Lynch	(3.128)	(400)	Keio Corp	Bank of America Merrill Lynch	(539)
(1.800)	Harmonic Drive Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.429	(100)	Keyence Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.557
(4.400)	Harmonic Drive Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.250)	(3.600)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.379)
7.500	Haseko Corp	Bank of America Merrill Lynch	41	4.700	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	710
(300)	Hirata Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.222	51	KLab Inc	Bank of America Merrill Lynch	(102)
(5.200)	Hiroshima Bank Ltd/The	Bank of America Merrill Lynch	2.924	2.600	Kobe Steel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(428)
400	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	377	6.600	Kokuyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.624
(5.500)	Hitachi Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.042	1.800	Konami Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.825)
1.600	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9)	1.200	Koshidaka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	752
16.000	Hitachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10.850)	(7.700)	Kuraray Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9.739
(2.100)	Hitachi Metals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	925	(7.800)	Kyushu Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	950
100	Hosokawa Micron Corp	Bank of America Merrill Lynch	(424)	(4.000)	LINE Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.659
4.500	Hoya Corp	Bank of America Merrill Lynch	26.500	(1.000)	Link And Motivation Inc	Bank of America Merrill Lynch	2
(400)	Ichikoh Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(143)	(4.300)	Lixil Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.660
(10.900)	IDOM Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.229	1.300	M&A Capital Partners Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	29.469
(3.400)	IHI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14.787)	2.000	Makino Milling Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	105
(1.200)	Infomart Corp	Bank of America Merrill Lynch	(568)	300	Mandom Corp	Bank of America Merrill Lynch	(53)

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(4.300)	Maruichi Steel Tube Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.488	2.600	Pepper Food Service Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14.841)
700	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(812)	(6.200)	PeptiDream Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.151
5.400	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18.667	(2.780)	PeptiDream Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.458)
6.300	Medipal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	12.126	(17.200)	Rakuten Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.562
2.500	Meitec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21.626)	(600)	RaQualia Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.322
(36)	Minebea Mitsumi Inc	Bank of America Merrill Lynch	43	(22.600)	Renesas Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8.909)
3.000	Miraca Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.017)	(14.500)	Renesas Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	8.821
13.100	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.386)	700	Round One Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.028
(7.100)	Mitsubishi Logistics Corp	Bank of America Merrill Lynch	14.790	(500)	SanBio Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	65
(17.900)	Mitsubishi Motors Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.320)	10.200	Sansha Electric Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19.183)
(5.700)	Mitsui E&S Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.384	(2.500)	Sanyo Special Steel Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(165)
(7.200)	Mitsui High-Tec Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.762	1.000	SBI Holdings Inc/Japan	Bank of America Merrill Lynch	(406)
4.000	Mixi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.374)	19.100	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.772
(4.399)	MonotaRO Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22.503)	(6.800)	Seiko Epson Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.177
(900)	Murata Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10.121)	1.600	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(474)
11.400	Nichidai Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.054)	6.300	SG Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.661)
(1.500)	Nidec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.875)	(4.981)	Sharp Corp/Japan	Bank of America Merrill Lynch	14.645
4.900	Nihon M&A Center Inc	Bank of America Merrill Lynch	16.710	400	Shikoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(214)
1.200	Nihon Unisys Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.021	5.900	Shionogi & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.790
(500)	Nintendo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	67	4.700	Ship Healthcare Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.148
(1.700)	Nippon Chemi-Con Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.318)	1.500	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.008
1.700	Nippon Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.939	3.600	SIGMAXYZ Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.718)
(1.600)	Nippon Paper Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.162	(1.800)	Siix Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.376
(5.300)	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.280	29.000	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.138)
6.300	Nissin Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.901)	(20)	SMS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12
(500)	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	707	1.100	Sodick Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(237)
(42.700)	North Pacific Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.542	(1.700)	SoftBank Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	10.835
9.600	NTT DOCOMO Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.857	(15.500)	Solasia Pharma KK	Bank of America Merrill Lynch	1.857
(2.500)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	201	5.100	Solasto Corp	Bank of America Merrill Lynch	34.738
7.500	Olympus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.463)	(1.800)	Sosei Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.811
1.200	Oracle Corp Japan	Bank of America Merrill Lynch	(6.572)	1.100	Square Enix Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.408
(405)	OSAKA Titanium Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	217	6.700	Square Enix Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38.389
3.200	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16.612)	4.700	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13.976)
(4.800)	Pacific Metals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9.291	3.900	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12.455)
100	Paltac Corporation	Bank of America Merrill Lynch	876	(9.200)	Sumco Corp	Bank of America Merrill Lynch	14.214
(6.200)	Park24 Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9.258	(700)	Sumida Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.140

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Pays-Bas			
6.800	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23.208	(13.824)	ABN AMRO Group NV -CVA '144A'	JP Morgan	59.707
(600)	Sumitomo Forestry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	894	(266.697)	Aegon NV	JP Morgan	195.302
(5.200)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23.238	3.562	Akzo Nobel NV	Morgan Stanley	(8.715)
(6.300)	Suruga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.833)	10.113	Akzo Nobel NV	JP Morgan	115
300	Sushiro Global Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	428	(20.515)	Altice NV	Bank of America Merrill Lynch	(140.359)
2.300	Taisei Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.696	36.148	Altice NV	JP Morgan	247.316
(4.000)	Takashimaya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(351)	44.626	Altice NV 'A'	JP Morgan	(165.380)
(2.019)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	4.168	(21.257)	Altice NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	110.018
(15)	Tateru Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39)	(490)	ASML Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	799
(2.200)	TDK Corp	Bank of America Merrill Lynch	(511)	4.482	BE Semiconductor Industries NV	Bank of America Merrill Lynch	(65.955)
19.500	Techno Horizon Holdings Co	Bank of America Merrill Lynch	(29.296)	(2.746)	Beter Bed Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	3.320
800	TechnoPro Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.789	(2.499)	Brunel International NV	Bank of America Merrill Lynch	(2.824)
1.600	Token Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.327)	(3.629)	Fugro NV - CVA	Bank of America Merrill Lynch	(2.269)
30.000	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.106)	115.105	ING Groep NV	JP Morgan	(163.160)
(10.000)	Toppan Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.250	6.304	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America Merrill Lynch	1.404
(14.500)	Toray Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.190	601	Koninklijke DSM NV	JP Morgan	(472)
(39.979)	Toshiba Corp	Bank of America Merrill Lynch	607	525.987	Koninklijke KPN NV	JP Morgan	(152.286)
(2.800)	Towa Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.499	(32.315)	NN Group NV	JP Morgan	97.833
6.200	Toyota Boshoku Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9.819)	(10.069)	OCI NV	Bank of America Merrill Lynch	(12.189)
(1.500)	Toyota Industries Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.679	(6.157)	OCI NV	Bank of America Merrill Lynch	(20.852)
1.400	Toyota Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7.613)	119.427	Pharming Group NV	Bank of America Merrill Lynch	2.783
(2.000)	Toyota Tsusho Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.237	(31.665)	PostNL NV	Bank of America Merrill Lynch	7.203
(300)	Tri Chemical Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18)	(8.600)	RELX NV	Credit Suisse	(8.417)
3.800	TS Tech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11.733	(14.593)	RELX NV	JP Morgan	(14.283)
12.000	Tsugami Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11.969)	(3.788)	Signify NV	Morgan Stanley	3.399
5.600	Unipres Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14.039)	(2.598)	Takeaway.com NV '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(9.557)
3.900	UNITED Inc/Japan	Bank of America Merrill Lynch	(24.863)	(911)	Unibail-Rodamco SE (Reit)	Morgan Stanley	2.123
(2.000)	Universal Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4.930)				(35.396)
(89)	W-Scope Corp	Bank of America Merrill Lynch	(198)	Nouvelle-Zélande			
(15.060)	Wacom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.773)	45.531	Spark New Zealand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4.273
6.100	YA-MAN Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12.195				4.273
25.000	Yamaguchi Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17.745)	Norvège			
12.100	Yumeshin Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11.959)	2.309	Aker BP ASA	Bank of America Merrill Lynch	1.682
(8.800)	ZIGEXn Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.665)	(30.045)	Archer Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.926)
			252.493	(33.406)	Axactor AB	Bank of America Merrill Lynch	4.253
				(33.971)	Borr Drilling Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19.083)
				(2.284)	Borregaard ASA	Bank of America Merrill Lynch	(1.340)
				32.884	BW Offshore Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.433
				(14.990)	DNB ASA	JP Morgan	11.647
				102.419	DNO ASA	Bank of America Merrill Lynch	11.632
				(1.654)	Frontline Ltd/Bermuda	Bank of America Merrill Lynch	(2.688)
				(6.869)	Hoegh LNG Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	521
				(6.295)	NEL ASA	Bank of America Merrill Lynch	(184)

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Norvège suite				Afrique du Sud			
(15.479)	Nordic Nanovector ASA	Bank of America Merrill Lynch	(2.954)	(2.684)	AngloGold Ashanti Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(714)
21.636	Orkla ASA	Bank of America Merrill Lynch	(4.631)	(37.278)	Ascendis Health Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(581)
8.025	Salmar ASA	Bank of America Merrill Lynch	(39.523)	9.229	Astral Foods Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24.715)
3.123	Salmar ASA	Bank of America Merrill Lynch	(949)	4.589	Barloworld Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12.066)
(279)	Sbanken ASA	Bank of America Merrill Lynch	(228)	(868)	Curro Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	315
(36.926)	Solstad Farstad ASA	Bank of America Merrill Lynch	17	(2.661)	DataTec Ltd	Bank of America Merrill Lynch	24
(58.465)	Storebrand ASA	JP Morgan	11.995	12.631	Dis-Chem Pharmacies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9.369)
12.989	Telenor ASA	Bank of America Merrill Lynch	(16.805)	(5.847)	Famous Brands Ltd	Bank of America Merrill Lynch	546
4.096	TGS Nopec Geophysical Co ASA	Bank of America Merrill Lynch	1.800	30.419	FirstRand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13.282)
(60.780)	Thin Film Electronics ASA	Bank of America Merrill Lynch	1.618	(2.247)	Impala Platinum Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(274)
(7.367)	Veidekke ASA	Bank of America Merrill Lynch	2.112	1.924	JSE Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.029)
			(37.601)	(74)	KAP Industrial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4
Pologne				908	Kumba Iron Ore Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.360
50	Bank Handlowy w Warszawie SA	Bank of America Merrill Lynch	—	2.370	Liberty Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(969)
(646)	Budimex SA	Bank of America Merrill Lynch	—	(13.463)	Life Healthcare Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.705
2.599	Dino Polska SA	Bank of America Merrill Lynch	—	(710)	Naspers Ltd 'N'	Bank of America Merrill Lynch	961
5.002	Energa SA	Bank of America Merrill Lynch	—	(1.225)	Naspers Ltd 'N'	Bank of America Merrill Lynch	19.952
(179)	Kernel Holding SA	Bank of America Merrill Lynch	—	3.585	Nedbank Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(908)
(1.752)	KGHM Polska Miedz SA	Bank of America Merrill Lynch	—	(53.060)	Northam Platinum Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12.927
(2)	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	Bank of America Merrill Lynch	—	(33.803)	Pick n Pay Stores Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13.211
5.881	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	Bank of America Merrill Lynch	—	(1.724)	PSG Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	761
(1.154)	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	Bank of America Merrill Lynch	—	24.242	Sanlam Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14.886)
			0,00	(27.580)	Sappi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.745)
Portugal				(210.318)	Sibanye Gold Ltd	Bank of America Merrill Lynch	45.900
(1.581)	Corticeira Amorim SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(700)	9.588	Standard Bank Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.207)
(862)	CTT-Correios de Portugal SA	Bank of America Merrill Lynch	(92)				7.921
(2)	Semapa-Sociedade de Investimento e Gestao	Bank of America Merrill Lynch	(8)	Corée du Sud			
			(800)	(490)	Advanced Process Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	154
Singapour				10.211	AJ Rent A Car Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(21.556)
(7.300)	DBS Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.409	(1.453)	Alpha Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.348
(1.400)	Jardine Strategic Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.557	(561)	Amorepacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	10.271
(79.700)	Singapore Post Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.190	(12.924)	Anam Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.573
(13.700)	StarHub Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.478	6.688	BGF Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9.106)
8.500	Venture Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.364	(824)	BGF retail Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7.851
(69.500)	Wilmar International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.038	6.317	BH Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	33.689
155.900	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(23.861)	(231)	Cafe24 Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7.067)
			(9.825)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(412)	Cancer Ropco Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.740	(112)	Polus BioPharm Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
634	Celltrion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.712)	6.375	PSK Inc	Bank of America Merrill Lynch	38.656
(1.288)	CJ CGV Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10.740	1	S-Oil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(77)	CJ Logistics Corp	Bank of America Merrill Lynch	637	606	Samji Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(363)
381	CJ O Shopping Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.051)	12	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	748
961	Com2uSCorp	Bank of America Merrill Lynch	26.760	(1.437)	Samsung C&T Corp	Bank of America Merrill Lynch	21.060
863	Daeduck GDS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9	3.150	Samsung Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.157)
(918)	ESV Inc	Bank of America Merrill Lynch	176	(22.131)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.476)
(201)	Gamevil Inc	Bank of America Merrill Lynch	(448)	6.485	Sangsangin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(313)
2.171	Grand Korea Leisure Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(308)	4.648	SFA Engineering Corp	Bank of America Merrill Lynch	15.735
(901)	Hankook Cosmetics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	995	(1.853)	SillaJen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13.270)
(541)	Hanmi Pharm Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.296)	3.932	SK Discovery Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13.115)
(774)	Hanssem Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.846	556	SK Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.198)
(26.409)	Hyundai Merchant Marine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(38.593)	1.574	SK Hynix Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.227
(1.545)	Iijin Materials Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.276)	(161)	STCube Inc	Bank of America Merrill Lynch	58
45	ING Life Insurance Korea Ltd '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(58)	(269)	Studio Dragon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.049)
7.539	Interflex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.305	(870)	ViroMed Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(52.220)
(517)	Iriver Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.156)	(19.783)	Yungjin Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.617
(455)	JW Pharmaceutical Corp	Bank of America Merrill Lynch	627				62.195
(165)	JW Shinyak Corp	Bank of America Merrill Lynch	229	Espagne			
2.409	KG Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.115	26.680	Abertis Infraestructuras SA	Bank of America Merrill Lynch	1.088
2.393	Kginicis Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.074)	132.925	Abertis Infraestructuras SA	Morgan Stanley	(2.323)
2.651	Kia Motors Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.550)	2.816	Aena SME SA '144A'	Morgan Stanley	(22.475)
(5.604)	Komipharm International Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	51.787	128.929	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	JP Morgan	(120.975)
(1.604)	Korea Kolmar Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8.122	(9.004)	Banco Santander SA	JP Morgan	8.062
(60)	Leaders Cosmetics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	190	8	Bankinter SA	Bank of America Merrill Lynch	(4)
16.302	LG Uplus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10.798)	(4.508)	Cellnex Telecom SA '144A'	Bank of America Merrill Lynch	3.702
(1.205)	LIG Nex1 Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7.577)	(8.212)	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	Bank of America Merrill Lynch	(26.504)
6	Lotte Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(42)	595	CIE Automotive SA	Bank of America Merrill Lynch	(165)
(874)	ME2ON Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	664	(14.610)	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	Bank of America Merrill Lynch	512
(6)	NanoMedics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6	23.927	Ence Energia y Celulosa SA	Bank of America Merrill Lynch	8.688
(181)	NAVER Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.006	2.826	Ercros SA	Bank of America Merrill Lynch	(371)
(1.082)	Netmarble Corp '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(8.163)	5.134	Fluidra SA	Bank of America Merrill Lynch	355
(11.911)	New Pride Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5.325)	43.146	Gestamp Automocion SA '144A'	Morgan Stanley	(10.306)
(2.140)	Peptron Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.610	721	Grifols SA	Bank of America Merrill Lynch	463
				5.571	Hispania Activos Inmobiliarios SOCIMI SA (Reit)	Morgan Stanley	(577)
				20.994	Hispania Activos Inmobiliarios SOCIMI SA (Reit)	Credit Suisse	(501)

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Espagne suite				Suède suite			
1	Industria de Diseno Textil SA	Bank of America Merrill Lynch	2	21.879	KappAhl AB	Bank of America Merrill Lynch	(3.919)
4	Masmovil Ibercom SA	Bank of America Merrill Lynch	(17)	(5.976)	Mr. Green & Co AB	Bank of America Merrill Lynch	(2)
26.203	Mediaset Espana Comunicacion SA	Bank of America Merrill Lynch	(21.750)	8.449	Mr. Green & Co AB	Bank of America Merrill Lynch	1.239
6.344	Papeles y Cartones de Europa SA	Bank of America Merrill Lynch	(2.205)	8.223	Mr. Green & Co AB	Bank of America Merrill Lynch	834
(26.096)	Pharma Mar SA	Bank of America Merrill Lynch	5.724	(21.696)	Munters Group AB '144A'	Bank of America Merrill Lynch	7.625
(19.811)	Red Electrica Corp SA	Morgan Stanley	13.388	(8.105)	NCC AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(2.990)
10.498	Saeta Yield SA	Bank of America Merrill Lynch	(1.957)	(22.364)	NetEnt AB	Bank of America Merrill Lynch	406
(8.546)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Bank of America Merrill Lynch	6.981	(20.371)	Nobia AB	Bank of America Merrill Lynch	(5.871)
(1.759)	Tecnicas Reunidas SA	Bank of America Merrill Lynch	3.136	2.323	Nolato AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	27.390
(2)	Telefonica SA	Bank of America Merrill Lynch	2	(5.262)	Nordea Bank AB	Bank of America Merrill Lynch	5.401
(43.123)	Telefonica SA	JP Morgan	32.566	3.175	Nordea Bank AB	Credit Suisse	(1.483)
(20.117)	Tubacex SA	Bank of America Merrill Lynch	14.162	103.657	Nordea Bank AB	JP Morgan	(47.955)
			(111.299)	(1.739)	Peab AB	Bank of America Merrill Lynch	(115)
Suède				(4.970)	Qliro Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(97)
7.981	AcadeMedia AB '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(537)	(723)	Saab AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	323
(9.987)	Alfa Laval AB	Morgan Stanley	12.681	(2.578)	Sandvik AB	JP Morgan	935
46.264	Arjo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	22.554	24.304	SSAB AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5.973)
(5.431)	Atlas Copco AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	144	13.928	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	2.966
(5.431)	Atlas Copco AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4.113	(13.012)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2.981
(2.137)	Atlas Copco AB 'A'	JP Morgan	(1.933)	(5.985)	Sweco AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(17.596)
6.132	Atlas Copco AB 'A'	Morgan Stanley	(2.086)	1.913	Swedish Match AB	Bank of America Merrill Lynch	125
(1.168)	Atlas Copco AB 'A'	JP Morgan	(1.463)	5.968	Swedish Match AB	Bank of America Merrill Lynch	(1.329)
2.702	Autoliv Inc SDR	Morgan Stanley	4.978	(51.699)	Tele2 AB 'B'	JP Morgan	42.201
(3.156)	Bilia AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.288	(4.778)	Tele2 AB 'B'	Morgan Stanley	464
601	BioGaia AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1.616)	(17.808)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	JP Morgan	10.539
5.972	Biotage AB	Bank of America Merrill Lynch	9.343	50.528	Telia Co AB	Bank of America Merrill Lynch	(18.853)
8.570	Boliden AB	Bank of America Merrill Lynch	5.568	1.808	THQ Nordic AB	Bank of America Merrill Lynch	12.442
8.570	Boliden AB	Bank of America Merrill Lynch	(19.844)	(4.293)	Tobii AB	Bank of America Merrill Lynch	(808)
(4.937)	Boozt AB '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(208)	9.742	Vitrolife AB	Bank of America Merrill Lynch	2.518
(66)	Cellavision AB	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(12.241)	Volvo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	11.241
2.313	Com Hem Holding AB	Morgan Stanley	(199)				82.484
(4.238)	Eltel AB '144A'	Bank of America Merrill Lynch	139	Suisse			
(907)	Evolution Gaming Group AB '144A'	JP Morgan	(2.108)	1.496	Adecco Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(6.256)
3.546	Granges AB	Bank of America Merrill Lynch	(1.695)	(1.788)	ams AG	Bank of America Merrill Lynch	(217)
(3.254)	Haldex AB	Bank of America Merrill Lynch	517	(6.617)	Aryzta AG	Morgan Stanley	38.902
(2.959)	Hansa Medical AB	Bank of America Merrill Lynch	9.512	1.639	Bobst Group SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	1.164
(3.775)	Hennes & Mauritz AB 'B'	JP Morgan	6.916	(1.061)	Cie Financiere Richemont SA Reg	JP Morgan	4.865
2.613	ICA Gruppen AB	Bank of America Merrill Lynch	(1.722)	109	Conzzeta AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(6.414)
8.260	International Petroleum Corp/Sweden	Bank of America Merrill Lynch	15.358				
(565)	Investment AB Latour 'B'	Bank of America Merrill Lynch	154				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Suisse				Taiwan			
Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie	USD	Nombre	Description	Contrepartie	USD
Suisse suite				Taiwan suite			
(1.201)	Cosmo Pharmaceuticals NV	Bank of America Merrill Lynch	39.536	(61.000)	China Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	403
(1.853)	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	3.441	33.000	Chipbond Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.421
(25.167)	Credit Suisse Group AG Reg	JP Morgan	40.663	(5.000)	Chunghwa Precision Test Tech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.898)
(97)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	671	(15.000)	Chunghwa Telecom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2.720
(94.273)	Evolva Holding SA	Bank of America Merrill Lynch	1.108	(10.900)	Cub Elecparts Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.041
21	Georg Fischer AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	493	(3.340)	Eclat Textile Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(217)
(38)	Givaudan SA Reg	JP Morgan	1.041	(5.000)	Ennoconn Corp	Bank of America Merrill Lynch	102
(62)	HOCHDORF Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(409)	2.000	FLEXium Interconnect Inc	Bank of America Merrill Lynch	515
38	Implenia AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(97)	469.000	HannStar Display Corp	Bank of America Merrill Lynch	16.062
(6.115)	Julius Baer Group Ltd	JP Morgan	18.309	(29.000)	Hota Industrial Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11.062)
306	Kardex AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1.153	(82.000)	HTC Corp	Bank of America Merrill Lynch	7.299
(2.382)	LafargeHolcim Ltd Reg	JP Morgan	6.056	221.000	Innolux Corp	Bank of America Merrill Lynch	2.650
(21)	Meyer Burger Technology AG	Bank of America Merrill Lynch	1	86.000	King Yuan Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.801)
2.797	Nestle SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	(3.899)	(6.000)	Kingpak Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.812)
(601)	Nestle SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	760	(6.372)	LandMark Optoelectronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.929)
(6.451)	Nestle SA Reg	JP Morgan	10.995	103.395	Macronix International	Bank of America Merrill Lynch	4.649
(1.872)	Newron Pharmaceuticals SpA	Bank of America Merrill Lynch	(1.487)	(3.000)	President Chain Store Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.081)
(1.104)	Novartis AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	2.413	76.000	Radiant Opto-Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.063
(1.667)	Novartis AG Reg	JP Morgan	5.440	33.000	Sino-American Silicon Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.416
10.655	OC Oerlikon Corp AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(2.594)	(11.000)	TaiMed Biologics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(393)
(469)	Roche Holding AG	JP Morgan	5.967	64.000	Taiwan Semiconductor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	34.248
126	Roche Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(714)	7.000	Tripod Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.458)
5	Schweizerische Nationalbank	Bank of America Merrill Lynch	(716)	9.000	Tul Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.397)
177	Swatch Group AG/The	Bank of America Merrill Lynch	1.199	(4.408)	Tung Thih Electronic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.233
433	Swisscom AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(5.552)	212.000	Walsin Lihwa Corp	Bank of America Merrill Lynch	32.148
4.122	Tornos Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(7.741)	610	Walsin Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.023
69.355	UBS Group AG Reg	JP Morgan	(113.135)	4.000	Yageo Corp	Bank of America Merrill Lynch	42.195
2.138	UBS Group AG Reg	Credit Suisse	(2.418)				118.713
(628)	Zur Rose Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(6.138)				
(1.684)	Zurich Insurance Group AG	JP Morgan	38.781				
			65.171				
Taiwan				Turquie			
(220.000)	Acer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.728)	(2.330)	AG Anadolu Grubu Holding AS	Bank of America Merrill Lynch	(480)
(22.600)	Advantech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3.087	106.499	Anel Elektrik Proje Taahhut ve Ticaret AS	Bank of America Merrill Lynch	(9.167)
5.000	ALLIED CIRCUIT Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.151)	(41.225)	Arcelik AS	Bank of America Merrill Lynch	13.230
18.000	Ardentec Corp	Bank of America Merrill Lynch	375	(1.283)	Aygaz AS	Bank of America Merrill Lynch	(5)
11.000	Asia Optical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	414	(6.935)	BIM Birllesik Magazalar AS	Bank of America Merrill Lynch	2.525
(12.000)	ASMedia Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15.994)	(2.772)	Cimsa Cimento Sanayi VE Ticaret AS	Bank of America Merrill Lynch	742
158.000	AU Optronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.126				
1.000	Catcher Technology Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	444				

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

			Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Turquie suite				Royaume-Uni suite			
(37.253)	Dogtas Kelebek Mobilya Sanayi ve Ticaret AS	Bank of America Merrill Lynch	9.208	(3.125)	British American Tobacco Plc	Bank of America Merrill Lynch	6.127
(1)	Dogus Otomotiv Servis ve Ticaret AS*	Bank of America Merrill Lynch	—	20.538	BTG Plc	Bank of America Merrill Lynch	(21.704)
(145.383)	Enka Insaat ve Sanayi AS	Bank of America Merrill Lynch	726	(614)	Burberry Group Plc	JP Morgan	(1.539)
(45.384)	Haci Omer Sabanci Holding AS	Bank of America Merrill Lynch	2.725	(7.871)	Burberry Group Plc	Morgan Stanley	(6.592)
(101.733)	Ihlas Holding AS	Bank of America Merrill Lynch	2.021	(25.828)	Cairn Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	(412)
70.555	Kardemir Karabuk Demir Celik Sanayi ve Ticaret AS 'D'	Bank of America Merrill Lynch	10.277	(52.274)	Cairn Homes Plc*	Bank of America Merrill Lynch	—
109.796	Koza Anadolu Metal Madencilik Isletmeleri AS	Bank of America Merrill Lynch	60.580	(15.357)	Card Factory Plc	Morgan Stanley	3.621
(256)	Logo Yazilim Sanayi Ve Ticaret AS	Bank of America Merrill Lynch	(17)	19.198	Card Factory Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.186
(3.997)	Migros Ticaret AS	Bank of America Merrill Lynch	1.090	85.911	Centamin Plc	Bank of America Merrill Lynch	(19.579)
(625)	MLP Saglik Hizmetleri AS	Bank of America Merrill Lynch	113	94.390	Centrica Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6.867)
(7.833)	NET Holding AS	Bank of America Merrill Lynch	467	13.747	Clinigen Healthcare Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.477)
22.873	TAV Havalimanlari Holding AS	Bank of America Merrill Lynch	(1.448)	(134.127)	Coats Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.149)
67.119	Tekfen Holding AS	Bank of America Merrill Lynch	(3.407)	(87.344)	Cobham Plc	Bank of America Merrill Lynch	(12.656)
(9.857)	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	Bank of America Merrill Lynch	(740)	(102.949)	Cobham Plc	Morgan Stanley	(8.211)
27.308	Trakya Cam Sanayii AS	Bank of America Merrill Lynch	(4.340)	4.059	Compass Group Plc	Morgan Stanley	567
20.907	Turk Hava Yollari AO	Bank of America Merrill Lynch	(1.850)	(2.898)	ConvaTec Group Plc '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(320)
(13.370)	Turkiye Is Bankasi AS 'C'	Bank of America Merrill Lynch	561	40.065	Conviviality Plc**	Bank of America Merrill Lynch	(53.897)
(2.042)	Ulker Biskuvi Sanayi AS	Bank of America Merrill Lynch	131	(20.442)	Dairy Crest Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	11.657
			82.942	124	DFS Furniture Plc	Bank of America Merrill Lynch	12
Royaume-Uni				9.137	Diageo Plc	Morgan Stanley	5.101
9.143	Abcam Plc	Bank of America Merrill Lynch	(365)	(113.994)	EnQuest Plc	Bank of America Merrill Lynch	2.576
(5.112)	Admiral Group Plc	Morgan Stanley	1.087	(20.912)	Essentra Plc	Morgan Stanley	2.057
5	AG Barr Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1)	30.539	Evrax Plc	Bank of America Merrill Lynch	28.346
(14.937)	Aggreko Plc	Morgan Stanley	8.300	19.354	Ferrexpo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4.605)
(108.829)	Amerisur Resources Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2.805)	270	Fidessa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3
1.352	Anglo American Plc	Bank of America Merrill Lynch	733	41.693	Forterra Plc '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(4.157)
(98.208)	Anglo American Plc	JP Morgan	(79.359)	(9.057)	Fresnillo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9.135)
(16.154)	AO World Plc	Bank of America Merrill Lynch	(10.350)	119	Frontier Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	712
16.184	Ascential Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.211	(14.939)	G4S Plc	Bank of America Merrill Lynch	448
(1.911)	ASOS Plc	Bank of America Merrill Lynch	(12.600)	3.714	Games Workshop Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	21.229
(14.635)	Auto Trader Group Plc '144A'	Morgan Stanley	4.883	(661)	GB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	13
31.474	Aviva Plc	JP Morgan	(11.547)	37.630	Genel Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	33.448
29.832	Aviva Plc	Morgan Stanley	(14.752)	571	Genus Plc	Bank of America Merrill Lynch	546
38.239	BAE Systems Plc	Morgan Stanley	(102)	(6.162)	Glanbia Plc	Morgan Stanley	(8.400)
(18.364)	Barclays Plc	JP Morgan	1.487	(4.621)	Glencore Plc	Bank of America Merrill Lynch	(121)
1.647	Barratt Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	(426)	6.577	Globaltrans Investment Plc RegS GDR	Bank of America Merrill Lynch	1.280
2.358	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.153	2.719	Greggs Plc	Bank of America Merrill Lynch	730
8.703	BHP Billiton Plc	Bank of America Merrill Lynch	19.968	(4.772)	Greggs Plc	Morgan Stanley	381
				(67.915)	GVC Holdings Plc***	Bank of America Merrill Lynch	(1)

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

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

*** Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(2.129)	GVC Holdings Plc	JP Morgan	(4.104)	(70.558)	Ophir Energy Plc	Bank of America	
8	Hastings Group	Bank of America				Merrill Lynch	(4.157)
	Holdings Plc '144A'	Merrill Lynch	(2)	(1.296)	Oxford Biomedica Plc	Bank of America	
(3.437)	Headlam Group Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(2.661)
		Merrill Lynch	(291)	(486)	Paddy Power Betfair Plc	JP Morgan	(14.342)
2.485	Highland Gold Mining Ltd	Bank of America		(4)	Pantheon Resources Plc*	Bank of America	
		Merrill Lynch	218			Merrill Lynch	–
(13.736)	HSBC Holdings Plc	Bank of America		(5)	Patisserie Holdings Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.741			Merrill Lynch	(3)
(178.715)	HSBC Holdings Plc	JP Morgan	(9.506)	(10.514)	Pearson Plc	JP Morgan	1.391
(80.545)	Hurricane Energy Plc	Bank of America		(23.510)	Pearson Plc	Morgan Stanley	3.938
		Merrill Lynch	(1.600)	(9.770)	Pennon Group Plc	Bank of America	
14.306	IG Group Holdings Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.014)
		Merrill Lynch	7.131	5.514	Persimmon Plc	Bank of America	
23.293	Indivior Plc	Bank of America				Merrill Lynch	9.455
		Merrill Lynch	5.647	(149.255)	Petra Diamonds Ltd	Bank of America	
38.720	Informa Plc	Morgan Stanley	9.471			Merrill Lynch	11.111
(27.461)	Inmarsat Plc	Morgan Stanley	(1.132)	52.992	Phoenix Group Holdings	Morgan Stanley	(15.638)
10.871	International Consolidated	Bank of America		4.759	Playtech Plc	Credit Suisse	(75)
	Airlines Group SA	Merrill Lynch	(4.195)	11.510	Playtech Plc	JP Morgan	(1.994)
(4.876)	Interserve Plc	Bank of America		9.080	Plus500 Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	283			Merrill Lynch	26.433
(44.083)	IP Group Plc	Bank of America		482.456	Premier Foods Plc	Morgan Stanley	12.827
		Merrill Lynch	(2.327)	103.671	Premier Oil Plc	Bank of America	
(5.819)	iShares Core Corp Bond					Merrill Lynch	4.330
	UCITS ETF GBP Dist	Morgan Stanley	(13.215)	(14.826)	Provident Financial Plc	Bank of America	
(8.857)	iShares Euro High Yield					Merrill Lynch	4.540
	Corp Bond UCITS ETF	Morgan Stanley	9.185	6.743	Prudential Plc	Morgan Stanley	(10.756)
14	IWG Plc	Bank of America		75.586	Prudential Plc	JP Morgan	(92.438)
		Merrill Lynch	12	(1.382)	PureCircle Ltd	Bank of America	
34.503	J Sainsbury Plc	Bank of America				Merrill Lynch	238
		Merrill Lynch	7.804	5.927	Reckitt Benckiser Group Plc	JP Morgan	13.315
(15.733)	J Sainsbury Plc	Morgan Stanley	(293)	(2.893)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America	
(16.667)	John Wood Group Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(7.153)
		Merrill Lynch	(19.172)	5.699	Redde Plc	Bank of America	
(1.423)	Johnson Matthey Plc	JP Morgan	(2.818)			Merrill Lynch	(359)
(7.708)	Johnson Matthey Plc	Morgan Stanley	3.074	(520)	RELX Plc	Credit Suisse	(532)
15.070	Just Eat Plc	Bank of America		(10.167)	RELX Plc	JP Morgan	(10.407)
		Merrill Lynch	13.342	165	Rhi Magnesita NV	Bank of America	
(39)	KCOM Group Plc	Bank of America				Merrill Lynch	1.779
		Merrill Lynch	2	(21.259)	Royal Bank of Scotland		
(10.587)	Laird Plc	Bank of America			Group Plc	JP Morgan	(593)
		Merrill Lynch	(226)	25.300	Royal Mail Plc	Bank of America	
(3.629)	Lancashire Holdings Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(23.100)
		Merrill Lynch	176	(19.373)	RPC Group Plc	Morgan Stanley	7.108
159.223	Legal & General Group Plc	Morgan Stanley	(33.230)	10	RPS Group Plc	Bank of America	
(376.122)	Legal & General Group Plc	JP Morgan	28.500			Merrill Lynch	1
1.299.772	Lloyds Banking Group Plc	JP Morgan	(40.201)	(2.006)	Schroders Plc	JP Morgan	3.280
591.738	Lloyds Banking Group Plc	Morgan Stanley	(27.295)	(228.320)	Serco Group Plc	Morgan Stanley	18.969
(49.354)	Lonmin Plc	Bank of America		(154.655)	Serco Group Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	9.093			Merrill Lynch	6.310
(68.235)	Lookers Plc	Morgan Stanley	(363)	(6.887)	Severn Trent Plc	Bank of America	
(12.874)	Magnit PJSC GDR RegS	Bank of America				Merrill Lynch	(3.982)
		Merrill Lynch	(5.214)	15.937	Shire Plc	Morgan Stanley	(21.927)
(1.149)	Mail.Ru Group Ltd GDR RegS	Bank of America		11.347	Shire Plc	JP Morgan	10.320
		Merrill Lynch	3.930	(187.360)	Sirius Minerals Plc	Bank of America	
(61.544)	Meggitt Plc	Morgan Stanley	3.354			Merrill Lynch	(8.617)
119.623	Melrose Industries Plc	Morgan Stanley	(17.174)	74.837	Sky Plc	JP Morgan	(4.974)
(46.209)	Melrose Industries Plc	Bank of America		36.858	Sky Plc	Morgan Stanley	(9.064)
		Merrill Lynch	(1.856)	(8.804)	Smart Metering Systems Plc	Bank of America	
(1.992)	Metro Bank Plc	Morgan Stanley	3.231			Merrill Lynch	(234)
11.922	Mondi Plc	Morgan Stanley	(3.962)	42.209	Smith & Nephew Plc	JP Morgan	36.926
50.212	N Brown Group Plc	Bank of America		(73.102)	SolGold Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	934			Merrill Lynch	(1.320)
12.175	NEX Group Plc	Morgan Stanley	3.075	(1)	Staffline Group Plc*	Bank of America	
(13.561)	Nostrum Oil & Gas Plc	Bank of America				Merrill Lynch	–
		Merrill Lynch	13.517	53.212	Standard Chartered Plc	JP Morgan	(5.212)
(17.175)	Ocado Group Plc	Bank of America		84.205	Standard Life Aberdeen Plc	JP Morgan	(14.613)
		Merrill Lynch	(82.104)	(31.021)	Standard Life Aberdeen Plc	Bank of America	
						Merrill Lynch	414

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

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Royaume-Uni suite				Etats-Unis suite			
(1.004)	Stobart Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	267	(16.920)	ANGI Homeservices Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(29.779)
2.517	Stock Spirits Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(384)	(1.775)	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23.661)
16.741	Taylor Wimpey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(507)	(2.502)	Applied Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.397
(17.777)	UBM Plc	Morgan Stanley	(6.144)	(3.591)	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	(5.707)
(2.781)	Unilever Plc	JP Morgan	(4.750)	(3.310)	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America Merrill Lynch	4.435
(15)	Vertu Motors Plc	Bank of America Merrill Lynch	—	(1.335)	Arena Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	490
(161.000)	Vodafone Group Plc	Credit Suisse	32.552	(1.348)	Ashland Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(688)
(744.153)	Vodafone Group Plc	JP Morgan	154.242	1.649	Aspen Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	24.554
(62.880)	Vodafone Group Plc	Morgan Stanley	5.684	(3.424)	AT&T Inc	Credit Suisse	(359)
(3.516)	William Hill Plc	JP Morgan	(1.790)	(1.798)	Autodesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.029
4.376	WizzAir Holdings Plc '144A'	Bank of America Merrill Lynch	11.983	1.605	Autohome Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	23.658
(17.378)	WPP Plc	JP Morgan	11.928	(784)	Avis Budget Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.930
(1.073)	WPP Plc	Credit Suisse	328	807	Axcelis Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(363)
(13.863)	WPP Plc	Morgan Stanley	22.759	(3.309)	Baker Hughes a GE Co	Bank of America Merrill Lynch	3.746
(4.990)	X5 Retail Group NV	Bank of America		(1.490)	Baker Hughes a GE Co	Credit Suisse	1.669
	GDR RegS	Merrill Lynch	3.862	(394)	Bank of New York Mellon Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	330
76.396	ZPG Plc '144A'	Morgan Stanley	812	(1.325)	Baozun Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	(20.802)
			(137.465)	(3.087)	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	19.401
Etats-Unis				(703)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	5.104
(5.599)	2U Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64.417)	1.575	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.691)
1.059	8x8 Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.439)	450	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.309
1.068	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.507	(697)	Bluebird Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.584)
(6.901)	Abeona Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.648)	(1.587)	Blueprint Medicines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13.474)
(4.648)	ABM Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.016	300	Boeing Co/The	Bank of America Merrill Lynch	3.300
(180)	Achaogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53)	2.823	Bofl Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.428
(2.176)	ACI Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.809)	2.229	Boise Cascade Co	Bank of America Merrill Lynch	12.390
(517)	Adamas Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	918	(4.503)	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	16.841
(2.003)	Adient Plc	Bank of America Merrill Lynch	16.965	58	Boston Beer Co Inc/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	840
(314)	Aerie Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	126	1.527	Bristol-Myers Squibb Co	Bank of America Merrill Lynch	1.314
(1.729)	Agios Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.524)	(920)	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15.268)
(6.949)	Alder Biopharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18.319)	48	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	456
(90.114)	Alibaba Group Holding Ltd ADR	Credit Suisse	(205.987)	(1.802)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	961
468	Align Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	40.806	1.506	Brown-Forman Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	3.067
5.956	Altice USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.035	(1.842)	Bunge Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.484
1.105	Altice USA Inc 'A'	Credit Suisse	(22)	(2.477)	C&J Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.310
(289)	Amazon.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43.347)	648	Cabot Microelectronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	8.307
(5.655)	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	15.269				
(458)	AMERCO	Bank of America Merrill Lynch	2.533				
(563)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(191)				
(12.315)	American Outdoor Brands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22.536)				
822	Amgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.692				
(1.616)	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16.160)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
599	Cabot Oil & Gas Corp	Bank of America Merrill Lynch	(107)	(1.853)	DOWDUPONT ORD	Bank of America Merrill Lynch	(2.276)
151	Calavo Growers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(713)	(57)	Dynavax Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	60
(11.577)	Camping World Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	84.978	7.657	Electro Scientific Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	16.233
(9.065)	Cara Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32.634)	3.260	Emergent BioSolutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.184
(7.282)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53.428)	1.402	Enanta Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.852
(10.391)	CARVANA Co	Bank of America Merrill Lynch	(19.479)	1.313	EPAM Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.340
(1.121)	Casey's General Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	6.198	(2.149)	EQT Corp	Bank of America Merrill Lynch	715
(1.693)	Cavium Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.763)	5.066	Etsy Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.579
(6.894)	CenturyLink Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.137	841	Euronet Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.482
1.340	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.018	1.446	Evercore Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5.567
1.393	Charles River Laboratories International Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.304	(1.322)	Evolent Health Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5.618)
(911)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3.626	(1.368)	Exact Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21.519)
(4.642)	Cheniere Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51.279)	385	Exelixis Inc	Bank of America Merrill Lynch	119
1.932	China Biologic Products Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	251	2.089	Expeditors International of Washington Inc	Bank of America Merrill Lynch	24.316
423	Cimpress NV	Bank of America Merrill Lynch	(2.081)	(5.061)	Extraction Oil & Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15.335)
(1.793)	Citigroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.071	881	F5 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.242
(6.204)	Citizens Financial Group Inc	Morgan Stanley	10.547	(1.915)	Facebook Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(48.449)
(2.371)	Clovis Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.178)	(243)	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	(330)
(541)	CME Group Inc	Morgan Stanley	(3.714)	8.521	Fairmount Santrol Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.960
(2.997)	Colfax Corp	Bank of America Merrill Lynch	436	1.264	Ferrari NV	Bank of America Merrill Lynch	8.960
(4.146)	Comcast Corp 'A'	Credit Suisse	5.842	(8.235)	Finisar Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7.247)
1.015	Commerce Bancshares Inc/MO	Bank of America Merrill Lynch	(582)	1.207	First Financial Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.406
1.913	Corcept Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	206	(7.332)	First Horizon National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2.053)
1.299	Core Laboratories NV	Bank of America Merrill Lynch	2.988	2.262	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	294
(3.992)	Corning Inc	Bank of America Merrill Lynch	300	12.593	Flowers Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.095)
(8.669)	Coty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	32.680	2.077	Fortinet Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.906
(2.438)	Cree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20.002)	(1.379)	G-III Apparel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.012)
(2.597)	CRISPR Therapeutics AG	Bank of America Merrill Lynch	2.655	(1.265)	Gartner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.358)
2.246	CVB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	826	(5.794)	GCI Liberty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	27.675
(1.040)	CVS Health Corp	Morgan Stanley	853	(11.378)	GDS Holdings Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(133.344)
(1.535)	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.164)	2.059	Generac Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.574
(2.061)	Deere & Co	Bank of America Merrill Lynch	(3.800)	(33.727)	General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(19.738)
1.777	Delek US Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.238	1.715	Gilead Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.128
2.730	Delphi Automotive Plc	Morgan Stanley	(2.730)	2.937	Glaukos Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.180
174	Delphi Technologies Plc	Bank of America Merrill Lynch	(418)	12.940	GNC Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3.882)
(5.371)	DENTSPLY SIRONA Inc	Bank of America Merrill Lynch	20.374				
1.967	Domtar Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.316				

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(11.810)	Gogo Inc	Bank of America Merrill Lynch	27.390	3.081	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.044
(12.124)	Golar LNG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	33.109	(3.123)	IQVIA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.930)
(1.718)	Goldman Sachs Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	46.082	(4.277)	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.668)
977	Graco Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.042	(554)	Itron Inc	Bank of America Merrill Lynch	(181)
(841)	Guidewire Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.419)	(1.315)	Jack in the Box Inc	Bank of America Merrill Lynch	256
447	Haemonetics Corp	Bank of America Merrill Lynch	652	(3.162)	JD.com Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	3.268
(1.262)	Halliburton Co	Credit Suisse	2.347	(70)	Jumei International Holding Ltd ADR	Morgan Stanley	(13)
7.247	Halozyne Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(507)	6.016	KEMET Corp	Bank of America Merrill Lynch	10.215
2.381	Harsco Corp	Bank of America Merrill Lynch	8.572	(841)	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.154)
(3.123)	HB Fuller Co	Bank of America Merrill Lynch	(8.526)	761	KLA-Tencor Corp	Bank of America Merrill Lynch	9.901
2.730	Health Insurance Innovations Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	8.463	(3.755)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.210)
(3.169)	Healthcare Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.402	(2.010)	Kraft Heinz Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(2.541)
204	HealthEquity Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.410	(10.537)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.971)
(7.358)	Heartland Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.609)	5.403	Kulicke & Soffa Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.097
(1.371)	Hertz Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.186	(4.338)	La Jolla Pharmaceutical Co	Bank of America Merrill Lynch	(16.289)
(1.034)	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	(581)	74	Lam Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	1.237
(6.111)	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	10.258	3.636	Landstar System Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.022
4.425	Hibbett Sports Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.657)	2.909	Lazard Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4.644
(6.509)	Hilltop Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7.550)	(2.022)	Lennar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3.320
(727)	Himax Technologies Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	(225)	(1.691)	Liberty Broadband Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2.630
1.767	HollyFrontier Corp	Bank of America Merrill Lynch	22.579	(3.171)	Liberty Broadband Corp 'C'	Bank of America Merrill Lynch	39.860
(3.222)	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.486)	(4.285)	Liberty Global Plc 'A'	Credit Suisse	5.526
2.857	Huntsman Corp	Bank of America Merrill Lynch	901	(2.680)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5.065)
(1.861)	II-VI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.910)	867	Ligand Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	34.810
14.071	ImmunoGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(835)	(641)	Lithia Motors Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	200
(12.127)	Immunomedics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39.046)	9.215	Louisiana-Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.888)
(5.748)	Infinera Corp	Bank of America Merrill Lynch	15.577	1.092	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.545
10.729	Innoviva Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.004	(90)	Lumentum Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	360
903	Inogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	37.475	(3.685)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15.174)
(1.233)	Insmed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.883)	(1.237)	MakeMyTrip Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.979
(1.545)	Insulet Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12.793)	3.649	Manhattan Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	474
(6.009)	Intel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17.486)	(5.899)	Marathon Petroleum Corp	Morgan Stanley	(16.281)
(1.562)	Intellia Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.715)	(28.117)	Mattel Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40.043)
(6.827)	InterXion Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	(1.592)	1.626	MAXIMUS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.162)
(6.288)	Intrexon Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.981	(6.116)	MaxLinear Inc	Bank of America Merrill Lynch	22.243
				(6)	McDermott International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(3.693)	Medicines Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(13.221)	1.460	Philip Morris International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.784)
(1.375)	Mercury Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.341)	2.777	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1.296)
(3.332)	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19.459)	1.588	Plantronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.054
18.803	MiMedx Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.573	(4.062)	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16.784)
2.102	Moelis & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	10.819	2.134	PRA Health Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	11.332
(592)	Mohawk Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.256	(2.545)	Procter & Gamble Co/The	Morgan Stanley	687
2.940	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	8.119	1.655	Prudential Financial Inc	Credit Suisse	(5.610)
3.624	Momo Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	37.798	(1.937)	QEP Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(387)
17.024	Monsanto Co	Credit Suisse	44.773	1.696	Qualys Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.714
(1.702)	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	441	(4.073)	Radius Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.643
(4.154)	Mosaic Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(6.012)	788	Ralph Lauren Corp	Bank of America Merrill Lynch	14.659
603	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.634	(36)	Rayonier Advanced Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	59
8.314	MSG Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7.483)	745	Red Hat Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.427
1.221	Myriad Genetics Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.281	(3.551)	Repligen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(23.224)
849	National Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.153	(6.385)	REV Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.867
(5.663)	Navistar International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.529)	(288)	Rockwell Collins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(701)
(2.278)	Nektar Therapeutics	Bank of America Merrill Lynch	47.109	(9.428)	Roku Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.133)
1.722	NetApp Inc	Bank of America Merrill Lynch	811	6.395	RPC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.753)
(1.509)	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67.229)	628	S&P Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.785
1.916	NETGEAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	5.286	167	Sanderson Farms Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.469)
(14.315)	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	29.835	(4.874)	Santander Consumer USA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.264
(1.542)	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.415	(876)	Schlumberger Ltd	Credit Suisse	788
409	NRG Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	239	(10.600)	Sea Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(46.322)
1.470	Nutrisystem Inc	Bank of America Merrill Lynch	10.878	1.521	Seagate Technology Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.125
(1.327)	NVIDIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25.485)	(2.418)	Seattle Genetics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19.852)
53	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.915)	(683)	Sempra Energy	Bank of America Merrill Lynch	(583)
(7.530)	Okta Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119.350)	496	Shutterstock Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.460
(2.849)	Omnicom Group Inc	Credit Suisse	8.775	101	Silicon Motion Technology Corp ADR	Bank of America Merrill Lynch	173
3.282	Orion Engineered Carbons SA	Bank of America Merrill Lynch	1.053	664	SINA Corp/China	Bank of America Merrill Lynch	(3.171)
(15.532)	Parsley Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(18.820)	(685)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	1.678
(7.756)	Pattern Energy Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3.413)	2.966	SMART Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	19.370
(15.643)	Patterson-UTI Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25.967)	(30.056)	Snap Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	74.487
1.326	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6.306	1.455	SodaStream International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13.342)
1.941	Pegasystems Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.232	2.490	SolarEdge Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	17.270
(2.639)	Penumbra Inc	Bank of America Merrill Lynch	(97.115)	(1.365)	SPDR S&P 500 ETF Trust	Morgan Stanley	1.188
3.742	PetMed Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	12.137	(1.620)	Spectrum Brands Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.065)
				1.367	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.199

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(2.844)	Spirit Airlines Inc	Bank of America Merrill Lynch	(881)	7.986	Vector Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.757)
(6.414)	Square Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(58.175)	(7.791)	Veeco Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.024)
(9.345)	Sterling Bancorp/DE	Bank of America Merrill Lynch	(15.066)	1.889	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	13.922
(457)	Stryker Corp	Credit Suisse	(4.232)	(53.435)	VEON Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	10.758
2.697	Supernus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	27.363	352	VeriSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	4.801
(13.755)	Switch Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	25.962	(35)	Verizon Communications Inc	Credit Suisse	20
(4.306)	Symantec Corp	Bank of America Merrill Lynch	29.281	982	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.643
2.706	TAL Education Group ADR	Bank of America Merrill Lynch	12.532	(2.555)	ViaSat Inc	Bank of America Merrill Lynch	(332)
(5.215)	Targa Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14.940)	(6.982)	Viavi Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.229
(3.044)	Teladoc Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25.113)	(5.247)	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	(11.543)
(775)	Tenaris SA ADR	Bank of America Merrill Lynch	318	794	VMware Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	9.714
2.790	Teradyne Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.749	317	Vodafone Group Plc ADR	Credit Suisse	(501)
409	Terex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(661)	5.413	Vonage Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(113)
(1.506)	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	7.878	(848)	Vulcan Materials Co	Bank of America Merrill Lynch	(1.852)
(24.110)	TherapeuticsMD Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9.105)	1.943	Warrior Met Coal Inc	Bank of America Merrill Lynch	956
(849)	Thomson Reuters Corp	Morgan Stanley	(407)	(2.944)	Wayfair Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(80.660)
2.978	Tiffany & Co	Credit Suisse	86.451	(67.127)	Weatherford International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5.297)
4.267	Tivity Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1.067)	248	Westlake Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(506)
2.558	Toro Co/The	Bank of America Merrill Lynch	3.377	1.836	Wingstop Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3.901)
1.169	TripAdvisor Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.035	2.124	Winnebago Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4.779)
2.572	Tupperware Brands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.009)	4.937	World Fuel Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(839)
1.427	Ubiquiti Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.906	(17.351)	WPX Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62.290)
(5.186)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67.783)	(6.215)	Wright Medical Group NV	Bank of America Merrill Lynch	(34.149)
1.265	UMB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	4.681	842	Yelp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(598)
480	United Therapeutics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1.416)	(4.574)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(15.086)
(2.188)	Universal Display Corp	Bank of America Merrill Lynch	10.318	1.286	Zoetis Inc	Bank of America Merrill Lynch	2.172
542	Universal Display Corp	Bank of America Merrill Lynch	(778)				(537.732)
1.385	Valero Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	18.102	Total (exposition brute sous-jacente – 248.342.286 USD)			(456.720)
1.302	Varian Medical Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.906				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR 275.000	Fund receives default protection on Casino Guichard Perrachon SA and pays Fixed 1,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2020	(33.644)	9.947
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Rallye SA and pays Fixed 5,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2021	(13.108)	36.818
CDS	EUR 400.000	Fund receives default protection on ArcelorMittal and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/12/2020	(121.641)	(52.866)
CDS	USD 600.000	Fund receives default protection on DISH DBS Corp and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/12/2020	(9.076)	(28.645)
CDS	USD 1.500.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.26 and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/12/2020	(32.391)	(24.616)
CDS	USD 201.000	Fund receives default protection on Neiman Marcus Group Inc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/12/2020	15.151	18.286
CDS	USD 600.000	Fund receives default protection on Xerox Corp and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/12/2020	(41.220)	(2.535)
CDS	USD 1.600.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Frontier Communications Corp	Barclays Bank	20/12/2020	225.519	(158.481)
CDS	JPY 24.000.000	Fund receives default protection on ITOCHU Corp and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2021	(594)	(5.611)
CDS	USD 2.000.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.26 and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2021	(11.601)	(36.359)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Neiman Marcus Group Inc and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2021	60.664	34.932
CDS	EUR 1.300.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Deutsche Bank AG	Barclays Bank	20/12/2021	66.837	(15.790)
CDS	USD 1.000.000	Fund receives default protection on Arconic Inc and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/12/2021	(35.361)	4.941
CDS	USD 4.000.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.27 and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/12/2021	(27.654)	(73.838)
CDS	USD 9.900.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.HY.28 and pays Fixed 5,000%	Barclays Bank	20/6/2022	(30.684)	(738.039)
CDS	USD 5.000.000	Fund receives default protection on Markit CDX.NA.IG.28 and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/6/2022	5.271	(87.165)
CDS	EUR 600.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Barclays Bank	20/12/2022	8.214	(7.815)
CDS	USD 734.000	Fund receives default protection on Nordstrom Inc and pays Fixed 1,000%	Goldman Sachs	20/6/2023	3.525	34.248
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Alcoa Inc and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/12/2020	(52.439)	(31.962)
CDS	USD 600.000	Fund receives default protection on Devon Energy Corp and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2020	(153.777)	(11.609)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Sears Roebuck Acceptance Corp and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/12/2020	(18.755)	63.745
CDS	EUR 676.000	Fund receives default protection on Telecom Italia SpA/Milano and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2021	(38.367)	4.611
CDS	USD 400.000	Fund receives default protection on Teck Resources Ltd and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2021	(163.046)	(53.046)
CDS	EUR 900.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Deutsche Bank AG	JP Morgan	20/12/2021	4.630	(48.913)
CDS	USD 1.500.000	Fund receives default protection on American Axle & Manufacturing Inc and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2022	(94.184)	(166.249)
CDS	USD 1.000.000	Fund receives default protection on CenturyLink Inc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2022	(2.809)	66.149
CDS	USD 1.000.000	Fund receives default protection on Freeport-McMoRan Inc and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2022	(111.683)	5.817
CDS	USD 1.000.000	Fund receives default protection on Weatherford International Ltd and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/6/2022	(54.181)	146.819
CDS	EUR 400.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Version 1 and pays Fixed 1,000%	JP Morgan	20/12/2022	5.999	(5.210)
CDS	EUR 275.000	Fund receives default protection on Rallye SA and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/12/2022	47.607	54.346
CDS	USD 912.000	Fund receives default protection on SuperValu Inc and pays Fixed 5,000%	JP Morgan	20/6/2023	(23.539)	50.562
IRS	USD 6.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 1,905%	Morgan Stanley	21/11/2023	266.399	266.399
IRS	USD 5.000.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,099%	Morgan Stanley	21/11/2026	271.198	271.198
TRS	EUR 396.208	Fund receives 1 Month EURIBOR and pays STOXX 600 Automobiles & Parts Gross Return Index	Morgan Stanley	31/10/2018	29.728	29.728
TRS	EUR 309.865	Fund receives 1 Month EURIBOR and pays STOXX 600 Chemicals Gross Return Index	Morgan Stanley	31/10/2018	10.236	10.236

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
TRS	EUR 535.384	Fund receives 1 Month EURIBOR and pays STOXX Europe 600 Utilities Gross Return	Morgan Stanley	31/10/2018	26.383	26.383
Total (exposition brute sous-jacente – 58.947.090 USD)					(22.393)	(413.584)

CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance
 IRS (interest rate swaps) : swaps sur taux d'intérêt
 TRS (total return swaps) : swaps sur rendement total

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
AUD	189.000	USD	142.800	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	370
AUD	12.589.161	USD	9.685.827	UBS	20/6/2018	(148.678)
BRL	25.976.980	USD	7.176.779	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2018	(201.314)
BRL	7.798.882	USD	2.129.591	Bank of America Merrill Lynch	3/7/2018	(41.148)
CAD	120.969	USD	93.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	393
CAD	16.510.171	USD	12.816.980	UBS	20/6/2018	(65.355)
CLP	995.281.491	USD	1.646.557	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(70.006)
CZK	29.021.079	USD	1.417.883	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(106.774)
DKK	306.709	USD	49.000	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2018	(978)
DKK	4.070.250	USD	654.055	JP Morgan	14/6/2018	(16.475)
EUR	2.209.000	USD	2.588.369	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	(14.062)
EUR	1.293.908	USD	1.545.791	JP Morgan	14/6/2018	(37.151)
EUR	10.154.008	USD	12.502.749	UBS	20/6/2018	(657.785)
GBP	351.000	USD	470.441	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	(3.801)
GBP	5.691.613	USD	7.995.276	UBS	20/6/2018	(423.602)
HKD	4.424.254	USD	564.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	(252)
HUF	264.351.332	USD	1.050.728	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(84.814)
ILS	3.183.306	USD	924.483	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(31.826)
INR	321.768.552	USD	4.832.755	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(73.613)
JPY	24.380.296	USD	222.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	2.751
JPY	1.326.209.915	USD	12.438.561	UBS	20/6/2018	(201.891)
KRW	3.391.660.142	USD	3.178.444	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(37.727)
NOK	842.053	USD	104.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	(1.158)
NOK	12.035.192	USD	1.543.106	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(72.464)
NOK	36.497.847	USD	4.672.016	UBS	20/6/2018	(212.156)
NZD	4.897.244	USD	3.536.220	UBS	20/6/2018	(103.822)
PHP	15.618.873	USD	298.761	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(2.553)
PLN	4.310.388	USD	1.268.419	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(104.333)
RUB	309.948.837	USD	5.390.467	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(420.252)
SEK	1.052.676	USD	121.000	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2018	(1.622)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
SEK	6.425.371	USD	780.074	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(50.714)
SEK	36.506.459	USD	4.242.153	UBS	20/6/2018	(98.209)
SGD	504.557	USD	376.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	718
SGD	759.804	USD	577.927	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(10.506)
TRY	39.860.192	USD	9.950.049	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(1.218.516)
TWD	50.187.921	USD	1.725.779	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(50.720)
USD	90.611	AUD	121.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	(1.048)
USD	113	AUD	151	JP Morgan	14/6/2018	(1)
USD	781.012	AUD	1.000.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	23.444
USD	11.873.424	AUD	15.542.285	UBS	20/6/2018	99.082
USD	7.043.969	BRL	25.976.980	Bank of America Merrill Lynch	4/6/2018	68.504
USD	128.716	BRL	479.936	Bank of America Merrill Lynch	3/7/2018	195
USD	105.000	CAD	134.886	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	862
USD	110.847	CAD	142.553	JP Morgan	14/6/2018	767
USD	781.855	CAD	1.005.142	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	5.535
USD	8.858.154	CAD	11.333.064	UBS	20/6/2018	105.066
USD	197.000	CHF	195.696	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	(1.580)
USD	785.499	CHF	783.554	JP Morgan	14/6/2018	(10.066)
USD	431.108	CHF	403.231	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	21.465
USD	1.082.252	CLP	676.166.303	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	11.188
USD	1.447.655	CZK	31.076.804	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	43.673
USD	1.262.680	DKK	7.878.309	JP Morgan	14/6/2018	28.585
USD	395.725	EUR	330.000	JP Morgan	4/6/2018	11.226
USD	589.291	EUR	497.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	10.101
USD	13.165.223	EUR	11.054.373	JP Morgan	14/6/2018	276.305
USD	2.496.016	EUR	2.000.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	162.954
USD	14.806.730	EUR	12.194.393	UBS	20/6/2018	581.594
USD	5.280.243	EUR	4.500.000	JP Morgan	27/6/2018	27.835
USD	134.456	GBP	99.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	2.840
USD	63.134	GBP	47.389	JP Morgan	14/6/2018	112
USD	696.886	GBP	500.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	31.725
USD	11.770.185	GBP	8.451.546	UBS	20/6/2018	526.913

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	8.005.613	GBP	6.000.000	JP Morgan	27/6/2018	20.640
USD	687.000	HKD	5.388.946	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	329
USD	281.444	HKD	2.207.419	JP Morgan	14/6/2018	110
USD	899.557	HKD	7.034.481	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	2.865
USD	1.701.236	HUF	451.159.399	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	52.744
USD	1.858.378	ILS	6.619.838	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	2.054
USD	5.123.195	INR	341.694.904	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	69.331
USD	327.000	JPY	35.773.214	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	(2.777)
USD	10.150.490	JPY	1.093.161.572	UBS	20/6/2018	64.109
USD	325.000	JPY	35.433.496	JP Morgan	27/6/2018	(2.108)
USD	2.950.071	KRW	3.159.959.670	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	23.911
USD	86.000	NOK	702.075	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	254
USD	4.909	NOK	39.739	JP Morgan	14/6/2018	55
USD	1.723.671	NOK	13.841.731	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	32.278
USD	2.697.389	NOK	21.233.551	UBS	20/6/2018	102.752
USD	2.150.790	NZD	2.984.192	UBS	20/6/2018	59.219
USD	2.524.654	PHP	132.763.697	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	6.822
USD	42.000	PLN	150.404	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	1.391
USD	1.667.623	PLN	5.984.120	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	51.520
USD	1.616.304	RUB	102.127.670	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(21.374)
USD	265.000	SEK	2.321.238	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2018	1.763
USD	1.319.585	SEK	11.431.890	JP Morgan	14/6/2018	22.573
USD	2.208.556	SEK	18.617.613	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	95.222
USD	8.058.321	SEK	66.080.860	UBS	20/6/2018	557.309
USD	150.000	SGD	200.477	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	318
USD	2.406.653	SGD	3.205.549	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	12.751
USD	46.000	TRY	206.937	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	436
USD	9.496.731	TRY	43.224.438	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	28.246

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	10.147.830	TWD	297.171.052	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	229.524
USD	454.000	ZAR	5.727.719	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	770
USD	975.696	ZAR	12.079.459	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	21.499
ZAR	2.885.545	USD	231.000	Bank of America Merrill Lynch	7/6/2018	(2.669)
ZAR	59.259.100	USD	4.872.178	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(191.101)
						(1.292.003)
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	18.046.590	USD	18.005.948	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	315.556
USD	2.788.245	CHF	2.778.340	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(32.419)
						283.137
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	73.847.896	USD	87.871.302	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1.774.937)
USD	5.471.864	EUR	4.621.173	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	84.220
						(1.690.717)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	9.530.362	USD	12.942.871	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(269.261)
USD	1.673.980	GBP	1.248.001	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	14.370
						(254.891)
Catégorie d'Actions couverte en couronnes suédoises						
SEK	678.646.812	USD	77.793.444	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(803.577)
USD	1.678.945	SEK	14.773.162	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	2.987
						(800.590)
Total (exposition brute sous-jacente – 485.953.302 USD)						(3.755.064)

Dépôts à terme au 31 mai 2018

Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
DÉPÔTS À TERME		
Credit Agricole Corp	5.362.445	2,10
Skandinaviska Enskilda Banken AB	5.359.404	2,10
Total des dépôts à terme	10.721.849	4,20

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
(1)	EUR	3 Month EURIBOR	Juin 2018	1.169.452	(29)
(1)	EUR	3 Month EURIBOR	Décembre 2018	1.169.452	-
30	EUR	3 Month EURIBOR	Mars 2019	35.083.546	(2.724)
59	EUR	3 Month EURIBOR	Juin 2019	68.997.640	(859)
48	CHF	3 Month Euro Swiss Franc Futures	Mars 2019	48.954.272	4.286
(1)	AUD	90 Day Bank Bill	Septembre 2018	755.798	(18)
43	AUD	90 Day Bank Bill	Mars 2019	32.499.318	5.233
(401)	USD	90 Day Euro	Mars 2019	401.000.000	(21.887)
(68)	USD	90 Day Euro	Septembre 2019	68.000.000	(9.200)
(89)	GBP	90 Day Sterling	Mars 2019	59.274.281	(22.565)
(1)	GBP	90 Day Sterling	Décembre 2018	666.003	(100)
(108)	GBP	90 Day Sterling	Juin 2019	71.928.341	(10.767)
53	EUR	Amsterdam Index	Juin 2018	6.861.367	(74.535)
(76)	USD	AUD/USD	Juin 2018	5.756.240	98.790
(25)	AUD	Australian 10 Year Bond	Juin 2018	2.437.552	(42.566)
(51)	AUD	Australian 3 Year Bond	Juin 2018	3.529.538	(11.879)
(95)	CAD	Banker's Acceptance Bill	Juin 2019	73.133.039	(6.369)
(147)	TRY	BIST 30 Index	Juin 2018	405.053	3.090
45	USD	British Pound Futures	Juin 2018	3.739.500	(208.750)
109	EUR	CAC 40 Index	Juin 2018	6.849.180	(188.218)
(3)	EUR	CAC 40 Index	Juin 2018	188.509	3.233
5	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	346.690	1.158
(15)	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	1.040.070	(24.317)
(79)	USD	Canadian Dollar Futures	Juin 2018	6.098.800	(65)
14	USD	CBOE Volatility Index	Juin 2018	214.900	2.550
4	EUR	DAX Index	Juin 2018	1.475.603	(42.091)
(27)	EUR	DAX Index	Juin 2018	9.960.324	(125.363)
(30)	USD	DJIA Mini Index	Juin 2018	3.678.000	13.940
9	USD	Dollar Index	Juin 2018	847.170	2.800
3	USD	E-Mini S&P 400 Index	Juin 2018	589.020	12.650
9	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	1.222.650	11.125
(29)	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	3.939.650	(23.575)
(32)	USD	EUR/USD	Juin 2018	4.663.800	171.494
22	EUR	Euro BOBL	Juin 2018	2.799.791	23.466
(42)	EUR	Euro BOBL	Juin 2018	5.345.056	(92.862)
55	EUR	Euro BTP	Juin 2018	7.415.948	(567.684)
(10)	EUR	Euro BTP	Juin 2018	1.149.337	(24.142)
(54)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	6.343.519	(264.244)
4	EUR	Euro BUXL	Juin 2018	707.453	21.182
(11)	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	1.302.798	(2.243)
85	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	10.067.077	17.052
(429)	EUR	EURO STOXX 50 Index	Juin 2018	17.064.849	(71.775)
226	EUR	EURO STOXX 50 Index	Juin 2018	8.989.874	95.670
(7)	EUR	Euro-OAT	Juin 2018	984.288	(29.035)
55	EUR	Euro-OAT	Juin 2018	7.733.689	115.595
(39)	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	3.984.628	(216.047)
8	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	817.360	(3.350)
(1)	GBP	FTSE 250 Index	Juin 2018	55.537	(2.620)
94	USD	FTSE China A50	Juin 2018	1.156.905	1.175
166	MYR	FTSE KLCI	Juin 2018	3.600.490	(141.822)
(2)	EUR	FTSE MIB Index	Juin 2018	253.187	15.030
4	EUR	FTSE MIB Index	Juin 2018	506.374	(36.790)
(149)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index	Juin 2018	5.903.007	160.966
78	HKD	Hang Seng China Enterprises Index	Juin 2018	5.927.988	24.705
(1)	HKD	Hang Seng Index	Juin 2018	194.281	(3.676)
(39)	EUR	IBEX 35 Index	Juin 2018	4.304.155	286.091
10	JPY	Japan 10 Year Bond	Juin 2018	9.491.132	19.264
8	USD	Japanese Yen Futures	Juin 2018	922.600	5.438
51	KRW	Korean 10 Year Bond	Juin 2018	5.679.336	32.172
(78)	KRW	KOSPI 200 Index	Juin 2018	5.613.294	33.142
154	USD	Mexican Peso Futures	Juin 2018	3.839.220	(120.585)
29	USD	Mini MSCI EAFE Index	Juin 2018	2.882.165	(55.940)
37	USD	Mini MSCI Emerging Markets Index	Juin 2018	2.068.670	(4.345)
181	SGD	MSCI Singapore Index	Juin 2018	5.290.540	(142.370)
(21)	USD	MSCI Taiwan Index	Juin 2018	829.290	8.960
(37)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Stock Index	Juin 2018	5.173.895	(47.770)
(10)	USD	New Zealand Dollar Futures	Juin 2018	700.800	(8.730)
36	JPY	Nikkei 225 Index	Juin 2018	3.684.778	28.089
(1)	JPY	Nikkei 225 Index	Juin 2018	204.526	3.503
(3)	JPY	Nikkei 225 Index	Juin 2018	307.065	4.071
(335)	NOK	OBX Index	Juin 2018	3.286.732	46.229
(54)	SEK	OMX Stockholm 30 Index	Juin 2018	950.921	27.657

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
58	SEK	OMX Stockholm 30 Index	Juin 2018	1.021.359	(29.848)
(57)	USD	Russell 2000 Mini Index	Juin 2018	4.696.515	(206.520)
28	CAD	S&P/TSX 60 Index	Juin 2018	4.093.006	97.879
80	THB	SET 50 Index	Juin 2018	568.828	(24.015)
20	USD	SGX CNX NIFTY Index	Juin 2018	428.640	1.940
58	AUD	SPI 200 Index	Juin 2018	6.607.824	(34.637)
42	EUR	STOXX Europe 600 Index	Juin 2018	939.821	(1.730)
(19)	USD	Swiss Franc Futures	Juin 2018	2.412.050	15.600
(44)	CHF	Swiss Market Index	Juin 2018	3.813.006	172.324
16	TWD	TAIEX Index	Juin 2018	1.160.423	(8.498)
(13)	JPY	Topix Index	Juin 2018	2.090.281	22.167
(53)	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	8.976.818	(10.222)
(17)	USD	US Long Bond	Septembre 2018	2.084.047	(20.742)
3	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	302.007	156
(13)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	1.291.004	(1.422)
(51)	USD	US Treasury 2 Year Note	Septembre 2018	10.035.372	9.562
8	USD	US Treasury 2 Year Note	Septembre 2018	1.574.176	(750)
(32)	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	3.113.536	5.445
10	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	972.980	(1.328)
(5)	USD	US Ultra Bond	Septembre 2018	568.765	(4.852)
(278)	EUR	VSTOXX Mini Index	Juin 2018	550.650	(95.688)
Total				1.131.308.421	(1.467.280)

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
11	Call	UniCredit SpA	Credit Suisse	EUR 16,50	14/6/2018	(6.407)	208
12	Call	UniCredit SpA	Credit Suisse	EUR 18,00	14/6/2018	(6.732)	40
17	Call	UniCredit SpA	Credit Suisse	EUR 18,50	14/6/2018	(7.653)	35
12	Put	UniCredit SpA	Credit Suisse	EUR 17,50	14/6/2018	39.564	47.646
18	Call	Airbus SE	Credit Suisse	EUR 100,00	15/6/2018	(3.599)	2.345
26	Call	Akzo Nobel NV	Credit Suisse	EUR 80,00	15/6/2018	(6.906)	303
23	Call	Akzo Nobel NV	Credit Suisse	EUR 84,00	15/6/2018	(5.852)	39
23	Call	Atos SE	Credit Suisse	EUR 110,00	15/6/2018	4.934	17.764
23	Call	Atos SE	Credit Suisse	EUR 115,00	15/6/2018	(78)	8.402
23	Call	Atos SE	Credit Suisse	EUR 120,00	15/6/2018	(7.093)	3.470
232	Call	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Credit Suisse	EUR 6,50	15/6/2018	(5.154)	254
23	Call	BASF SE	Credit Suisse	EUR 88,00	15/6/2018	(2.619)	669
46	Call	Bayer AG Reg	Credit Suisse	EUR 105,00	15/6/2018	(4.129)	3.500
12	Call	Continental AG	Credit Suisse	EUR 220,00	15/6/2018	(2.480)	4.608
12	Call	Continental AG	Credit Suisse	EUR 230,00	15/6/2018	(5.747)	778
12	Call	Continental AG	Credit Suisse	EUR 240,00	15/6/2018	(2.779)	92
23	Call	Danone SA	Credit Suisse	EUR 68,00	15/6/2018	(5.192)	674
23	Call	Danone SA	Credit Suisse	EUR 70,00	15/6/2018	(1.804)	218
696	Call	Deutsche Telekom AG Reg	Credit Suisse	EUR 14,50	15/6/2018	(11.650)	677
107	Call	ING Groep NV	Credit Suisse	EUR 13,50	15/6/2018	(2.724)	240
174	Call	ING Groep NV	Credit Suisse	EUR 14,00	15/6/2018	(6.854)	133
174	Call	ING Groep NV	Credit Suisse	EUR 14,50	15/6/2018	(3.330)	57
46	Call	Koninklijke DSM NV	Credit Suisse	EUR 85,00	15/6/2018	568	10.740
49	Call	Koninklijke DSM NV	Credit Suisse	EUR 90,00	15/6/2018	(2.958)	1.537
1.533	Call	Koninklijke KPN NV	Credit Suisse	EUR 2,49	15/6/2018	1.868	1.868
23	Call	Safran SA	Credit Suisse	EUR 100,00	15/6/2018	4.852	8.183
23	Call	SAP SE	Credit Suisse	EUR 97,00	15/6/2018	(88)	3.045
116	Call	UBS Group AG Reg	Credit Suisse	CHF 17,00	15/6/2018	(3.817)	162
23	Call	Valeo SA	Credit Suisse	EUR 56,00	15/6/2018	(3.768)	523
23	Call	Valeo SA	Credit Suisse	EUR 58,00	15/6/2018	(2.533)	99
46	Call	Vinci SA	Credit Suisse	EUR 86,00	15/6/2018	(2.834)	3.195
137	Call	Vivendi SA	Credit Suisse	EUR 24,00	15/6/2018	(8.960)	518
185	Call	Vodafone Group Plc	Credit Suisse	GBP 1,95	15/6/2018	(14.633)	2.061
185	Call	Vodafone Group Plc	Credit Suisse	GBP 215,00	15/6/2018	(11.919)	1
162	Put	Aegon NV	Credit Suisse	EUR 5,40	15/6/2018	(1.302)	3.542
12	Put	Allianz SE Reg	Credit Suisse	EUR 175,00	15/6/2018	(3.153)	3.009
23	Put	BASF SE	Credit Suisse	EUR 82,00	15/6/2018	(2.032)	1.575
93	Put	ING Groep NV	Credit Suisse	EUR 13,50	15/6/2018	5.238	11.343

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
58	Put	Publicis Groupe SA	Credit Suisse	EUR 56,00	15/6/2018	(10.143)	4.673
107	Call	Enel SpA	Credit Suisse	EUR 5,00	19/7/2018	(3.987)	6.948
16	Call	UniCredit SpA	Credit Suisse	EUR 15,00	19/7/2018	(2.248)	7.045
11	Put	Atlantia SpA	Credit Suisse	EUR 25,00	19/7/2018	3.835	9.307
16	Put	UniCredit SpA	Credit Suisse	EUR 15,00	19/7/2018	13.971	24.924
16	Put	UniCredit SpA	Credit Suisse	EUR 15,50	19/7/2018	20.257	31.424
536	Call	Aegon NV	Credit Suisse	EUR 5,80	20/7/2018	(8.729)	4.226
215	Call	AXA SA	Credit Suisse	EUR 23,00	20/7/2018	(5.188)	3.261
751	Call	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Credit Suisse	EUR 6,25	20/7/2018	(10.391)	8.062
23	Call	BASF SE	Credit Suisse	EUR 90,00	20/7/2018	(1.924)	1.228
43	Call	Bayer AG Reg	Credit Suisse	EUR 110,00	20/7/2018	(586)	3.166
43	Call	BNP Paribas SA	Credit Suisse	EUR 56,00	20/7/2018	(2.104)	3.890
46	Call	Cie de Saint-Gobain	Credit Suisse	EUR 45,00	20/7/2018	(3.024)	1.216
430	Call	ING Groep NV	Credit Suisse	EUR 13,00	20/7/2018	(3.110)	10.375
214	Call	ING Groep NV	Credit Suisse	EUR 14,00	20/7/2018	(2.872)	1.039
23	Call	Koninklijke DSM NV	Credit Suisse	EUR 90,00	20/7/2018	(2.179)	3.057
23	Call	SAP SE	Credit Suisse	EUR 98,00	20/7/2018	586	4.945
107	Call	UBS Group AG Reg	Credit Suisse	CHF 15,50	20/7/2018	(1.238)	2.714
215	Call	UBS Group AG Reg	Credit Suisse	CHF 16,00	20/7/2018	(4.173)	5.267
70	Call	Verizon Communications Inc	Credit Suisse	USD 52,50	20/7/2018	(3.733)	630
11	Call	WPP PLC	Credit Suisse	GBP 14,00	20/7/2018	(3.876)	490
11	Put	Allianz SE Reg	Credit Suisse	EUR 185,00	20/7/2018	6.862	11.450
107	Put	BNP Paribas SA	Credit Suisse	EUR 56,00	20/7/2018	31.354	44.407
107	Put	BNP Paribas SA	Credit Suisse	EUR 58,00	20/7/2018	51.058	63.296
54	Put	Publicis Groupe SA	Credit Suisse	EUR 58,00	20/7/2018	3.912	16.268
43	Put	Renault SA	Credit Suisse	EUR 80,00	20/7/2018	6.408	16.979
215	Call	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Credit Suisse	EUR 6,25	17/8/2018	(201)	3.545
107	Call	UBS Group AG Reg	Credit Suisse	CHF 16,00	17/8/2018	551	3.799
23	Call	Bayer AG Reg	Credit Suisse	EUR 100,00	21/9/2018	11.433	15.293
23	Call	Bayer AG Reg	Credit Suisse	EUR 110,00	21/9/2018	1.839	4.556
63	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.350,00	15/6/2018	39.523	65.257
81	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.400,00	15/6/2018	(1.119)	52.568
116	Call	Verizon Communications Inc	Exchange Traded	USD 52,50	15/6/2018	(4.330)	232
29	Put	Apple Inc	Exchange Traded	USD 160,00	15/6/2018	(14.239)	145
8	Put	DAX Index	Exchange Traded	EUR 12.100,00	15/6/2018	(5.321)	1.724
6	Put	DAX Index	Exchange Traded	EUR 12.200,00	15/6/2018	(5.741)	1.765
2	Put	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 6.500,00	15/6/2018	(2.360)	27
23	Put	KLA-Tencor Corp	Exchange Traded	USD 100,00	15/6/2018	(11.557)	230
9	Put	Lam Research Corp	Exchange Traded	USD 180,00	15/6/2018	(9.261)	369
2	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.500,00	15/6/2018	(11.340)	410
18	Call	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 7.700,00	20/7/2018	3.469	30.148
9	Put	DAX Index	Exchange Traded	EUR 12.500,00	20/7/2018	1.783	11.053
34	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.350,00	20/7/2018	(3.761)	20.402
15	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.400,00	20/7/2018	(925)	12.182
57	Put	Monsanto Co	Exchange Traded	USD 110,00	20/7/2018	(17.290)	570
3	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2.600,00	20/7/2018	(15.371)	5.730
47	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.300,00	17/8/2018	(5.195)	28.860
11	Put	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 7.450,00	17/8/2018	(2.028)	16.633
25	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.525,00	21/9/2018	(968)	16.982
54	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.700,00	21/9/2018	(13.166)	9.564
459	Call	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 140,00	21/9/2018	(30.046)	4.011
8	Call	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 8.100,00	21/9/2018	(4.110)	3.908
14	Put	DAX Index	Exchange Traded	EUR 12.500,00	21/9/2018	6.359	29.770
39	Put	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3.250,00	21/9/2018	(7.085)	27.946
8	Put	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 7.500,00	21/9/2018	(3.458)	17.600
5	Put	DAX Index	Exchange Traded	EUR 12.500,00	21/12/2018	2.432	15.351
1.100	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3.150,00	20/12/2019	(737.000)	4.433.000
Total (exposition brute sous-jacente – 71.141.501 USD)						(869.500)	5.267.470

BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund suite

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	17,15
Finance	10,86
Titres adossés à des actifs	9,07
Communications	8,33
Titres hypothécaires	5,16
Biens de consommation non cyclique	4,83
Technologie	4,27
Matériaux de base	3,77
Biens de consommation cyclique	3,77
Énergie	3,42
Valeurs industrielles	2,40
Organismes de placement collectif	2,24
Services aux collectivités	2,09
Diversifiés	0,08
Portefeuille de titres à la valeur de marché	77,44
Autres éléments de l'actif net	22,56
	100,00

BlackRock Style Advantage Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
OBLIGATIONS				Supranational suite			
USD 20.000.000	Allemagne Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 4,50% 16/7/2018	20.058.581	0,60	USD 13.000.000	Inter-American Development Bank FRN 12/9/2018	13.000.303	0,39
USD 141.170.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,125% 6/8/2018	140.911.758	4,23	USD 180.000.000	Inter-American Development Bank 1,00% 13/5/2019	177.593.229	5,34
USD 95.010.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,00% 7/9/2018	94.753.552	2,85	USD 30.000.000	International Bank for Reconstruction & Development 1,00% 15/6/2018	29.989.710	0,90
USD 140.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,125% 16/11/2018	139.367.659	4,19	USD 50.000.000	International Bank for Reconstruction & Development 1,875% 15/3/2019	49.863.783	1,50
USD 18.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375% 14/12/2018	17.926.423	0,54	USD 50.000.000	International Bank for Reconstruction & Development 1,375% 22/4/2019	49.614.319	1,49
USD 116.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,50% 6/2/2019	115.328.625	3,46	USD 50.000.000	International Bank for Reconstruction & Development 1,25% 26/7/2019	49.357.028	1,48
		528.346.598	15,87	USD 39.214.000	International Finance Corp 0,875% 15/6/2018	39.200.608	1,18
				USD 65.420.000	International Finance Corp 1,25% 16/7/2018	65.347.303	1,96
				USD 54.500.000	International Finance Corp 1,75% 4/9/2018	54.455.855	1,64
						1.670.534.099	50,19
				Etats-Unis			
USD 60.000.000	Supranational African Development Bank 1,625% 2/10/2018	59.868.327	1,80	USD 87.000.000	United States Treasury Bill 21/6/2018 (Zero Coupon)	86.927.782	2,61
USD 15.000.000	African Development Bank 1,00% 2/11/2018	14.916.034	0,45	USD 85.000.000	United States Treasury Bill 19/7/2018 (Zero Coupon)	84.820.147	2,55
USD 11.000.000	African Development Bank 1,125% 4/3/2019	10.898.012	0,33	USD 110.000.000	United States Treasury Bill 16/8/2018 (Zero Coupon)	109.587.225	3,29
USD 25.000.000	Asian Development Bank 1,125% 5/6/2018	25.001.000	0,75	USD 110.000.000	United States Treasury Bill 13/9/2018 (Zero Coupon)	109.412.472	3,29
USD 60.467.000	Asian Development Bank 1,75% 11/9/2018	60.383.586	1,81	USD 71.000.000	United States Treasury Bill 27/9/2018 (Zero Coupon)	70.557.353	2,12
USD 13.840.000	Asian Development Bank 1,50% 28/9/2018	13.805.644	0,41	USD 140.000.000	United States Treasury Bill 11/10/2018 (Zero Coupon)	139.004.628	4,18
USD 211.991.000	Asian Development Bank 1,375% 15/1/2019	210.766.254	6,33			600.309.607	18,04
USD 12.828.000	Asian Development Bank 1,75% 21/3/2019	12.764.932	0,38	Total des obligations		2.799.190.304	84,10
USD 94.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 1,625% 15/11/2018	93.747.299	2,82	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		2.799.190.304	84,10
USD 195.000.000	European Investment Bank 1,25% 15/5/2019	192.952.334	5,80	Portefeuille de titres à la valeur de marché		2.799.190.304	84,10
USD 23.000.000	European Investment Bank 1,00% 15/6/2018	22.992.609	0,69	Autres éléments de l'actif net		529.199.824	15,90
USD 150.000.000	European Investment Bank 1,125% 15/8/2018	149.765.046	4,50	Total de l'actif net (USD)		3.328.390.128	100,00
USD 175.000.000	European Investment Bank 1,875% 15/3/2019	174.312.607	5,24				
USD 100.000.000	Inter-American Development Bank 1,75% 24/8/2018	99.938.277	3,00				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Autriche				Autriche suite			
6.676	Andritz AG	Bank of America		19.081	voestalpine AG	Deutsche Bank	(3.335)
		Merrill Lynch	(9.023)	(21.825)	Wienerberger AG	Bank of America	
305	Andritz AG	Citibank	(192)			Merrill Lynch	2.629
1.171	Andritz AG	JP Morgan	(1.228)	(54.583)	Wienerberger AG	Credit Suisse	(58.510)
567	Buwog AG	JP Morgan	—	(6.731)	Wienerberger AG	JP Morgan	2.604
55.377	Buwog AG	Citibank	(1.290)				(262.008)
867	Buwog AG	Deutsche Bank	—				
2.120	Buwog AG	Bank of America					
		Merrill Lynch	—				
10.913	CA Immobilien Anlagen AG	Bank of America		(69.122)	Belgique	Bank of America	
		Merrill Lynch			Ablynx NV	Merrill Lynch	(4.832)
9.677	CA Immobilien Anlagen AG	Deutsche Bank	22.354	(11.761)	Ablynx NV	Deutsche Bank	(3.553)
(8.228)	Erste Group Bank AG	Credit Suisse	19.168	(1.298)	Ackermans & van Haaren NV	Citibank	13.158
(6.688)	Erste Group Bank AG	Citibank	21.283	(3.030)	Ackermans & van Haaren NV	JP Morgan	25.066
(11.391)	Erste Group Bank AG	JP Morgan	16.832	(932)	Ackermans & van Haaren NV	Deutsche Bank	7.276
(94.729)	Immofinanz AG	Citibank	28.505	31.277	Ageas	Bank of America	
(426.529)	Immofinanz AG	Credit Suisse	4.415			Merrill Lynch	(43.366)
(1.344.224)	Immofinanz AG	JP Morgan	45.591	16.373	Ageas	Citibank	(43.305)
(65.144)	Immofinanz AG	Deutsche Bank	175.417	25.137	Ageas	JP Morgan	(56.277)
(10.594)	Lenzing AG	Citibank	4.099	43.599	Ageas	Credit Suisse	(98.043)
(2.771)	Lenzing AG	Bank of America	20.932	20.631	Ageas	Deutsche Bank	(24.489)
		Merrill Lynch	(89)	(31.694)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	Citibank	(2.954)
37.659	Oesterreichische Post AG	Bank of America		(27.139)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	JP Morgan	67.353
		Merrill Lynch	41.969	(39.654)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	Deutsche Bank	(40.497)
51.380	Oesterreichische Post AG	Citibank	17.960	(67.541)	Anheuser-Busch InBev SA/NV	Bank of America	
73.238	Oesterreichische Post AG	Credit Suisse	32.012			Merrill Lynch	(110.174)
13.940	Oesterreichische Post AG	Deutsche Bank	18.516	13.200	Befimmo SA (Reit)	Bank of America	
13.919	Oesterreichische Post AG	JP Morgan	19.461			Merrill Lynch	—
38.735	OMV AG	Bank of America		7.134	Befimmo SA (Reit)	Citibank	3.325
		Merrill Lynch	(268.084)	17.431	Befimmo SA (Reit)	JP Morgan	(6.093)
22.428	OMV AG	JP Morgan	(105.051)	6.621	Befimmo SA (Reit)	Credit Suisse	(2.314)
29.666	OMV AG	Credit Suisse	(142.853)	6.007	Befimmo SA (Reit)	Deutsche Bank	—
9.579	OMV AG	Deutsche Bank	(66.296)	(17.961)	Bekaert SA	Bank of America	
75.163	OMV AG	Citibank	(395.844)			Merrill Lynch	18.689
(38.809)	Raiffeisen Bank			(4.902)	Bekaert SA	Citibank	6.511
	International AG	JP Morgan	86.367	(45.831)	Bekaert SA	Deutsche Bank	56.604
(17.939)	Raiffeisen Bank	Bank of America		(43.994)	Bekaert SA	JP Morgan	82.825
	International AG	Merrill Lynch	52.954	42.815	bpost SA	Credit Suisse	(77.822)
(44.389)	Raiffeisen Bank			128.850	bpost SA	Deutsche Bank	(102.088)
	International AG	Credit Suisse	101.642	87.098	bpost SA	Citibank	(69.008)
(4.589)	Raiffeisen Bank			66.551	bpost SA	JP Morgan	(120.965)
	International AG	Deutsche Bank	16.094	1.487	Cie d'Entreprises CFE	Citibank	240
67.934	Telekom Austria AG	Citibank	(21.371)	1.339	Cie d'Entreprises CFE	Bank of America	
31.045	Telekom Austria AG	JP Morgan	(10.852)			Merrill Lynch	(2.354)
80.788	Telekom Austria AG	Credit Suisse	(28.239)	12.122	Cofinimmo SA (Reit)	Bank of America	
26.217	Telekom Austria AG	Bank of America				Merrill Lynch	7.749
		Merrill Lynch	(2.444)	8.052	Cofinimmo SA (Reit)	Citibank	3.128
(16.885)	UNIQA Insurance Group AG	Bank of America		13.003	Cofinimmo SA (Reit)	Credit Suisse	(80.297)
		Merrill Lynch	393	7.254	Cofinimmo SA (Reit)	Deutsche Bank	5.916
(65.152)	UNIQA Insurance Group AG	Credit Suisse	(3.796)	15.943	Cofinimmo SA (Reit)	JP Morgan	(98.453)
(39.080)	UNIQA Insurance Group AG	Deutsche Bank	911	18.913	Colruyt SA	Credit Suisse	(39.443)
(22.959)	UNIQA Insurance Group AG	JP Morgan	(1.338)	7.755	Colruyt SA	Bank of America	
(4.540)	Vienna Insurance Group AG					Merrill Lynch	(18.343)
	Wiener Versicherung			32.707	Colruyt SA	Citibank	(60.212)
	Gruppe	Citibank	9.098	9.498	Colruyt SA	JP Morgan	(11.288)
(9.410)	Vienna Insurance Group AG			18.050	Colruyt SA	Deutsche Bank	(42.693)
	Wiener Versicherung			8.850	D'ieteren SA/NV	Bank of America	
	Gruppe	JP Morgan	17.762			Merrill Lynch	4.125
(1.097)	Vienna Insurance Group AG	Bank of America		10.680	D'ieteren SA/NV	Citibank	2.738
	Wiener Versicherung Gruppe	Merrill Lynch	2.659	25.262	D'ieteren SA/NV	JP Morgan	31.789
(1.628)	Vienna Insurance Group AG			10.710	D'ieteren SA/NV	Credit Suisse	743
	Wiener Versicherung			19.215	D'ieteren SA/NV	Deutsche Bank	8.632
	Gruppe	Deutsche Bank	3.946	(6.918)	Elia System Operator SA/NV	Bank of America	
(10.163)	Vienna Insurance Group AG					Merrill Lynch	(14.509)
	Wiener Versicherung			(1.569)	Elia System Operator SA/NV	JP Morgan	(1.828)
	Gruppe	Credit Suisse	19.183	(10.120)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Bank of America	
19.600	voestalpine AG	Bank of America				Merrill Lynch	21.932
		Merrill Lynch	(3.426)	(3.288)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Credit Suisse	10.957
7.859	voestalpine AG	Citibank	(10.530)	(10.139)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Citibank	42.056
7.368	voestalpine AG	JP Morgan	10.044	(5.088)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Deutsche Bank	11.710
41.800	voestalpine AG	Credit Suisse	56.983	(8.320)	Groupe Bruxelles Lambert SA	JP Morgan	27.725
				7.774	KBC Ancora	Citibank	(24.275)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Belgique suite				Danemark suite			
9.059	KBC Ancora	JP Morgan	(26.388)	1.701	Carlsberg A/S 'B'	Citibank	1.598
11.105	KBC Ancora	Bank of America		(18.633)	Chr Hansen Holding A/S	Bank of America	
		Merrill Lynch	(22.997)			Merrill Lynch	(95.666)
13.157	KBC Ancora	Deutsche Bank	(32.062)	(24.984)	Chr Hansen Holding A/S	Citibank	(94.641)
102	KBC Ancora	Credit Suisse	(297)	(24.462)	Chr Hansen Holding A/S	JP Morgan	(127.891)
17.359	KBC Group NV	Bank of America		(25.576)	Chr Hansen Holding A/S	Credit Suisse	(124.520)
		Merrill Lynch	(97.084)	(26.335)	Chr Hansen Holding A/S	Deutsche Bank	(123.750)
6.759	KBC Group NV	Credit Suisse	(37.486)	8.400	Coloplast A/S 'B'	Bank of America	
2.367	KBC Group NV	Citibank	(17.485)			Merrill Lynch	20.249
24.099	KBC Group NV	JP Morgan	(120.331)	3.237	Coloplast A/S 'B'	Citibank	(1.115)
1.199	KBC Group NV	Deutsche Bank	(6.706)	11.040	Coloplast A/S 'B'	JP Morgan	61.866
(832)	Melexis NV	Bank of America		9.522	Coloplast A/S 'B'	Deutsche Bank	19.645
		Merrill Lynch	(582)	1.102	Coloplast A/S 'B'	Credit Suisse	6.175
(6.095)	Melexis NV	Credit Suisse	(29.827)	21.652	Danske Bank A/S	Bank of America	
(1.801)	Melexis NV	Citibank	525			Merrill Lynch	(12.201)
(1.105)	Melexis NV	Deutsche Bank	(773)	65.410	Danske Bank A/S	Citibank	(44.026)
(1.748)	Melexis NV	JP Morgan	(8.554)	20.043	Danske Bank A/S	JP Morgan	(16.000)
(137.414)	Ontex Group NV	Credit Suisse	(320.274)	5.550	Danske Bank A/S	Credit Suisse	(4.431)
(41.272)	Ontex Group NV	Deutsche Bank	(59.629)	39.300	Danske Bank A/S	Deutsche Bank	(23.413)
(140.445)	Ontex Group NV	Bank of America		27.607	Dfds A/S	Bank of America	
		Merrill Lynch	(146.665)			Merrill Lynch	(48.399)
(45.456)	Ontex Group NV	Citibank	58.259	30.813	Dfds A/S	Credit Suisse	(46.303)
(61.128)	Ontex Group NV	JP Morgan	(158.116)	49.987	Dfds A/S	Citibank	(40.688)
99.450	Proximus SADP	Bank of America		17.921	Dfds A/S	JP Morgan	(26.930)
		Merrill Lynch	(71.842)	65.288	Dfds A/S	Deutsche Bank	(100.597)
166.742	Proximus SADP	JP Morgan	(176.570)	(18.114)	DSV A/S	Bank of America	
16.536	Proximus SADP	Citibank	(8.092)			Merrill Lynch	(567)
7.063	Proximus SADP	Deutsche Bank	(5.102)	(31.246)	DSV A/S	Citibank	(23.477)
90.599	Proximus SADP	Credit Suisse	(195.289)	(4.875)	DSV A/S	Credit Suisse	(17.704)
5.333	Sofina SA	Citibank	(13.670)	(17.244)	FLSmidth & Co A/S	Bank of America	
5.545	Sofina SA	JP Morgan	(19.382)			Merrill Lynch	(5.270)
4.192	Sofina SA	Deutsche Bank	(11.722)	(17.947)	FLSmidth & Co A/S	JP Morgan	(11.799)
2.641	Sofina SA	Bank of America		(9.041)	FLSmidth & Co A/S	Citibank	11.463
		Merrill Lynch	(6.100)	(21.277)	FLSmidth & Co A/S	Deutsche Bank	(5.662)
1.903	Sofina SA	Credit Suisse	(6.652)	(10.423)	Genmab A/S	Credit Suisse	505.519
9.972	Solvay SA	Credit Suisse	18.590	(20.341)	Genmab A/S	Citibank	828.796
8.100	Solvay SA	Bank of America		(10.183)	Genmab A/S	Bank of America	
		Merrill Lynch	(9.097)			Merrill Lynch	432.726
730	Solvay SA	JP Morgan	1.361	(4.132)	Genmab A/S	JP Morgan	215.251
3.670	Solvay SA	Citibank	(4.062)	41.865	GN Store Nord A/S	Deutsche Bank	1.311
3.323	Solvay SA	Deutsche Bank	(1.936)	77.655	GN Store Nord A/S	JP Morgan	35.036
(7.104)	Telenet Group Holding NV	Citibank	30.957	42.339	GN Store Nord A/S	Citibank	36.451
23.961	UCB SA	Credit Suisse	78.562	51.533	GN Store Nord A/S	Bank of America	
3.560	UCB SA	Citibank	2.903			Merrill Lynch	4.191
50.395	UCB SA	Deutsche Bank	168.228	14.716	GN Store Nord A/S	Credit Suisse	4.837
31.845	UCB SA	JP Morgan	150.643	6.907	H Lundbeck A/S	Bank of America	
12.665	UCB SA	Bank of America				Merrill Lynch	43.138
		Merrill Lynch	44.860	15.019	H Lundbeck A/S	Credit Suisse	106.263
(98.658)	Umicore SA	Bank of America		22.088	H Lundbeck A/S	Citibank	86.782
		Merrill Lynch	(68.971)	27.128	H Lundbeck A/S	Deutsche Bank	151.315
(48.544)	Umicore SA	Citibank	16.429	16.226	H Lundbeck A/S	JP Morgan	114.802
(70.261)	Umicore SA	Deutsche Bank	(37.528)	(9.763)	ISS A/S	Deutsche Bank	(11.389)
			(1.889.182)	(20.731)	ISS A/S	Bank of America	
				(15.671)	ISS A/S	Merrill Lynch	(19.146)
Bermudes				6.971	Jyske Bank A/S Reg	Credit Suisse	6.623
11.574	Hiscox Ltd	Citibank	(3.077)	2.517	Jyske Bank A/S Reg	JP Morgan	(21.199)
			(3.077)	1.730	Jyske Bank A/S Reg	Credit Suisse	(10.322)
				7.105	Jyske Bank A/S Reg	Deutsche Bank	(5.687)
Danemark						Bank of America	
(27.470)	Ambu A/S 'B'	Deutsche Bank	(45.149)	13.182	Novo Nordisk A/S 'B'	Merrill Lynch	(23.355)
(103.310)	Ambu A/S 'B'	JP Morgan	(31.581)			Bank of America	
(127.315)	Ambu A/S 'B'	Citibank	(304.910)	33.719	Novo Nordisk A/S 'B'	Merrill Lynch	(2.579)
(1.490)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Bank of America		73.639	Novo Nordisk A/S 'B'	Citibank	(26.654)
		Merrill Lynch	127.285	24.717	Novo Nordisk A/S 'B'	JP Morgan	(29.254)
(2.435)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Citibank	(46.486)	52.307	Novo Nordisk A/S 'B'	Credit Suisse	(8.512)
(375)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Credit Suisse	50.539	(44.812)	Novozymes A/S 'B'	Deutsche Bank	(10.789)
20.198	Carlsberg A/S 'B'	Deutsche Bank	11.152	(21.047)	Novozymes A/S 'B'	JP Morgan	(105.217)
8.331	Carlsberg A/S 'B'	JP Morgan	(782)			Bank of America	
3.808	Carlsberg A/S 'B'	Bank of America		(29.433)	Novozymes A/S 'B'	Merrill Lynch	(39.205)
		Merrill Lynch	1.104	(4.786)	Novozymes A/S 'B'	Citibank	3.686
						Credit Suisse	(11.237)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Danemark suite				Finlande suite			
(29.018)	Orsted A/S '144A'	Bank of America		76.929	Kemira OYJ	Deutsche Bank	(13.445)
		Merrill Lynch	103.884	(25.026)	Kesko OYJ 'B'	Bank of America	
(40.334)	Orsted A/S '144A'	Credit Suisse	136.328			Merrill Lynch	(15.193)
(134)	Orsted A/S '144A'	Citibank	610	(921)	Kesko OYJ 'B'	Credit Suisse	(1.127)
(17.741)	Orsted A/S '144A'	Deutsche Bank	58.595	(6.997)	Kesko OYJ 'B'	Citibank	1.957
(46.395)	Orsted A/S '144A'	JP Morgan	214.237	(40.127)	Kesko OYJ 'B'	Deutsche Bank	(29.922)
9.228	Pandora A/S	Credit Suisse	(17.386)	(1.773)	Kesko OYJ 'B'	JP Morgan	(2.169)
16.123	Pandora A/S	Citibank	(12.114)	(45.622)	Kone OYJ 'B'	JP Morgan	(11.694)
3.996	Pandora A/S	JP Morgan	(114.341)	(58.152)	Kone OYJ 'B'	Credit Suisse	(48.778)
7.343	Pandora A/S	Bank of America		(8.531)	Kone OYJ 'B'	Citibank	5.765
		Merrill Lynch	(69.884)	(75.562)	Kone OYJ 'B'	Bank of America	
9.151	Rockwool International A/S 'B'	Credit Suisse	186.214			Merrill Lynch	(94.642)
4.311	Rockwool International A/S 'B'	Deutsche Bank	64.781	(31.295)	Kone OYJ 'B'	Deutsche Bank	(47.767)
2.954	Rockwool International A/S 'B'	Citibank	22.195	(51.215)	Konecranes OYJ	Citibank	89.510
2.763	Rockwool International A/S 'B'	JP Morgan	56.224	(39.328)	Konecranes OYJ	Credit Suisse	(64.930)
1.727	Rockwool International A/S 'B'	Bank of America		(56.486)	Konecranes OYJ	Deutsche Bank	(47.558)
		Merrill Lynch	20.172	(45)	Konecranes OYJ	Bank of America	
39.841	Royal Unibrew A/S	Citibank	320.549			Merrill Lynch	(59)
26.830	Royal Unibrew A/S	JP Morgan	204.947	(47.189)	Konecranes OYJ	JP Morgan	(76.975)
23.564	Royal Unibrew A/S	Deutsche Bank	164.361	151.905	Metsa Board OYJ	Citibank	(20.354)
14.812	Royal Unibrew A/S	Bank of America		138.553	Metsa Board OYJ	Deutsche Bank	30.990
		Merrill Lynch	102.016	(34.463)	Metso OYJ	Bank of America	
29.115	Royal Unibrew A/S	Credit Suisse	207.495			Merrill Lynch	22.556
30.955	Sydbank A/S	Bank of America		(65.882)	Metso OYJ	Credit Suisse	14.585
		Merrill Lynch	(74.620)	(51.009)	Metso OYJ	Citibank	62.405
22.947	Sydbank A/S	Citibank	(52.442)	(10.833)	Metso OYJ	Deutsche Bank	7.068
24.913	Sydbank A/S	JP Morgan	(62.206)	24.195	Neste OYJ	Bank of America	
55.874	Sydbank A/S	Credit Suisse	(140.531)			Merrill Lynch	33.829
7.313	Sydbank A/S	Deutsche Bank	(17.629)	20.014	Neste OYJ	JP Morgan	88.613
61.658	Topdanmark A/S	Bank of America		69	Neste OYJ	Credit Suisse	306
		Merrill Lynch	(32.904)	15.944	Neste OYJ	Deutsche Bank	22.293
46.122	Topdanmark A/S	Citibank	(12.995)	(715.403)	Nokia OYJ	Bank of America	
22.213	Topdanmark A/S	JP Morgan	(39.638)			Merrill Lynch	258.401
63.711	Topdanmark A/S	Credit Suisse	(88.167)	(281.482)	Nokia OYJ	Citibank	104.294
24.080	Topdanmark A/S	Deutsche Bank	(11.308)	(42.869)	Nokian Renkaat OYJ	Credit Suisse	23.975
(53.383)	Tryg A/S	Credit Suisse	(17.217)	(58.407)	Nokian Renkaat OYJ	JP Morgan	32.665
(38.195)	Tryg A/S	Bank of America		(47.428)	Orion OYJ 'B'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(20.627)			Merrill Lynch	22.542
(57.413)	Tryg A/S	Deutsche Bank	(47.051)	(14.234)	Orion OYJ 'B'	Credit Suisse	(7.629)
5.776	Vestas Wind Systems A/S	Deutsche Bank	(19.134)	(42.745)	Outokumpu OYJ	Deutsche Bank	25.899
36.156	William Demant Holding A/S	JP Morgan	-	(24.772)	Outokumpu OYJ	JP Morgan	9.549
				(318.168)	Outokumpu OYJ	Bank of America	
			2.151.714			Merrill Lynch	103.160
Finlande				(511.738)	Outokumpu OYJ	Credit Suisse	159.795
(13.263)	Cargotec OYJ 'B'	Bank of America		13.047	Sampo OYJ 'A'	Credit Suisse	(29.947)
		Merrill Lynch	15.509	12.200	Sampo OYJ 'A'	Bank of America	
(29.506)	Cargotec OYJ 'B'	Credit Suisse	25.324			Merrill Lynch	(25.018)
(17.295)	Cargotec OYJ 'B'	Deutsche Bank	16.524	9.426	Sampo OYJ 'A'	Citibank	(14.497)
(18.951)	Cargotec OYJ 'B'	JP Morgan	11.040	27.334	Sampo OYJ 'A'	Deutsche Bank	(56.053)
(4.840)	Elisa OYJ	Deutsche Bank	(7.114)	30.509	Stora Enso OYJ 'R'	Credit Suisse	22.750
(14.864)	Elisa OYJ	Bank of America		52.636	Stora Enso OYJ 'R'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(21.995)			Merrill Lynch	8.586
(35.171)	Fortum OYJ	Credit Suisse	5.271	20.646	Stora Enso OYJ 'R'	Citibank	(1.203)
(201.184)	Fortum OYJ	Bank of America		316.603	Stora Enso OYJ 'R'	JP Morgan	230.016
		Merrill Lynch	19.873	102.463	Stora Enso OYJ 'R'	Deutsche Bank	11.035
(97.269)	Fortum OYJ	Citibank	90.666	51.910	Tieto OYJ	Bank of America	
(77.008)	Fortum OYJ	JP Morgan	(58.322)			Merrill Lynch	(2.353)
(91.260)	Huhtamaki OYJ	JP Morgan	(35.452)	24.624	Tieto OYJ	Citibank	(24.100)
(9.879)	Huhtamaki OYJ	Citibank	1.381	58.463	Tieto OYJ	JP Morgan	(17.711)
(41.582)	Huhtamaki OYJ	Credit Suisse	(18.895)	10.928	Tieto OYJ	Credit Suisse	(3.835)
(36.568)	Huhtamaki OYJ	Bank of America		67.461	Tieto OYJ	Deutsche Bank	-
		Merrill Lynch	3.409	31.085	UPM-Kymmene OYJ	Bank of America	
(34.858)	Huhtamaki OYJ	Deutsche Bank	3.249			Merrill Lynch	(1.449)
12.789	Kemira OYJ	Credit Suisse	596	176.841	UPM-Kymmene OYJ	Citibank	(115.386)
32.614	Kemira OYJ	Bank of America		82.455	UPM-Kymmene OYJ	JP Morgan	67.799
		Merrill Lynch	(5.700)	6.044	UPM-Kymmene OYJ	Credit Suisse	5.493
15.340	Kemira OYJ	Citibank	(4.111)	47.914	UPM-Kymmene OYJ	Deutsche Bank	(2.233)
43.965	Kemira OYJ	JP Morgan	2.049	36.346	Valmet OYJ	JP Morgan	(2.117)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Finlande suite				France suite			
15.021	Valmet OYJ	Bank of America		33.900	Atos SE	Citibank	52.088
		Merrill Lynch	(2.657)	34.238	Atos SE	JP Morgan	161.564
301.024	Valmet OYJ	Credit Suisse	(17.537)	23.838	Atos SE	Deutsche Bank	68.048
10.033	Valmet OYJ	Citibank	(3.624)	48.064	AXA SA	Bank of America	
49.403	Valmet OYJ	Deutsche Bank	576			Merrill Lynch	(74.174)
(72.911)	Wartsila OYJ Abp	Credit Suisse	(14.442)	28.488	AXA SA	Citibank	(52.777)
(113.952)	Wartsila OYJ Abp	Bank of America		18.866	AXA SA	JP Morgan	(25.609)
		Merrill Lynch	(47.798)	35.211	AXA SA	Credit Suisse	(47.795)
(62.754)	Wartsila OYJ Abp	JP Morgan	(12.430)	13.573	AXA SA	Deutsche Bank	(20.875)
				9.555	BioMerieux	Deutsche Bank	67.911
			633.082	8.060	BioMerieux	JP Morgan	58.225
				6.012	BNP Paribas SA	Bank of America	
France						Merrill Lynch	(68.928)
(67.142)	Accor SA	Bank of America		7.142	BNP Paribas SA	Citibank	(77.806)
		Merrill Lynch	(28.163)	1.380	BNP Paribas SA	JP Morgan	(13.844)
(29.547)	Accor SA	JP Morgan	(20.492)	2.474	BNP Paribas SA	Deutsche Bank	(28.365)
(253.076)	Accor SA	Citibank	271.282	6.662	BNP Paribas SA	Credit Suisse	(68.830)
(22.514)	Accor SA	Deutsche Bank	12.666	(848.266)	Bollere SA	Bank of America	
(13.871)	Aeroports de Paris	Bank of America				Merrill Lynch	197.671
		Merrill Lynch	119.384	(890.946)	Bollere SA	Citibank	244.988
(4.956)	Aeroports de Paris	Citibank	12.704	(564.690)	Bollere SA	JP Morgan	57.899
(22.777)	Aeroports de Paris	JP Morgan	145.962	(239.480)	Bollere SA	Credit Suisse	44.809
(7.056)	Aeroports de Paris	Credit Suisse	14.998	(449.571)	Bollere SA	Deutsche Bank	104.763
(5.741)	Aeroports de Paris	Deutsche Bank	56.189	(3.058)	Bollere SA	Bank of America	
25.092	Air France-KLM	Credit Suisse	(12.630)			Merrill Lynch	777
84.403	Air France-KLM	Deutsche Bank	(38.550)	(1.242)	Bollere SA	Citibank	376
560.469	Air France-KLM	Bank of America		(2.941)	Bollere SA	JP Morgan	367
		Merrill Lynch	(253.899)	24.092	Bouygues SA	Citibank	(60.914)
109.813	Air France-KLM	Citibank	(65.766)	8.086	Bouygues SA	JP Morgan	(28.829)
161.612	Air France-KLM	JP Morgan	(69.500)	23.781	Bouygues SA	Bank of America	
(8.156)	Air Liquide SA	Credit Suisse	20.907			Merrill Lynch	(151.565)
(18.058)	Air Liquide SA	Citibank	136.762	(30.193)	Bureau Veritas SA	Bank of America	
(51.856)	Air Liquide SA	JP Morgan	132.924			Merrill Lynch	13.016
(8.516)	Air Liquide SA	Bank of America		(54.465)	Bureau Veritas SA	Citibank	(6.981)
		Merrill Lynch	25.631	(137.974)	Bureau Veritas SA	JP Morgan	57.874
(15.217)	Air Liquide SA	Deutsche Bank	54.763	(178.178)	Bureau Veritas SA	Credit Suisse	48.618
(7.704)	Airbus SE	JP Morgan	21.005	(35.520)	Bureau Veritas SA	Deutsche Bank	15.313
(31.384)	Airbus SE	Citibank	100.925	4.007	Capgemini SE	Citibank	(5.602)
(758)	Airbus SE	Bank of America		5.785	Capgemini SE	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.457)			Merrill Lynch	(14.492)
(11.094)	Airbus SE	Deutsche Bank	(21.328)	4.410	Capgemini SE	JP Morgan	(10.020)
(39.482)	ALD SA '144A'	Bank of America		4.329	Capgemini SE	Deutsche Bank	(10.844)
		Merrill Lynch	28.982	(44.931)	Carrefour SA	JP Morgan	59.157
(109.368)	ALD SA '144A'	Deutsche Bank	82.550	(87.128)	Carrefour SA	Bank of America	
(23.925)	ALD SA '144A'	JP Morgan	19.036			Merrill Lynch	75.430
(62.748)	Alstom SA	Credit Suisse	(98.413)	(1.431)	Carrefour SA	Deutsche Bank	1.242
(28.377)	Alstom SA	Bank of America		(51.949)	Carrefour SA	Citibank	58.896
		Merrill Lynch	(58.853)	34.010	Casino Guichard	Bank of America	
(5.751)	Alstom SA	JP Morgan	1.038		Perrachon SA	Merrill Lynch	(153.752)
(9.306)	Alten SA	Bank of America		3.771	Casino Guichard	JP Morgan	(26.011)
		Merrill Lynch	(11.385)		Perrachon SA	Bank of America	
(5.233)	Alten SA	Credit Suisse	(7.622)	42.772	Cie de Saint-Gobain	Merrill Lynch	(92.944)
(6.668)	Alten SA	JP Morgan	(9.712)			JP Morgan	(21.751)
(8.069)	Alten SA	Citibank	(2.350)	16.233	Cie de Saint-Gobain	Citibank	(74.638)
(7.818)	Alten SA	Deutsche Bank	(9.565)	25.675	Cie de Saint-Gobain	Credit Suisse	(22.464)
(55.623)	Altran Technologies SA	Deutsche Bank	(42.963)	13.302	Cie de Saint-Gobain	Deutsche Bank	(149.383)
(165.021)	Altran Technologies SA	Bank of America		65.457	Cie de Saint-Gobain	Bank of America	
		Merrill Lynch	47.817	20.145	Cie Generale des	Merrill Lynch	(194.817)
13.104	Amundi SA '144A'	Credit Suisse	(129.474)		Etablissements Michelin SCA		
7.290	Amundi SA '144A'	Citibank	(54.361)	34.256	Cie Generale des		
3.396	Arkema SA	Bank of America			Etablissements		
		Merrill Lynch	(21.961)		Michelin SCA	Citibank	(235.489)
35.624	Arkema SA	Citibank	(244.669)	27.185	Cie Generale des		
20.293	Arkema SA	JP Morgan	(52.018)		Etablissements		
31.558	Arkema SA	Credit Suisse	(134.664)		Michelin SCA	JP Morgan	(259.253)
18.975	Arkema SA	Deutsche Bank	(122.703)	14.842	Cie Generale des		
16.871	Atos SE	Credit Suisse	79.612		Etablissements		
3.898	Atos SE	Bank of America			Michelin SCA	Credit Suisse	(110.676)
		Merrill Lynch	11.127				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
France suite				France suite			
51.612	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Deutsche Bank	(479.225)	(21.963)	Essilor International Cie Generale d'Optique SA	Bank of America Merrill Lynch	(24.311)
25.176	Cie Plastic Omnium SA	Citibank	(58.374)	(12.895)	Essilor International Cie Generale d'Optique SA	Citibank	24.039
23.692	Cie Plastic Omnium SA	JP Morgan	(14.449)	(10.053)	Essilor International Cie Generale d'Optique SA	JP Morgan	(21.670)
54.539	Cie Plastic Omnium SA	Bank of America Merrill Lynch	(41.305)	(5.253)	Essilor International Cie Generale d'Optique SA	Deutsche Bank	(4.954)
48.009	Cie Plastic Omnium SA	Deutsche Bank	(36.359)	6.410	Eurazeo SA	Credit Suisse	(21.584)
53.410	Cie Plastic Omnium SA	Credit Suisse	(21.186)	19.496	Eurazeo SA	JP Morgan	(39.396)
18.835	CNP Assurances	Bank of America Merrill Lynch	(19.312)	22.764	Eurazeo SA	Bank of America Merrill Lynch	(35.196)
36.943	CNP Assurances	Citibank	(49.931)	29.204	Eurazeo SA	Citibank	(73.158)
7.114	CNP Assurances	JP Morgan	(5.305)	13.103	Eurazeo SA	Deutsche Bank	(20.610)
4.373	CNP Assurances	Credit Suisse	(3.261)	(9.520)	Eurofins Scientific SE	Credit Suisse	(26.602)
10.277	CNP Assurances	Deutsche Bank	(10.537)	(8.075)	Eurofins Scientific SE	Bank of America Merrill Lynch	5.928
2.958	Covivio (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(8.789)	(3.418)	Eurofins Scientific SE	Citibank	34.249
5.245	Covivio (Reit)	Credit Suisse	(38.806)	(4.676)	Eurofins Scientific SE	JP Morgan	1.548
360	Covivio (Reit)	Citibank	(503)	(4.239)	Eurofins Scientific SE	Deutsche Bank	1.976
6.221	Covivio (Reit)	Deutsche Bank	(18.483)	16.583	Euronext NV '144A'	JP Morgan	(16.924)
1.500	Covivio (Reit)	JP Morgan	(11.098)	6.644	Euronext NV '144A'	Credit Suisse	(28.256)
(65.877)	Credit Agricole SA	Bank of America Merrill Lynch	140.464	18.610	Euronext NV '144A'	Deutsche Bank	(35.778)
(60.639)	Credit Agricole SA	JP Morgan	119.216	13.150	Euronext NV '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(25.281)
(19.005)	Danone SA	Bank of America Merrill Lynch	(21.121)	40.471	Euronext NV '144A'	Citibank	(44.797)
(20.499)	Danone SA	Citibank	(8.598)	(46.401)	Eutelsat Communications SA	Bank of America Merrill Lynch	(15.138)
(44.157)	Danone SA	JP Morgan	(31.899)	(60.368)	Eutelsat Communications SA	Citibank	8.616
1.218	Dassault Aviation SA	Credit Suisse	(40.385)	(5.428)	Eutelsat Communications SA	JP Morgan	11.922
1.301	Dassault Aviation SA	Deutsche Bank	(53.055)	(47.885)	Eutelsat Communications SA	Credit Suisse	27.995
74	Dassault Aviation SA	Bank of America Merrill Lynch	(3.018)	(5.421)	Eutelsat Communications SA	Deutsche Bank	(1.769)
854	Dassault Aviation SA	Citibank	(43.782)	31.532	Faurecia SA	Bank of America Merrill Lynch	91.114
675	Dassault Aviation SA	JP Morgan	(19.662)	65.791	Faurecia SA	Citibank	(164.045)
(13.914)	Dassault Systemes SE	JP Morgan	(161.308)	51.368	Faurecia SA	JP Morgan	137.658
(40.756)	Edenred	JP Morgan	69.331	33.599	Faurecia SA	Deutsche Bank	64.171
12.443	Eiffage SA	Citibank	(34.505)	70.927	Faurecia SA	Credit Suisse	190.073
3.814	Eiffage SA	Deutsche Bank	(17.464)	(22.396)	Fnac Darty SA	Bank of America Merrill Lynch	(27.399)
15.185	Eiffage SA	Bank of America Merrill Lynch	(70.508)	(6.377)	Gecina SA (Reit)	Citibank	(352)
5.670	Eiffage SA	JP Morgan	(21.720)	(2.486)	Gecina SA (Reit)	JP Morgan	2.317
22.054	Eiffage SA	Credit Suisse	(102.271)	(4.308)	Gecina SA (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(2.679)
(28.235)	Electricite de France SA	Citibank	36.023	(6.437)	Gecina SA (Reit)	Credit Suisse	6.000
(136.847)	Electricite de France SA	Deutsche Bank	140.309	(295.879)	Getlink	Bank of America Merrill Lynch	70.672
(104.470)	Electricite de France SA	JP Morgan	43.212	(322.327)	Getlink	Citibank	3.756
(40.978)	Electricite de France SA	Bank of America Merrill Lynch	45.342	(57.355)	Getlink	Credit Suisse	10.358
(96.761)	Elior Group SA '144A'	Deutsche Bank	27.630	(257.021)	Getlink	JP Morgan	46.418
(5.142)	Elior Group SA '144A'	JP Morgan	13.480	(155.462)	Getlink	Deutsche Bank	12.275
(100.065)	Elior Group SA '144A'	Citibank	240.361	(8.760)	Hermes International	Credit Suisse	(491.963)
(137.066)	Elior Group SA '144A'	Bank of America Merrill Lynch	99.890	(1.781)	Hermes International	Bank of America Merrill Lynch	(58.519)
(58.187)	Elior Group SA '144A'	Credit Suisse	238.252	(2.042)	Hermes International	Citibank	(20.461)
(21.038)	Elis SA	Bank of America Merrill Lynch	23.287	(5.058)	Hermes International	JP Morgan	(284.058)
(270.139)	Elis SA	Credit Suisse	620.314	(5.424)	Hermes International	Deutsche Bank	(178.218)
(173.537)	Elis SA	Citibank	197.653	19.111	ICADE (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(20.184)
(206.371)	Elis SA	Deutsche Bank	228.430	25.935	ICADE (Reit)	Citibank	(24.175)
(104.321)	Elis SA	JP Morgan	78.005	6.811	ICADE (Reit)	JP Morgan	1.984
23.458	Engie SA	Bank of America Merrill Lynch	(32.115)	15.732	ICADE (Reit)	Deutsche Bank	(16.762)
137.603	Engie SA	Citibank	(109.825)	8.204	ICADE (Reit)	Credit Suisse	2.390
197.765	Engie SA	JP Morgan	(248.552)	(23.602)	Iliad SA	Credit Suisse	588.497
181.606	Engie SA	Credit Suisse	(238.048)	(32.488)	Iliad SA	Bank of America Merrill Lynch	(118.943)
76.108	Engie SA	Deutsche Bank	(104.196)	(17.170)	Iliad SA	Citibank	(60.017)
7.370	Eramet	Bank of America Merrill Lynch	(50.664)	(11.703)	Iliad SA	JP Morgan	296.670
15.577	Eramet	Credit Suisse	(51.959)	(28.337)	Iliad SA	Deutsche Bank	(348.680)
8.306	Eramet	Deutsche Bank	(63.323)	8.067	Imerys SA	Bank of America Merrill Lynch	7.049
6.128	Eramet	JP Morgan	(20.706)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
France suite				France suite			
3.856	Imerys SA	JP Morgan	(15.276)	40.223	Nexity SA	Bank of America	
6.783	Imerys SA	Citibank	(20.944)			Merrill Lynch	(123.650)
533	Imerys SA	Deutsche Bank	466	7.011	Nexity SA	Citibank	(16.910)
(56.858)	Ingenico Group SA	Bank of America		12.963	Orange SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	19.274			Merrill Lynch	2.190
(10.276)	Ingenico Group SA	Citibank	14.847	281.356	Orange SA	Citibank	(65.564)
(15.046)	Ingenico Group SA	JP Morgan	82.395	383.571	Orange SA	JP Morgan	(187.272)
(17.495)	Ingenico Group SA	Credit Suisse	22.862	96.055	Orange SA	Credit Suisse	(52.602)
(14.726)	Ingenico Group SA	Deutsche Bank	5.491	183.518	Orange SA	Deutsche Bank	34.148
1.787	Ipsen SA	Citibank	6.455	(47.163)	Orpea	JP Morgan	(208.706)
6.462	Ipsen SA	JP Morgan	31.999	(17.046)	Orpea	Credit Suisse	(67.528)
7.715	Ipsen SA	Bank of America		(31.253)	Orpea	Bank of America	
		Merrill Lynch	37.231			Merrill Lynch	(123.809)
12.572	Ipsen SA	Credit Suisse	63.901	(18.734)	Orpea	Citibank	(81.855)
11.578	Ipsen SA	Deutsche Bank	75.545	(29.713)	Orpea	Deutsche Bank	(128.515)
(16.965)	JCDecaux SA	JP Morgan	52.184	(16.939)	Pernod Ricard SA	Bank of America	
(57.462)	JCDecaux SA	Citibank	18.747			Merrill Lynch	(108.324)
(84.662)	JCDecaux SA	Bank of America		(1.719)	Pernod Ricard SA	Citibank	(7.611)
		Merrill Lynch	55.530	(7.464)	Pernod Ricard SA	JP Morgan	(57.398)
(36.140)	JCDecaux SA	Credit Suisse	38.529	(11.234)	Pernod Ricard SA	Credit Suisse	(77.299)
(34.231)	JCDecaux SA	Deutsche Bank	31.907	(4.321)	Pernod Ricard SA	Deutsche Bank	(28.446)
2.845	Kering SA	Citibank	11.933	255.368	Peugeot SA	Bank of America	
(12.131)	Klepierre SA (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(24.931)
		Merrill Lynch	14.134	115.281	Peugeot SA	Citibank	(114.172)
(11.802)	Klepierre SA (Reit)	Citibank	12.789	168.931	Peugeot SA	JP Morgan	(50.538)
(11.497)	Klepierre SA (Reit)	Credit Suisse	12.458	13.623	Peugeot SA	Deutsche Bank	(1.111)
(34.512)	Korian SA	JP Morgan	31.365	210.512	Peugeot SA	Credit Suisse	(40.759)
(95.467)	Korian SA	Bank of America		7.338	Publicis Groupe SA	Citibank	(19.665)
		Merrill Lynch	79.654	2.754	Publicis Groupe SA	JP Morgan	(5.537)
(39.872)	Korian SA	Citibank	16.724	9.291	Publicis Groupe SA	Bank of America	
(42.711)	Korian SA	Credit Suisse	28.376			Merrill Lynch	(19.816)
(63.481)	Korian SA	Deutsche Bank	59.172	(5.609)	Remy Cointreau SA	JP Morgan	(71.889)
8.010	L'Oreal SA	Deutsche Bank	43.629	(6.859)	Remy Cointreau SA	Bank of America	
4.591	L'Oreal SA	Citibank	10.163			Merrill Lynch	(69.528)
6.422	L'Oreal SA	Credit Suisse	53.875	(13.087)	Remy Cointreau SA	Citibank	(48.741)
2.677	L'Oreal SA	JP Morgan	22.458	(15.302)	Remy Cointreau SA	Credit Suisse	(172.101)
(37.353)	Lagardere SCA	Citibank	435	(7.093)	Remy Cointreau SA	Deutsche Bank	(71.900)
(25.181)	Lagardere SCA	Deutsche Bank	2.262	(22.892)	Renault SA	Credit Suisse	165.637
(9.438)	Lagardere SCA	Credit Suisse	(1.181)	(17.017)	Renault SA	JP Morgan	116.001
6.971	Legrand SA	Deutsche Bank	(7.310)	(8.540)	Renault SA	Bank of America	
13.927	Legrand SA	Credit Suisse	(21.027)			Merrill Lynch	58.309
(3.133)	LVMH Moet Hennessy	Bank of America		(10.607)	Renault SA	Citibank	89.374
	Louis Vuitton SE	Merrill Lynch	(3.833)	(11.777)	Renault SA	Deutsche Bank	80.411
(3.013)	LVMH Moet Hennessy			(31.404)	Rexel SA	Credit Suisse	12.990
	Louis Vuitton SE	Citibank	33.351	(43.583)	Rexel SA	Bank of America	
(5.196)	LVMH Moet Hennessy					Merrill Lynch	8.633
	Louis Vuitton SE	JP Morgan	(47.525)	(51.008)	Rexel SA	JP Morgan	21.098
(4.560)	LVMH Moet Hennessy			(11.916)	Rexel SA	Deutsche Bank	2.360
	Louis Vuitton SE	Deutsche Bank	(5.579)	(24.148)	Rubis SCA	JP Morgan	126.612
81.695	Mercialys SA (Reit)	Bank of America		(34.345)	Rubis SCA	Citibank	78.033
		Merrill Lynch	(36.171)	(69.701)	Rubis SCA	Credit Suisse	365.454
34.881	Mercialys SA (Reit)	Citibank	(8.941)	(37.956)	Rubis SCA	Bank of America	
15.192	Mercialys SA (Reit)	JP Morgan	(6.195)			Merrill Lynch	72.430
49.376	Mercialys SA (Reit)	Credit Suisse	(17.303)	(26.300)	Rubis SCA	Deutsche Bank	56.690
49.168	Mercialys SA (Reit)	Deutsche Bank	(21.769)	9.502	Safran SA	Citibank	-
74.405	Metropole Television SA	Citibank	(95.362)	6.285	Safran SA	JP Morgan	27.461
29.770	Metropole Television SA	Credit Suisse	(60.701)	4.924	Safran SA	Bank of America	
25.846	Metropole Television SA	Bank of America				Merrill Lynch	15.892
		Merrill Lynch	(46.224)	18.060	Safran SA	Credit Suisse	78.910
61.505	Metropole Television SA	JP Morgan	(125.409)	2.390	Safran SA	Deutsche Bank	7.714
80.009	Natixis SA	JP Morgan	(54.815)	101.868	Sanofi	Credit Suisse	(15.130)
90.440	Natixis SA	Credit Suisse	(60.465)	11.924	Sanofi	Bank of America	
67.637	Natixis SA	Deutsche Bank	(52.801)			Merrill Lynch	15.977
(45.209)	Nexans SA	Bank of America		34.370	Sanofi	Citibank	(19.612)
		Merrill Lynch	77.726	24.407	Sanofi	JP Morgan	(3.413)
(35.945)	Nexans SA	Deutsche Bank	68.685	88.792	Sanofi	Deutsche Bank	85.846
(9.229)	Nexans SA	JP Morgan	20.108	(9.353)	Sartorius Stedim Biotech	Bank of America	
(33.019)	Nexans SA	Citibank	56.554			Merrill Lynch	(9.808)
41.983	Nexity SA	JP Morgan	(112.954)	(6.930)	Sartorius Stedim Biotech	Credit Suisse	(22.609)
26.397	Nexity SA	Credit Suisse	(80.582)	(14.653)	Sartorius Stedim Biotech	Citibank	(854)
6.808	Nexity SA	Deutsche Bank	(20.783)	(9.317)	Sartorius Stedim Biotech	Deutsche Bank	(9.770)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
France suite				France suite			
(2.231)	Sartorius Stedim Biotech	JP Morgan	(7.278)	12.403	Total SA	Citibank	(32.082)
73.155	Schneider Electric SE	Citibank	(349.470)	60.305	Total SA	JP Morgan	6.324
16.447	Schneider Electric SE	Credit Suisse	(22.055)	55.136	Total SA	Credit Suisse	5.782
2.970	Schneider Electric SE	Deutsche Bank	(9.371)	3.488	Trigano SA	Deutsche Bank	8.534
4.570	Schneider Electric SE	Bank of America		5.301	Trigano SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.839)			Merrill Lynch	(3.989)
6.453	SCOR SE	Bank of America		11.854	Trigano SA	Citibank	(27.623)
		Merrill Lynch	(10.677)	5.589	Trigano SA	JP Morgan	57.459
21.822	SCOR SE	Citibank	(45.767)	37.898	Ubisoft Entertainment SA	Bank of America	
4.545	SCOR SE	JP Morgan	(8.738)			Merrill Lynch	319.945
14.534	SCOR SE	Credit Suisse	(27.942)	7.031	Ubisoft Entertainment SA	Citibank	43.091
15.607	SCOR SE	Deutsche Bank	(25.822)	5.002	Ubisoft Entertainment SA	JP Morgan	40.097
(9.212)	SEB SA	Bank of America		1.526	Ubisoft Entertainment SA	Credit Suisse	12.233
		Merrill Lynch	54.589	36.039	Ubisoft Entertainment SA	Deutsche Bank	304.853
(5.872)	SEB SA	Citibank	37.630	11.811	Valeo SA	Citibank	(58.624)
(3.292)	SEB SA	JP Morgan	9.678	4.480	Valeo SA	JP Morgan	(14.302)
(76)	Societe BIC SA	JP Morgan	275	(311.945)	Vallourec SA	Citibank	263.147
(25)	Societe BIC SA	Bank of America		(214.261)	Vallourec SA	JP Morgan	(92.343)
		Merrill Lynch	79	(787.335)	Vallourec SA	Bank of America	
(5)	Societe BIC SA	Credit Suisse	18			Merrill Lynch	(314.655)
(7.378)	Societe BIC SA	Deutsche Bank	23.210	(108.698)	Vallourec SA	Deutsche Bank	(43.441)
(17.308)	Societe Generale SA	JP Morgan	102.950	35.291	Veolia Environnement SA	Bank of America	
(29.296)	Societe Generale SA	Credit Suisse	164.330			Merrill Lynch	(6.785)
(35.002)	Societe Generale SA	Deutsche Bank	227.567	72.393	Veolia Environnement SA	JP Morgan	(97.844)
(24.854)	Societe Generale SA	Bank of America		33.310	Veolia Environnement SA	Citibank	(23.675)
		Merrill Lynch	161.589	6.960	Veolia Environnement SA	Credit Suisse	(9.407)
(7.844)	Sodexo SA	Bank of America		14.035	Veolia Environnement SA	Deutsche Bank	(2.698)
		Merrill Lynch	2.742	(5.725)	Vicat SA	Credit Suisse	29.684
(9.479)	Sodexo SA	Citibank	21.868	(10.006)	Vicat SA	Bank of America	
(7.306)	Sodexo SA	JP Morgan	—			Merrill Lynch	34.764
(28.938)	Sodexo SA	Credit Suisse	(12.832)	(982)	Vicat SA	Citibank	2.975
2.439	Sopra Steria Group	Bank of America		(2.885)	Vicat SA	JP Morgan	14.958
		Merrill Lynch	(6.820)	(4.666)	Vicat SA	Deutsche Bank	12.656
6.335	Sopra Steria Group	Credit Suisse	(31.001)	20.721	Vinci SA	Bank of America	
1.933	Sopra Steria Group	Citibank	1.577			Merrill Lynch	(25.592)
(64.628)	SPIE SA	Credit Suisse	119.729	22.439	Vinci SA	Citibank	(83.663)
(26.613)	SPIE SA	Deutsche Bank	50.853	15.115	Vinci SA	JP Morgan	(12.328)
(103.248)	SPIE SA	Bank of America		(8.694)	Vivendi SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	197.291			Merrill Lynch	16.512
(6.296)	SPIE SA	Citibank	7.116	(76.579)	Vivendi SA	Citibank	140.977
(35.224)	SPIE SA	JP Morgan	65.256	(79.277)	Vivendi SA	JP Morgan	147.791
28.097	STMicroelectronics NV	Bank of America		(11.350)	Vivendi SA	Deutsche Bank	18.460
		Merrill Lynch	327	(10.620)	Wendel SA	Citibank	82.905
5.679	STMicroelectronics NV	Citibank	1.654	(7.734)	Wendel SA	JP Morgan	126.158
7.778	STMicroelectronics NV	JP Morgan	1.110	(9.212)	Wendel SA	Bank of America	
(95.774)	Suez	JP Morgan	152.880			Merrill Lynch	134.167
(117.187)	Suez	Deutsche Bank	15.702	(3.566)	Wendel SA	Credit Suisse	58.169
(244.322)	Suez	Bank of America		(5.423)	Wendel SA	Deutsche Bank	40.129
		Merrill Lynch	32.737	22.805	Worldline SA/France '144A'	Bank of America	
(22.527)	Tarkett SA	Credit Suisse	29.277			Merrill Lynch	133.388
(24.895)	Tarkett SA	Bank of America		19.832	Worldline SA/France '144A'	Citibank	4.159
		Merrill Lynch	42.929	50.768	Worldline SA/France '144A'	JP Morgan	435.361
(66.131)	Tarkett SA	Deutsche Bank	98.876	21	Worldline SA/France '144A'	Credit Suisse	180
(15.743)	Teleperformance	Credit Suisse	34.348	27.054	Worldline SA/France '144A'	Deutsche Bank	158.240
(919)	Teleperformance	Bank of America					514.410
		Merrill Lynch	321				
(10.875)	Teleperformance	Citibank	(12.275)		Allemagne		
(7.348)	Teleperformance	JP Morgan	26.541	(103.328)	1&1 Drillisch AG	Citibank	145.998
23.344	Television Francaise 1	JP Morgan	(32.231)	(80.837)	1&1 Drillisch AG	Bank of America	
6.517	Television Francaise 1	Bank of America				Merrill Lynch	208.064
		Merrill Lynch	(6.416)	(51.926)	1&1 Drillisch AG	JP Morgan	142.179
43.299	Television Francaise 1	Credit Suisse	(59.783)	(83.585)	1&1 Drillisch AG	Deutsche Bank	194.778
37.607	Television Francaise 1	Citibank	(30.015)	(902)	Aareal Bank AG	Deutsche Bank	5.066
172.287	Television Francaise 1	Deutsche Bank	(159.043)	(6.206)	Aareal Bank AG	Citibank	32.756
33.457	Thales SA	Bank of America		(4.632)	Aareal Bank AG	JP Morgan	29.144
		Merrill Lynch	(72.571)	22.010	adidas AG	Deutsche Bank	112.560
32.726	Thales SA	JP Morgan	(41.944)	884	adidas AG	Citibank	(566)
22.949	Thales SA	Credit Suisse	(44.378)	5.243	adidas AG	Credit Suisse	22.731
42.480	Thales SA	Deutsche Bank	(63.282)	7.292	Allianz SE Reg	Bank of America	
53.965	Total SA	Bank of America				Merrill Lynch	(115.911)
		Merrill Lynch	(125.755)	19.119	Allianz SE Reg	Citibank	(329.247)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Allemagne suite				Allemagne suite			
14.325	Allianz SE Reg	JP Morgan	(301.681)	103.217	Covestro AG '144A'	Credit Suisse	35.853
13.258	Allianz SE Reg	Credit Suisse	(344.480)	33.031	Covestro AG '144A'	JP Morgan	46.183
9.201	Allianz SE Reg	Deutsche Bank	(152.875)	101.934	Covestro AG '144A'	Citibank	(152.023)
20.610	Aurubis AG	Bank of America		(17.276)	CTS Eventim AG & Co KGaA	Bank of America	
		Merrill Lynch	(97.015)			Merrill Lynch	(53.141)
32.040	Aurubis AG	Citibank	(169.484)	(44.481)	CTS Eventim AG & Co KGaA	Citibank	(119.202)
(7.022)	Axel Springer SE	Bank of America		(30.291)	CTS Eventim AG & Co KGaA	JP Morgan	(63.528)
		Merrill Lynch	39.272	(27.765)	CTS Eventim AG & Co KGaA	Deutsche Bank	(68.407)
(4.693)	Axel Springer SE	Citibank	12.030	(35.393)	Daimler AG Reg	Bank of America	
(12.710)	Axel Springer SE	JP Morgan	45.093			Merrill Lynch	200.678
60.763	BASF SE	Bank of America		(13.877)	Daimler AG Reg	Citibank	92.322
		Merrill Lynch	(204.606)	(36.607)	Daimler AG Reg	JP Morgan	212.837
13.378	BASF SE	Citibank	(66.633)	(12.424)	Daimler AG Reg	Credit Suisse	72.013
43.897	BASF SE	JP Morgan	(58.819)	(37.549)	Daimler AG Reg	Deutsche Bank	213.063
12.027	BASF SE	Credit Suisse	(16.115)	(299.365)	Deutsche Bank AG Reg	Credit Suisse	666.110
83.810	BASF SE	Deutsche Bank	(310.204)	(388.988)	Deutsche Bank AG Reg	Bank of America	
11.481	Bayer AG Reg	Citibank	(42.004)			Merrill Lynch	910.084
9.540	Bayer AG Reg	Bank of America		(304.386)	Deutsche Bank AG Reg	Citibank	600.077
		Merrill Lynch	(1.112)	(182.481)	Deutsche Bank AG Reg	JP Morgan	463.932
10.634	Bayer AG Reg	JP Morgan	1.982	(3.972)	Deutsche Boerse AG	Bank of America	
10.301	Bayer AG Reg	Deutsche Bank	(1.200)			Merrill Lynch	8.099
17.711	Bayer AG Reg	Credit Suisse	432	(8.129)	Deutsche Boerse AG	Credit Suisse	7.104
(8.593)	Bayerische Motoren Werke AG	Bank of America		(6.193)	Deutsche Boerse AG	Deutsche Bank	12.628
		Merrill Lynch	65.980	(9.356)	Deutsche Boerse AG	JP Morgan	8.176
(5.911)	Bayerische Motoren Werke AG			15.597	Deutsche EuroShop AG	Bank of America	
		JP Morgan	45.278			Merrill Lynch	10.904
(10.030)	Bayerische Motoren Werke AG			19.162	Deutsche EuroShop AG	Citibank	(893)
		Deutsche Bank	77.014	4.122	Deutsche EuroShop AG	JP Morgan	672
(5.174)	Bechtle AG	Citibank	(301)	3.796	Deutsche EuroShop AG	Deutsche Bank	2.654
(25.168)	Bechtle AG	Bank of America		3.855	Deutsche EuroShop AG	Credit Suisse	629
		Merrill Lynch	(38.114)	216.938	Deutsche Lufthansa AG Reg	Citibank	(472.671)
(4.478)	Bechtle AG	JP Morgan	(961)	268.166	Deutsche Lufthansa AG Reg	Bank of America	
28.051	Beiersdorf AG	Bank of America				Merrill Lynch	(587.413)
		Merrill Lynch	45.757	66.379	Deutsche Lufthansa AG Reg	JP Morgan	(154.683)
6.438	Beiersdorf AG	Deutsche Bank	10.502	148.828	Deutsche Lufthansa AG Reg	Credit Suisse	(270.826)
2.959	Beiersdorf AG	JP Morgan	5.240	217.573	Deutsche Lufthansa AG Reg	Deutsche Bank	(476.590)
(119.453)	Bilfinger SE	JP Morgan	(8.351)	40.488	Deutsche Post AG Reg	JP Morgan	(87.745)
(10.435)	Bilfinger SE	Citibank	8.268	90.076	Deutsche Post AG Reg	Citibank	(162.676)
(4.541)	Bilfinger SE	Bank of America		121.655	Deutsche Post AG Reg	Credit Suisse	(224.069)
		Merrill Lynch	5.714	44.111	Deutsche Post AG Reg	Deutsche Bank	(67.329)
(165.622)	Bilfinger SE	Deutsche Bank	208.412	179.138	Deutsche Post AG Reg	Bank of America	
(24.294)	Brenntag AG	Bank of America				Merrill Lynch	(273.427)
		Merrill Lynch	849	228.248	Deutsche Telekom AG Reg	Bank of America	
(15.856)	Brenntag AG	JP Morgan	(12.932)			Merrill Lynch	(223.392)
(3.742)	Brenntag AG	Deutsche Bank	131	117.060	Deutsche Telekom AG Reg	Citibank	(30.006)
(4.678)	Carl Zeiss Meditec AG	JP Morgan	(10.084)	43.640	Deutsche Telekom AG Reg	JP Morgan	(32.540)
(9.521)	Carl Zeiss Meditec AG	Bank of America		53.144	Deutsche Telekom AG Reg	Deutsche Bank	(52.013)
		Merrill Lynch	(24.405)	5.421	Deutsche Telekom AG Reg	Credit Suisse	(7.516)
(22.766)	Carl Zeiss Meditec AG	Citibank	(30.505)	(41.981)	Deutsche Wohnen SE	Credit Suisse	(22.377)
(14.711)	Carl Zeiss Meditec AG	Credit Suisse	(31.710)	(10.839)	Deutsche Wohnen SE	Bank of America	
(9.500)	Carl Zeiss Meditec AG	Deutsche Bank	(24.352)			Merrill Lynch	(2.652)
(192.538)	Ceconomy AG	JP Morgan	106.466	(71.023)	Deutsche Wohnen SE	Citibank	(75.248)
(103.809)	Commerzbank AG	Credit Suisse	215.659	(38.971)	Deutsche Wohnen SE	JP Morgan	(17.709)
(35.369)	Commerzbank AG	Deutsche Bank	90.786	(68.367)	Deutsche Wohnen SE	Deutsche Bank	(16.728)
(95.489)	Commerzbank AG	Bank of America		(8.176)	Dialog Semiconductor Plc	Deutsche Bank	(572)
		Merrill Lynch	245.103	(5.803)	DMG Mori AG	Citibank	-
(194.365)	Commerzbank AG	Citibank	329.652	(19.409)	DMG Mori AG	Bank of America	
(167.558)	Commerzbank AG	JP Morgan	348.095			Merrill Lynch	(7.915)
(3.936)	CompuGroup Medical SE	JP Morgan	21.096	(20.123)	DMG Mori AG	JP Morgan	(24.619)
(8.338)	CompuGroup Medical SE	Bank of America		(5.327)	Duerr AG	Deutsche Bank	31.896
		Merrill Lynch	40.414	(525.439)	E.ON SE	Bank of America	
(4.747)	CompuGroup Medical SE	Citibank	21.128			Merrill Lynch	142.034
(17.835)	CompuGroup Medical SE	Deutsche Bank	77.175	(439.806)	E.ON SE	Credit Suisse	130.150
3.445	Continental AG	Citibank	(27.295)	(544.924)	E.ON SE	Deutsche Bank	147.301
3.640	Continental AG	JP Morgan	(39.443)	(330.716)	E.ON SE	JP Morgan	181.877
21.228	Continental AG	Bank of America		105.660	Evonik Industries AG	Credit Suisse	(101.432)
		Merrill Lynch	(75.272)	66.480	Evonik Industries AG	JP Morgan	(85.832)
1.680	Continental AG	Credit Suisse	(18.204)	30.590	Evonik Industries AG	Deutsche Bank	(45.265)
8.777	Continental AG	Deutsche Bank	(29.657)	9.584	Evonik Industries AG	Bank of America	
83.077	Covestro AG '144A'	Bank of America				Merrill Lynch	(14.182)
		Merrill Lynch	(54.280)	61.561	Evonik Industries AG	Citibank	(117.634)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Allemagne suite				Allemagne suite			
(57.541)	Evotec AG	Bank of America		31.393	Hochtief AG	JP Morgan	106.104
		Merrill Lynch	(167.274)	19.885	Hochtief AG	Citibank	53.981
(56.965)	Evotec AG	Credit Suisse	(121.130)	11.879	Hochtief AG	Credit Suisse	29.066
(18.023)	Evotec AG	Deutsche Bank	(52.394)	20.263	Hochtief AG	Deutsche Bank	89.716
(62.341)	Evotec AG	JP Morgan	(151.309)	3.861	Hugo Boss AG	Citibank	(2.879)
(67.201)	Evotec AG	Citibank	(76.733)	(25.835)	Infineon Technologies AG	Bank of America	
(6.461)	Fraport AG Frankfurt Airport	Bank of America				Merrill Lynch	14.534
	Services Worldwide	Merrill Lynch	14.932	(15.234)	Infineon Technologies AG	Credit Suisse	(1.420)
(10.115)	Fraport AG Frankfurt Airport			(66.515)	Infineon Technologies AG	JP Morgan	(6.200)
	Services Worldwide	Citibank	32.528	(10.605)	Innogy SE	JP Morgan	10.256
(10.842)	Fraport AG Frankfurt Airport			(67.121)	Innogy SE	Citibank	3.128
	Services Worldwide	JP Morgan	24.507	(5.754)	Innogy SE	Credit Suisse	5.565
(2.714)	Fraport AG Frankfurt Airport			(48.522)	K+S AG Reg	Citibank	72.931
	Services Worldwide	Credit Suisse	6.135	(4.395)	K+S AG Reg	Credit Suisse	5.991
(2.798)	Fraport AG Frankfurt Airport			(34.393)	K+S AG Reg	Bank of America	
	Services Worldwide	Deutsche Bank	6.325			Merrill Lynch	106.995
750	Freenet AG	Bank of America		(39.600)	K+S AG Reg	JP Morgan	53.984
		Merrill Lynch	(1.258)	(5.612)	K+S AG Reg	Deutsche Bank	17.459
8.950	Freenet AG	Citibank	(4.484)	(10.741)	KION Group AG	Credit Suisse	52.562
7.293	Freenet AG	Credit Suisse	(4.929)	(43.102)	KION Group AG	Bank of America	
4.912	Freenet AG	Deutsche Bank	(8.241)			Merrill Lynch	96.423
6.922	Freenet AG	JP Morgan	(4.678)	(13.867)	KION Group AG	Deutsche Bank	31.022
11.339	Fresenius Medical Care AG	Bank of America		(31.702)	KION Group AG	Citibank	126.676
	& Co KGaA	Merrill Lynch	10.569	6.446	Krones AG	Bank of America	
957	Fresenius Medical Care AG					Merrill Lynch	3.045
	& Co KGaA	Credit Suisse	1.360	1.562	Krones AG	JP Morgan	(905)
13.194	Fresenius Medical Care AG			1.813	Krones AG	Credit Suisse	8.238
	& Co KGaA	JP Morgan	18.755	(1.343)	Lanxess AG	Bank of America	
12.107	Fresenius Medical Care AG					Merrill Lynch	1.565
	& Co KGaA	Citibank	(1.411)	(12.100)	Lanxess AG	JP Morgan	(15.790)
30.986	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Bank of America		8.364	LEG Immobilien AG	Citibank	18.321
		Merrill Lynch	722	6.042	LEG Immobilien AG	JP Morgan	(7.213)
5.672	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Citibank	(3.040)	6.755	LEG Immobilien AG	Bank of America	
1.041	Fuchs Petrolub SE (Pref)	JP Morgan	(558)			Merrill Lynch	(11.963)
15.819	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Deutsche Bank	369	11.027	LEG Immobilien AG	Deutsche Bank	(19.529)
(38.088)	GEA Group AG	JP Morgan	88.756	3.786	LEG Immobilien AG	Credit Suisse	(2.823)
(29.806)	GEA Group AG	Citibank	39.590	(3.981)	Linde AG	Bank of America	
(7.978)	GEA Group AG	Credit Suisse	18.591			Merrill Lynch	(5.102)
2.971	Gerresheimer AG	Bank of America		(3.232)	Linde AG	Deutsche Bank	(4.142)
		Merrill Lynch	2.769	(1.023)	Linde AG	JP Morgan	(8.284)
1.042	Gerresheimer AG	Citibank	728	(11.265)	MAN SE	Credit Suisse	42.658
2.186	Gerresheimer AG	JP Morgan	637	(42.620)	MAN SE	Bank of America	
2.060	Gerresheimer AG	Credit Suisse	600			Merrill Lynch	121.359
17.555	Gerresheimer AG	Deutsche Bank	16.363	(29.589)	MAN SE	Citibank	51.713
(34.190)	Grand City Properties SA	JP Morgan	(19.121)	(43.326)	MAN SE	JP Morgan	164.064
(90.280)	Grand City Properties SA	Credit Suisse	(50.491)	(63.419)	MAN SE	Deutsche Bank	244.324
(126.939)	Grand City Properties SA	Bank of America		19.151	Merck KGaA	Credit Suisse	112.686
		Merrill Lynch	(56.417)	27.734	Merck KGaA	Bank of America	
(78.737)	Grand City Properties SA	Citibank	(7.339)			Merrill Lynch	270.793
(15.082)	Grand City Properties SA	Deutsche Bank	(7.381)	32.469	Merck KGaA	Citibank	136.192
(8.808)	Grenke AG	Deutsche Bank	28.426	18.550	Merck KGaA	JP Morgan	109.797
(6.434)	Grenke AG	Bank of America		12.867	Merck KGaA	Deutsche Bank	125.633
		Merrill Lynch	24.364	(21.463)	MorphoSys AG	Deutsche Bank	(12.700)
(263)	Grenke AG	Citibank	1.486	3.004	MTU Aero Engines AG	Bank of America	
(5.562)	Grenke AG	JP Morgan	23.654			Merrill Lynch	39.201
6.777	Hannover Rueck SE	Bank of America		4.853	MTU Aero Engines AG	Citibank	29.403
		Merrill Lynch	(33.954)	6.215	MTU Aero Engines AG	JP Morgan	63.000
8.051	Hannover Rueck SE	Citibank	(52.531)	679	MTU Aero Engines AG	Credit Suisse	6.883
9.516	Hannover Rueck SE	Credit Suisse	(53.220)	818	MTU Aero Engines AG	Deutsche Bank	10.675
4.008	Hannover Rueck SE	Deutsche Bank	(20.081)	4.782	Muenchener		
6.589	Hannover Rueck SE	JP Morgan	(36.850)		Rueckversicherungs-		
(73.952)	Hapag-Lloyd AG '144A'	Deutsche Bank	(165.437)		Gesellschaft AG in		
(105.355)	Hapag-Lloyd AG '144A'	JP Morgan	(233.233)		Muenchen Reg	Credit Suisse	(70.483)
(4.136)	HeidelbergCement AG	Citibank	23.999	21.185	Muenchener		
(3.444)	HeidelbergCement AG	JP Morgan	14.738		Rueckversicherungs-		
(21.281)	HeidelbergCement AG	Bank of America			Gesellschaft AG in	Bank of America	
		Merrill Lynch	86.784		Muenchen Reg	Merrill Lynch	(368.059)
(318)	HeidelbergCement AG	Deutsche Bank	1.297				
5.306	Hochtief AG	Bank of America					
		Merrill Lynch	41.421				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Allemagne suite				Allemagne suite			
13.559	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen Reg	JP Morgan	(199.848)	(6.562)	Sartorius AG (Pref)	Bank of America	
9.860	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Deutsche Bank	(163.134)	(1.449)	Sartorius AG (Pref)	Merrill Lynch	2.294
12.893	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Citibank	(243.361)	39.956	Schaeffler AG (Pref)	JP Morgan	1.013
16.343	Nemetschek SE	Credit Suisse	(100.780)	57.281	Schaeffler AG (Pref)	Deutsche Bank	(29.795)
15.145	Nemetschek SE	JP Morgan	(113.667)	230.557	Schaeffler AG (Pref)	Citibank	(70.745)
(24.175)	OSRAM Licht AG	Credit Suisse	40.305	130.076	Schaeffler AG (Pref)	Bank of America	(183.788)
(79.073)	OSRAM Licht AG	Bank of America		52.335	Schaeffler AG (Pref)	JP Morgan	(62.139)
(16.035)	OSRAM Licht AG	Merrill Lynch	31.243	8.426	Scout24 AG '144A'	Credit Suisse	(27.796)
(3.922)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Deutsche Bank	4.484	(11.042)	Siemens AG Reg	Deutsche Bank	393
(29.765)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Citibank	22.422	(4.572)	Siemens AG Reg	Bank of America	
(19.572)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Credit Suisse	275.365	(11.349)	Siemens AG Reg	Merrill Lynch	50.176
(14.530)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Bank of America	155.525	(11.751)	Siemens AG Reg	Credit Suisse	(10.548)
(8.553)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Merrill Lynch		(10.842)	Siemens Healthineers AG	Deutsche Bank	62.019
7.679	ProSiebenSat.1 Media SE	Deutsche Bank	58.060	(17.297)	Siemens Healthineers AG	Citibank	75.578
8.726	ProSiebenSat.1 Media SE	Bank of America	(41.157)	7.424	Siltronic AG	Credit Suisse	(2.842)
114.131	ProSiebenSat.1 Media SE	Merrill Lynch	(14.539)	2.393	Siltronic AG	Citibank	12.596
22.335	ProSiebenSat.1 Media SE	JP Morgan	(744.874)	7.168	Siltronic AG	Bank of America	(55.793)
1.123	ProSiebenSat.1 Media SE	Deutsche Bank	(58.395)	16.344	Siltronic AG	Credit Suisse	(5.298)
237	Puma SE	Credit Suisse	(7.694)	14.061	Siltronic AG	Citibank	(32.572)
(12.508)	Qiagen NV	Merrill Lynch	140.555	43.795	Software AG	Deutsche Bank	(100.959)
(12.024)	Qiagen NV	Citibank	(30.459)	10.635	Software AG	JP Morgan	(31.128)
(981)	Qiagen NV	Deutsche Bank	(13.169)	20.296	Software AG	Bank of America	
(14.750)	Qiagen NV	JP Morgan	(35.919)	94.804	Software AG	Merrill Lynch	(65.851)
(122)	Rational AG	Citibank	(782)	20.485	Software AG	Credit Suisse	(25.402)
(1.622)	Rational AG	Deutsche Bank	(41.577)	(2.188)	Stroer SE & Co KGaA	Deutsche Bank	(39.965)
23.137	Rheinmetall AG	Bank of America	(66.047)	(5.692)	Stroer SE & Co KGaA	JP Morgan	(227.215)
20.943	Rheinmetall AG	Merrill Lynch	(150.071)	(15.921)	Stroer SE & Co KGaA	Citibank	(16.946)
45.741	Rheinmetall AG	Citibank	(325.967)	4.871	Suedzucker AG	Deutsche Bank	14.276
5.509	Rheinmetall AG	Credit Suisse	(15.726)	26.679	Suedzucker AG	Citibank	28.518
27.639	Rheinmetall AG	Deutsche Bank	(265.534)	10.837	Suedzucker AG	JP Morgan	133.562
6.843	Rhoen-Klinikum AG	JP Morgan		288	Suedzucker AG	Credit Suisse	6.385
56.165	Rhoen-Klinikum AG	Bank of America	(3.189)	3.185	Suedzucker AG	Citibank	10.258
27.904	Rhoen-Klinikum AG	Merrill Lynch	(15.706)	(31.163)	Symrise AG	Deutsche Bank	14.773
4.185	Rhoen-Klinikum AG	Citibank	(33.813)	(8.966)	Symrise AG	JP Morgan	378
3.614	Rhoen-Klinikum AG	Deutsche Bank	(1.950)	(62.215)	Symrise AG	Bank of America	4.342
6.088	RTL Group SA	Credit Suisse	(4.379)	(24.052)	Symrise AG	Merrill Lynch	53.077
2.178	RTL Group SA	Deutsche Bank	(50.592)	(29.892)	Symrise AG	Citibank	9.820
5.852	RTL Group SA	Bank of America		(294.346)	Telefonica Deutschland Holding AG	JP Morgan	55.590
7.726	RTL Group SA	Merrill Lynch	(18.271)	(786.075)	Telefonica Deutschland Holding AG	Credit Suisse	28.024
3.799	RTL Group SA	Citibank	(6.478)	(293.911)	Telefonica Deutschland Holding AG	Deutsche Bank	43.884
(172.166)	RWE AG	Deutsche Bank	(50.592)	(83.470)	Telefonica Deutschland Holding AG	Citibank	25.722
(163.139)	RWE AG	Bank of America	(53.019)	(218.608)	thyssenkrupp AG	JP Morgan	444.209
(157.172)	RWE AG	Merrill Lynch	141.422	(79.742)	thyssenkrupp AG	Bank of America	1.407
12.501	Salzgitter AG	Credit Suisse	64.128	(110.826)	thyssenkrupp AG	Merrill Lynch	(291.517)
4.029	Salzgitter AG	Deutsche Bank	107.837	(63.219)	thyssenkrupp AG	Credit Suisse	(29.732)
20.615	Salzgitter AG	Bank of America		(103.421)	thyssenkrupp AG	Deutsche Bank	(33.440)
13.971	Salzgitter AG	Merrill Lynch	(53.019)	54.003	Uniper SE	Citibank	55.245
34.536	Salzgitter AG	Citibank	(20.608)		Uniper SE	JP Morgan	(38.560)
(20.262)	SAP SE	JP Morgan	(86.711)	38.990	Uniper SE	Bank of America	(18.481)
		Credit Suisse	(58.765)	163.093	Uniper SE	Credit Suisse	(21.352)
		Deutsche Bank	(146.472)	61.981	Uniper SE	JP Morgan	(89.313)
		Deutsche Bank	(26.205)	151.303	Uniper SE	Deutsche Bank	(20.525)
				(2.440)	United Internet AG Reg	Citibank	(95.197)
				(22.703)	United Internet AG Reg	Bank of America	
				(19.735)	United Internet AG Reg	Merrill Lynch	2.445
				(760)	United Internet AG Reg	JP Morgan	40.208
				(32.318)	United Internet AG Reg	Citibank	21.155
				(5.521)	Volkswagen AG (Pref)	Credit Suisse	1.346
						Deutsche Bank	30.585
						Credit Suisse	78.866

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Allemagne suite				Hong Kong suite			
(41.336)	Volkswagen AG (Pref)	Bank of America		299.000	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	JP Morgan	(11.429)
(7.592)	Volkswagen AG (Pref)	Merrill Lynch	563.194	371.000	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(29.455)
(6.628)	Volkswagen AG (Pref)	Citibank	133.926	134.500	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	Credit Suisse	(5.141)
(17.250)	Volkswagen AG (Pref)	JP Morgan	94.679	51.000	ANTA Sports Products Ltd	Citibank	(2.599)
(30.918)	Vonovia SE	Deutsche Bank	242.794	29.000	ANTA Sports Products Ltd	JP Morgan	(9.607)
(67.140)	Vonovia SE	Credit Suisse	24.136	69.000	ANTA Sports Products Ltd	Deutsche Bank	(5.714)
(6.426)	Vonovia SE	Bank of America		68.700	ASM Pacific Technology Ltd	JP Morgan	1.523
(37.205)	Vonovia SE	Merrill Lynch	(98.567)	51.600	ASM Pacific Technology Ltd	Citibank	(18.408)
(25.988)	Vonovia SE	JP Morgan	5.016	1.304.000	Bank of China Ltd 'H'	Bank of America	
7.217	Wacker Chemie AG	Citibank	(44.216)	568.000	Bank of China Ltd 'H'	Merrill Lynch	(24.921)
1.731	Wacker Chemie AG	Deutsche Bank	(44.452)	1.159.000	Bank of China Ltd 'H'	Citibank	(2.895)
21.485	Wacker Chemie AG	Merrill Lynch	(97.543)	2.041.000	Bank of China Ltd 'H'	JP Morgan	(7.383)
(8.579)	Wirecard AG	Credit Suisse	(19.365)	615.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(39.006)
(6.400)	Wirecard AG	JP Morgan	(378.485)	2.068.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	Bank of America	
(30.163)	Zalando SE '144A'	JP Morgan	(123.448)	372.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	(11.754)
(59.582)	Zalando SE '144A'	Citibank	(45.860)	670.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	Citibank	(18.444)
(8.273)	Zalando SE '144A'	JP Morgan	13.355	859.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	JP Morgan	(948)
(46.204)	Zalando SE '144A'	JP Morgan	(33.180)	(10.001)	Bank of East Asia Ltd/The	Credit Suisse	(1.707)
(9.997)	Zalando SE '144A'	Credit Suisse	(5.109)	(545.127)	Bank of East Asia Ltd/The	Deutsche Bank	(17.947)
		Deutsche Bank	(127.050)	(1.627)	Bank of East Asia Ltd/The	Credit Suisse	637
		Bank of America		(316.498)	Bank of East Asia Ltd/The	Citibank	–
		Merrill Lynch	(27.489)	(122.399)	Bank of East Asia Ltd/The	Deutsche Bank	102
			(751.401)	50.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd	Bank of America	17.366
				41.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd	JP Morgan	18.714
				427.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd	Merrill Lynch	12.547
				106.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	Citibank	2.115
				243.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd	JP Morgan	127.995
				(12.344.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Credit Suisse	56.723
				(7.400.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Deutsche Bank	51.333
				(4.344.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Bank of America	(298.821)
				(800.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Merrill Lynch	(10.842)
				(116.500)	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Citibank	149.436
				(169.760)	BOC Hong Kong Holdings Ltd	JP Morgan	(25.482)
				(245.500)	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Bank of America	21.523
				(100.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Merrill Lynch	21.523
				(1.822.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Citibank	10.815
				(3.007.733)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	JP Morgan	26.042
				(126.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Deutsche Bank	1.019
				(266.000)	BYD Co Ltd 'H'	Bank of America	18.571
				(101.500)	BYD Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	122.629
				(189.000)	BYD Electronic International Co Ltd	Citibank	(525)
				816	Cathay Pacific Airways Ltd	JP Morgan	96.589
				(1.000)	Cathay Pacific Airways Ltd	Citibank	21.338
				(19.837.000)	CGN Power Co Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	8.187
						Citibank	29
						Citibank	8
						Citibank	(25.274)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(4.175.000)	CGN Power Co Ltd 'H' '144A'	Deutsche Bank	(10.639)	(14.651.823)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	214.107
(7.581.000)	CGN Power Co Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	(50.418)	(99.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	Credit Suisse	1.766
190.000	Champion (Reit)	Bank of America		(3.636.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	Bank of America	
45.000	Champion (Reit)	Merrill Lynch	484	(690.000)	China Jinmao Holdings Group Ltd	Deutsche Bank	23.736
102.000	Champion (Reit)	JP Morgan	516	(6.096.000)	China Jinmao Holdings Group Ltd	Citibank	132.037
(2.013.000)	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	Citibank	(260)	(62.000)	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	5.135
(2.296.000)	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	—	(1.030.000)	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Bank of America	
(15.471.000)	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	Bank of America	—	(602.000)	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	85.301
(924.000)	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	—	(1.000)	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Citibank	7.670
575.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	Citibank	1.137	(23.000)	China Life Insurance Co Ltd 'H'	JP Morgan	70
1.786.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(24.909)	(4.461.000)	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	Deutsche Bank	176
518.000	China Communications Construction Co Ltd 'H'	Citibank	(84.195)	(801.000)	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	Bank of America	
170.500	China Conch Venture Holdings Ltd	JP Morgan	(23.099)	457.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	Merrill Lynch	34.102
107.500	China Conch Venture Holdings Ltd	Credit Suisse	54.804	179.000	China Medical System Holdings Ltd	Citibank	(3.062)
1.276.000	China Construction Bank Corp 'H'	JP Morgan	36.242	2.550.000	China Medical System Holdings Ltd	Deutsche Bank	34.117
810.000	China Construction Bank Corp 'H'	Citibank	(21.135)	459.000	China Medical System Holdings Ltd	Bank of America	
554.000	China Construction Bank Corp 'H'	JP Morgan	(15.480)	(6.000)	China Mengniu Dairy Co Ltd	Merrill Lynch	8.210
1.026.000	China Construction Bank Corp 'H'	Bank of America	(24.705)	(386.000)	China Mengniu Dairy Co Ltd	Credit Suisse	(49.979)
569.000	China Construction Bank Corp 'H'	Merrill Lynch	(29.699)	(76.000)	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Citibank	74.856
(581.000)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	Credit Suisse	(25.374)	212.500	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(1.108)
(1.219.000)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	4.428	1.308.500	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Bank of America	(71.311)
(5.779.866)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	JP Morgan	12.333	(316.000)	China Merchants Port Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(16.461)
(1.204.000)	China Everbright International Ltd	Citibank	22.092	(2.558.296)	China Merchants Port Holdings Co Ltd	JP Morgan	(26.064)
(324.000)	China Everbright International Ltd	JP Morgan	(71.214)	(2.722.198)	China Merchants Port Holdings Co Ltd	Bank of America	
(5.605.000)	China Everbright International Ltd	Deutsche Bank	(25.594)	(602.000)	China Merchants Port Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	78.228
(2.827.000)	China Everbright International Ltd	Bank of America	(442.761)	(1.718.000)	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H'	Citibank	145.670
678.000	China Everbright Ltd	Merrill Lynch	(79.241)	(116.500)	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H'	Deutsche Bank	(445)
588.000	China Everbright Ltd	Citibank	1.728	125.500	China Mobile Ltd	Bank of America	(64.759)
514.000	China Everbright Ltd	JP Morgan	13.485	66.500	China Mobile Ltd	Credit Suisse	(32.196)
824.000	China Everbright Ltd	Credit Suisse	37.641	126.500	China Mobile Ltd	Deutsche Bank	(62.327)
220.000	China Everbright Ltd	Deutsche Bank	561	707.000	China Mobile Ltd	Citibank	(283.748)
(74.000)	China Evergrande Group	Bank of America		(6.258.000)	China National Building Material Co Ltd 'H'		
(111.000)	China Evergrande Group	Merrill Lynch	21.685	(38.000)	China Overseas Land & Investment Ltd	Citibank	223.252
(171.000)	China Evergrande Group	Citibank	19.799	(74.000)	China Overseas Land & Investment Ltd	Bank of America	
(87.000)	China Evergrande Group	JP Morgan	41.395	(53.400)	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	5.810
(2.300.500)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Credit Suisse	21.061	(68.124)	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	Citibank	3.771
(1.675.000)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	55.690			JP Morgan	14.873
(6.821.000)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Bank of America	40.548			Citibank	6.076
(1.857.000)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Merrill Lynch					
(327.400)	China Gas Holdings Ltd	Citibank	34.762				
(858.200)	China Gas Holdings Ltd	JP Morgan	24.707				
(385.200)	China Gas Holdings Ltd	Deutsche Bank	(113.889)				
(4.000)	China Gas Holdings Ltd	Bank of America	(317.095)				
		Merrill Lynch	(51.532)				
		Citibank	(2.090)				
		JP Morgan					

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(3.400)	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	1.083	(728.800)	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Citibank	(27.857)
(186.400)	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	Bank of America		3.210.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	Credit Suisse	(48.683)
744.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Merrill Lynch	59.373	4.712.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	Deutsche Bank	(40.917)
850.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	Citibank	(2.844)	(2.534.000)	China Unicom Hong Kong Ltd	Bank of America	
(10.341.000)	China Power International Development Ltd	JP Morgan	(25.627)	(4.466.000)	China Unicom Hong Kong Ltd	Merrill Lynch	135.600
(6.122.000)	China Power International Development Ltd	Credit Suisse	(10.497)	(1.238.000)	China Unicom Hong Kong Ltd	Citibank	159.323
(1.702.000)	China Power International Development Ltd	Citibank	46.800	289.300	China Vanke Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	58.928
855.500	China Railway Construction Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(352)	251.900	China Vanke Co Ltd 'H'	Credit Suisse	(121.341)
559.500	China Railway Construction Corp Ltd 'H'	JP Morgan	(25.070)	172.300	China Vanke Co Ltd 'H'	Bank of America	(101.098)
527.000	China Railway Group Ltd 'H'	Deutsche Bank	(17.109)	389.100	China Vanke Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	(73.541)
328.000	China Railway Group Ltd 'H'	Citibank	5.372	30.900	China Vanke Co Ltd 'H'	Citibank	(79.320)
2.137.000	China Railway Group Ltd 'H'	JP Morgan	2.090	2.596.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	JP Morgan	(12.401)
786.000	China Railway Group Ltd 'H'	Deutsche Bank	(2.723)	244.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	JP Morgan	(16.538)
		Bank of America		334.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	Credit Suisse	(4.730)
		Merrill Lynch	(1.001)	1.008.000	CITIC Ltd	Citibank	(5.107)
48.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	JP Morgan	17.103	203.000	CITIC Ltd	Deutsche Bank	(28.885)
74.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	Credit Suisse	20.616	1.467.000	CITIC Ltd	Bank of America	
230.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	106.960	1.687.000	CITIC Ltd	Merrill Lynch	(6.725)
76.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	Citibank	26.144	1.342.000	CITIC Ltd	Credit Suisse	(29.906)
(46.000)	China Resources Gas Group Ltd	Deutsche Bank	(10.256)	(63.500)	CITIC Securities Co Ltd 'H'	Citibank	21.494
(708.000)	China Resources Gas Group Ltd	Bank of America		(2.010.500)	CITIC Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	(27.357)
(234.000)	China Resources Gas Group Ltd	Merrill Lynch	(157.861)			Deutsche Bank	(647)
316.000	China Resources Land Ltd	Citibank	16.398	(575.500)	CITIC Securities Co Ltd 'H'	Bank of America	
182.000	China Resources Land Ltd	JP Morgan	(19.062)	15.000	CK Asset Holdings Ltd	Merrill Lynch	(20.493)
406.500	China Resources Pharmaceutical Group Ltd '144A'	Citibank	(4.638)			Citibank	(27.863)
196.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd '144A'	Deutsche Bank	72.509	202.000	CK Asset Holdings Ltd	Bank of America	
242.000	China Resources Power Holdings Co Ltd	JP Morgan	31.465	318.000	CK Asset Holdings Ltd	Merrill Lynch	(4.682)
469.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	JP Morgan	24.050	164.000	CK Asset Holdings Ltd	Credit Suisse	(38.605)
173.500	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	Credit Suisse	37.048	154.000	CK Asset Holdings Ltd	Deutsche Bank	(99.265)
203.500	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(6.632)	23.000	CK Asset Holdings Ltd	JP Morgan	(31.343)
78.500	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	Bank of America			CK Hutchison Holdings Ltd	Citibank	(30.413)
603.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	(7.778)			Bank of America	
(3.296.000)	China State Construction International Holdings Ltd	JP Morgan	6.201	29.000	CK Hutchison Holdings Ltd	Merrill Lynch	(4.249)
(5.782.913)	China State Construction International Holdings Ltd	Citibank	56.853	84.000	CK Hutchison Holdings Ltd	Credit Suisse	(11.269)
(580.000)	China State Construction International Holdings Ltd	JP Morgan	33.595	44.500	CK Hutchison Holdings Ltd	JP Morgan	(32.642)
(1.158.000)	China State Construction International Holdings Ltd	Credit Suisse	(16.229)	6.500	CK Hutchison Holdings Ltd	Citibank	1.417
(698.000)	China State Construction International Holdings Ltd	Deutsche Bank	7.115	(448.500)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Deutsche Bank	(1.201)
(223.400)	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Citibank	15.655	(1.000)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Bank of America	
(817.600)	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Bank of America	57.294	(32.000)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Merrill Lynch	97.143
		Merrill Lynch		(37.500)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Citibank	6
				336.500	CLP Holdings Ltd	Deutsche Bank	6.931
						JP Morgan	5.749
				843.500	CLP Holdings Ltd	Bank of America	
				216.000	CLP Holdings Ltd	Merrill Lynch	27.868
				1.232.000	CLP Holdings Ltd	Citibank	80.603
				230.500	CLP Holdings Ltd	JP Morgan	20.640
				(146.748)	CMBC Capital Holdings Ltd	Credit Suisse	107.143
				(2.470.000)	CMBC Capital Holdings Ltd	Deutsche Bank	19.089
				835.000	CNOOC Ltd	JP Morgan	1.028
				2.265.000	CNOOC Ltd	Citibank	–
				(154.000)	COSCO SHIPPING Ports Ltd	Credit Suisse	(13.352)
				(1.130.000)	COSCO SHIPPING Ports Ltd	Deutsche Bank	(242.410)
				(772.000)	COSCO SHIPPING Ports Ltd	Bank of America	
				101.000	Country Garden Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(8.633)
				311.000	Country Garden Holdings Co Ltd	Citibank	(35.993)
				300.000	Country Garden Holdings Co Ltd	JP Morgan	(51.158)
				1.109.000	Country Garden Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(10.303)
				47.000	Country Garden Holdings Co Ltd	Bank of America	
				(895.000)	CRRC Corp Ltd 'H'	Merrill Lynch	(49.134)
				(3.812.000)	CRRC Corp Ltd 'H'	Citibank	(16.054)
						Deutsche Bank	(7.425)
						Bank of America	
						Merrill Lynch	17.105
						Citibank	9.714

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(2.374.000)	CRRRC Corp Ltd 'H'	JP Morgan	10.298	736.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	Citibank	(46.887)
1.036.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	211.194	214.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(37.081)
594.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Credit Suisse	238.396	146.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	(9.673)
1.528.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Citibank	243.352	1.184.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	Credit Suisse	(75.467)
36.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	Deutsche Bank	7.339	(21.157.000)	Guotai Junan International Holdings Ltd	Citibank	350.429
204.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	JP Morgan	81.873	(1.363.000)	Guotai Junan International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	27.785
(20.000)	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Citibank	5.479	(1.022.000)	Guotai Junan International Holdings Ltd	Deutsche Bank	20.834
(164.400)	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38.750	(1.999.611)	Guotai Junan International Holdings Ltd	JP Morgan	45.859
(8.800)	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Deutsche Bank	2.074	835.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	101.068
346.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	4.408	264.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Citibank	40.363
3.824.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Citibank	(82.826)	596.000	Haier Electronics Group Co Ltd	JP Morgan	119.483
4.180.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	JP Morgan	223.680	376.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Deutsche Bank	44.230
4.402.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	56.086	400.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Credit Suisse	84.090
2.186.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Credit Suisse	25.426	157.000	Haitian International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	26.004
(156.000)	ENN Energy Holdings Ltd	Citibank	(14.907)	592.000	Haitian International Holdings Ltd	Citibank	45.256
(43.000)	ENN Energy Holdings Ltd	JP Morgan	(36.505)	1.003.000	Haitian International Holdings Ltd	JP Morgan	138.166
(244.000)	Far East Horizon Ltd	JP Morgan	(11.344)	480.000	Haitian International Holdings Ltd	Credit Suisse	64.214
(427.000)	Far East Horizon Ltd	Deutsche Bank	(4.352)	289.000	Haitian International Holdings Ltd	Deutsche Bank	38.726
(208.000)	Far East Horizon Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.120)	(1.708.607)	Haitong International Securities Group Ltd	Credit Suisse	13.062
(1.742.000)	Far East Horizon Ltd	Citibank	(51.048)	(3.905.000)	Haitong International Securities Group Ltd	Deutsche Bank	94.532
325.500	Fosun International Ltd	Credit Suisse	29.860	(483)	Haitong International Securities Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11
1.357.000	Fosun International Ltd	Deutsche Bank	(46.915)	(8.460.773)	Haitong International Securities Group Ltd	Citibank	(93.640)
134.000	Fosun International Ltd	JP Morgan	12.292	(1.213.048)	Haitong International Securities Group Ltd	JP Morgan	38.638
456.500	Fosun International Ltd	Citibank	(2.327)	(353.200)	Haitong Securities Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	42.301
(9.745.000)	Fullshare Holdings Ltd	Citibank	(24.832)	(1.760.400)	Haitong Securities Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	210.834
(12.500)	Fullshare Holdings Ltd	JP Morgan	16	(2.271.542)	Haitong Securities Co Ltd 'H'	Citibank	81.037
6.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	612	(362.400)	Haitong Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	27.768
6.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Credit Suisse	459	(276.000)	Hang Lung Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	40.440
163.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Citibank	12.461	(78.000)	Hang Lung Group Ltd	Deutsche Bank	11.429
261.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	JP Morgan	19.952	(190.000)	Hang Lung Group Ltd	JP Morgan	3.295
143.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Deutsche Bank	14.576	(368.000)	Hang Lung Group Ltd	Citibank	2.344
(20.091.000)	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	Citibank	230.381	(872.000)	Hang Lung Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	148.876
163.000	Geely Automobile Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19.729)	(64.000)	Hang Lung Properties Ltd	Deutsche Bank	10.927
86.000	Geely Automobile Holdings Ltd	Citibank	(5.479)	(231.000)	Hang Lung Properties Ltd	Citibank	7.652
397.000	Geely Automobile Holdings Ltd	JP Morgan	(35.407)	(449.000)	Hang Lung Properties Ltd	JP Morgan	44.079
456.000	Geely Automobile Holdings Ltd	Credit Suisse	(40.669)	94.200	Hang Seng Bank Ltd	Citibank	(6.001)
300.800	GF Securities Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(33.726)	127.700	Hang Seng Bank Ltd	Deutsche Bank	(73.216)
(5.924.000)	GOME Retail Holdings Ltd	Citibank	(22.643)	28.300	Hang Seng Bank Ltd	JP Morgan	(4.327)
(765.497)	GOME Retail Holdings Ltd	JP Morgan	(4.648)	73.670	Henderson Land Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	939
(1.740.000)	GOME Retail Holdings Ltd	Deutsche Bank	(4.434)	60.100	Henderson Land Development Co Ltd	Citibank	4.977
(325.500)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	18.662	122.000	Henderson Land Development Co Ltd	Deutsche Bank	1.554
(304.000)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	17.430				
(1.120.548)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Citibank	17.132				
682.000	Guangdong Investment Ltd	Citibank	(17.379)				
1.180.000	Guangdong Investment Ltd	JP Morgan	99.227				
676.000	Guangdong Investment Ltd	Credit Suisse	58.222				
1.108.000	Guangdong Investment Ltd	Deutsche Bank	13.523				
1.492.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(258.529)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
73.000	Henderson Land Development Co Ltd	JP Morgan	8.626	63.500	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15.777)
29.000	Hengan International Group Co Ltd	Deutsche Bank	13.486	365.500	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Credit Suisse	20.956
113.000	Hengan International Group Co Ltd	Citibank	59.029	479.000	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Citibank	(33.566)
3.430.500	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd '144A' (Unit)	Credit Suisse	79.479	177.500	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Deutsche Bank	(44.100)
1.471.500	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd '144A' (Unit)	Bank of America		297.000	Kingboard Chemical Holdings Ltd	JP Morgan	17.028
1.236.500	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd '144A' (Unit)	Merrill Lynch	58.120	1.223.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd	JP Morgan	(6.894)
4.076.000	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd '144A' (Unit)	Citibank	25.207	1.014.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Citibank	(93.019)
(1.720.000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	JP Morgan	166.183	2.112.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Deutsche Bank	(219.941)
(242.000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America	26.297	366.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Bank of America	
807.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Merrill Lynch	5.550	1.354.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Merrill Lynch	(38.290)
1.510.500	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Citibank		343.000	Kingsoft Corp Ltd	Credit Suisse	(33.197)
1.512.800	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Deutsche Bank	(8.226)	982.000	Kingsoft Corp Ltd	Deutsche Bank	47.155
340	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Bank of America	(15.396)	(518.000)	Kunlun Energy Co Ltd	JP Morgan	–
551.900	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Merrill Lynch	69.388	(1.508.000)	Kunlun Energy Co Ltd	Bank of America	(9.900)
98.000	Hopewell Holdings Ltd	Citibank	–	(226.000)	Kunlun Energy Co Ltd	Merrill Lynch	82.617
49.000	Hopewell Holdings Ltd	Credit Suisse	25.314	174.000	KWG Property Holding Ltd	JP Morgan	(6.446)
109.000	Hopewell Holdings Ltd	JP Morgan	(8.586)	297.000	KWG Property Holding Ltd	Credit Suisse	(1.330)
(1.818.000)	Huaneng Power International Inc 'H'	Deutsche Bank	(3.913)	571.500	KWG Property Holding Ltd	JP Morgan	(2.270)
(1.000.000)	Huaneng Power International Inc 'H'	Citibank	(6.944)	372.000	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	Citibank	(55.339)
(168.000)	Huaneng Power International Inc 'H'	Bank of America	(60.224)	440.000	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	Bank of America	1.422
(2.632.000)	Huaneng Power International Inc 'H'	JP Morgan	(78.725)	841.000	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	Merrill Lynch	17.379
(1.105.721)	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	Deutsche Bank	(13.057)	732.000	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	Citibank	32.145
(201.200)	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	Bank of America	(204.559)	(9.142.000)	Lenovo Group Ltd	Deutsche Bank	2.798
(500.800)	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	Merrill Lynch		(1.582.000)	Li & Fung Ltd	Citibank	(384.377)
171.000	Hysan Development Co Ltd	Citibank	(28.176)	(3.424.000)	Li & Fung Ltd	Bank of America	272.109
186.000	Hysan Development Co Ltd	Deutsche Bank	16.919	(1.862.000)	Li & Fung Ltd	Merrill Lynch	152.688
73.000	Hysan Development Co Ltd	Bank of America	42.112	(386.000)	Link (Reit)	Citibank	151.711
5.000	Hysan Development Co Ltd	Merrill Lynch	18.519	150.500	Link (Reit)	Deutsche Bank	66.393
105.000	Hysan Development Co Ltd	Citibank		52.000	Link (Reit)	Citibank	959
270.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Deutsche Bank	(5.925)	113.000	Link (Reit)	Credit Suisse	18.882
1.972.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Bank of America	(2.325)	136.000	Link (Reit)	Deutsche Bank	15.837
1.213.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Merrill Lynch	637	30.500	Link (Reit)	JP Morgan	49.384
708.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Citibank	13.378	176.000	Longfor Properties Co Ltd	Bank of America	4.275
582.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Deutsche Bank	(12.728)	139.000	Longfor Properties Co Ltd	Bank of America	(35.879)
166.500	Kerry Properties Ltd	Citibank	(32.663)	80.000	Longfor Properties Co Ltd	Merrill Lynch	1.771
58.000	Kerry Properties Ltd	JP Morgan	(43.273)	198.500	Longfor Properties Co Ltd	Citibank	1.771
279.500	Kerry Properties Ltd	Deutsche Bank	(33.376)	(70.000)	Luk Fook Holdings International Ltd	Deutsche Bank	(16.308)
75.000	Kerry Properties Ltd	Credit Suisse	(20.763)	(397.000)	Luk Fook Holdings International Ltd	JP Morgan	5.058
218.500	Kerry Properties Ltd	Citibank	58.338	(45.000)	Luk Fook Holdings International Ltd	Credit Suisse	(11.148)
		Credit Suisse	28.081	(219.000)	Luk Fook Holdings International Ltd	Citibank	(116.338)
		Bank of America	37.392	(1.857.200)	Man Wah Holdings Ltd	Deutsche Bank	(14.620)
		Merrill Lynch	10.034	(9.200)	Man Wah Holdings Ltd	Bank of America	(71.152)
		JP Morgan	105.788	(2.508.800)	Man Wah Holdings Ltd	Merrill Lynch	2.366
				(2.329.200)	Man Wah Holdings Ltd	Citibank	(844)
					Man Wah Holdings Ltd	Deutsche Bank	(131.220)
					Man Wah Holdings Ltd	Bank of America	
					Man Wah Holdings Ltd	Merrill Lynch	(127.608)
					Melco International Development Ltd	Deutsche Bank	29.457
					Melco International Development Ltd	Credit Suisse	(10.040)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
54.000	Melco International Development Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.848	341.200	Sands China Ltd	Credit Suisse	21.328
163.000	Melco International Development Ltd	Citibank	22.845	548.800	Sands China Ltd	Deutsche Bank	5.382
(547.200)	MGM China Holdings Ltd	Deutsche Bank	13.944	(3.700.500)	Semiconductor Manufacturing International Corp	Citibank	(28.289)
(1.319.600)	MGM China Holdings Ltd	Credit Suisse	20.280	(1.448.000)	Semiconductor Manufacturing International Corp	Deutsche Bank	73.796
(1.006.400)	MGM China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	25.645	(2.471.500)	Semiconductor Manufacturing International Corp	Bank of America Merrill Lynch	125.957
(883.729)	MGM China Holdings Ltd	Citibank	(90.076)	(1.038.374)	Semiconductor Manufacturing International Corp	JP Morgan	10.584
(398.400)	MGM China Holdings Ltd	JP Morgan	20.304	1.012.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	JP Morgan	—
(242.000)	Minth Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	74.000	22.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Deutsche Bank	(1.121)
(635.750)	Minth Group Ltd	Citibank	81.001	30.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.529)
(6.000)	Minth Group Ltd	Deutsche Bank	1.835	650.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Citibank	—
(294.648)	Minth Group Ltd	JP Morgan	44.879	4.928.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Credit Suisse	—
(232.000)	MMG Ltd	Credit Suisse	10.937	(94.000)	Shangri-La Asia Ltd	Deutsche Bank	(10.300)
(3.416.000)	MMG Ltd	Citibank	143.626	(420.000)	Shangri-La Asia Ltd	JP Morgan	(39.059)
(1.328.000)	MMG Ltd	Deutsche Bank	98.136	(534.000)	Shangri-La Asia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(58.512)
130.000	MTR Corp Ltd	Credit Suisse	(10.766)	(496.000)	Shangri-La Asia Ltd	Citibank	(1.264)
190.500	MTR Corp Ltd	Deutsche Bank	(53.397)	323.000	Shimao Property Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	43.211
240.000	MTR Corp Ltd	Citibank	9.173	165.000	Shimao Property Holdings Ltd	Deutsche Bank	22.074
(54.600)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	15.304	327.500	Shimao Property Holdings Ltd	Credit Suisse	89.712
(455.388)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	Citibank	34.812	1.066.000	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	Credit Suisse	10.865
(122.600)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	34.365	951.000	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	JP Morgan	9.693
(490.300)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	JP Morgan	126.235	2.936.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	Citibank	508.742
(2.129.297)	New World Development Co Ltd	Citibank	(260.596)	2.071.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	Deutsche Bank	126.655
(285.578)	New World Development Co Ltd	Deutsche Bank	(2.911)	328.000	Sino Land Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5.851)
(3.589.272)	New World Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(36.585)	200.000	Sino Land Co Ltd	Citibank	5.606
(412.000)	New World Development Co Ltd	JP Morgan	(4.875)	120.000	Sino Land Co Ltd	Credit Suisse	3.975
720.000	Nexteer Automotive Group Ltd	Deutsche Bank	75.223	48.000	Sino Land Co Ltd	Deutsche Bank	(856)
482.000	Nexteer Automotive Group Ltd	JP Morgan	103.171	78.000	Sino Land Co Ltd	JP Morgan	2.584
94.000	Nexteer Automotive Group Ltd	Credit Suisse	20.121	(2.198.500)	Sino-Ocean Group Holding Ltd	Bank of America Merrill Lynch	100.840
7.000	Nexteer Automotive Group Ltd	Citibank	696	(789.000)	Sino-Ocean Group Holding Ltd	Citibank	(2.011)
(196.484)	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	Citibank	(2.003)	(500)	Sino-Ocean Group Holding Ltd	JP Morgan	12
1.454.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(11.115)	(51.500)	Sino-Ocean Group Holding Ltd	Deutsche Bank	2.362
715.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	Citibank	3.644	(193.600)	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(9.867)
1.238.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	JP Morgan	1.577	(698.400)	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Citibank	(35.593)
(468.000)	PetroChina Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(20.273)	(1)	Sisram Medical Ltd '144A'	JP Morgan	—
(476.000)	PetroChina Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(20.620)	128.000	SJM Holdings Ltd	Citibank	31.801
(15.474.000)	PetroChina Co Ltd 'H'	Citibank	(670.322)	987.000	SJM Holdings Ltd	Credit Suisse	284.202
(954.000)	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	JP Morgan	48.929	730.000	SJM Holdings Ltd	JP Morgan	210.200
(1.036.000)	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	79.198	(4.483.000)	SOHO China Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(62.830)
370.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Citibank	(42.427)	(1.007.000)	SOHO China Ltd	JP Morgan	(23.635)
130.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	JP Morgan	(948)	(810.000)	SOHO China Ltd	Citibank	(25.800)
86.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Credit Suisse	3.287	(688.500)	SOHO China Ltd	Deutsche Bank	(9.649)
90.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(22.934)	151.000	Sun Art Retail Group Ltd	Deutsche Bank	(2.693)
17.000	Power Assets Holdings Ltd	Credit Suisse	(8.447)	233.000	Sun Art Retail Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4.156)
107.000	Power Assets Holdings Ltd	Deutsche Bank	(6.824)	194.500	Sun Art Retail Group Ltd	Citibank	(3.965)
49.000	Power Assets Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8.428)	560.500	Sun Art Retail Group Ltd	JP Morgan	(714)
662.500	Power Assets Holdings Ltd	JP Morgan	(256.127)	63.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Credit Suisse	12.843
738.000	Power Assets Holdings Ltd	Citibank	(14.104)	38.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Deutsche Bank	(11.620)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
5.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America		567.000	WH Group Ltd '144A'	Deutsche Bank	(9.391)
		Merrill Lynch	(1.529)	470.500	WH Group Ltd '144A'	Bank of America	
17.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Citibank	2.599			Merrill Lynch	(7.793)
107.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	JP Morgan	21.813	(990.000)	Wharf Holdings Ltd/The	Citibank	12.614
(488.000)	Sunac China Holdings Ltd	Citibank	192.745	(466.000)	Wharf Holdings Ltd/The	JP Morgan	14.906
(553.482)	Sunac China Holdings Ltd	JP Morgan	331.439	(231.000)	Wharf Holdings Ltd/The	Bank of America	
(157.000)	Sunac China Holdings Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	22.074
		Merrill Lynch	103.017	(163.000)	Wharf Real Estate Investment	Bank of America	
(45.000)	Sunac China Holdings Ltd	Credit Suisse	20.771	Co Ltd	Co Ltd	Merrill Lynch	55.035
(9.000)	Sunny Optical Technology			(244.000)	Wharf Real Estate Investment		
	Group Co Ltd	Deutsche Bank	(11.467)	Co Ltd	Co Ltd	JP Morgan	(85.492)
(15.000)	Sunny Optical Technology	Bank of America		(180.000)	Wheelock & Co Ltd	Bank of America	
	Group Co Ltd	Merrill Lynch	(19.111)			Merrill Lynch	(1.147)
(5.000)	Sunny Optical Technology			(136.000)	Wheelock & Co Ltd	Citibank	6.931
	Group Co Ltd	JP Morgan	(11.722)	(40.000)	Wheelock & Co Ltd	Deutsche Bank	(255)
(108.500)	Sunny Optical Technology			(154.000)	Wheelock & Co Ltd	JP Morgan	(18.844)
	Group Co Ltd	Citibank	(113.356)	37.600	Wynn Macau Ltd	Bank of America	
(47.000)	Swire Pacific Ltd 'A'	Deutsche Bank	(4.491)			Merrill Lynch	–
(535.500)	Swire Pacific Ltd 'A'	Bank of America		434.400	Wynn Macau Ltd	Citibank	5.535
		Merrill Lynch	(51.171)	350.400	Wynn Macau Ltd	Credit Suisse	5.913
(204.000)	Swire Pacific Ltd 'A'	Citibank	(54.582)	312.800	Wynn Macau Ltd	JP Morgan	(19.927)
(10.500)	Swire Pacific Ltd 'A'	JP Morgan	(4.682)	1.396.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	Bank of America	
(16.800)	Swire Properties Ltd	Deutsche Bank	(2.033)			Merrill Lynch	14.229
(312.800)	Swire Properties Ltd	Bank of America		1.694.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	JP Morgan	(120.530)
		Merrill Lynch	(37.861)	220.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	Deutsche Bank	2.242
(296.600)	Swire Properties Ltd	Citibank	(69.911)	164.500	Yue Yuen Industrial	Bank of America	
(12.800)	Swire Properties Ltd	JP Morgan	(3.343)	Holdings Ltd	Holdings Ltd	Merrill Lynch	41.918
55.000	Techtronic Industries Co Ltd	Bank of America		164.500	Yue Yuen Industrial		
		Merrill Lynch	(16.117)	Holdings Ltd	Holdings Ltd	Citibank	45.062
375.000	Techtronic Industries Co Ltd	Citibank	(90.779)	209.000	Yue Yuen Industrial		
165.500	Techtronic Industries Co Ltd	JP Morgan	22.941	Holdings Ltd	Holdings Ltd	Credit Suisse	33.286
329.000	Techtronic Industries Co Ltd	Credit Suisse	71.260	246.500	Yue Yuen Industrial		
153.000	Techtronic Industries Co Ltd	Deutsche Bank	(43.598)	Holdings Ltd	Holdings Ltd	Deutsche Bank	62.813
38.500	Tencent Holdings Ltd	Bank of America		406.000	Yue Yuen Industrial		
		Merrill Lynch	5.886	Holdings Ltd	Holdings Ltd	JP Morgan	64.660
105.700	Tencent Holdings Ltd	JP Morgan	113.770	(563.000)	Zhongsheng Group		
100.600	Tencent Holdings Ltd	Deutsche Bank	15.381	Holdings Ltd	Holdings Ltd	Citibank	(7.173)
61.200	Tencent Holdings Ltd	Citibank	(60.820)	(7.500)	Zhongsheng Group		
43.800	Tencent Holdings Ltd	Credit Suisse	27.898	Holdings Ltd	Holdings Ltd	JP Morgan	(1.099)
1.568.000	Tingyi Cayman Islands			(185.000)	Zhongsheng Group		
	Holding Corp	Credit Suisse	348.677	Holdings Ltd	Holdings Ltd	Deutsche Bank	(32.999)
74.000	Tingyi Cayman Islands			(429.000)	Zhuzhou CRRC Times		
	Holding Corp	JP Morgan	16.971	Electric Co Ltd 'H'	Electric Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	73.237
654.000	Tingyi Cayman Islands			(1.337.400)	Zhuzhou CRRC Times	Bank of America	
	Holding Corp	Citibank	123.322	Electric Co Ltd 'H'	Electric Co Ltd 'H'	Merrill Lynch	272.636
630.000	Tingyi Cayman Islands			(677.900)	Zhuzhou CRRC Times		
	Holding Corp	Deutsche Bank	114.739	Electric Co Ltd 'H'	Electric Co Ltd 'H'	Citibank	(90.690)
(136.000)	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H'	Bank of America					1.228.548
		Merrill Lynch	(30.323)	Italie			
(2.751.000)	Value Partners Group Ltd	Citibank	28.040	2.121.423	A2A SpA	Bank of America	
(852.087)	Value Partners Group Ltd	JP Morgan	27.141			Merrill Lynch	(454.807)
(448.000)	Value Partners Group Ltd	Deutsche Bank	9.704	2.130.252	A2A SpA	JP Morgan	(361.777)
28.700	VTech Holdings Ltd	Bank of America		1.174.594	A2A SpA	Citibank	(103.328)
		Merrill Lynch	(4.205)	174.625	A2A SpA	Deutsche Bank	(37.437)
116.000	VTech Holdings Ltd	Citibank	(28.820)	1.421.712	A2A SpA	Credit Suisse	(248.555)
78.800	VTech Holdings Ltd	JP Morgan	(10.740)	56.619	ACEA SpA	Bank of America	
59.500	VTech Holdings Ltd	Credit Suisse	(5.806)			Merrill Lynch	(78.504)
122.400	VTech Holdings Ltd	Deutsche Bank	(17.934)	51.839	ACEA SpA	Citibank	(42.884)
255.000	Want Want China	Bank of America		36.795	ACEA SpA	JP Morgan	(48.445)
	Holdings Ltd	Merrill Lynch	17.544	39.892	ACEA SpA	Credit Suisse	(52.523)
2.314.000	Want Want China			23.197	ACEA SpA	Deutsche Bank	(32.163)
	Holdings Ltd	JP Morgan	242.421	51.049	Amplifon SpA	Bank of America	
143.000	Want Want China					Merrill Lynch	(63.643)
	Holdings Ltd	Citibank	12.389	84.138	Amplifon SpA	Citibank	(15.685)
373.000	Want Want China			29.738	Amplifon SpA	JP Morgan	4.846
	Holdings Ltd	Credit Suisse	40.395	17.593	Amplifon SpA	Credit Suisse	(21.668)
753.000	Want Want China			12.832	Anima Holding SpA '144A'	Bank of America	
	Holdings Ltd	Deutsche Bank	49.114			Merrill Lynch	(18.868)
758.000	WH Group Ltd '144A'	Citibank	(61.809)	77.098	Anima Holding SpA '144A'	Citibank	(74.739)
1.207.000	WH Group Ltd '144A'	JP Morgan	13.352				
570.500	WH Group Ltd '144A'	Credit Suisse	2.907				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Italie suite				Italie suite			
463	Anima Holding SpA '144A'	Deutsche Bank	(681)	(74.553)	CNH Industrial NV	Deutsche Bank	28.446
7.460	Anima Holding SpA '144A'	JP Morgan	(11.317)	(423.098)	Davide Campari-Milano SpA	Bank of America	
2.580	Anima Holding SpA '144A'	Credit Suisse	(3.914)			Merrill Lynch	(23.027)
42.755	Assicurazioni Generali SpA	Credit Suisse	(80.893)	(154.729)	Davide Campari-Milano SpA	Citibank	(9.916)
56.411	Assicurazioni Generali SpA	Bank of America		(190.003)	Davide Campari-Milano SpA	JP Morgan	(24.402)
		Merrill Lynch	(140.985)	(37.507)	Davide Campari-Milano SpA	Credit Suisse	(7.211)
62.791	Assicurazioni Generali SpA	Citibank	(65.479)	(245.260)	Davide Campari-Milano SpA	Deutsche Bank	(10.002)
60.383	Assicurazioni Generali SpA	JP Morgan	(136.999)	9.615	De' Longhi SpA	JP Morgan	(12.323)
42.666	Assicurazioni Generali SpA	Deutsche Bank	(106.633)	19.005	De' Longhi SpA	Citibank	(8.415)
(7.788)	Atlantia SpA	Bank of America		2.140	De' Longhi SpA	Deutsche Bank	(2.294)
		Merrill Lynch	30.036	(13.178)	DiaSorin SpA	Bank of America	
(63.720)	Atlantia SpA	Citibank	113.592			Merrill Lynch	(23.799)
(21.839)	Atlantia SpA	JP Morgan	83.462	(8.687)	DiaSorin SpA	Credit Suisse	(43.017)
(45.733)	Atlantia SpA	Credit Suisse	125.779	(6.362)	DiaSorin SpA	JP Morgan	(31.504)
(5.775)	Atlantia SpA	Deutsche Bank	22.272	363.554	Enel SpA	Bank of America	
224.217	Autogrill SpA	Bank of America				Merrill Lynch	(167.463)
		Merrill Lynch	(10.450)	327.483	Enel SpA	Citibank	(77.840)
18.527	Autogrill SpA	JP Morgan	(14.031)	553.339	Enel SpA	JP Morgan	(371.360)
151.046	Autogrill SpA	Citibank	(26.399)	224.253	Enel SpA	Credit Suisse	(150.502)
70.083	Autogrill SpA	Deutsche Bank	(3.266)	541.505	Enel SpA	Deutsche Bank	(290.230)
14.495	Azimut Holding SpA	Credit Suisse	(47.401)	332.078	Eni SpA	Citibank	(240.665)
37.744	Azimut Holding SpA	Citibank	(36.941)	34.181	Eni SpA	Deutsche Bank	(14.902)
134.358	Azimut Holding SpA	JP Morgan	(325.836)	90.218	ERG SpA	Credit Suisse	(256.487)
37.255	Azimut Holding SpA	Bank of America		98.385	ERG SpA	JP Morgan	(220.953)
		Merrill Lynch	(44.511)	53.477	ERG SpA	Deutsche Bank	(117.012)
7.884	Azimut Holding SpA	Deutsche Bank	(12.673)	9.825	EXOR NV	Credit Suisse	(40.524)
5.136	Banca Generali SpA	Bank of America		(3.040)	Ferrari NV	Citibank	4.959
		Merrill Lynch	(32.913)	(1.632)	Ferrari NV	JP Morgan	(94)
20.112	Banca Generali SpA	Citibank	(69.832)	14.550	Fiat Chrysler Automobiles NV	Citibank	1.255
20.913	Banca Generali SpA	JP Morgan	(148.637)	51.561	Fiat Chrysler Automobiles NV	JP Morgan	18.503
20.697	Banca Generali SpA	Credit Suisse	(147.102)	24.802	Fiat Chrysler Automobiles NV	Deutsche Bank	15.489
30.253	Banca Generali SpA	Deutsche Bank	(165.925)	20.233	Fiat Chrysler Automobiles NV	Credit Suisse	7.261
23.465	Banca Mediolanum SpA	Bank of America		193.136	FinecoBank Banca	Bank of America	
		Merrill Lynch	(11.620)		Fineco SpA	Merrill Lynch	(233.049)
18.459	Banca Mediolanum SpA	Citibank	(1.828)	37.155	FinecoBank Banca		
18.699	Banca Mediolanum SpA	JP Morgan	(14.162)		Fineco SpA	Citibank	(28.572)
20.133	Banca Mediolanum SpA	Deutsche Bank	(9.970)	132.233	FinecoBank Banca		
9.052	Banca Mediolanum SpA	Credit Suisse	(6.856)		Fineco SpA	JP Morgan	(197.211)
(166.067)	Banca Popolare di Sondrio SCPA	Bank of America		18.597	FinecoBank Banca		
		Merrill Lynch	89.076		Fineco SpA	Credit Suisse	(27.735)
(110.520)	Banca Popolare di Sondrio SCPA			123.060	FinecoBank Banca		
		Citibank	19.831		Fineco SpA	Deutsche Bank	(143.574)
(40.456)	Banca Popolare di Sondrio SCPA			1.311	IMA Industria Macchine Automatiche SpA	Bank of America	
		JP Morgan	15.838			Merrill Lynch	(4.430)
(180.507)	Banco BPM SpA	Bank of America		792	IMA Industria Macchine Automatiche SpA		
		Merrill Lynch	175.615			JP Morgan	(1.061)
(1.306.652)	Banco BPM SpA	Deutsche Bank	999.828	631	IMA Industria Macchine Automatiche SpA		
(561.633)	Banco BPM SpA	Credit Suisse	486.738			Credit Suisse	(845)
(999.347)	Banco BPM SpA	Citibank	558.324	1.257	IMA Industria Macchine Automatiche SpA		
(421.130)	Banco BPM SpA	JP Morgan	380.767			Citibank	2.124
(543.055)	BPER Banca	Citibank	391.033	(31.028)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'		
(338.877)	BPER Banca	JP Morgan	187.945			JP Morgan	21.691
48.210	Brembo SpA	Bank of America		(46.386)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'		
		Merrill Lynch	9.549			Credit Suisse	32.428
74.434	Brembo SpA	JP Morgan	(31.222)	(69.825)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'		
58.930	Brembo SpA	Citibank	13.046			Citibank	26.441
15.317	Brembo SpA	Deutsche Bank	3.034	(145.780)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA '144A'		
52.190	Brembo SpA	Credit Suisse	(21.891)			Bank of America	
(3.414)	Brunello Cucinelli SpA	Bank of America		7.820	Interpump Group SpA	Merrill Lynch	102.763
		Merrill Lynch	(14.320)			Bank of America	
(30.015)	Brunello Cucinelli SpA	Deutsche Bank	(125.899)	5.685	Interpump Group SpA	Merrill Lynch	(11.480)
20.030	Buzzi Unicem SpA	Bank of America		(137.740)	Intesa Sanpaolo SpA	Credit Suisse	(3.842)
		Merrill Lynch	(38.974)			Bank of America	
17.510	Buzzi Unicem SpA	Citibank	(31.827)	(88.357)	Intesa Sanpaolo SpA	Merrill Lynch	109.132
16.447	Buzzi Unicem SpA	JP Morgan	(32.003)	(74.716)	Intesa Sanpaolo SpA	JP Morgan	66.454
7.849	Buzzi Unicem SpA	Credit Suisse	(15.273)	(238.665)	Intesa Sanpaolo SpA	Credit Suisse	56.194
14.355	Buzzi Unicem SpA	Deutsche Bank	(27.932)	770.707	Iren SpA	Citibank	83.702
(69.635)	CNH Industrial NV	Bank of America		202.048	Iren SpA	Credit Suisse	(330.688)
		Merrill Lynch	36.444	1.132.707	Iren SpA	Deutsche Bank	(70.937)
(28.723)	CNH Industrial NV	Citibank	32.630	124.638	Iren SpA	JP Morgan	(525.270)
(97.672)	CNH Industrial NV	JP Morgan	52.918			Bank of America	
						Merrill Lynch	(45.309)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Italie suite				Italie suite			
302.223	Iren SpA	Citibank	(62.680)	1.361.145	Telecom Italia SpA/Milano	Credit Suisse	(238.842)
192.384	Italgas SpA	JP Morgan	(139.832)	565.481	Telecom Italia SpA/Milano	Deutsche Bank	(75.507)
296.257	Italgas SpA	Credit Suisse	(172.723)	(334.253)	Tenaris SA	Credit Suisse	197.770
(174.366)	Leonardo SpA	Bank of America		(118.576)	Tenaris SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	137.338			Merrill Lynch	74.606
(21.710)	Leonardo SpA	Credit Suisse	33.302	(20.760)	Tenaris SA	JP Morgan	8.466
(38.016)	Leonardo SpA	JP Morgan	27.617	(125.927)	Tenaris SA	Citibank	181.204
(6.198)	Luxottica Group SpA	Citibank	6.933	(88.750)	Tenaris SA	Deutsche Bank	64.029
(17.597)	Luxottica Group SpA	JP Morgan	(17.633)	551.084	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Bank of America	
(23.835)	Luxottica Group SpA	Bank of America				Merrill Lynch	(229.228)
		Merrill Lynch	(5.198)	118.621	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	JP Morgan	(61.228)
(24.410)	Luxottica Group SpA	Credit Suisse	(24.460)				
(49.440)	Luxottica Group SpA	Deutsche Bank	(17.282)	291.661	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Deutsche Bank	(121.319)
165.028	Mediaset SpA	Credit Suisse	(89.411)			JP Morgan	183.875
183.049	Mediaset SpA	Bank of America		(25.026)	Tod's SpA	Citibank	13.388
		Merrill Lynch	(103.441)	(9.575)	Tod's SpA	Deutsche Bank	51.569
1.150.577	Mediaset SpA	Citibank	(298.580)	(36.883)	Tod's SpA	Bank of America	
400.261	Mediaset SpA	JP Morgan	(216.859)	(101.877)	UniCredit SpA	Merrill Lynch	444.183
684.175	Mediaset SpA	Deutsche Bank	(315.439)			Citibank	342.909
73.868	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Bank of America		(113.719)	UniCredit SpA	Credit Suisse	721.294
		Merrill Lynch	(168.003)	(221.528)	UniCredit SpA	Deutsche Bank	331.970
66.504	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Credit Suisse	(134.028)	(76.140)	UniCredit SpA	JP Morgan	434.814
4.896	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	JP Morgan	(11.204)	(115.608)	Unione di Banche Italiane SpA	Citibank	314.696
20.472	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Deutsche Bank	(46.561)	(429.045)	Unione di Banche Italiane SpA	Credit Suisse	70.562
48.922	Moncler SpA	Credit Suisse	156.754	(69.851)	Unione di Banche Italiane SpA	Bank of America	
4.339	Moncler SpA	JP Morgan	13.903	(362.409)	Unione di Banche Italiane SpA	Merrill Lynch	511.358
13.737	Moncler SpA	Bank of America				Deutsche Bank	164.964
		Merrill Lynch	25.289	(116.913)	Unione di Banche Italiane SpA	JP Morgan	258.963
23.722	Moncler SpA	Citibank	39.525	(226.263)	Unipol Gruppo SpA	Credit Suisse	466.021
57.123	Moncler SpA	Deutsche Bank	105.160	(557.834)	Unipol Gruppo SpA	Deutsche Bank	117.277
(188.944)	Poste Italiane SpA '144A'	Citibank	59.880	(137.505)	Unipol Gruppo SpA	Bank of America	
(147.644)	Poste Italiane SpA '144A'	JP Morgan	112.162	(248.570)	Unipol Gruppo SpA	Merrill Lynch	212.003
42.225	Prysmian SpA	Bank of America				Citibank	78.844
		Merrill Lynch	(119.060)	(214.686)	Unipol Gruppo SpA	JP Morgan	233.985
25.721	Prysmian SpA	Citibank	(48.549)	(286.495)	Unipol Gruppo SpA	Citibank	17.844
31.385	Prysmian SpA	JP Morgan	(65.457)	(494.033)	UnipolSai Assicurazioni SpA	Deutsche Bank	22.499
7.510	Prysmian SpA	Credit Suisse	(15.663)	(91.085)	UnipolSai Assicurazioni SpA	Credit Suisse	105.731
35.423	Prysmian SpA	Deutsche Bank	(99.881)	(332.397)	UnipolSai Assicurazioni SpA	JP Morgan	411.934
44.575	Recordati SpA	Bank of America		(1.295.039)	UnipolSai Assicurazioni SpA	Credit Suisse	(11.949)
		Merrill Lynch	62.324	(73.255)	Yoox Net-A-Porter Group SpA	Citibank	(4.895)
19.905	Recordati SpA	Citibank	(3.943)	(105.034)	Yoox Net-A-Porter Group SpA	JP Morgan	(1.929)
20.692	Recordati SpA	JP Morgan	31.342	(11.827)	Yoox Net-A-Porter Group SpA		(366.490)
23.086	Recordati SpA	Deutsche Bank	32.278				
26.481	Recordati SpA	Credit Suisse	40.111				
(11)	Salvatore Ferragamo SpA	Bank of America					
		Merrill Lynch	2				
(2.292)	Salvatore Ferragamo SpA	JP Morgan	107				
(10.256)	Salvatore Ferragamo SpA	Credit Suisse	478				
(44.852)	Salvatore Ferragamo SpA	Deutsche Bank	10.840				
(352.859)	Snam SpA	Bank of America					
		Merrill Lynch	105.938				
(402.572)	Snam SpA	Credit Suisse	163.382				
(165.816)	Snam SpA	Deutsche Bank	44.850				
60.759	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	Bank of America					
		Merrill Lynch	(239.281)				
44.560	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	Citibank	(101.242)				
22.400	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	Credit Suisse	(107.007)				
23.238	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	Deutsche Bank	(91.516)				
136.293	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	JP Morgan	(651.087)				
2.154.149	Telecom Italia SpA/Milano	Bank of America					
		Merrill Lynch	(273.571)				
145.716	Telecom Italia SpA/Milano	Citibank	(7.912)				
1.429.967	Telecom Italia SpA/Milano	JP Morgan	(190.242)				
				Japon			
				2.900	77 Bank Ltd/The	Deutsche Bank	(5.987)
				1.600	77 Bank Ltd/The	Bank of America	
						Merrill Lynch	(3.303)
				1.100	77 Bank Ltd/The	Credit Suisse	(2.464)
				800	77 Bank Ltd/The	Citibank	(1.541)
				400	77 Bank Ltd/The	JP Morgan	(896)
				(7.400)	ABC-Mart Inc	Deutsche Bank	40.924
				(12.300)	ABC-Mart Inc	JP Morgan	51.016
				(18.800)	ABC-Mart Inc	Credit Suisse	77.976
				(10.300)	ABC-Mart Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	56.961
				(19.700)	ABC-Mart Inc	Citibank	81.709
				(22.100)	Acom Co Ltd	JP Morgan	7.740
				(6.100)	Acom Co Ltd	Credit Suisse	2.137
				(25.600)	Acom Co Ltd	Citibank	5.191
				10.500	Advantest Corp	Citibank	(7.065)
				7.000	Advantest Corp	Deutsche Bank	(16.130)
				9.500	Aeon Co Ltd	Credit Suisse	-
				24.700	Aeon Co Ltd	Citibank	(114)
				(88.200)	AEON Financial Service Co Ltd	Credit Suisse	70.726
				(15.500)	AEON Financial Service Co Ltd	Citibank	16.286
				(108.500)	AEON Financial Service Co Ltd	JP Morgan	87.004

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(27.900)	AEON Financial Service Co Ltd	Deutsche Bank	50.917	(13.700)	Asahi Group Holdings Ltd	JP Morgan	(23.487)
(97.000)	AEON Financial Service Co Ltd	Bank of America		(29.800)	Asahi Intecc Co Ltd	Citibank	(48.067)
(209.500)	Aiful Corp	Merrill Lynch	177.022	(3.700)	Asahi Intecc Co Ltd	Deutsche Bank	1.364
(198.900)	Aiful Corp	Deutsche Bank	52.136	(28.000)	Asahi Intecc Co Ltd	Bank of America	
(363.600)	Aiful Corp	Merrill Lynch	49.498	(69.200)	Asahi Intecc Co Ltd	Merrill Lynch	10.323
(214.500)	Aiful Corp	Citibank	50.270	(27.300)	Asahi Kasei Corp	JP Morgan	(16.451)
(64.700)	Ain Holdings Inc	JP Morgan	55.357	(38.600)	Asahi Kasei Corp	Bank of America	
(20.900)	Ain Holdings Inc	Credit Suisse	(190.829)	(11.100)	Asahi Kasei Corp	Merrill Lynch	(6.920)
(12.300)	Air Water Inc	JP Morgan	(61.643)	47.800	Asics Corp	Citibank	6.582
(27.000)	Air Water Inc	Credit Suisse	1.927			JP Morgan	1.177
(27.500)	Air Water Inc	Bank of America		3.500	Asics Corp	Bank of America	
(30.500)	Air Water Inc	Merrill Lynch	28.370	22.000	Asics Corp	Merrill Lynch	(25.493)
(44.600)	Air Water Inc	JP Morgan	4.309	44.400	Asics Corp	Credit Suisse	(8.291)
(6.100)	Aisin Seiki Co Ltd	Deutsche Bank	32.048	65.000	Astellas Pharma Inc	Citibank	(12.775)
(1.200)	Aisin Seiki Co Ltd	Citibank	39.671	278.800	Astellas Pharma Inc	JP Morgan	(61.027)
		Credit Suisse	27.550	380.500	Astellas Pharma Inc	Deutsche Bank	(3.295)
		Bank of America				JP Morgan	(5.139)
(2.700)	Aisin Seiki Co Ltd	Merrill Lynch	5.420			Bank of America	
(4.400)	Aisin Seiki Co Ltd	Citibank	12.941	64.800	Astellas Pharma Inc	Merrill Lynch	(2.288)
(4.900)	Aisin Seiki Co Ltd	JP Morgan	19.872	468.400	Astellas Pharma Inc	Citibank	(3.285)
39.400	Ajinomoto Co Inc	Deutsche Bank	21.949	17.000	Autobacs Seven Co Ltd	Credit Suisse	(8.635)
		Bank of America		66.300	Autobacs Seven Co Ltd	Credit Suisse	(26.167)
		Merrill Lynch	(6.355)	41.500	Autobacs Seven Co Ltd	Citibank	(50.109)
27.300	Ajinomoto Co Inc	Deutsche Bank	(4.403)	56.700	Autobacs Seven Co Ltd	JP Morgan	(63.879)
17.500	Ajinomoto Co Inc	Citibank	4.274	43.200	Autobacs Seven Co Ltd	Deutsche Bank	(48.080)
10.500	Ajinomoto Co Inc	Credit Suisse	4.791			Bank of America	
7.700	Alfresa Holdings Corp	Deutsche Bank	3.123	8.200	Azbil Corp	Merrill Lynch	(36.632)
80.800	Alfresa Holdings Corp	JP Morgan	213.739	50.000	Azbil Corp	Credit Suisse	21.162
2.700	Alfresa Holdings Corp	Bank of America		21.400	Azbil Corp	Citibank	(27.651)
		Merrill Lynch	1.095	27.400	Azbil Corp	JP Morgan	55.228
7.300	Alfresa Holdings Corp	Citibank	(3.566)			Bank of America	
(91.700)	Alps Electric Co Ltd	Credit Suisse	(35.498)	17.800	Azbil Corp	Merrill Lynch	(50.509)
(75.700)	Alps Electric Co Ltd	Deutsche Bank	108.846	100	Bandai Namco Holdings Inc	Deutsche Bank	(32.813)
(40.500)	Alps Electric Co Ltd	Citibank	41.062	26.600	Bandai Namco Holdings Inc	Deutsche Bank	498
(74.900)	Alps Electric Co Ltd	JP Morgan	(17.701)	200	Bandai Namco Holdings Inc	Citibank	101.747
93.400	Amada Holdings Co Ltd	JP Morgan	(108.753)	26.100	Bandai Namco Holdings Inc	JP Morgan	1.530
95.800	Amada Holdings Co Ltd	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(126.268)	6.000	Bandai Namco Holdings Inc	Merrill Lynch	129.905
100.200	Amada Holdings Co Ltd	Citibank	(98.819)	(24.400)	Bank of Kyoto Ltd/The	Credit Suisse	45.901
120.700	Amada Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(134.612)	(7.000)	Bank of Kyoto Ltd/The	Credit Suisse	138.709
68.800	Amada Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(76.236)			Bank of America	
(10.500)	ANA Holdings Inc	Credit Suisse	(14.710)	(7.400)	Bank of Kyoto Ltd/The	Merrill Lynch	43.873
(1.400)	ANA Holdings Inc	Deutsche Bank	(2.090)	(26.600)	Bank of Kyoto Ltd/The	Citibank	32.057
(35.800)	ANA Holdings Inc	JP Morgan	(51.750)	(6.400)	Bank of Kyoto Ltd/The	JP Morgan	159.362
(31.600)	ANA Holdings Inc	Bank of America		(5.100)	Benesse Holdings Inc	Deutsche Bank	39.787
		Merrill Lynch	(47.184)	(8.900)	Benesse Holdings Inc	Credit Suisse	9.636
75.000	Aoyama Trading Co Ltd	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(224.371)	(12.600)	Benesse Holdings Inc	Merrill Lynch	4.512
31.700	Aoyama Trading Co Ltd	JP Morgan	(90.576)	(18.800)	Benesse Holdings Inc	Citibank	9.291
5.200	Aoyama Trading Co Ltd	Credit Suisse	(14.858)	102.300	Bridgestone Corp	JP Morgan	35.522
58.900	Aoyama Trading Co Ltd	Deutsche Bank	(173.722)			Bank of America	
39.000	Aoyama Trading Co Ltd	Citibank	(89.043)	94.900	Bridgestone Corp	Merrill Lynch	(119.646)
145.400	Aozora Bank Ltd	Bank of America		47.500	Bridgestone Corp	Deutsche Bank	(102.494)
		Merrill Lynch	(154.118)	119.000	Bridgestone Corp	JP Morgan	(65.233)
78.700	Aozora Bank Ltd	JP Morgan	(50.777)	93.200	Bridgestone Corp	Citibank	(252.270)
38.600	Aozora Bank Ltd	Credit Suisse	(24.904)	68.900	Brother Industries Ltd	Credit Suisse	(123.151)
82.800	Aozora Bank Ltd	Deutsche Bank	(83.607)	87.900	Brother Industries Ltd	Citibank	(88.907)
83.900	Aozora Bank Ltd	Citibank	(98.252)	39.000	Brother Industries Ltd	Deutsche Bank	(165.145)
19.500	Asahi Glass Co Ltd	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(54.012)	67.700	Brother Industries Ltd	Merrill Lynch	(82.624)
7.600	Asahi Glass Co Ltd	Citibank	(22.766)	92.700	Brother Industries Ltd	JP Morgan	(84.239)
35.100	Asahi Glass Co Ltd	JP Morgan	(37.307)	(13.100)	Calbee Inc	Credit Suisse	(115.346)
28.100	Asahi Glass Co Ltd	Deutsche Bank	(84.174)			Bank of America	
19.700	Asahi Glass Co Ltd	Credit Suisse	(36.907)	(1.800)	Calbee Inc	Merrill Lynch	5.192
(25.600)	Asahi Group Holdings Ltd	Bank of America		(72.100)	Calbee Inc	Credit Suisse	(2.572)
		Merrill Lynch	27.607	(2.500)	Calbee Inc	Citibank	(9.968)
(27.600)	Asahi Group Holdings Ltd	Credit Suisse	(9.741)	(31.100)	Calbee Inc	Deutsche Bank	1.267
(41.600)	Asahi Group Holdings Ltd	Deutsche Bank	37.598	180.300	Canon Inc	JP Morgan	(44.431)
(6.600)	Asahi Group Holdings Ltd	Citibank	1.886	238.300	Canon Inc	Citibank	(132.798)
						Bank of America	
						Merrill Lynch	(184.499)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
65.100	Canon Inc	Credit Suisse	(42.002)	(9.800)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Citibank	(10.839)
196.500	Canon Inc	Deutsche Bank	(148.317)	21.700	Credit Saison Co Ltd	Credit Suisse	(30.201)
106.400	Canon Inc	JP Morgan	(68.648)	400	Credit Saison Co Ltd	Deutsche Bank	(531)
46.200	Canon Marketing Japan Inc	Citibank	(62.171)	25.100	Credit Saison Co Ltd	Bank of America	
38.800	Canon Marketing Japan Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(33.314)
		Merrill Lynch	(47.563)	52.700	Credit Saison Co Ltd	Citibank	(75.289)
61.000	Canon Marketing Japan Inc	JP Morgan	(76.260)	23.400	Credit Saison Co Ltd	JP Morgan	(32.567)
32.400	Canon Marketing Japan Inc	Credit Suisse	(43.073)	4.500	CyberAgent Inc	Credit Suisse	(21.983)
10.200	Canon Marketing Japan Inc	Deutsche Bank	(12.504)	14.900	CyberAgent Inc	Deutsche Bank	(39.827)
68.800	Casio Computer Co Ltd	Bank of America		12.900	CyberAgent Inc	JP Morgan	(63.017)
		Merrill Lynch	(25.365)	17.400	Dai Nippon Printing Co Ltd	Citibank	(2.726)
98.300	Casio Computer Co Ltd	JP Morgan	(5.436)	10.200	Dai Nippon Printing Co Ltd	JP Morgan	(2.068)
16.200	Casio Computer Co Ltd	Citibank	(5.077)	46.500	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America	
35.700	Casio Computer Co Ltd	Credit Suisse	(3.340)			Merrill Lynch	(27.430)
64.300	Casio Computer Co Ltd	Deutsche Bank	(21.633)	42.000	Dai Nippon Printing Co Ltd	Credit Suisse	(8.517)
17.000	Central Japan Railway Co	JP Morgan	166.874	6.000	Dai Nippon Printing Co Ltd	Deutsche Bank	(3.539)
17.400	Central Japan Railway Co	Credit Suisse	170.800	(45.800)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Citibank	82.528
7.800	Central Japan Railway Co	Deutsche Bank	48.174	(39.100)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Credit Suisse	36.399
21.400	Central Japan Railway Co	Citibank	90.732	(85.000)	Dai-ichi Life Holdings Inc	JP Morgan	99.059
54.400	Central Japan Railway Co	Bank of America		(54.200)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Deutsche Bank	83.427
		Merrill Lynch	328.030	(19.900)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Bank of America	
(6.000)	Chiba Bank Ltd/The	Deutsche Bank	1.825			Merrill Lynch	30.631
(14.000)	Chiba Bank Ltd/The	JP Morgan	4.903	58.200	Daicel Corp	Citibank	(34.868)
(9.000)	Chiba Bank Ltd/The	Bank of America		100.600	Daicel Corp	JP Morgan	(44.100)
		Merrill Lynch	2.737	140.800	Daicel Corp	Credit Suisse	(56.440)
(5.000)	Chiba Bank Ltd/The	Citibank	1.475	69.200	Daicel Corp	Deutsche Bank	(19.772)
(477.599)	Chiyoda Corp	JP Morgan	704.326	54.000	Daicel Corp	Bank of America	
(86.800)	Chiyoda Corp	Credit Suisse	90.129			Merrill Lynch	(15.429)
(159.000)	Chiyoda Corp	Citibank	179.135	(8.900)	Daido Steel Co Ltd	Citibank	41.836
(6.100)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(18.554)	(8.600)	Daido Steel Co Ltd	Deutsche Bank	71.340
(7.500)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Deutsche Bank	(20.047)	(15.600)	Daido Steel Co Ltd	Credit Suisse	116.466
(13.600)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America		(2.800)	Daido Steel Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(36.352)			Merrill Lynch	23.227
(6.500)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(17.374)	(5.200)	Daido Steel Co Ltd	JP Morgan	38.822
(26.400)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(80.299)	(9.100)	Daifuku Co Ltd	Deutsche Bank	10.065
18.100	Chugoku Bank Ltd/The	JP Morgan	(10.343)	(41.800)	Daifuku Co Ltd	Citibank	165.667
1.500	Chugoku Bank Ltd/The	Deutsche Bank	(1.065)	(14.500)	Daifuku Co Ltd	JP Morgan	45.440
54.400	Chugoku Bank Ltd/The	Citibank	(36.101)	(37.100)	Daifuku Co Ltd	Credit Suisse	85.497
15.800	Chugoku Bank Ltd/The	Bank of America		32.500	Daiichi Sankyo Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(11.213)			Merrill Lynch	(118.323)
4.300	Chugoku Bank Ltd/The	Credit Suisse	(2.457)	9.500	Daiichi Sankyo Co Ltd	Citibank	(37.652)
223.800	Citizen Watch Co Ltd	JP Morgan	(193.900)	29.900	Daiichi Sankyo Co Ltd	JP Morgan	(138.621)
80.600	Citizen Watch Co Ltd	Deutsche Bank	(42.345)	15.900	Daiichikosho Co Ltd	Citibank	(24.914)
70.800	Citizen Watch Co Ltd	Bank of America		33.300	Daiichikosho Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(37.196)			Merrill Lynch	(57.421)
155.600	Citizen Watch Co Ltd	Citibank	(88.918)	49.700	Daiichikosho Co Ltd	JP Morgan	(278.519)
137.000	Citizen Watch Co Ltd	Credit Suisse	(118.697)	30.000	Daiichikosho Co Ltd	Credit Suisse	(207.509)
(77.800)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Credit Suisse	43.025	5.000	Daiichikosho Co Ltd	Deutsche Bank	(8.756)
(47.100)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Citibank	(73.801)	(4.800)	Daikin Industries Ltd	Citibank	29.200
8.000	COMSYS Holdings Corp	Deutsche Bank	(9.586)	3.900	Daishi Bank Ltd/The	JP Morgan	(10.604)
58.600	COMSYS Holdings Corp	Bank of America		1.100	Daishi Bank Ltd/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	(70.215)			Merrill Lynch	(4.258)
1.800	COMSYS Holdings Corp	Credit Suisse	(365)	3.200	Daishi Bank Ltd/The	Citibank	(8.701)
(51.100)	Concordia Financial Group Ltd	Credit Suisse	4.710	300	Daishi Bank Ltd/The	Credit Suisse	(816)
(9.200)	Concordia Financial Group Ltd	Deutsche Bank	1.526	400	Daishi Bank Ltd/The	Deutsche Bank	(1.548)
(32.900)	Concordia Financial Group Ltd	JP Morgan	3.032	98.000	Daiwa Securities Group Inc	Citibank	(30.169)
(28.300)	Concordia Financial Group Ltd	Bank of America		153.000	Daiwa Securities Group Inc	JP Morgan	(43.434)
		Merrill Lynch	4.695	14.000	Daiwa Securities Group Inc	Bank of America	
26.800	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(4.594)
82.300	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(79.045)	12.000	Daiwa Securities Group Inc	Credit Suisse	(3.407)
16.400	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(26.550)	122.000	Daiwa Securities Group Inc	Deutsche Bank	(40.219)
(2.400)	Cosmos Pharmaceutical Corp	JP Morgan	(5.291)	(50.000)	DeNA Co Ltd	Credit Suisse	29.034
(1.100)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Deutsche Bank	32.296	(49.700)	DeNA Co Ltd	Deutsche Bank	33.898
(5.900)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Credit Suisse	8.212	(120.200)	DeNA Co Ltd	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	81.984
		Merrill Lynch	79.395	(92.900)	DeNA Co Ltd	JP Morgan	53.944
(200)	Cosmos Pharmaceutical Corp	JP Morgan	1.493	(4.800)	DeNA Co Ltd	Citibank	2.522
				42.800	Denka Co Ltd	Bank of America	
						Merrill Lynch	(145.961)
				37.600	Denka Co Ltd	Citibank	(135.158)
				13.300	Denka Co Ltd	Credit Suisse	4.291

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
18.000	Denka Co Ltd	Deutsche Bank	(61.385)	2.100	Fast Retailing Co Ltd	Citibank	(35.615)
14.800	Denka Co Ltd	JP Morgan	4.774	2.800	Fast Retailing Co Ltd	Deutsche Bank	(37.421)
23.500	Denso Corp	Bank of America		3.000	Fast Retailing Co Ltd	JP Morgan	(25.672)
		Merrill Lynch	(94.221)	(9.400)	FP Corp	Bank of America	
27.400	Denso Corp	Citibank	(133.140)			Merrill Lynch	18.194
14.200	Denso Corp	JP Morgan	(40.181)	(18.400)	FP Corp	Credit Suisse	40.702
24.600	Denso Corp	Deutsche Bank	(98.525)	(17.300)	FP Corp	Deutsche Bank	26.118
17.400	Denso Corp	Credit Suisse	(47.422)	(32.900)	FP Corp	JP Morgan	65.845
(10.100)	Dentsu Inc	Deutsche Bank	(5.586)	(11.900)	FP Corp	Citibank	5.484
(50.800)	Dentsu Inc	JP Morgan	28.093	(70.000)	Fuji Electric Co Ltd	Citibank	19.356
(25.800)	Dentsu Inc	Credit Suisse	14.268	(149.000)	Fuji Electric Co Ltd	Deutsche Bank	24.097
(20.700)	Dentsu Inc	Citibank	22.895	(9.500)	Fuji Oil Holdings Inc	Bank of America	
2.200	DIC Corp	JP Morgan	(2.028)			Merrill Lynch	(21.015)
2.600	DIC Corp	Bank of America		(26.300)	Fuji Oil Holdings Inc	JP Morgan	(123.628)
		Merrill Lynch	(4.913)	(33.200)	Fuji Oil Holdings Inc	Credit Suisse	(128.726)
16.000	DIC Corp	Credit Suisse	(14.747)	(19.500)	Fuji Oil Holdings Inc	Deutsche Bank	(42.340)
5.200	DIC Corp	Deutsche Bank	(9.825)	(9.200)	Fuji Oil Holdings Inc	Citibank	(17.807)
(1.100)	Disco Corp	Citibank	(2.839)	21.900	FUJIFILM Holdings Corp	Bank of America	
(2.600)	Disco Corp	JP Morgan	5.991			Merrill Lynch	(14.130)
17.800	DMG Mori Co Ltd	Bank of America		116.500	FUJIFILM Holdings Corp	JP Morgan	(40.717)
		Merrill Lynch	(51.188)	51.800	FUJIFILM Holdings Corp	Credit Suisse	(19.098)
126.400	DMG Mori Co Ltd	Credit Suisse	(322.939)	7.000	FUJIFILM Holdings Corp	Citibank	(6.645)
102.600	DMG Mori Co Ltd	Citibank	(317.684)	22.400	FUJIFILM Holdings Corp	Deutsche Bank	(17.201)
10.000	DMG Mori Co Ltd	JP Morgan	(25.439)	184.900	Fujikura Ltd	Bank of America	
(27.800)	Don Quijote Holdings Co Ltd	Credit Suisse	30.748			Merrill Lynch	(81.803)
(22.800)	Don Quijote Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(7.487)	140.900	Fujikura Ltd	Citibank	(107.790)
(50.396)	Don Quijote Holdings Co Ltd	Citibank	(17.053)	131.900	Fujikura Ltd	JP Morgan	(13.373)
(77.400)	Don Quijote Holdings Co Ltd	JP Morgan	35.796	139.200	Fujikura Ltd	Credit Suisse	(14.113)
(31.700)	Don Quijote Holdings Co Ltd	Bank of America		14.300	Fujikura Ltd	Deutsche Bank	(6.327)
		Merrill Lynch	(26.296)	25.500	Fujitsu General Ltd	Deutsche Bank	(15.982)
6.100	Dowa Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(37.108)	17.000	Fujitsu General Ltd	Credit Suisse	(10.498)
3.800	Dowa Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(14.010)	6.000	Fujitsu General Ltd	Bank of America	
200	Dowa Holdings Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(3.761)
		Merrill Lynch	(737)	9.500	Fujitsu General Ltd	JP Morgan	(5.867)
1.000	Dowa Holdings Co Ltd	Citibank	(2.673)	40.600	Fujitsu General Ltd	Citibank	(22.827)
400	Dowa Holdings Co Ltd	JP Morgan	(2.433)	161.000	Fujitsu Ltd	Citibank	(44.815)
29.000	East Japan Railway Co	Citibank	14.701	77.000	Fujitsu Ltd	Deutsche Bank	(2.910)
21.200	East Japan Railway Co	JP Morgan	8.679	430.000	Fujitsu Ltd	Credit Suisse	(74.907)
11.600	East Japan Railway Co	Credit Suisse	7.096	531.000	Fujitsu Ltd	Bank of America	
15.400	East Japan Railway Co	Deutsche Bank	(11.355)			Merrill Lynch	(20.066)
4.600	East Japan Railway Co	Bank of America		(139.000)	Fukuoka Financial		
		Merrill Lynch	(3.392)		Group Inc	Deutsche Bank	11.530
(11.300)	Ebara Corp	Credit Suisse	43.744	(87.000)	Fukuoka Financial		
(11.600)	Ebara Corp	Deutsche Bank	22.635		Group Inc	JP Morgan	(4.811)
(63.700)	Ebara Corp	Citibank	211.365	(84.000)	Fukuoka Financial		
(2.700)	Eisai Co Ltd	Credit Suisse	(14.682)		Group Inc	Credit Suisse	(4.645)
(17.900)	Eisai Co Ltd	JP Morgan	(72.945)	(38.000)	Fukuoka Financial	Bank of America	
33.000	Ezaki Glico Co Ltd	Credit Suisse	(46.072)		Group Inc	Merrill Lynch	3.152
14.200	Ezaki Glico Co Ltd	Deutsche Bank	27.072	(105.000)	Fukuoka Financial		
35.700	Ezaki Glico Co Ltd	Bank of America			Group Inc	Citibank	22.259
		Merrill Lynch	73.594	(24.700)	Fukuyama Transporting	Bank of America	
17.200	Ezaki Glico Co Ltd	Citibank	28.536		Co Ltd	Merrill Lynch	(6.770)
2.200	Ezaki Glico Co Ltd	JP Morgan	(3.042)	(13.300)	Fukuyama Transporting		
(13.300)	FamilyMart UNY				Co Ltd	Credit Suisse	(92.948)
	Holdings Co Ltd	Citibank	(15.936)	(1.200)	Fukuyama Transporting		
(3.114)	FamilyMart UNY				Co Ltd	Deutsche Bank	(332)
	Holdings Co Ltd	JP Morgan	(18.082)	(13.200)	Fukuyama Transporting		
(9.500)	FamilyMart UNY				Co Ltd	Citibank	14.600
	Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(4.378)	(26.100)	Furukawa Electric Co Ltd	Credit Suisse	238.118
(26.100)	FamilyMart UNY			(5.200)	Furukawa Electric Co Ltd	Deutsche Bank	36.426
	Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(151.555)	(34.300)	Furukawa Electric Co Ltd	JP Morgan	363.565
(54.800)	FamilyMart UNY	Bank of America		(6.700)	Furukawa Electric Co Ltd	Citibank	31.906
	Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(25.255)	5.800	Glory Ltd	Deutsche Bank	(15.770)
(2.600)	FANUC Corp	Credit Suisse	10.305	53.700	Glory Ltd	Credit Suisse	(258.995)
(1.500)	FANUC Corp	Deutsche Bank	6.935	38.400	Glory Ltd	Bank of America	
(4.100)	FANUC Corp	JP Morgan	16.250			Merrill Lynch	(86.741)
(3.800)	FANUC Corp	Citibank	46.408	27.900	Glory Ltd	Citibank	(45.002)
(900)	FANUC Corp	Bank of America		33.500	Glory Ltd	JP Morgan	(188.350)
		Merrill Lynch	4.562	(5.507)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America	
2.100	Fast Retailing Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(27.917)
		Merrill Lynch	(28.066)	(47.400)	GMO Payment Gateway Inc	Citibank	(34.951)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(34.100)	GMO Payment Gateway Inc	JP Morgan	(132.006)	(45.300)	Hiroshima Bank Ltd/The	Credit Suisse	22.547
141.000	GS Yuasa Corp	Credit Suisse	(94.871)	(51.700)	Hiroshima Bank Ltd/The	Deutsche Bank	28.942
75.000	GS Yuasa Corp	Deutsche Bank	(33.181)	(44.500)	Hiroshima Bank Ltd/The	JP Morgan	22.148
75.000	GS Yuasa Corp	Bank of America		4.500	Hisamitsu		
		Merrill Lynch	(33.181)		Pharmaceutical Co Inc	Citibank	8.295
71.000	GS Yuasa Corp	Citibank	(32.720)	7.100	Hisamitsu		
19.000	GS Yuasa Corp	JP Morgan	(12.784)		Pharmaceutical Co Inc	JP Morgan	10.471
202.400	GungHo Online			5.600	Hisamitsu		
	Entertainment Inc	Deutsche Bank	(9.328)		Pharmaceutical Co Inc	Credit Suisse	8.258
944.700	GungHo Online			10.500	Hisamitsu	Bank of America	
	Entertainment Inc	Credit Suisse	(78.366)		Pharmaceutical Co Inc	Merrill Lynch	25.162
1.291.300	GungHo Online	Bank of America		1.400	Hisamitsu		
	Entertainment Inc	Merrill Lynch	(84.547)		Pharmaceutical Co Inc	Deutsche Bank	3.355
662.800	GungHo Online			(5.200)	Hitachi Capital Corp	JP Morgan	7.093
	Entertainment Inc	Citibank	(54.981)	(6.900)	Hitachi Capital Corp	Deutsche Bank	10.494
824.700	GungHo Online			(200)	Hitachi Capital Corp	Credit Suisse	273
	Entertainment Inc	JP Morgan	(68.411)	(2.500)	Hitachi Capital Corp	Bank of America	
20.300	Gunma Bank Ltd/The	Citibank	(6.923)			Merrill Lynch	3.802
58.500	Gunma Bank Ltd/The	Bank of America		(8.700)	Hitachi Chemical Co Ltd	JP Morgan	8.919
		Merrill Lynch	(22.646)	(31.600)	Hitachi Chemical Co Ltd	Credit Suisse	3.786
39.700	Gunma Bank Ltd/The	Deutsche Bank	(15.368)	(58.100)	Hitachi Chemical Co Ltd	Citibank	81.397
73.300	Gunma Bank Ltd/The	JP Morgan	(13.512)	(17.100)	Hitachi Chemical Co Ltd	Deutsche Bank	22.696
(9.500)	H2O Retailing Corp	Citibank	10.595	6.200	Hitachi Construction		
(8.100)	H2O Retailing Corp	Deutsche Bank	26.802		Machinery Co Ltd	Citibank	(16.001)
(5.100)	H2O Retailing Corp	Bank of America		1.300	Hitachi Construction		
		Merrill Lynch	16.875		Machinery Co Ltd	JP Morgan	479
(59.300)	Hachijuni Bank Ltd/The	JP Morgan	32.135	(7.900)	Hitachi High-Technologies		
15.800	Hakuhodo DY Holdings Inc	Deutsche Bank	2.039		Corp	JP Morgan	14.774
9.100	Hakuhodo DY Holdings Inc	Citibank	84	(9.600)	Hitachi High-Technologies		
21.900	Hakuhodo DY Holdings Inc	JP Morgan	13.524		Corp	Credit Suisse	3.734
900	Hakuhodo DY Holdings Inc	Credit Suisse	556	39.000	Hitachi Ltd	Citibank	(12.761)
(5.500)	Hamamatsu Photonics KK	Credit Suisse	(18.503)	340.000	Hitachi Ltd	JP Morgan	(192.414)
(2.700)	Hamamatsu Photonics KK	Deutsche Bank	(5.475)	240.000	Hitachi Ltd	Bank of America	
(14.900)	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America				Merrill Lynch	(149.758)
		Merrill Lynch	(30.213)	154.000	Hitachi Ltd	Credit Suisse	(76.718)
(55.800)	Hamamatsu Photonics KK	JP Morgan	(187.723)	150.000	Hitachi Ltd	Deutsche Bank	(88.686)
(2.700)	Hamamatsu Photonics KK	Citibank	(2.240)	(30.400)	Hitachi Metals Ltd	Credit Suisse	26.058
2.800	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Bank of America		(41.500)	Hitachi Metals Ltd	Deutsche Bank	50.226
		Merrill Lynch	7.742	(52.900)	Hitachi Metals Ltd	Bank of America	
100	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Deutsche Bank	65			Merrill Lynch	80.938
1.100	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Credit Suisse	1.926	(231.300)	Hitachi Metals Ltd	Citibank	315.521
10.600	Hankyu Hanshin Holdings Inc	JP Morgan	18.563	(150.200)	Hitachi Metals Ltd	JP Morgan	128.749
3.000	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Citibank	2.765	(1.300)	Hitachi Transport System Ltd	Deutsche Bank	1.977
(49.960)	Harmonic Drive Systems Inc	Citibank	276.289	(600)	Hitachi Transport System Ltd	Citibank	387
(79.898)	Harmonic Drive Systems Inc	JP Morgan	189	(16.700)	Hitachi Transport System Ltd	JP Morgan	36.942
(24.800)	Harmonic Drive Systems Inc	Credit Suisse	—	(2.000)	Hokuhoku Financial Group Inc	Credit Suisse	1.051
(38.900)	Harmonic Drive Systems Inc	Deutsche Bank	53.781	(10.900)	Hokuhoku Financial Group Inc	Deutsche Bank	10.047
174.000	Haseko Corp	Bank of America		(11.700)	Hokuhoku Financial Group Inc	JP Morgan	6.147
		Merrill Lynch	(67.358)	(800)	Hokuhoku Financial Group Inc	Citibank	671
44.100	Haseko Corp	JP Morgan	(13.379)	(19.400)	Honda Motor Co Ltd	Deutsche Bank	35.404
202.100	Haseko Corp	Credit Suisse	(106.177)	(31.900)	Honda Motor Co Ltd	Citibank	72.330
171.800	Haseko Corp	Citibank	(8.358)	(10.500)	Honda Motor Co Ltd	JP Morgan	17.710
20.900	Haseko Corp	Deutsche Bank	(8.091)	900	Hoshizaki Corp	Credit Suisse	6.221
(57.500)	Heiwa Corp	Credit Suisse	(124.658)	11.300	Hoshizaki Corp	Bank of America	
(139.300)	Heiwa Corp	Deutsche Bank	(61.045)			Merrill Lynch	67.699
(49.400)	Heiwa Corp	JP Morgan	(89.243)	600	Hoshizaki Corp	Citibank	3.097
5.600	Hikari Tsushin Inc	Citibank	(2.065)	7.300	Hoshizaki Corp	JP Morgan	50.463
100	Hikari Tsushin Inc	Deutsche Bank	1.254	4.300	Hoshizaki Corp	Deutsche Bank	25.762
5.600	Hikari Tsushin Inc	Bank of America		(300)	House Foods Group Inc	Credit Suisse	(442)
		Merrill Lynch	70.197	(500)	House Foods Group Inc	Deutsche Bank	(23)
(7.400)	Hino Motors Ltd	Bank of America		(4.200)	House Foods Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.798			Merrill Lynch	(194)
(12.300)	Hino Motors Ltd	Credit Suisse	6.802	(20.400)	House Foods Group Inc	JP Morgan	(30.084)
2.835	Hirose Electric Co Ltd	Bank of America		10.100	Hoya Corp	Citibank	5.772
		Merrill Lynch	(13.849)	49.300	Hoya Corp	JP Morgan	294.905
4.515	Hirose Electric Co Ltd	Citibank	(19.975)	39.700	Hoya Corp	Deutsche Bank	46.105
4.305	Hirose Electric Co Ltd	JP Morgan	(57.535)	62.100	Hoya Corp	Bank of America	
1.785	Hirose Electric Co Ltd	Deutsche Bank	(8.720)			Merrill Lynch	72.119
(27.300)	Hiroshima Bank Ltd/The	Citibank	14.091	59.000	Hoya Corp	Credit Suisse	352.929
(8.000)	Hiroshima Bank Ltd/The	Bank of America		(28.600)	Ibiden Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	4.572			Merrill Lynch	3.427

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(39.700)	Ibiden Co Ltd	Credit Suisse	(9.880)	(8.600)	J Front Retailing Co Ltd	Bank of America	
(22.500)	Ibiden Co Ltd	Citibank	21.983			Merrill Lynch	6.975
(14.700)	Ibiden Co Ltd	JP Morgan	(3.658)	76.400	Jafco Co Ltd	Credit Suisse	(160.543)
(1.900)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Bank of America		26.800	Jafco Co Ltd	Citibank	(102.512)
		Merrill Lynch	7.793	13.900	Jafco Co Ltd	Bank of America	
(41.500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Credit Suisse	120.489			Merrill Lynch	(43.008)
(2.900)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Deutsche Bank	11.895	15.100	Jafco Co Ltd	Deutsche Bank	(42.449)
(25.500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	JP Morgan	74.036	31.600	Jafco Co Ltd	JP Morgan	(64.077)
(40.300)	IHI Corp	Deutsche Bank	(53.280)	144.100	Japan Airlines Co Ltd	Credit Suisse	129.594
(18.200)	IHI Corp	JP Morgan	(67.939)	93.300	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America	
(3.300)	IHI Corp	Bank of America				Merrill Lynch	117.968
		Merrill Lynch	(4.410)	45.400	Japan Airlines Co Ltd	Deutsche Bank	66.952
(14.800)	IHI Corp	Credit Suisse	(55.247)	59.000	Japan Airlines Co Ltd	Citibank	40.241
(216.800)	Iida Group Holdings Co Ltd	Credit Suisse	185.228	26.500	Japan Airlines Co Ltd	JP Morgan	21.494
(176.200)	Iida Group Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	19.488	1.200	Japan Airport Terminal Co Ltd	Bank of America	
(118.300)	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(111)
		Merrill Lynch	13.084	100	Japan Airport Terminal Co Ltd	Deutsche Bank	(9)
(87.400)	Iida Group Holdings Co Ltd	Citibank	118.418	1.000	Japan Airport Terminal Co Ltd	Citibank	(92)
(156.500)	Iida Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	120.814	3.100	Japan Airport Terminal Co Ltd	JP Morgan	13.715
(444.800)	Inpex Corp	Credit Suisse	697.000	(42.200)	Japan Exchange Group Inc	Credit Suisse	(10.891)
(16.000)	Inpex Corp	Deutsche Bank	13.454	(80.800)	Japan Exchange Group Inc	Citibank	7.447
(25.800)	Inpex Corp	JP Morgan	41.377	(19.000)	Japan Exchange Group Inc	JP Morgan	(4.903)
(84.800)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	JP Morgan	(97.700)	(14.100)	Japan Exchange Group Inc	Deutsche Bank	1.300
(26.000)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Citibank	6.231	(18.500)	Japan Exchange Group Inc	Bank of America	
(48.400)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Credit Suisse	(55.763)			Merrill Lynch	1.705
(82.800)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Deutsche Bank	13.737	(68.000)	Japan Post Bank Co Ltd	Credit Suisse	102.788
(41.800)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Bank of America		(10.000)	Japan Post Bank Co Ltd	Deutsche Bank	14.379
		Merrill Lynch	6.935	(27.100)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America	
(52.900)	Isuzu Motors Ltd	JP Morgan	101.904			Merrill Lynch	38.966
(21.200)	Isuzu Motors Ltd	Bank of America		(34.300)	Japan Post Bank Co Ltd	Citibank	24.975
		Merrill Lynch	41.523	(13.400)	Japan Post Bank Co Ltd	JP Morgan	20.255
31.900	Ito En Ltd	Bank of America		(115.200)	Japan Post Holdings Co Ltd	JP Morgan	98.747
		Merrill Lynch	20.582	(23.900)	Japan Post Holdings Co Ltd	Credit Suisse	20.487
47.800	Ito En Ltd	Citibank	37.449	108.500	Japan Tobacco Inc	Bank of America	
29.100	Ito En Ltd	JP Morgan	21.457			Merrill Lynch	(117.005)
58.200	Ito En Ltd	Credit Suisse	42.914	(17.900)	JFE Holdings Inc	JP Morgan	19.303
7.900	Ito En Ltd	Deutsche Bank	5.097	(205.500)	JGC Corp	JP Morgan	727.432
142.600	ITOCHU Corp	Bank of America		(16.500)	JGC Corp	Deutsche Bank	40.562
		Merrill Lynch	28.910	(77.100)	JGC Corp	Credit Suisse	287.806
76.400	ITOCHU Corp	Citibank	(69.362)	(111.000)	JGC Corp	Citibank	274.188
98.400	ITOCHU Corp	JP Morgan	(27.194)	(87.900)	JGC Corp	Bank of America	
43.400	ITOCHU Corp	Credit Suisse	(14.801)			Merrill Lynch	204.974
53.400	ITOCHU Corp	Deutsche Bank	11.813	1.900	JSR Corp	Bank of America	
21.400	Itochu Techno-Solutions Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(35)
		Merrill Lynch	(16.963)	18.000	JSR Corp	JP Morgan	7.300
25.600	Itochu Techno-Solutions Corp	Credit Suisse	(16.292)	2.400	JSR Corp	Citibank	(1.991)
53.600	Itochu Techno-Solutions Corp	JP Morgan	(30.630)	30.900	JTEKT Corp	JP Morgan	(23.639)
6.000	Itochu Techno-Solutions Corp	Deutsche Bank	(4.756)	28.900	JTEKT Corp	Citibank	(55.405)
4.600	Itochu Techno-Solutions Corp	Citibank	(2.713)	3.200	JTEKT Corp	Credit Suisse	(2.448)
(41.400)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Credit Suisse	(11.448)	5.300	JTEKT Corp	Bank of America	
(86.700)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Deutsche Bank	7.991			Merrill Lynch	(7.914)
(126.900)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Bank of America		(89.500)	JXTG Holdings Inc	Citibank	44.133
		Merrill Lynch	11.696	(454.500)	JXTG Holdings Inc	Credit Suisse	18.432
(228.200)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	JP Morgan	(56.026)	(92.400)	JXTG Holdings Inc	JP Morgan	3.747
(34.200)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Citibank	(4.616)	127.400	K's Holdings Corp	Citibank	(48.144)
(106.200)	Iyo Bank Ltd/The	Credit Suisse	96.054	100.600	K's Holdings Corp	Credit Suisse	(123.322)
(19.600)	Iyo Bank Ltd/The	Deutsche Bank	16.259	87.300	K's Holdings Corp	Bank of America	
(27.000)	Iyo Bank Ltd/The	JP Morgan	25.633			Merrill Lynch	(42.646)
(15.800)	Iyo Bank Ltd/The	Bank of America		60.400	K's Holdings Corp	Deutsche Bank	(29.506)
		Merrill Lynch	13.107	92.100	K's Holdings Corp	JP Morgan	(76.889)
(1.400)	Iyo Bank Ltd/The	Citibank	865	10.500	Kagome Co Ltd	Credit Suisse	–
4.800	Izumi Co Ltd	Credit Suisse	(13.715)	14.200	Kagome Co Ltd	Bank of America	
1.900	Izumi Co Ltd	Deutsche Bank	(5.954)			Merrill Lynch	(5.235)
25.900	Izumi Co Ltd	JP Morgan	(74.003)	29.600	Kagome Co Ltd	JP Morgan	–
21.000	Izumi Co Ltd	Bank of America		23.400	Kagome Co Ltd	Deutsche Bank	(8.627)
		Merrill Lynch	(65.809)	16.000	Kagome Co Ltd	Citibank	4.424
14.200	Izumi Co Ltd	Citibank	(7.853)	497.000	Kajima Corp	Bank of America	
(64.500)	J Front Retailing Co Ltd	Credit Suisse	37.701			Merrill Lynch	(572.607)
(36.400)	J Front Retailing Co Ltd	JP Morgan	20.465	159.000	Kajima Corp	Credit Suisse	(180.394)
(14.300)	J Front Retailing Co Ltd	Citibank	6.854	83.000	Kajima Corp	Deutsche Bank	(95.627)
(19.000)	J Front Retailing Co Ltd	Deutsche Bank	9.818	256.000	Kajima Corp	Citibank	(77.725)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
551.000	Kajima Corp	JP Morgan	(711.001)	(60.300)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America	
171.100	Kakaku.com Inc	JP Morgan	469.955			Merrill Lynch	(2.779)
32.300	Kakaku.com Inc	Bank of America		(9.400)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Credit Suisse	(5.607)
		Merrill Lynch	54.779	(30.000)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Citibank	(1.383)
98.600	Kakaku.com Inc	Citibank	117.235	(37.500)	Keisei Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	(48.389)
26.900	Kakaku.com Inc	Credit Suisse	73.885	(55.500)	Kewpie Corp	Deutsche Bank	7.249
15.200	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(54.638)	(22.000)	Kewpie Corp	Credit Suisse	406
22.300	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Deutsche Bank	(71.939)	(1.200)	Kewpie Corp	Citibank	(133)
28.100	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(38.850)	(17.500)	Kewpie Corp	Bank of America	
17.500	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	5.645
		Merrill Lynch	(49.003)	(21.000)	Kewpie Corp	JP Morgan	387
21.300	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(76.566)	(1.100)	Keyence Corp	Credit Suisse	1.825
36.700	Kamigumi Co Ltd	JP Morgan	(36.533)	(2.900)	Keyence Corp	Deutsche Bank	42.232
2.000	Kamigumi Co Ltd	Credit Suisse	(1.991)	(11.500)	Keyence Corp	Citibank	181.253
20.300	Kamigumi Co Ltd	Bank of America		(8.500)	Keyence Corp	JP Morgan	14.102
		Merrill Lynch	(16.423)	(2.500)	Keyence Corp	Bank of America	
12.700	Kamigumi Co Ltd	Deutsche Bank	(11.120)			Merrill Lynch	36.407
30.100	Kamigumi Co Ltd	Citibank	(3.329)	7.100	Kikkoman Corp	Citibank	13.743
16.000	Kaneka Corp	JP Morgan	5.456	37.000	Kikkoman Corp	Bank of America	
37.000	Kaneka Corp	Credit Suisse	12.618			Merrill Lynch	29.646
19.000	Kaneka Corp	Bank of America		124.000	Kikkoman Corp	Credit Suisse	283.407
		Merrill Lynch	(3.502)	54.200	Kinden Corp	Bank of America	
29.000	Kaneka Corp	Deutsche Bank	(5.346)			Merrill Lynch	(38.466)
77.000	Kaneka Corp	Citibank	(16.323)	131.100	Kinden Corp	JP Morgan	(114.793)
(102.300)	Kansai Paint Co Ltd	Deutsche Bank	33.002	75.800	Kinden Corp	Credit Suisse	(57.381)
(106.300)	Kansai Paint Co Ltd	Credit Suisse	80.039	87.300	Kinden Corp	Deutsche Bank	(61.958)
(251.300)	Kansai Paint Co Ltd	JP Morgan	201.513	127.000	Kinden Corp	Citibank	(52.675)
(69.200)	Kansai Paint Co Ltd	Bank of America		(1.000)	Kintetsu Group		
		Merrill Lynch	22.324		Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(1.060)
(36.200)	Kansai Paint Co Ltd	Citibank	29.077	(2.800)	Kintetsu Group	Bank of America	
27.700	Kao Corp	Bank of America			Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(2.968)
		Merrill Lynch	169.016	(23.600)	Kintetsu Group		
57.800	Kao Corp	Deutsche Bank	352.676		Holdings Co Ltd	JP Morgan	(17.402)
59.600	Kao Corp	Citibank	203.348	(7.200)	Kintetsu Group		
23.700	Kao Corp	JP Morgan	159.971		Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(5.309)
5.400	Kao Corp	Credit Suisse	35.089	(36.800)	Kintetsu Group		
(12.100)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	22.305		Holdings Co Ltd	Citibank	(55.966)
(29.100)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	JP Morgan	51.741	70.900	Kirin Holdings Co Ltd	Citibank	85.280
(12.800)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Deutsche Bank	25.955	30.400	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America	
(226.086)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Credit Suisse	406.348			Merrill Lynch	49.875
(46.602)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Bank of America		67.100	Kirin Holdings Co Ltd	JP Morgan	17.935
		Merrill Lynch	105.235	1.800	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Deutsche Bank	(2.854)
(74.086)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Citibank	194.613	13.800	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(18.698)
(104.600)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Deutsche Bank	236.204	9.600	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America	
(156.700)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	JP Morgan	294.396			Merrill Lynch	(15.219)
29.100	KDDI Corp	Citibank	(4.291)	4.400	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(5.962)
21.300	KDDI Corp	Credit Suisse	(1.691)	9.600	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(8.140)
10.300	KDDI Corp	Bank of America		15.200	Kobayashi Pharmaceutical		
		Merrill Lynch	(2.041)		Co Ltd	Credit Suisse	–
4.800	KDDI Corp	Deutsche Bank	(951)	700	Kobayashi Pharmaceutical	Bank of America	
5.600	KDDI Corp	JP Morgan	2.065		Co Ltd	Merrill Lynch	1.226
(28.000)	Keihan Holdings Co Ltd	Citibank	12.830	100	Kobayashi Pharmaceutical		
(28.300)	Keihan Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	1.304		Co Ltd	JP Morgan	–
(1.600)	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America		(94.500)	Kobe Steel Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	74			Merrill Lynch	79.262
(12.700)	Keihan Holdings Co Ltd	JP Morgan	(16.388)	(19.000)	Kobe Steel Ltd	JP Morgan	13.484
(40.800)	Keihan Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(38.979)	(41.900)	Kobe Steel Ltd	Deutsche Bank	35.144
(62.700)	Keikyu Corp	Citibank	(7.488)	800	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America	
(117.300)	Keikyu Corp	Credit Suisse	123.246			Merrill Lynch	516
(96.100)	Keikyu Corp	Deutsche Bank	40.745	900	Koito Manufacturing Co Ltd	Citibank	(1.576)
(2.800)	Keikyu Corp	Bank of America		4.900	Koito Manufacturing Co Ltd	Credit Suisse	21.227
		Merrill Lynch	1.187	2.100	Koito Manufacturing Co Ltd	Deutsche Bank	1.355
(16.200)	Keikyu Corp	JP Morgan	20.904	(60.800)	Komatsu Ltd	Credit Suisse	10.087
(39.100)	Keio Corp	Credit Suisse	(60.748)	(22.100)	Komatsu Ltd	Deutsche Bank	21.999
(23.900)	Keio Corp	Deutsche Bank	(27.048)	(9.900)	Komatsu Ltd	Bank of America	
(8.300)	Keio Corp	Citibank	(8.033)			Merrill Lynch	9.855
(32.400)	Keio Corp	JP Morgan	(52.260)	(28.100)	Komatsu Ltd	JP Morgan	4.662
(10.800)	Keio Corp	Bank of America		(39.800)	Komatsu Ltd	Citibank	77.036
		Merrill Lynch	(11.448)	18.100	Komeri Co Ltd	Bank of America	
(2.400)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Deutsche Bank	(111)			Merrill Lynch	(27.026)
				11.800	Komeri Co Ltd	Deutsche Bank	(17.619)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
2.800	Komeri Co Ltd	Citibank	(3.639)	39.600	Lawson Inc	Citibank	(25.222)
23.300	Komeri Co Ltd	Credit Suisse	(42.029)	(61.600)	LINE Corp	Citibank	(44.465)
17.000	Komeri Co Ltd	JP Morgan	(32.435)	(60.857)	LINE Corp	Bank of America	
38.400	Konami Holdings Corp	Bank of America				Merrill Lynch	67.310
		Merrill Lynch	(99.101)	(226.200)	LINE Corp	Credit Suisse	147.940
5.600	Konami Holdings Corp	Citibank	(17.549)	(70.400)	LINE Corp	Deutsche Bank	77.865
8.200	Konami Holdings Corp	JP Morgan	(27.209)	(130.548)	LINE Corp	JP Morgan	90.245
6.000	Konami Holdings Corp	Credit Suisse	(19.909)	54.400	Lintec Corp	Bank of America	
1.200	Konami Holdings Corp	Deutsche Bank	(3.097)			Merrill Lynch	(79.292)
215.300	Konica Minolta Inc	Citibank	(89.299)	31.300	Lintec Corp	Citibank	(36.062)
245.700	Konica Minolta Inc	JP Morgan	106.437	9.000	Lintec Corp	JP Morgan	2.074
4.300	Konica Minolta Inc	Bank of America		13.600	Lintec Corp	Deutsche Bank	(21.936)
		Merrill Lynch	(515)	11.800	Lintec Corp	Credit Suisse	2.719
2.400	Kose Corp	Bank of America		36.000	Lion Corp	Credit Suisse	(117.793)
		Merrill Lynch	43.136	63.700	Lion Corp	JP Morgan	(208.429)
1.700	Kose Corp	Credit Suisse	42.619	3.400	Lion Corp	Bank of America	
(56.000)	Kubota Corp	Deutsche Bank	48.518			Merrill Lynch	(3.792)
(108.100)	Kubota Corp	JP Morgan	(498)	11.500	Lion Corp	Deutsche Bank	(12.825)
(139.400)	Kubota Corp	Bank of America		4.200	Lion Corp	Citibank	(5.845)
		Merrill Lynch	120.776	30.400	Lixil Group Corp	Credit Suisse	(34.464)
(36.000)	Kubota Corp	Citibank	36.665	10.000	Lixil Group Corp	Deutsche Bank	(16.038)
185.400	Kuraray Co Ltd	Bank of America		21.400	Lixil Group Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(391.323)			Merrill Lynch	(34.320)
83.300	Kuraray Co Ltd	Credit Suisse	(89.062)	27.100	Lixil Group Corp	JP Morgan	(30.723)
124.000	Kuraray Co Ltd	Citibank	(117.551)	20.500	Lixil Group Corp	Citibank	(29.476)
65.100	Kuraray Co Ltd	JP Morgan	(67.800)	(185.200)	M3 Inc	Bank of America	
52.800	Kuraray Co Ltd	Deutsche Bank	(111.445)			Merrill Lynch	(409.678)
29.200	Kurita Water Industries Ltd	JP Morgan	(67.284)	(2.400)	M3 Inc	Citibank	(332)
55.300	Kurita Water Industries Ltd	Bank of America		(44.100)	M3 Inc	JP Morgan	(140.232)
		Merrill Lynch	(86.649)	13.700	Mabuchi Motor Co Ltd	Citibank	(50.509)
15.300	Kurita Water Industries Ltd	Citibank	(16.922)	20.100	Mabuchi Motor Co Ltd	JP Morgan	(50.021)
28.100	Kurita Water Industries Ltd	Credit Suisse	(64.750)	10.600	Mabuchi Motor Co Ltd	Bank of America	
42.000	Kurita Water Industries Ltd	Deutsche Bank	(65.809)			Merrill Lynch	(35.172)
(7.200)	Kyocera Corp	Credit Suisse	14.977	100	Mabuchi Motor Co Ltd	Credit Suisse	(249)
(5.900)	Kyocera Corp	Deutsche Bank	16.097	2.400	Mabuchi Motor Co Ltd	Deutsche Bank	(7.964)
(22.100)	Kyocera Corp	Citibank	64.979	(20.500)	Makita Corp	Deutsche Bank	30.232
(21.600)	Kyocera Corp	Bank of America		(7.300)	Makita Corp	Credit Suisse	5.046
		Merrill Lynch	58.930	(3.600)	Makita Corp	JP Morgan	2.489
(30.900)	Kyocera Corp	JP Morgan	68.069	(500)	Makita Corp	Citibank	1.521
57.900	Kyowa Exeo Corp	JP Morgan	12.190	(4.400)	Makita Corp	Bank of America	
45.700	Kyowa Exeo Corp	Bank of America				Merrill Lynch	6.489
		Merrill Lynch	(25.973)	166.900	Marubeni Corp	Credit Suisse	(17.537)
39.300	Kyowa Exeo Corp	Citibank	(25.718)	295.100	Marubeni Corp	Deutsche Bank	(49.231)
39.400	Kyowa Exeo Corp	Deutsche Bank	(23.605)	286.600	Marubeni Corp	Bank of America	
(72.200)	Kyowa Hakko Kirin Co Ltd	Credit Suisse	63.542			Merrill Lynch	(47.813)
(4.100)	Kyowa Hakko Kirin Co Ltd	Deutsche Bank	(642)	267.900	Marubeni Corp	Citibank	(104.297)
(6.600)	Kyowa Hakko Kirin Co Ltd	Citibank	3.589	497.200	Marubeni Corp	JP Morgan	(54.498)
(5.600)	Kyowa Hakko Kirin Co Ltd	Bank of America		(25.500)	Marui Group Co Ltd	Citibank	8.173
		Merrill Lynch	(877)	(16.600)	Marui Group Co Ltd	JP Morgan	3.626
(12.000)	Kyowa Hakko Kirin Co Ltd	JP Morgan	12.166	(145.500)	Marui Group Co Ltd	Deutsche Bank	114.625
(57.000)	Kyudenko Corp	Credit Suisse	(42.030)	(300)	Marui Group Co Ltd	Credit Suisse	88
(17.200)	Kyudenko Corp	Deutsche Bank	26.951	300	Maruichi Steel Tube Ltd	Citibank	(719)
(8.800)	Kyudenko Corp	Citibank	22.711	28.900	Maruichi Steel Tube Ltd	JP Morgan	(94.238)
(700)	Kyudenko Corp	JP Morgan	(516)	37.100	Maruichi Steel Tube Ltd	Deutsche Bank	(121.393)
(104.200)	Kyushu Financial Group Inc	Deutsche Bank	35.535	31.900	Maruichi Steel Tube Ltd	Credit Suisse	(60.360)
(53.500)	Kyushu Financial Group Inc	Credit Suisse	10.355	38.300	Maruichi Steel Tube Ltd	Bank of America	
(130.800)	Kyushu Financial Group Inc	JP Morgan	25.317			Merrill Lynch	(125.319)
(9.300)	Kyushu Financial Group Inc	Citibank	3.600	104.100	Matsui Securities Co Ltd	Bank of America	
(190.900)	Kyushu Financial Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(20.376)
		Merrill Lynch	64.330	97.200	Matsui Securities Co Ltd	Citibank	(31.356)
25.900	Kyushu Railway Co	Bank of America		99.900	Matsui Securities Co Ltd	JP Morgan	15.026
		Merrill Lynch	8.355	106.700	Matsui Securities Co Ltd	Credit Suisse	15.735
16.300	Kyushu Railway Co	Credit Suisse	(6.009)	60.700	Matsui Securities Co Ltd	Deutsche Bank	(11.749)
121.900	Kyushu Railway Co	Citibank	22.471	14.600	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(47.099)
41.400	Kyushu Railway Co	Deutsche Bank	13.355	7.400	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Credit Suisse	17.051
41.300	Kyushu Railway Co	JP Morgan	(15.227)	5.400	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Bank of America	
10.700	Lawson Inc	Deutsche Bank	(8.876)			Merrill Lynch	(17.420)
17.400	Lawson Inc	Credit Suisse	18.276	31.300	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Citibank	(72.123)
37.200	Lawson Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(30.859)				
22.400	Lawson Inc	JP Morgan	24.775				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
22.900	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	JP Morgan	52.767	(67.600)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	(6.062)
(57.600)	Mazda Motor Corp	Credit Suisse	48.843	(22.700)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Deutsche Bank	19.347
(6.400)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Credit Suisse	(18.287)	(50.600)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America	
(19.100)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	JP Morgan	(54.574)	(3.200)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Merrill Lynch	34.046
(771.000)	Mebuki Financial Group Inc	Citibank	191.871	(34.500)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Citibank	5.456
(240.000)	Mebuki Financial Group Inc	Bank of America		(232.800)	Mitsubishi Logistics Corp	JP Morgan	(3.180)
(571.900)	Mebuki Financial Group Inc	Merrill Lynch	70.787	(51.100)	Mitsubishi Logistics Corp	Credit Suisse	360.731
(77.000)	Mebuki Financial Group Inc	Credit Suisse	141.855	(20.500)	Mitsubishi Logistics Corp	Deutsche Bank	105.031
(1.685.400)	Mebuki Financial Group Inc	Deutsche Bank	22.711			Bank of America	
5.000	Medipal Holdings Corp	JP Morgan	401.333	(116.600)	Mitsubishi Logistics Corp	Merrill Lynch	42.136
26.600	Medipal Holdings Corp	Deutsche Bank	3.549	30.900	Mitsubishi Materials Corp	Credit Suisse	186.115
6.300	Medipal Holdings Corp	JP Morgan	40.944			Bank of America	
9.800	Medipal Holdings Corp	Citibank	(4.123)	21.800	Mitsubishi Materials Corp	Merrill Lynch	(41.297)
20.700	Medipal Holdings Corp	Credit Suisse	15.085	17.600	Mitsubishi Materials Corp	Citibank	(35.163)
		Bank of America		19.800	Mitsubishi Materials Corp	JP Morgan	(46.233)
7.800	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Merrill Lynch	14.691	13.900	Mitsubishi Materials Corp	Credit Suisse	(52.012)
13.000	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Credit Suisse	(10.424)	(539.000)	Mitsubishi Motors Corp	Deutsche Bank	(18.577)
5.800	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Deutsche Bank	(1.198)	(174.700)	Mitsubishi Motors Corp	Credit Suisse	(162.041)
33.100	Megmilk Snow Brand Co Ltd	JP Morgan	(7.752)			Bank of America	
		Bank of America		(310.300)	Mitsubishi Motors Corp	Merrill Lynch	78.900
9.500	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Merrill Lynch	(3.051)	(37.000)	Mitsubishi Motors Corp	JP Morgan	(88.661)
5.600	MEIJI Holdings Co Ltd	Citibank	(2.189)	(861.400)	Mitsubishi Motors Corp	Deutsche Bank	16.710
17.100	MEIJI Holdings Co Ltd	Credit Suisse	25.808	8.600	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	Citibank	585.483
5.300	MEIJI Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	20.489			Credit Suisse	(15.853)
3.300	MEIJI Holdings Co Ltd	Citibank	9.770	48.100	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	Bank of America	
		Bank of America		16.300	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	Merrill Lynch	(887)
(63.200)	Minebea Mitsumi Inc	Merrill Lynch	3.954			JP Morgan	(30.047)
(34.300)	Minebea Mitsumi Inc	JP Morgan	98.445	71.500	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	Citibank	(13.839)
37.700	Miraca Holdings Inc	Citibank	72.081	(351.900)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc		
2.200	Miraca Holdings Inc	JP Morgan	(248.449)	(25.800)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	JP Morgan	192.013
76.300	Miraca Holdings Inc	Credit Suisse	(14.498)	(249.500)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Credit Suisse	14.078
23.200	Miraca Holdings Inc	Deutsche Bank	(14.065)	(73.100)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc		
20.500	Miraca Holdings Inc	Citibank	(22.453)	(49.400)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Citibank	144.418
		Bank of America		(10.800)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Credit Suisse	53.222
(18.300)	MISUMI Group Inc	Merrill Lynch	(3.779)	(6.400)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Deutsche Bank	28.239
(8.100)	MISUMI Group Inc	Credit Suisse	(6.747)	(55.400)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Bank of America	
(18.800)	MISUMI Group Inc	JP Morgan	(29.494)	119.700	Mitsui & Co Ltd	Merrill Lynch	5.375
(80.000)	MISUMI Group Inc	Deutsche Bank	(23.393)	101.400	Mitsui & Co Ltd	Citibank	1.652
93.100	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JP Morgan	(29.494)	83.200	Mitsui & Co Ltd	JP Morgan	39.318
240.500	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Credit Suisse	(13.224)	90.100	Mitsui & Co Ltd	Deutsche Bank	(58.474)
380.600	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Deutsche Bank	(5.407)	60.600	Mitsui & Co Ltd	Bank of America	(49.534)
239.400	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Citibank	(96.426)	7.200	Mitsui Chemicals Inc	Merrill Lynch	(62.667)
167.600	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JP Morgan	(33.458)	16.100	Mitsui Chemicals Inc	JP Morgan	(21.083)
		Deutsche Bank				Credit Suisse	(3.631)
74.300	Mitsubishi Corp	JP Morgan	(99.984)			Deutsche Bank	(9.291)
11.400	Mitsubishi Corp	Credit Suisse	(15.970)	31.400	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America	
31.400	Mitsubishi Corp	Deutsche Bank	(46.318)	20.600	Mitsui Chemicals Inc	Merrill Lynch	(20.775)
47.700	Mitsubishi Electric Corp	Citibank	(48.801)	17.100	Mitsui Chemicals Inc	JP Morgan	–
66.300	Mitsubishi Electric Corp	JP Morgan	(57.303)	(16.000)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Citibank	(18.038)
153.200	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America		(5.800)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Credit Suisse	–
		Merrill Lynch	(160.973)	(5.800)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd		
57.000	Mitsubishi Electric Corp	Deutsche Bank	(53.019)	(37.200)	Mitsui OSK Lines Ltd	JP Morgan	(4.277)
13.100	Mitsubishi Electric Corp	Credit Suisse	(10.384)			Citibank	29.402
41.600	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America				Bank of America	
17.500	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Merrill Lynch	(27.223)			Merrill Lynch	146.407
50.600	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Citibank	(24.840)				
52.200	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JP Morgan	116.129				
		Deutsche Bank	(35.297)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(22.000)	Mitsui OSK Lines Ltd	Credit Suisse	87.599	(11.200)	Nankai Electric		
(13.600)	Mitsui OSK Lines Ltd	Deutsche Bank	53.525		Railway Co Ltd	Citibank	3.097
(58.700)	Mitsui OSK Lines Ltd	JP Morgan	233.729	(17.400)	Nankai Electric		
(1.500)	Mitsui OSK Lines Ltd	Citibank	5.281		Railway Co Ltd	JP Morgan	(1.604)
(11.800)	Miura Co Ltd	JP Morgan	35.130	7.900	NEC Corp	Credit Suisse	3.277
(19.500)	Miura Co Ltd	Credit Suisse	58.053	4.300	NEC Corp	Bank of America	
148.600	Mixi Inc	Deutsche Bank	(343.118)			Merrill Lynch	595
44.000	Mixi Inc	Bank of America		25.600	NEC Corp	Citibank	4.719
		Merrill Lynch	(99.359)	23.600	NEC Corp	Deutsche Bank	3.263
65.500	Mixi Inc	Citibank	(265.154)	(41.400)	Nexon Co Ltd	Deutsche Bank	(57.238)
31.600	Mixi Inc	Credit Suisse	(97.571)	(63.600)	Nexon Co Ltd	Bank of America	
12.300	Mixi Inc	JP Morgan	(37.979)			Merrill Lynch	(87.930)
(934.100)	Mizuho Financial Group Inc	Credit Suisse	73.182	(210.100)	Nexon Co Ltd	Citibank	(160.473)
(1.205.100)	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America		(162.400)	Nexon Co Ltd	JP Morgan	(261.131)
		Merrill Lynch	128.846	(33.500)	NGK Insulators Ltd	Credit Suisse	20.688
(145.300)	Mizuho Financial Group Inc	Deutsche Bank	15.535	(29.600)	NGK Insulators Ltd	Deutsche Bank	23.036
(2.027.300)	Mizuho Financial Group Inc	JP Morgan	158.828	(44.000)	NGK Insulators Ltd	Citibank	53.127
2.200	Mochida Pharmaceutical			(9.500)	NGK Spark Plug Co Ltd	Citibank	24.517
	Co Ltd	Deutsche Bank	(4.461)	(10.900)	NGK Spark Plug Co Ltd	JP Morgan	3.014
5.400	Mochida Pharmaceutical			(46.200)	NH Foods Ltd	Credit Suisse	106.252
	Co Ltd	Citibank	(22.397)	(6.300)	NH Foods Ltd	Deutsche Bank	4.023
4.900	Mochida Pharmaceutical			(55.400)	NH Foods Ltd	JP Morgan	150.634
	Co Ltd	JP Morgan	(1.807)	132.600	NHK Spring Co Ltd	Bank of America	
7.900	Mochida Pharmaceutical	Bank of America				Merrill Lynch	(106.329)
	Co Ltd	Merrill Lynch	(16.019)	233.800	NHK Spring Co Ltd	Citibank	(251.533)
3.300	Mochida Pharmaceutical			197.700	NHK Spring Co Ltd	JP Morgan	(244.603)
	Co Ltd	Credit Suisse	(1.217)	76.700	NHK Spring Co Ltd	Credit Suisse	(106.042)
(1.900)	MonotaRO Co Ltd	Deutsche Bank	(700)	153.700	NHK Spring Co Ltd	Deutsche Bank	(123.249)
(36.000)	MonotaRO Co Ltd	Credit Suisse	(72.999)	9.400	Nichirei Corp	Deutsche Bank	(8.577)
(104.745)	MonotaRO Co Ltd	Bank of America		24.100	Nichirei Corp	Citibank	7.997
		Merrill Lynch	(38.617)	21.300	Nichirei Corp	Bank of America	
(95.800)	MonotaRO Co Ltd	JP Morgan	(194.258)			Merrill Lynch	(19.436)
37.100	Morinaga & Co Ltd/Japan	Deutsche Bank	(128.141)	28.700	Nichirei Corp	Credit Suisse	(24.866)
33.200	Morinaga & Co Ltd/Japan	Credit Suisse	36.044	(22.700)	Nidec Corp	Credit Suisse	(11.475)
5.500	Morinaga & Co Ltd/Japan	JP Morgan	7.604	(16.700)	Nidec Corp	Deutsche Bank	110.729
15.500	Morinaga & Co Ltd/Japan	Citibank	(54.288)	(17.100)	Nidec Corp	Bank of America	
4.800	Morinaga & Co Ltd/Japan	Bank of America				Merrill Lynch	113.480
		Merrill Lynch	(17.254)	(17.100)	Nidec Corp	JP Morgan	(22.066)
42.000	MS&AD Insurance Group			(7.200)	Nidec Corp	Citibank	40.813
	Holdings Inc	Deutsche Bank	(112.263)	(3.400)	Nifco Inc/Japan	Credit Suisse	4.074
67.400	MS&AD Insurance Group	Bank of America		(25.900)	Nifco Inc/Japan	Citibank	57.955
	Holdings Inc	Merrill Lynch	(157.547)	(14.800)	Nifco Inc/Japan	Deutsche Bank	31.350
67.500	MS&AD Insurance Group			(2.400)	Nifco Inc/Japan	Bank of America	
	Holdings Inc	Citibank	(92.700)			Merrill Lynch	4.977
47.400	MS&AD Insurance Group			(7.600)	Nifco Inc/Japan	JP Morgan	9.106
	Holdings Inc	JP Morgan	(86.504)	58.200	Nihon Kohden Corp	Deutsche Bank	36.477
5.600	MS&AD Insurance Group			10.000	Nihon Kohden Corp	Bank of America	
	Holdings Inc	Credit Suisse	(9.963)			Merrill Lynch	6.268
(35.000)	Murata Manufacturing Co Ltd	Credit Suisse	(523.326)	23.300	Nihon Kohden Corp	JP Morgan	—
(13.800)	Murata Manufacturing Co Ltd	Deutsche Bank	(44.518)	(25.600)	Nihon M&A Center Inc	Citibank	(24.775)
(97.200)	Murata Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(1.679.801)	(58.300)	Nihon M&A Center Inc	JP Morgan	(145.085)
(7.100)	Nabtesco Corp	Credit Suisse	8.180	(46.400)	Nihon M&A Center Inc	Credit Suisse	(115.471)
(6.300)	Nabtesco Corp	Deutsche Bank	10.742	140.000	Nikon Corp	Credit Suisse	(193.557)
(22.600)	Nabtesco Corp	JP Morgan	26.038	171.500	Nikon Corp	Bank of America	
(3.300)	Nabtesco Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(128.109)
		Merrill Lynch	5.627	77.700	Nikon Corp	JP Morgan	(107.424)
(10.300)	Nabtesco Corp	Citibank	31.329	44.300	Nikon Corp	Deutsche Bank	(33.539)
18.000	Nagase & Co Ltd	Bank of America		69.100	Nikon Corp	Citibank	(57.958)
		Merrill Lynch	(26.213)	(2.800)	Nintendo Co Ltd	Credit Suisse	57.809
19.000	Nagase & Co Ltd	Citibank	(22.241)	(1.000)	Nintendo Co Ltd	Citibank	(6.360)
20.600	Nagase & Co Ltd	JP Morgan	(24.683)	(2.100)	Nintendo Co Ltd	Deutsche Bank	(6.760)
13.600	Nagoya Railroad Co Ltd	Citibank	3.510	(1.800)	Nintendo Co Ltd	Bank of America	
25.700	Nagoya Railroad Co Ltd	JP Morgan	(15.397)			Merrill Lynch	16.591
11.200	Nagoya Railroad Co Ltd	Credit Suisse	(6.710)	(7.200)	Nintendo Co Ltd	JP Morgan	136.282
15.000	Nagoya Railroad Co Ltd	Deutsche Bank	2.627	(38.600)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Credit Suisse	75.475
(16.100)	Nankai Electric			(9.600)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Deutsche Bank	16.498
	Railway Co Ltd	Credit Suisse	(1.484)	(4.300)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Bank of America	
(400)	Nankai Electric					Merrill Lynch	8.442
	Railway Co Ltd	Deutsche Bank	147	(1.600)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Citibank	3.952
(4.800)	Nankai Electric	Bank of America		(48.500)	Nippon Electric Glass Co Ltd	JP Morgan	90.746
	Railway Co Ltd	Merrill Lynch	1.770	11.400	Nippon Express Co Ltd	Deutsche Bank	1.051

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
9.900	Nippon Express Co Ltd	Credit Suisse	(11.862)	33.100	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	JP Morgan	(43.580)
14.900	Nippon Express Co Ltd	JP Morgan	(17.853)	(38.400)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Credit Suisse	58.335
11.600	Nippon Express Co Ltd	Bank of America		(16.600)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Deutsche Bank	24.480
		Merrill Lynch	1.069	(8.400)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America	
22.100	Nippon Express Co Ltd	Citibank	6.111			Merrill Lynch	12.388
140.700	Nippon Kayaku Co Ltd	Citibank	(129.743)	(24.900)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	JP Morgan	50.491
19.400	Nippon Kayaku Co Ltd	Deutsche Bank	(18.954)	(12.700)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Citibank	4.682
(92.100)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(50.933)	16.300	Nissan Chemical Industries Ltd	Bank of America	
(74.600)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	106.576			Merrill Lynch	28.545
(72.300)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America		6.200	Nissan Chemical Industries Ltd	Deutsche Bank	10.858
		Merrill Lynch	103.290				
(15.100)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	JP Morgan	(8.351)	18.400	Nissan Chemical Industries Ltd	JP Morgan	50.878
14.300	Nippon Paper Industries Co Ltd	Credit Suisse	(33.083)	233.000	Nissan Motor Co Ltd	Credit Suisse	(69.796)
11.300	Nippon Paper Industries Co Ltd	Deutsche Bank	(20.206)	340.500	Nissan Motor Co Ltd	Citibank	(199.288)
60.500	Nippon Paper Industries Co Ltd	JP Morgan	(139.965)	210.300	Nissan Motor Co Ltd	JP Morgan	(62.996)
72.200	Nippon Paper Industries Co Ltd	Bank of America		148.700	Nissan Motor Co Ltd	Deutsche Bank	(61.676)
		Merrill Lynch	(129.101)	164.200	Nissan Motor Co Ltd	Bank of America	
32.700	Nippon Paper Industries Co Ltd	Citibank	(52.142)	(27.600)	Nissan Shatai Co Ltd	Merrill Lynch	(68.105)
(5.300)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Credit Suisse	(4.782)	(47.400)	Nissan Shatai Co Ltd	Bank of America	
(23.800)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Deutsche Bank	(5.309)	(26.600)	Nissan Shatai Co Ltd	Merrill Lynch	26.965
(2.000)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Bank of America		(37.000)	Nissan Shatai Co Ltd	Citibank	24.903
		Merrill Lynch	(737)	(13.400)	Nisshin Seifun Group Inc	Deutsche Bank	25.988
(19.100)	Nippon Shinyaku Co Ltd	JP Morgan	(26.407)	(15.000)	Nisshin Seifun Group Inc	Credit Suisse	52.519
(11.000)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Citibank	7.097	(1.700)	Nisshin Seifun Group Inc	Credit Suisse	14.574
(14.200)	Nippon Shokubai Co Ltd	Credit Suisse	(134.024)			JP Morgan	16.314
(5.800)	Nippon Shokubai Co Ltd	Deutsche Bank	(23.073)	(6.300)	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America	
(1.000)	Nippon Shokubai Co Ltd	Bank of America		3.300	Nisshinbo Holdings Inc	Merrill Lynch	(16)
		Merrill Lynch	(6.913)	32.800	Nisshinbo Holdings Inc	Citibank	(1.161)
(10.500)	Nippon Shokubai Co Ltd	JP Morgan	(114.643)	9.700	Nisshinbo Holdings Inc	JP Morgan	(8.121)
(14.700)	Nippon Shokubai Co Ltd	Citibank	(81.294)			Citibank	(48.976)
(13.400)	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	JP Morgan	19.514	21.800	Nisshinbo Holdings Inc	Bank of America	
(24.800)	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	Citibank	43.431	(21.100)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(13.858)
(29.000)	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	Deutsche Bank	60.007	(12.300)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(53.649)
29.800	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Citibank	(46.419)	(23.000)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Citibank	(11.669)
23.300	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Credit Suisse	(38.227)	(16.100)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	15.872
9.800	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Deutsche Bank	(29.176)	(3.500)	Nitori Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(436)
19.600	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Bank of America				JP Morgan	11.872
6.100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Merrill Lynch	(53.709)	(8.300)	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America	
(43.400)	Nippon Yusen KK	JP Morgan	(10.008)	(6.000)	Nitori Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(3.226)
		Bank of America		(22.600)	Nitori Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(9.180)
(103.000)	Nippon Yusen KK	Merrill Lynch	100.805	(8.200)	Nitto Denko Corp	Deutsche Bank	(5.530)
(18.400)	Nippon Yusen KK	Credit Suisse	194.617	(1.200)	Nitto Denko Corp	JP Morgan	(24.997)
(40.600)	Nippon Yusen KK	Citibank	29.403	(6.000)	Nitto Denko Corp	Credit Suisse	(6.349)
(121.400)	Nippon Yusen KK	Deutsche Bank	94.301			Deutsche Bank	(310)
(19.400)	Nipro Corp	JP Morgan	229.384	(500)	Nitto Denko Corp	Bank of America	
		Bank of America		(10.000)	NOK Corp	Merrill Lynch	(1.548)
(29.100)	Nipro Corp	Merrill Lynch	(7.689)	(6.300)	NOK Corp	Citibank	1.263
(51.800)	Nipro Corp	Credit Suisse	58.739	(11.000)	NOK Corp	Deutsche Bank	23.503
(168.100)	Nipro Corp	Deutsche Bank	757			Credit Suisse	12.136
(25.800)	Nipro Corp	JP Morgan	195.487	(5.900)	NOK Corp	Bank of America	
272.600	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Citibank	8.085	(18.600)	NOK Corp	Merrill Lynch	25.854
		Bank of America		(42.500)	Nomura Holdings Inc	Citibank	12.453
72.100	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Merrill Lynch	(325.467)	(170.300)	Nomura Holdings Inc	JP Morgan	35.830
		Credit Suisse	(29.240)	(55.900)	Nomura Holdings Inc	Citibank	17.353
88.900	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Citibank	(112.257)	(27.500)	Nomura Research Institute Ltd	JP Morgan	66.553
64.800	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Deutsche Bank	(76.450)	40.200	Nomura Research Institute Ltd	Deutsche Bank	26.483
						JP Morgan	—
				15.400	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America	
				8.700	Nomura Research Institute Ltd	Merrill Lynch	(66.694)
				14.700	Nomura Research Institute Ltd	Citibank	1.489
				(800)	NS Solutions Corp	Credit Suisse	(9.215)
				(22.200)	NS Solutions Corp	Deutsche Bank	(24.388)
				(200)	NS Solutions Corp	Credit Suisse	900
				(11.100)	NS Solutions Corp	Citibank	11.663
						Deutsche Bank	87
				(15.600)	NS Solutions Corp	Bank of America	
				(112.100)	NSK Ltd	Merrill Lynch	4.809
						JP Morgan	17.542
						Deutsche Bank	191.989

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(81.200)	NSK Ltd	JP Morgan	163.156	(109.000)	Orient Corp	Bank of America	
(7.300)	NSK Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	8.037
		Merrill Lynch	13.457	(71.900)	Orient Corp	Citibank	5.302
(41.100)	NSK Ltd	Credit Suisse	82.583	(9.000)	Oriental Land Co Ltd/Japan	Citibank	8.710
34.000	NTN Corp	Bank of America		(7.900)	Oriental Land Co Ltd/Japan	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.461)			Merrill Lynch	11.650
131.000	NTN Corp	Credit Suisse	(19.319)	(7.500)	Oriental Land Co Ltd/Japan	Credit Suisse	22.812
53.400	NTN Corp	Citibank	(31.992)	(2.100)	Oriental Land Co Ltd/Japan	Deutsche Bank	3.097
153.200	NTN Corp	Deutsche Bank	(52.124)	100.500	ORIX Corp	Bank of America	
16.700	NTN Corp	JP Morgan	(2.463)			Merrill Lynch	(133.389)
31.700	NTT Data Corp	Bank of America		30.900	ORIX Corp	Citibank	(32.610)
		Merrill Lynch	(877)	72.100	ORIX Corp	JP Morgan	(114.012)
30.800	NTT Data Corp	JP Morgan	568	13.600	ORIX Corp	Credit Suisse	(22.814)
14.900	NTT Data Corp	Citibank	2.472	32.300	ORIX Corp	Deutsche Bank	(42.870)
110.400	NTT Data Corp	Credit Suisse	2.035	32.500	OSG Corp	JP Morgan	(72.495)
95.700	NTT DOCOMO Inc	Citibank	(13.396)	23.900	OSG Corp	Citibank	(63.443)
19.100	NTT DOCOMO Inc	JP Morgan	2.905	20.300	OSG Corp	Deutsche Bank	(55.757)
66.800	NTT DOCOMO Inc	Bank of America		29.100	OSG Corp	Credit Suisse	(71.613)
		Merrill Lynch	616	58.400	Otsuka Corp	Credit Suisse	13.160
2.900	NTT DOCOMO Inc	Credit Suisse	441	65.100	Otsuka Corp	Citibank	60.003
56.900	NTT DOCOMO Inc	Deutsche Bank	524	24.000	Otsuka Corp	Deutsche Bank	18.803
146.900	Obayashi Corp	Credit Suisse	(185.495)	17.600	Otsuka Corp	Bank of America	
179.500	Obayashi Corp	Bank of America				Merrill Lynch	13.789
		Merrill Lynch	(218.388)	40.400	Otsuka Corp	JP Morgan	5.586
159.100	Obayashi Corp	Deutsche Bank	(155.420)	(7.800)	Otsuka Holdings Co Ltd	Credit Suisse	15.313
40.200	Obayashi Corp	Citibank	(20.379)	(12.500)	Otsuka Holdings Co Ltd	Citibank	(13.710)
96.900	Obayashi Corp	JP Morgan	(122.359)	(36.900)	Otsuka Holdings Co Ltd	JP Morgan	17.691
1.200	Obic Co Ltd	Citibank	2.212	(39.000)	Otsuka Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(52.628)
7.600	Obic Co Ltd	JP Morgan	8.406	(12.400)	Otsuka Holdings Co Ltd	Bank of America	
(59.200)	Odakyu Electric					Merrill Lynch	(17.144)
	Railway Co Ltd	Credit Suisse	1.637	(7.300)	Paltac Corporation	Citibank	7.401
(41.900)	Odakyu Electric			(6.700)	Paltac Corporation	JP Morgan	(26.017)
	Railway Co Ltd	Deutsche Bank	(1.931)	(26.800)	Paltac Corporation	Credit Suisse	(137.288)
(34.500)	Odakyu Electric	Bank of America		148.500	Panasonic Corp	Citibank	(104.023)
	Railway Co Ltd	Merrill Lynch	(1.590)	115.900	Panasonic Corp	Bank of America	
(114.300)	Odakyu Electric					Merrill Lynch	(149.021)
	Railway Co Ltd	JP Morgan	2.224	71.800	Panasonic Corp	JP Morgan	(70.811)
(48.200)	Odakyu Electric			54.500	Panasonic Corp	Deutsche Bank	(57.344)
	Railway Co Ltd	Citibank	(1.588)	(53.600)	Park24 Co Ltd	Deutsche Bank	33.100
300.000	Oji Holdings Corp	Credit Suisse	(135.490)	(20.900)	Park24 Co Ltd	Credit Suisse	44.691
247.000	Oji Holdings Corp	Citibank	(129.766)	(26.800)	Park24 Co Ltd	JP Morgan	57.308
260.000	Oji Holdings Corp	Bank of America		(93.100)	Park24 Co Ltd	Citibank	83.236
		Merrill Lynch	(62.307)	(18.800)	Park24 Co Ltd	Bank of America	
142.000	Oji Holdings Corp	JP Morgan	(64.132)			Merrill Lynch	11.610
136.000	Oji Holdings Corp	Deutsche Bank	(32.591)	(139.700)	PeptiDream Inc	Credit Suisse	(114.765)
6.800	OKUMA Corp	JP Morgan	(23.190)	(25.400)	PeptiDream Inc	Deutsche Bank	(46.822)
3.600	OKUMA Corp	Credit Suisse	(20.315)	(2.600)	PeptiDream Inc	Bank of America	
(3.100)	Olympus Corp	JP Morgan	5.000			Merrill Lynch	(4.793)
(19.200)	Olympus Corp	Credit Suisse	30.969	(75.500)	PeptiDream Inc	Citibank	3.479
(5.100)	Olympus Corp	Deutsche Bank	1.410	(31.400)	PeptiDream Inc	JP Morgan	(50.896)
(12.600)	Olympus Corp	Bank of America		(5.900)	Persol Holdings Co Ltd	Credit Suisse	18.163
		Merrill Lynch	4.219	(43.000)	Persol Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	135.840
19.900	Omron Corp	Credit Suisse	(53.191)	(13.500)	Persol Holdings Co Ltd	JP Morgan	41.560
35.800	Omron Corp	JP Morgan	(95.691)	(35.100)	Persol Holdings Co Ltd	Citibank	41.087
15.900	Omron Corp	Bank of America		(5.000)	Pigeon Corp	Credit Suisse	(6.452)
		Merrill Lynch	(43.965)	(7.100)	Pigeon Corp	Citibank	—
18.700	Omron Corp	Deutsche Bank	(51.707)	(7.200)	Pigeon Corp	Bank of America	
(30.400)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(44.551)			Merrill Lynch	(11.945)
(18.600)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	13.201	(20.300)	Pigeon Corp	JP Morgan	(26.195)
(51.400)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America		4.700	Pola Orbis Holdings Inc	Deutsche Bank	15.162
		Merrill Lynch	(8.054)	28.400	Pola Orbis Holdings Inc	Credit Suisse	94.235
(27.400)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(23.494)	29.600	Pola Orbis Holdings Inc	JP Morgan	98.217
(5.500)	Open House Co Ltd	Citibank	(11.660)	4.500	Pola Orbis Holdings Inc	Bank of America	
(3.600)	Open House Co Ltd	JP Morgan	(7.760)			Merrill Lynch	14.517
(7.900)	Open House Co Ltd	Deutsche Bank	(25.485)	51.200	Pola Orbis Holdings Inc	Citibank	122.697
1.600	Oracle Corp Japan	Citibank	(12.240)	(121.900)	Rakuten Inc	JP Morgan	92.244
4.300	Oracle Corp Japan	Credit Suisse	(26.554)	(185.800)	Rakuten Inc	Credit Suisse	140.598
13.400	Oracle Corp Japan	Deutsche Bank	(88.926)	(579.100)	Rakuten Inc	Deutsche Bank	266.345
(34.400)	Orient Corp	Credit Suisse	5.390	(262.700)	Rakuten Inc	Bank of America	
(56.900)	Orient Corp	JP Morgan	8.916			Merrill Lynch	120.823
(3.000)	Orient Corp	Deutsche Bank	221	(95.700)	Rakuten Inc	Citibank	35.636

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
178.700	Recruit Holdings Co Ltd	Bank of America		(37.400)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	6.925
		Merrill Lynch	445.653	(10.900)	SBI Holdings Inc/Japan	JP Morgan	10.136
4.700	Recruit Holdings Co Ltd	Credit Suisse	17.003	(17.900)	SBI Holdings Inc/Japan	Credit Suisse	(14.354)
70.400	Recruit Holdings Co Ltd	JP Morgan	254.685	(26.900)	SBI Holdings Inc/Japan	Deutsche Bank	(3.719)
160.500	Recruit Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	421.609	(9.000)	SBI Holdings Inc/Japan	Citibank	17.088
10.000	Recruit Holdings Co Ltd	Citibank	10.738	2.000	SCREEN Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(3.871)
(30.400)	Renesas Electronics Corp	Bank of America		2.600	SCREEN Holdings Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.966)			Merrill Lynch	(13.264)
(561.700)	Renesas Electronics Corp	Deutsche Bank	(165.670)	5.500	SCREEN Holdings Co Ltd	Citibank	(9.632)
(16.300)	Renesas Electronics Corp	JP Morgan	(1.653)	500	SCREEN Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(2.857)
(543.600)	Renesas Electronics Corp	Credit Suisse	(52.530)	5.600	SCREEN Holdings Co Ltd	JP Morgan	(10.839)
(15.400)	Renesas Electronics Corp	Citibank	(2.271)	(24.000)	SCSK Corp	Credit Suisse	(14.379)
(109.700)	Resona Holdings Inc	Bank of America		(39.800)	SCSK Corp	JP Morgan	(23.844)
		Merrill Lynch	28.412	(19.800)	SCSK Corp	Bank of America	
(122.800)	Resona Holdings Inc	Credit Suisse	15.867			Merrill Lynch	—
(1.700)	Resona Holdings Inc	Deutsche Bank	440	(18.700)	SCSK Corp	Citibank	6.894
(21.600)	Resona Holdings Inc	JP Morgan	896	21.200	Secom Co Ltd	Citibank	(5.110)
(128.300)	Resona Holdings Inc	Citibank	35.476	5.800	Secom Co Ltd	Credit Suisse	(10.959)
(74.600)	Resorttrust Inc	Bank of America		4.900	Secom Co Ltd	Deutsche Bank	(3.432)
		Merrill Lynch	214.528	28.400	Secom Co Ltd	Bank of America	
(73.000)	Resorttrust Inc	Credit Suisse	220.019			Merrill Lynch	(17.445)
(38.400)	Resorttrust Inc	Citibank	43.534	16.700	Secom Co Ltd	JP Morgan	(31.554)
(47.300)	Resorttrust Inc	Deutsche Bank	88.290	12.700	Sega Sammy Holdings Inc	Deutsche Bank	3.278
(89.800)	Resorttrust Inc	JP Morgan	270.654	69.600	Sega Sammy Holdings Inc	JP Morgan	58.377
(264.900)	Ricoh Co Ltd	Credit Suisse	141.612	32.100	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America	
(68.200)	Ricoh Co Ltd	Deutsche Bank	42.745			Merrill Lynch	8.284
(22.900)	Ricoh Co Ltd	Citibank	7.986	35.700	Sega Sammy Holdings Inc	Credit Suisse	29.943
(38.700)	Ricoh Co Ltd	JP Morgan	20.689	(43.500)	Seibu Holdings Inc	Credit Suisse	51.320
(400)	Rinnai Corp	Credit Suisse	1.917	(36.500)	Seibu Holdings Inc	Bank of America	
(8.000)	Rinnai Corp	JP Morgan	38.343			Merrill Lynch	5.383
(2.100)	Rinnai Corp	Citibank	6.000	(17.400)	Seibu Holdings Inc	Citibank	3.047
(4.600)	Rinnai Corp	Bank of America		(35.600)	Seibu Holdings Inc	JP Morgan	42.000
		Merrill Lynch	17.807	23.500	Seiko Epson Corp	Deutsche Bank	(29.241)
200	Rohm Co Ltd	Citibank	(442)	50.000	Seiko Epson Corp	JP Morgan	(48.389)
7.000	Rohm Co Ltd	JP Morgan	(22.582)	18.100	Seiko Epson Corp	Bank of America	
600	Rohm Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(22.522)
		Merrill Lynch	(3.152)	48.500	Seiko Epson Corp	Citibank	(61.689)
800	Rohm Co Ltd	Credit Suisse	(2.581)	207.100	Seino Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(40.086)
18.400	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Deutsche Bank	(848)	179.700	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America	
16.400	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	254.663
		Merrill Lynch	(756)	44.500	Seino Holdings Co Ltd	Citibank	8.203
5.900	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(4.079)	137.300	Seino Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	133.709
17.300	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	51.025	57.300	Seino Holdings Co Ltd	JP Morgan	(11.091)
(1.400)	Ryohin Keikaku Co Ltd	JP Morgan	23.227	187.400	Sekisui Chemical Co Ltd	Bank of America	
6.600	Sankyo Co Ltd	Credit Suisse	23.725			Merrill Lynch	(81.930)
12.100	Sankyo Co Ltd	Deutsche Bank	1.673	119.800	Sekisui Chemical Co Ltd	Citibank	(57.809)
11.200	Sankyo Co Ltd	JP Morgan	40.260	185.500	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	(99.559)
13.700	Sankyo Co Ltd	Bank of America		128.300	Sekisui Chemical Co Ltd	Credit Suisse	(70.953)
		Merrill Lynch	1.894	38.500	Sekisui Chemical Co Ltd	Deutsche Bank	(19.162)
21.600	Sankyo Co Ltd	Citibank	(14.932)	56.300	Sekisui House Ltd	Deutsche Bank	(37.622)
3.300	Sankyu Inc	Deutsche Bank	4.258	71.700	Sekisui House Ltd	JP Morgan	(34.176)
8.300	Sankyu Inc	Bank of America		2.000	Seria Co Ltd	Deutsche Bank	(1.659)
		Merrill Lynch	10.710	9.200	Seria Co Ltd	JP Morgan	(14.415)
14.400	Sankyu Inc	Credit Suisse	72.999	27.700	Seven & i Holdings Co Ltd	Credit Suisse	5.362
1.800	Sankyu Inc	Citibank	1.825	42.400	Seven & i Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(14.361)
12.300	Sankyu Inc	JP Morgan	62.353	33.600	Seven & i Holdings Co Ltd	Bank of America	
19.700	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	230			Merrill Lynch	(10.220)
26.100	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Deutsche Bank	6.894	23.000	Seven & i Holdings Co Ltd	JP Morgan	4.452
113.700	Sanwa Holdings Corp	Bank of America		32.500	Seven & i Holdings Co Ltd	Citibank	(1.797)
		Merrill Lynch	(139.375)	(74.000)	Seven Bank Ltd	Deutsche Bank	6.821
33.300	Sanwa Holdings Corp	Credit Suisse	(65.375)	(114.100)	Seven Bank Ltd	Bank of America	
177.200	Sanwa Holdings Corp	Citibank	(135.560)			Merrill Lynch	10.517
232.600	Sanwa Holdings Corp	Deutsche Bank	(265.238)	(101.700)	Seven Bank Ltd	JP Morgan	27.184
12.600	Sapporo Holdings Ltd	Citibank	(13.355)	(101.400)	Seven Bank Ltd	Citibank	6.542
18.100	Sapporo Holdings Ltd	Credit Suisse	(54.219)	(10.800)	Shimadzu Corp	JP Morgan	(2.489)
12.800	Sapporo Holdings Ltd	Deutsche Bank	(21.472)	(2.000)	Shimadzu Corp	Bank of America	
(110.500)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(35.647)			Merrill Lynch	2.396
(30.300)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America		2.000	Shimamura Co Ltd	Credit Suisse	(27.651)
		Merrill Lynch	(41.891)	800	Shimamura Co Ltd	Deutsche Bank	(10.544)
(50.700)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	101.024	5.000	Shimamura Co Ltd	JP Morgan	(69.128)
(96.400)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Deutsche Bank	(133.278)	3.100	Shimamura Co Ltd	Citibank	(41.716)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
13.100	Shimamura Co Ltd	Bank of America		(5.400)	SoftBank Group Corp	Credit Suisse	36.035
		Merrill Lynch	(172.662)	(3.100)	SoftBank Group Corp	Bank of America	
(1.700)	Shimano Inc	Credit Suisse	(9.715)			Merrill Lynch	23.258
(10.900)	Shimano Inc	Deutsche Bank	(46.214)	(12.200)	SoftBank Group Corp	Deutsche Bank	91.532
(12.500)	Shimano Inc	Citibank	(11.521)	(2.300)	SoftBank Group Corp	Citibank	14.500
(13.700)	Shimano Inc	JP Morgan	(78.289)	(10.600)	SoftBank Group Corp	JP Morgan	70.735
(3.400)	Shimano Inc	Bank of America		(6.100)	Sohgo Security		
		Merrill Lynch	(14.415)		Services Co Ltd	JP Morgan	28.955
190.700	Shimizu Corp	Bank of America		(4.900)	Sohgo Security	Bank of America	
		Merrill Lynch	(107.219)		Services Co Ltd	Merrill Lynch	19.194
42.900	Shimizu Corp	Credit Suisse	4.745	(875.000)	Sojitz Corp	Credit Suisse	198.919
20.600	Shimizu Corp	Citibank	(7.785)	(567.500)	Sojitz Corp	Deutsche Bank	183.073
110.300	Shimizu Corp	JP Morgan	12.200	(944.100)	Sojitz Corp	Bank of America	
(6.700)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Credit Suisse	12.351			Merrill Lynch	304.562
(200)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Deutsche Bank	959	(320.100)	Sojitz Corp	Citibank	112.114
(11.100)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America		(185.200)	Sojitz Corp	JP Morgan	40.968
		Merrill Lynch	53.201	16.700	Sompo Holdings Inc	Deutsche Bank	3.158
(2.400)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Citibank	14.932	16.800	Sompo Holdings Inc	Bank of America	
(8.300)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	JP Morgan	15.300			Merrill Lynch	22
(27.400)	Shinsei Bank Ltd	Credit Suisse	(3.788)	65.400	Sompo Holdings Inc	Citibank	25.317
(31.700)	Shinsei Bank Ltd	Deutsche Bank	26.881	17.100	Sompo Holdings Inc	JP Morgan	15.446
(91.100)	Shinsei Bank Ltd	JP Morgan	(12.595)	26.400	Sompo Holdings Inc	Credit Suisse	23.846
(29.200)	Shinsei Bank Ltd	Bank of America		7.900	Sony Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	24.761			Merrill Lynch	(8.082)
(37.200)	Shinsei Bank Ltd	Citibank	37.716	30.100	Sony Corp	Deutsche Bank	(30.795)
46.800	Shionogi & Co Ltd	Credit Suisse	12.509	8.500	Sony Corp	JP Morgan	1.267
12.300	Shionogi & Co Ltd	Deutsche Bank	(1.020)	6.300	Sony Corp	Credit Suisse	(7.183)
9.100	Shionogi & Co Ltd	JP Morgan	2.432	(16.700)	Sony Financial Holdings Inc	Credit Suisse	6.927
22.800	Shionogi & Co Ltd	Bank of America		(4.900)	Sony Financial Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.891)			Merrill Lynch	5.329
60.700	Shionogi & Co Ltd	Citibank	20.497	(13.400)	Sony Financial Holdings Inc	Deutsche Bank	14.574
65.900	Shiseido Co Ltd	Deutsche Bank	319.493	(21.700)	Sony Financial Holdings Inc	JP Morgan	9.000
6.800	Shiseido Co Ltd	JP Morgan	88.318	3.400	Sotetsu Holdings Inc	Credit Suisse	(627)
2.400	Shiseido Co Ltd	Bank of America		1.400	Sotetsu Holdings Inc	Citibank	(516)
		Merrill Lynch	11.636	6.900	Sotetsu Holdings Inc	JP Morgan	(1.272)
20.800	Shiseido Co Ltd	Citibank	104.947	29.700	Sotetsu Holdings Inc	Deutsche Bank	(13.687)
115.000	Shizuoka Bank Ltd/The	Bank of America		32.500	Sotetsu Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(79.497)			Merrill Lynch	(14.978)
122.000	Shizuoka Bank Ltd/The	Citibank	(75.340)	45.200	Square Enix Holdings Co Ltd	Credit Suisse	299.959
13.000	Shizuoka Bank Ltd/The	JP Morgan	(6.590)	13.200	Square Enix Holdings Co Ltd	Citibank	32.849
50.000	Shizuoka Bank Ltd/The	Credit Suisse	(25.347)	37.300	Square Enix Holdings Co Ltd	Bank of America	
15.000	Shizuoka Bank Ltd/The	Deutsche Bank	(10.369)			Merrill Lynch	110.014
(9.700)	Showa Denko KK	Deutsche Bank	(51.168)	14.200	Square Enix Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	41.882
(17.900)	Showa Denko KK	JP Morgan	(107.772)	61.000	Square Enix Holdings Co Ltd	JP Morgan	404.811
(9.000)	Showa Denko KK	Citibank	(17.420)	(4.900)	Stanley Electric Co Ltd	Deutsche Bank	9.033
315.700	Showa Shell Sekiyu KK	Credit Suisse	(367.429)	(24.500)	Stanley Electric Co Ltd	JP Morgan	51.938
70.200	Showa Shell Sekiyu KK	Bank of America		(100)	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(113.231)			Merrill Lynch	184
34.600	Showa Shell Sekiyu KK	JP Morgan	(53.171)	(600)	Stanley Electric Co Ltd	Citibank	1.383
4.900	Showa Shell Sekiyu KK	Citibank	(9.168)	(23.900)	Start Today Co Ltd	JP Morgan	(68.289)
184.400	Showa Shell Sekiyu KK	Deutsche Bank	(297.433)	(50.400)	Start Today Co Ltd	Credit Suisse	(144.007)
(21.000)	SKY Perfect JSAT			(35.200)	Start Today Co Ltd	Deutsche Bank	6.489
	Holdings Inc	Credit Suisse	2.129	(1.676)	Start Today Co Ltd	Citibank	927
(64.100)	SKY Perfect JSAT			29.600	Subaru Corp	Bank of America	
	Holdings Inc	JP Morgan	6.499			Merrill Lynch	(61.565)
(13.400)	SKY Perfect JSAT			6.100	Subaru Corp	Citibank	(15.281)
	Holdings Inc	Deutsche Bank	2.964	25.300	Subaru Corp	Credit Suisse	(80.684)
(35.900)	SKY Perfect JSAT			6.400	Subaru Corp	Deutsche Bank	(12.978)
	Holdings Inc	Citibank	7.610	79.100	Subaru Corp	JP Morgan	(252.257)
151.100	Skylark Co Ltd	Credit Suisse	36.210	10.100	Sugi Holdings Co Ltd	Bank of America	
53.700	Skylark Co Ltd	Deutsche Bank	18.313			Merrill Lynch	(15.218)
208.100	Skylark Co Ltd	JP Morgan	49.870	8.500	Sugi Holdings Co Ltd	Citibank	(2.350)
97.300	Skylark Co Ltd	Bank of America		14.100	Sugi Holdings Co Ltd	JP Morgan	9.778
		Merrill Lynch	33.182	4.600	Sugi Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(6.360)
286.200	Skylark Co Ltd	Citibank	76.499	600	Sugi Holdings Co Ltd	Credit Suisse	553
(1.800)	SMC Corp/Japan	Credit Suisse	18.416	(16.900)	Sumco Corp	Credit Suisse	2.960
(1.000)	SMC Corp/Japan	Deutsche Bank	8.387	(67.600)	Sumco Corp	Bank of America	
(1.900)	SMC Corp/Japan	Citibank	65.846			Merrill Lynch	121.499
(3.900)	SMC Corp/Japan	JP Morgan	39.900	(126.500)	Sumco Corp	JP Morgan	22.153
(1.100)	SMC Corp/Japan	Bank of America		(54.100)	Sumco Corp	Deutsche Bank	87.560
		Merrill Lynch	9.226				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
99.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America		42.500	Sumitomo Rubber		
		Merrill Lynch	5.475		Industries Ltd	JP Morgan	(35.647)
163.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Citibank	(13.521)	30.000	Sumitomo Rubber	Bank of America	
64.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	JP Morgan	12.388		Industries Ltd	Merrill Lynch	(33.181)
215.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Credit Suisse	41.615	8.000	Sumitomo Rubber		
21.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Deutsche Bank	1.161		Industries Ltd	Citibank	(9.733)
208.500	Sumitomo Corp	Bank of America		21.800	Sumitomo Rubber		
		Merrill Lynch	(217.311)		Industries Ltd	Credit Suisse	(18.285)
31.600	Sumitomo Corp	JP Morgan	(48.931)	18.000	Sundrug Co Ltd	Credit Suisse	(101.203)
95.500	Sumitomo Corp	Citibank	(126.752)	15.700	Sundrug Co Ltd	Bank of America	
34.300	Sumitomo Corp	Credit Suisse	(53.112)			Merrill Lynch	(89.718)
59.600	Sumitomo Corp	Deutsche Bank	(60.934)	21.900	Sundrug Co Ltd	JP Morgan	(123.130)
108.300	Sumitomo Dainippon			10.200	Sundrug Co Ltd	Citibank	(38.546)
	Pharma Co Ltd	Citibank	124.775	17.300	Sundrug Co Ltd	Deutsche Bank	(98.862)
137.100	Sumitomo Dainippon			(41.100)	Suntory Beverage & Food Ltd	Credit Suisse	151.947
	Pharma Co Ltd	JP Morgan	377.832	(28.500)	Suntory Beverage & Food Ltd	Deutsche Bank	43.464
37.600	Sumitomo Dainippon			32.400	Suruga Bank Ltd	Bank of America	
	Pharma Co Ltd	Credit Suisse	103.621			Merrill Lynch	(75.554)
87.000	Sumitomo Dainippon			20.500	Suruga Bank Ltd	JP Morgan	(31.366)
	Pharma Co Ltd	Deutsche Bank	335.862	39.600	Suruga Bank Ltd	Citibank	(29.565)
(44.800)	Sumitomo Electric			4.400	Suruga Bank Ltd	Credit Suisse	(6.732)
(33.800)	Industries Ltd	Citibank	70.197	54.900	Suruga Bank Ltd	Deutsche Bank	(128.022)
(49.700)	Sumitomo Electric			58.900	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Credit Suisse	97.719
	Industries Ltd	Deutsche Bank	40.500	17.800	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Deutsche Bank	(19.688)
(29.600)	Sumitomo Electric			16.100	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Bank of America	
	Industries Ltd	JP Morgan	14.201			Merrill Lynch	(20.027)
(15.700)	Sumitomo Electric			42.800	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Citibank	(82.843)
	Industries Ltd	Credit Suisse	8.458	28.300	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	JP Morgan	22.828
(10.700)	Sumitomo Forestry Co Ltd			67.100	Suzuki Motor Corp	Citibank	(71.842)
(58.400)	Sumitomo Forestry Co Ltd	Deutsche Bank	80.401	33.500	Suzuki Motor Corp	Bank of America	
(42.700)	Sumitomo Forestry Co Ltd	Citibank	46.441			Merrill Lynch	(4.940)
9.400	Sumitomo Heavy	Bank of America		16.000	Suzuki Motor Corp	Credit Suisse	63.855
	Industries Ltd	Merrill Lynch	(32.923)	17.400	Suzuki Motor Corp	Deutsche Bank	(2.566)
23.000	Sumitomo Heavy			54.200	Suzuki Motor Corp	JP Morgan	216.310
	Industries Ltd	JP Morgan	(58.557)	(8.800)	Sysmex Corp	Credit Suisse	(10.544)
5.700	Sumitomo Heavy			(17.400)	Sysmex Corp	Citibank	43.302
	Industries Ltd	Credit Suisse	(10.245)	(1.600)	Sysmex Corp	Deutsche Bank	(4.719)
8.900	Sumitomo Heavy			(36.700)	Sysmex Corp	Bank of America	
	Industries Ltd	Citibank	(35.274)			Merrill Lynch	(108.245)
138.400	Sumitomo Heavy			4.700	T&D Holdings Inc	Deutsche Bank	(6.216)
	Industries Ltd	Deutsche Bank	(485.484)	18.100	T&D Holdings Inc	Bank of America	
(47.800)	Sumitomo Metal					Merrill Lynch	(23.940)
(34.400)	Mining Co Ltd	Deutsche Bank	171.884	17.700	T&D Holdings Inc	Citibank	(25.368)
(68.600)	Sumitomo Metal			40.500	T&D Holdings Inc	JP Morgan	(34.343)
	Mining Co Ltd	Credit Suisse	171.532	(10.000)	Taiheiyo Cement Corp	Citibank	9.678
(41.900)	Sumitomo Metal			(12.900)	Taiheiyo Cement Corp	JP Morgan	4.756
	Mining Co Ltd	Citibank	258.400	153.100	Taisei Corp	Credit Suisse	127.001
(20.500)	Sumitomo Mitsui Financial			49.200	Taisei Corp	Citibank	(68.022)
	Group Inc	JP Morgan	208.930	42.300	Taisei Corp	Deutsche Bank	(62.017)
(28.800)	Sumitomo Mitsui Financial			20.200	Taisei Corp	Bank of America	
	Group Inc	Credit Suisse	13.786			Merrill Lynch	(25.488)
(25.800)	Sumitomo Mitsui Financial			23.100	Taisei Corp	JP Morgan	19.162
	Group Inc	Deutsche Bank	38.490	1.700	Taisho Pharmaceutical		
(7.200)	Sumitomo Mitsui Financial	Bank of America	34.481		Holdings Co Ltd	Credit Suisse	13.789
(17.800)	Sumitomo Mitsui Financial	Merrill Lynch	12.211	3.800	Taisho Pharmaceutical		
(40.600)	Sumitomo Mitsui Trust				Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	350
	Holdings Inc	Citibank	44.632	11.100	Taisho Pharmaceutical		
(18.900)	Sumitomo Mitsui Trust				Holdings Co Ltd	Citibank	(19.439)
	Holdings Inc	JP Morgan	(2.461)	28.500	Taisho Pharmaceutical		
(48.500)	Sumitomo Mitsui Trust				Holdings Co Ltd	JP Morgan	231.163
	Holdings Inc	Credit Suisse	44.632	14.500	Taisho Pharmaceutical	Bank of America	
(23.900)	Sumitomo Mitsui Trust				Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	1.336
	Holdings Inc	Deutsche Bank	50.344	(72.500)	Taiyo Nippon Sanso Corp	Credit Suisse	44.103
19.100	Sumitomo Rubber			(41.300)	Taiyo Nippon Sanso Corp	Deutsche Bank	29.808
	Industries Ltd	JP Morgan	45.150	(26.200)	Taiyo Nippon Sanso Corp	Bank of America	
		Citibank	46.701			Merrill Lynch	8.211
		Deutsche Bank	(21.125)	(150.600)	Taiyo Nippon Sanso Corp	JP Morgan	91.126
				(94.700)	Taiyo Nippon Sanso Corp	Citibank	90.777
				(85.600)	Takara Bio Inc	Credit Suisse	(252.472)
				(65.900)	Takara Bio Inc	Deutsche Bank	(30.977)
				(13.300)	Takara Bio Inc	JP Morgan	(39.228)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
(11.700)	Takara Bio Inc	Bank of America		(6.500)	Tokyu Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(5.500)			Merrill Lynch	(3.355)
(17.000)	Takara Bio Inc	Citibank	5.484	(44.900)	Tokyu Corp	JP Morgan	(35.591)
(28.500)	Takara Holdings Inc	Credit Suisse	32.177	(33.700)	Tokyu Corp	Citibank	(13.046)
(128.000)	Takara Holdings Inc	JP Morgan	21.473	(45.400)	Tokyu Corp	Deutsche Bank	(23.433)
(33.900)	Takara Holdings Inc	Deutsche Bank	42.494	(36.000)	Toppan Printing Co Ltd	Credit Suisse	6.456
(37.400)	Takara Holdings Inc	Citibank	12.048	(109.000)	Toppan Printing Co Ltd	Citibank	29.135
(159.000)	Takashimaya Co Ltd	Citibank	15.248	(71.000)	Toppan Printing Co Ltd	Deutsche Bank	11.145
(49.000)	Takashimaya Co Ltd	JP Morgan	4.536	(564.800)	Toray Industries Inc	Credit Suisse	434.604
19.300	Takeda Pharmaceutical Co Ltd			(242.700)	Toray Industries Inc	Deutsche Bank	129.521
		JP Morgan	(33.087)	(77.700)	Toray Industries Inc	Bank of America	
(40.800)	TDK Corp	Deutsche Bank	146.661			Merrill Lynch	41.466
(23.200)	TDK Corp	Credit Suisse	(8.553)	(163.100)	Toray Industries Inc	Citibank	76.067
(4.800)	TDK Corp	JP Morgan	(1.770)	(129.900)	Toray Industries Inc	JP Morgan	134.815
(24.400)	TDK Corp	Citibank	213.650	(243.000)	Toshiba Corp	Bank of America	
116.700	Teijin Ltd	Credit Suisse	37.621			Merrill Lynch	(15.008)
145.500	Teijin Ltd	JP Morgan	53.733	(1.365.000)	Toshiba Corp	Deutsche Bank	(88.069)
35.600	Teijin Ltd	Bank of America		(2.392.000)	Toshiba Corp	Credit Suisse	(267.030)
		Merrill Lynch	(25.594)	41.700	Tosoh Corp	Credit Suisse	1.537
74.900	Teijin Ltd	Citibank	(72.487)	27.000	Tosoh Corp	Bank of America	
66.700	Teijin Ltd	Deutsche Bank	(47.952)			Merrill Lynch	(13.274)
(5.900)	Terumo Corp	Credit Suisse	(28.720)	121.200	Tosoh Corp	Deutsche Bank	(82.666)
(5.900)	Terumo Corp	Citibank	(4.341)	7.800	Tosoh Corp	Citibank	(5.608)
(12.900)	Terumo Corp	Deutsche Bank	(7.827)	65.800	Tosoh Corp	JP Morgan	(16.550)
(43.100)	THK Co Ltd	Credit Suisse	(32.353)	13.000	TOTO Ltd	Credit Suisse	–
(11.600)	THK Co Ltd	Citibank	20.262	37.800	TOTO Ltd	Bank of America	
19.700	TIS Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(83.617)
		Merrill Lynch	(18.780)	61.600	TOTO Ltd	Citibank	(59.962)
29.300	TIS Inc	Credit Suisse	202.668	4.100	TOTO Ltd	JP Morgan	–
41.100	TIS Inc	Deutsche Bank	9.336	(64.400)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	JP Morgan	(71.823)
(3.500)	Tobu Railway Co Ltd	Credit Suisse	(161)	(54.500)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Credit Suisse	(60.782)
(7.100)	Tobu Railway Co Ltd	JP Morgan	(327)	(40.400)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Deutsche Bank	(34.969)
(8.800)	Tobu Railway Co Ltd	Citibank	811	(77.000)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Citibank	19.162
(15.200)	Toho Co Ltd/Tokyo	Deutsche Bank	7.005	6.400	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Deutsche Bank	(6.194)
(5.600)	Toho Co Ltd/Tokyo	Citibank	5.232	29.100	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America	
(10.600)	Toho Co Ltd/Tokyo	JP Morgan	6.295			Merrill Lynch	(28.163)
(36.700)	Tokai Carbon Co Ltd	Deutsche Bank	(178.604)	41.100	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Citibank	(20.835)
(104.100)	Tokai Carbon Co Ltd	JP Morgan	(691.793)	27.000	Toyo Suisan Kaisha Ltd	JP Morgan	(104.521)
(19.700)	Tokai Carbon Co Ltd	Citibank	(62.643)	16.100	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Credit Suisse	(62.325)
(13.800)	Tokai Rika Co Ltd	Citibank	37.014	(18.600)	Toyo Tire & Rubber Co Ltd	Credit Suisse	22.537
(42.900)	Tokai Rika Co Ltd	Credit Suisse	90.908	(73.400)	Toyo Tire & Rubber Co Ltd	Citibank	106.215
700	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc			(18.000)	Toyo Tire & Rubber Co Ltd	Deutsche Bank	11.448
		Citibank	(419)	(72.500)	Toyo Tire & Rubber Co Ltd	JP Morgan	61.436
281.100	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	JP Morgan	(50.072)	3.000	Toyobo Co Ltd	Citibank	(4.839)
636.000	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Bank of America		19.300	Toyobo Co Ltd	Credit Suisse	(53.900)
34.900	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Merrill Lynch	(293.070)	13.500	Toyobo Co Ltd	Deutsche Bank	(22.148)
6.600	Tokio Marine Holdings Inc	Deutsche Bank	(14.797)	21.000	Toyobo Co Ltd	Bank of America	
34.500	Tokio Marine Holdings Inc	Deutsche Bank	(3.467)			Merrill Lynch	(34.453)
		Bank of America		5.700	Toyobo Co Ltd	JP Morgan	(15.919)
		Merrill Lynch	(18.125)	28.900	Toyoda Gosei Co Ltd	Bank of America	
22.400	Tokio Marine Holdings Inc	JP Morgan	(1.032)			Merrill Lynch	(13.585)
20.600	Tokio Marine Holdings Inc	Citibank	(18.417)	3.900	Toyoda Gosei Co Ltd	Citibank	(2.049)
26.200	Tokio Marine Holdings Inc	Credit Suisse	(4.067)	2.200	Toyoda Gosei Co Ltd	JP Morgan	(750)
(49.000)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Credit Suisse	36.131	65.700	Toyota Boshoku Corp	Credit Suisse	(111.400)
(71.300)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Deutsche Bank	122.234	99.900	Toyota Boshoku Corp	Deutsche Bank	(198.888)
(10.200)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Bank of America		50.800	Toyota Boshoku Corp	Bank of America	
(59.500)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Merrill Lynch	17.487			Merrill Lynch	(101.136)
		JP Morgan	43.873	130.800	Toyota Boshoku Corp	Citibank	(284.476)
(3.100)	Tokyo Century Corp	JP Morgan	12.286	27.600	Toyota Boshoku Corp	JP Morgan	(38.413)
(2.100)	Tokyo Century Corp	Citibank	11.033	(45.000)	Toyota Industries Corp	Deutsche Bank	223.973
(200)	Tokyo Century Corp	Credit Suisse	793	(46.700)	Toyota Industries Corp	Credit Suisse	191.198
(300)	Tokyo Century Corp	Deutsche Bank	1.714	(19.200)	Toyota Industries Corp	Bank of America	
(1.600)	Tokyo Century Corp	Bank of America				Merrill Lynch	95.562
		Merrill Lynch	9.143	(61.100)	Toyota Industries Corp	JP Morgan	202.737
(47.800)	Tokyu Corp	Credit Suisse	(36.819)	(57.200)	Toyota Industries Corp	Citibank	363.777
				7.500	Toyota Motor Corp	Credit Suisse	(16.176)
				29.500	Toyota Motor Corp	Citibank	(164.773)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Japon suite			
23.700	Toyota Motor Corp	Deutsche Bank	(129.537)	14.600	West Japan Railway Co	Deutsche Bank	(21.396)
14.872	Toyota Motor Corp	JP Morgan	(32.076)	(275.600)	Yahoo Japan Corp	Bank of America	
39.900	Toyota Motor Corp	Bank of America				Merrill Lynch	7.454
		Merrill Lynch	(218.081)	(372.182)	Yahoo Japan Corp	JP Morgan	26.917
10.400	Toyota Tsusho Corp	Bank of America		(8.600)	Yakult Honsha Co Ltd	Credit Suisse	52.316
		Merrill Lynch	(31.633)	(1.400)	Yakult Honsha Co Ltd	Deutsche Bank	8.517
14.600	Toyota Tsusho Corp	Citibank	(53.155)	(23.800)	Yakult Honsha Co Ltd	JP Morgan	144.781
3.300	Toyota Tsusho Corp	JP Morgan	(9.125)	(13.000)	Yakult Honsha Co Ltd	Bank of America	
8.600	Trend Micro Inc/Japan	Citibank	(10.305)			Merrill Lynch	79.082
4.800	Trend Micro Inc/Japan	Deutsche Bank	2.212	(7.000)	Yakult Honsha Co Ltd	Citibank	15.485
1.600	Trend Micro Inc/Japan	JP Morgan	(4.867)	(62.500)	Yamada Denki Co Ltd	JP Morgan	14.978
8.300	Trend Micro Inc/Japan	Bank of America		(111.400)	Yamada Denki Co Ltd	Credit Suisse	13.461
		Merrill Lynch	3.825	(14.200)	Yamada Denki Co Ltd	Bank of America	
1.700	TS Tech Co Ltd	Citibank	(4.857)			Merrill Lynch	393
34.800	TS Tech Co Ltd	JP Morgan	(6.927)	(118.200)	Yamada Denki Co Ltd	Citibank	16.342
34.700	TS Tech Co Ltd	Credit Suisse	(11.881)	131.000	Yamaguchi Financial		
17.900	TS Tech Co Ltd	Deutsche Bank	(49.214)		Group Inc	Credit Suisse	(80.898)
16.500	TS Tech Co Ltd	Bank of America		172.000	Yamaguchi Financial	Bank of America	
		Merrill Lynch	(42.583)		Group Inc	Merrill Lynch	(125.549)
(39.100)	Tsumura & Co	JP Morgan	12.613	105.000	Yamaguchi Financial		
(83.500)	Tsumura & Co	Citibank	46.941		Group Inc	Citibank	(72.584)
(10.600)	Tsumura & Co	Deutsche Bank	(2.443)	114.000	Yamaguchi Financial		
(1.400)	Tsuruha Holdings Inc	Citibank	(645)		Group Inc	JP Morgan	(70.400)
(1.100)	Tsuruha Holdings Inc	Credit Suisse	(1.014)	108.000	Yamaguchi Financial		
(10.600)	Tsuruha Holdings Inc	JP Morgan	(9.770)		Group Inc	Deutsche Bank	(77.590)
(18.600)	Tsuruha Holdings Inc	Bank of America		19.700	Yamaha Corp	JP Morgan	(13.472)
		Merrill Lynch	51.431	9.100	Yamaha Corp	Citibank	(4.194)
(22.100)	TV Asahi Holdings Corp	Credit Suisse	46.035	4.900	Yamaha Corp	Deutsche Bank	(6.775)
(5.900)	TV Asahi Holdings Corp	Citibank	4.350	(8.200)	Yamaha Motor Co Ltd	Credit Suisse	12.406
(9.800)	TV Asahi Holdings Corp	Deutsche Bank	11.256	(9.400)	Yamaha Motor Co Ltd	Deutsche Bank	18.194
(34.900)	TV Asahi Holdings Corp	JP Morgan	72.698	(24.800)	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	51.431
18.300	Ube Industries Ltd	Bank of America		(24.500)	Yamaha Motor Co Ltd	Citibank	47.422
		Merrill Lynch	(47.228)	(33.500)	Yamato Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(36.980)
12.600	Ube Industries Ltd	Citibank	(38.905)	(2.900)	Yamato Holdings Co Ltd	Bank of America	
15.300	Ube Industries Ltd	JP Morgan	(25.384)			Merrill Lynch	(3.849)
15.200	Ube Industries Ltd	Credit Suisse	(25.218)	(36.500)	Yamato Holdings Co Ltd	Citibank	7.738
7.400	Ube Industries Ltd	Deutsche Bank	(19.098)	(96.800)	Yamato Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(77.622)
6.300	Ulvac Inc	Bank of America		(98.700)	Yamato Holdings Co Ltd	JP Morgan	(79.146)
		Merrill Lynch	(49.647)	4.600	Yamato Kogyo Co Ltd	JP Morgan	(15.263)
24.900	Ulvac Inc	Citibank	(120.489)	19.400	Yamato Kogyo Co Ltd	Credit Suisse	(64.372)
26.200	Ulvac Inc	Deutsche Bank	(206.470)	2.200	Yamato Kogyo Co Ltd	Deutsche Bank	(4.968)
46.400	Ulvac Inc	Credit Suisse	(388.936)	65.600	Yamazaki Baking Co Ltd	Deutsche Bank	13.907
27.900	Ulvac Inc	JP Morgan	(335.587)	62.300	Yamazaki Baking Co Ltd	Bank of America	
(16.200)	Unicharm Corp	Credit Suisse	(27.036)			Merrill Lynch	13.207
(75.400)	Unicharm Corp	Deutsche Bank	(108.815)	69.500	Yamazaki Baking Co Ltd	JP Morgan	20.499
(25.100)	Unicharm Corp	Citibank	(21.284)	90.800	Yamazaki Baking Co Ltd	Citibank	71.137
(25.800)	Universal Entertainment Corp	Credit Suisse	(57.072)	3.300	Yamazaki Baking Co Ltd	Credit Suisse	973
(215.948)	Universal Entertainment Corp	JP Morgan	(622.392)	(50.600)	Yaskawa Electric Corp	JP Morgan	51.302
(67.600)	Universal Entertainment Corp	Citibank	(292.843)	(18.500)	Yaskawa Electric Corp	Citibank	58.828
(9.300)	Ushio Inc	Credit Suisse	14.829	(11.700)	Yaskawa Electric Corp	Bank of America	
(1.700)	Ushio Inc	Citibank	1.724			Merrill Lynch	23.185
(10.600)	Ushio Inc	JP Morgan	16.902	(13.600)	Yaskawa Electric Corp	Credit Suisse	15.965
(15.700)	Ushio Inc	Deutsche Bank	22.574	1.000	Yokogawa Electric Corp	Credit Suisse	(3.530)
(58.700)	USS Co Ltd	Credit Suisse	145.031	115.800	Yokogawa Electric Corp	Bank of America	
(105.000)	USS Co Ltd	Citibank	170.330			Merrill Lynch	(103.531)
(36.000)	USS Co Ltd	Deutsche Bank	78.308	118.700	Yokogawa Electric Corp	JP Morgan	(219.410)
(77.700)	USS Co Ltd	JP Morgan	193.468	15.800	Yokogawa Electric Corp	Citibank	(18.786)
1.300	Wacoal Holdings Corp	Credit Suisse	(899)	30.700	Yokogawa Electric Corp	Deutsche Bank	(34.017)
2.500	Wacoal Holdings Corp	Citibank	(1.498)	26.000	Yokohama Rubber		
1.600	Wacoal Holdings Corp	JP Morgan	(1.106)		Co Ltd/The	Citibank	(65.183)
2.600	Wacoal Holdings Corp	Bank of America		23.700	Yokohama Rubber	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.558)		Co Ltd/The	Merrill Lynch	(44.781)
(43.600)	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America		4.300	Yokohama Rubber		
		Merrill Lynch	32.149		Co Ltd/The	Deutsche Bank	(8.125)
(78.800)	Welcia Holdings Co Ltd	JP Morgan	(108.945)	7.300	Zenkoku Hoshio Co Ltd	Credit Suisse	13.251
(17.700)	Welcia Holdings Co Ltd	Citibank	(11.420)	33.200	Zenkoku Hoshio Co Ltd	Deutsche Bank	35.835
18.300	West Japan Railway Co	Bank of America		50.000	Zensho Holdings Co Ltd	Credit Suisse	63.137
		Merrill Lynch	(19.901)	8.800	Zensho Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(1.541)
23.500	West Japan Railway Co	Citibank	(9.965)	19.100	Zensho Holdings Co Ltd	JP Morgan	24.118
13.600	West Japan Railway Co	Credit Suisse	(22.647)	37.000	Zensho Holdings Co Ltd	Bank of America	
3.000	West Japan Railway Co	JP Morgan	(6.664)			Merrill Lynch	(6.480)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Japon suite				Pays-Bas suite			
40.500	Zensho Holdings Co Ltd	Citibank	3.360	(95.143)	Boskalis Westminster	Bank of America	
26.500	Zeon Corp	JP Morgan	(4.152)			Merrill Lynch	13.303
223.800	Zeon Corp	Bank of America		(94.029)	Boskalis Westminster	JP Morgan	163.241
		Merrill Lynch	(84.060)	(64.143)	Boskalis Westminster	Citibank	26.158
134.100	Zeon Corp	Citibank	(100.116)	(111.439)	Boskalis Westminster	Credit Suisse	193.466
117.100	Zeon Corp	Credit Suisse	(36.224)	(48.324)	Boskalis Westminster	Deutsche Bank	6.757
126.200	Zeon Corp	Deutsche Bank	(23.264)	(54.778)	Galapagos NV	JP Morgan	(589.739)
			(5.970.345)	(1.319)	Galapagos NV	Citibank	(4.119)
				(52.162)	Galapagos NV	Deutsche Bank	(434.095)
				(7.234)	Galapagos NV	Credit Suisse	(77.881)
				(32.106)	Gemalto NV	Bank of America	
						Merrill Lynch	(10.474)
117.154	Aalberts Industries NV	Bank of America		(848)	Gemalto NV	JP Morgan	(287)
		Merrill Lynch	29.106	(12.211)	Gemalto NV	Credit Suisse	(4.126)
31.430	Aalberts Industries NV	Deutsche Bank	10.986	(1.725)	Gemalto NV	Deutsche Bank	(563)
28.944	Aegon NV	Citibank	(10.914)	(3.810)	Heineken NV	Credit Suisse	6.304
117.750	Aegon NV	Bank of America		(4.437)	Heineken NV	Bank of America	
		Merrill Lynch	(82.318)			Merrill Lynch	364
226.036	Aegon NV	Deutsche Bank	(153.970)	(31.213)	Heineken NV	JP Morgan	30.697
(31.920)	Akzo Nobel NV	Bank of America		(18.641)	Heineken NV	Deutsche Bank	19.113
		Merrill Lynch	(22.315)	(15.801)	IMCD NV	JP Morgan	17.793
(18.589)	Akzo Nobel NV	JP Morgan	(27.442)	(41.776)	IMCD NV	Bank of America	
(5.317)	Akzo Nobel NV	Credit Suisse	6.162			Merrill Lynch	30.255
(21.174)	Akzo Nobel NV	Deutsche Bank	(16.163)	(38.251)	IMCD NV	Credit Suisse	(82.451)
(274.385)	Altice Europe NV	Credit Suisse	1.457.149	(8.070)	IMCD NV	Citibank	10.343
(156.890)	Altice Europe NV	Deutsche Bank	878.721	(35.004)	IMCD NV	Deutsche Bank	26.510
(40.008)	Altice Europe NV	Citibank	(28.389)	108.422	ING Groep NV	Bank of America	
(348.010)	Altice Europe NV	JP Morgan	1.875.362			Merrill Lynch	(117.485)
(311.689)	Altice Europe NV	Bank of America		81.225	ING Groep NV	Credit Suisse	(133.631)
		Merrill Lynch	998.162	2.480	ING Groep NV	Deutsche Bank	(2.687)
(182.625)	Altice NV (Right)	Bank of America		43.857	ING Groep NV	Citibank	(52.224)
		Merrill Lynch	(1.249.476)	66.378	ING Groep NV	JP Morgan	(109.205)
(274.385)	Altice NV (Right)	Credit Suisse	(1.877.276)	130.003	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America	
(40.008)	Altice NV (Right)	Citibank	(273.725)			Merrill Lynch	(12.706)
(156.890)	Altice NV (Right)	Deutsche Bank	(1.073.403)	94.154	Koninklijke Ahold Delhaize NV	JP Morgan	37.464
(348.010)	Altice NV (Right)	JP Morgan	(2.381.000)	67.933	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Citibank	(12.506)
108.821	Aperam SA	Bank of America		3.866	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Deutsche Bank	(396)
		Merrill Lynch	(101.777)	57.227	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Credit Suisse	15.869
65.416	Aperam SA	Citibank	(97.547)	17.611	Koninklijke DSM NV	JP Morgan	(2.236)
90.529	Aperam SA	JP Morgan	(56.959)	16.594	Koninklijke DSM NV	Credit Suisse	1.160
3.707	Aperam SA	Credit Suisse	(2.332)	39.939	Koninklijke DSM NV	Bank of America	
85.644	Aperam SA	Deutsche Bank	(57.877)			Merrill Lynch	(56.773)
18.931	ArcelorMittal	Bank of America		23.213	Koninklijke DSM NV	Citibank	(74.649)
		Merrill Lynch	(52.607)	(256.242)	Koninklijke KPN NV	Citibank	26.572
23.148	ArcelorMittal	Citibank	(62.707)	(279.948)	Koninklijke KPN NV	Bank of America	
49.307	ArcelorMittal	Credit Suisse	(76.409)			Merrill Lynch	36.532
10.288	ASM International NV	Citibank	(26.032)	(71.424)	Koninklijke KPN NV	Deutsche Bank	9.321
23.015	ASM International NV	JP Morgan	(52.400)	70.002	Koninklijke Philips NV	Bank of America	
16.951	ASM International NV	Credit Suisse	(46.248)			Merrill Lynch	16.313
13.107	ASM International NV	Deutsche Bank	(32.834)	18.787	Koninklijke Philips NV	Citibank	(23.641)
9.786	ASM International NV	Bank of America		71.043	Koninklijke Philips NV	JP Morgan	3.725
		Merrill Lynch	(24.515)	63.769	Koninklijke Philips NV	Deutsche Bank	10.596
(7.785)	ASML Holding NV	Bank of America		103.333	Koninklijke Philips NV	Credit Suisse	(6.024)
		Merrill Lynch	(8.617)	(24.749)	Koninklijke Vopak NV	Citibank	(2.019)
(15.841)	ASML Holding NV	JP Morgan	(114.056)	(93.114)	Koninklijke Vopak NV	JP Morgan	(92.107)
(12.895)	ASML Holding NV	Credit Suisse	(91.624)	(116.851)	Koninklijke Vopak NV	Bank of America	
(12.596)	ASML Holding NV	Deutsche Bank	(13.942)			Merrill Lynch	(80.328)
12.363	ASR Nederland NV	Deutsche Bank	(33.131)	(16.670)	Koninklijke Vopak NV	Deutsche Bank	(11.005)
11.363	ASR Nederland NV	Bank of America		(5.839)	Koninklijke Vopak NV	Credit Suisse	(5.851)
		Merrill Lynch	(30.451)	16.466	NN Group NV	Bank of America	
95.104	ASR Nederland NV	Citibank	(299.188)			Merrill Lynch	(40.481)
44.336	ASR Nederland NV	JP Morgan	(163.239)	23.799	NN Group NV	Citibank	(71.819)
52.518	ASR Nederland NV	Credit Suisse	(188.599)	38.991	NN Group NV	JP Morgan	(118.119)
178.136	BE Semiconductor Industries NV	Credit Suisse	(550.617)	35.827	NN Group NV	Deutsche Bank	(90.603)
				66.403	NN Group NV	Credit Suisse	(182.226)
66.059	BE Semiconductor Industries NV	Citibank	(158.186)	(114.141)	OCI NV	JP Morgan	(309.722)
32.780	BE Semiconductor Industries NV	Deutsche Bank	(108.470)	(42.625)	OCI NV	Deutsche Bank	9.933
62.836	BE Semiconductor Industries NV	JP Morgan	(183.033)	(60.225)	OCI NV	Bank of America	
						Merrill Lynch	14.034
				(19.715)	OCI NV	Citibank	23.430
				(100.227)	OCI NV	Credit Suisse	(279.772)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

				Plus-values/ (moins-values) latentes USD								Plus-values/ (moins-values) latentes USD															
Nombre	Description	Contrepartie			Nombre	Description	Contrepartie			Nombre	Description	Contrepartie															
Pays-Bas suite														Norvège suite													
501.429	PostNL NV	Bank of America			(7.799)	Gjensidige Forsikring ASA	Citibank		(571)	(65.136)	Gjensidige Forsikring ASA	JP Morgan		8.750													
293.937	PostNL NV	Merrill Lynch	(63.149)							154.074	Leroy Seafood Group ASA	Deutsche Bank		(47.039)													
537.557	PostNL NV	Citibank	(70.893)		108.258	Leroy Seafood Group ASA	Credit Suisse		(106.822)	108.258	Leroy Seafood Group ASA	Bank of America															
463.139	PostNL NV	JP Morgan	(140.925)		123.842	Leroy Seafood Group ASA	Bank of America					Merrill Lynch	(39.133)														
284.355	PostNL NV	Credit Suisse	(121.416)							80.111	Leroy Seafood Group ASA	Citibank	(14.479)														
40.346	Randstad NV	Deutsche Bank	(33.794)		262.228	Leroy Seafood Group ASA	JP Morgan		(218.928)	262.228	Leroy Seafood Group ASA	Bank of America															
78.955	Randstad NV	Citibank	(131.626)		(76.968)	Marine Harvest ASA	Merrill Lynch																				
10.339	Randstad NV	Bank of America	(201.328)							26.162	Norsk Hydro ASA	Bank of America	46.997														
21.322	Randstad NV	JP Morgan	(25.779)									Merrill Lynch															
27.710	Randstad NV	Credit Suisse	(53.165)									Bank of America															
65.594	SBM Offshore NV	Deutsche Bank	(64.433)									Merrill Lynch	11.597														
59.132	SBM Offshore NV	Citibank	(79.866)		86.208	Norsk Hydro ASA	JP Morgan		29.478	86.208	Norsk Hydro ASA	Bank of America															
39.817	SBM Offshore NV	Credit Suisse	(43.133)		703.304	Orkla ASA	Bank of America					Merrill Lynch	34.355														
97.647	SBM Offshore NV	JP Morgan	(40.707)							174.342	Orkla ASA	Citibank	6.387														
		Bank of America								57.024	Orkla ASA	Deutsche Bank	2.863														
10.856	Signify NV '144A'	Merrill Lynch	(78.504)							5.336	Salmar ASA	Deutsche Bank	(14.075)														
135.157	Signify NV '144A'	Credit Suisse	(23.274)							13.339	Salmar ASA	Bank of America															
126.572	Signify NV '144A'	Deutsche Bank	(110.877)									Merrill Lynch	(35.186)														
		Bank of America								76.798	Salmar ASA	Citibank	61.899														
183.722	Signify NV '144A'	Merrill Lynch	(140.102)							18.428	Salmar ASA	JP Morgan	(93.168)														
76.062	Signify NV '144A'	Citibank	(164.829)							15.162	Salmar ASA	Credit Suisse	(1.277)														
(67.213)	TomTom NV	JP Morgan	(163.067)							(19.504)	Schibsted ASA 'B'	Credit Suisse	(4.764)														
		Bank of America								(22.415)	Schibsted ASA 'B'	Citibank	16.424														
(31.870)	TomTom NV	Merrill Lynch	16.759							(12.651)	Schibsted ASA 'B'	JP Morgan	(3.090)														
(187.230)	TomTom NV	Citibank	13.591							(14.337)	Schibsted ASA 'B'	Deutsche Bank	4.128														
(125.973)	TomTom NV	JP Morgan	(4.799)							(40.083)	Schibsted ASA 'B'	Bank of America															
(119.364)	TomTom NV	Credit Suisse	(3.229)									Merrill Lynch	(2.690)														
		Deutsche Bank	29.762							11.871	Storebrand ASA	JP Morgan	(2.436)														
7.960	Unibail-Rodamco SE (Reit)	Citibank	(18.549)							11.933	Storebrand ASA	Deutsche Bank	(1.865)														
2.079	Unibail-Rodamco SE (Reit)	Credit Suisse	(15.866)							524.914	Subsea 7 SA	Bank of America															
1.985	Unibail-Rodamco SE (Reit)	Deutsche Bank	(8.329)									Merrill Lynch	217.949														
1.548	Unibail-Rodamco SE (Reit)	Bank of America								142.996	Subsea 7 SA	Credit Suisse	189.056														
		Merrill Lynch	(7.575)							126.160	Subsea 7 SA	Deutsche Bank	52.383														
815	Unibail-Rodamco SE (Reit)	JP Morgan	(6.220)							21.486	Subsea 7 SA	Citibank	(15.219)														
(47.397)	Unilever NV - CVA	Bank of America								131.400	Subsea 7 SA	JP Morgan	207.001														
		Merrill Lynch	(43.606)							72.742	Telenor ASA	Bank of America															
(14.138)	Unilever NV - CVA	Credit Suisse	(19.603)									Merrill Lynch	(23.039)														
(5.759)	Unilever NV - CVA	JP Morgan	(7.985)							86.228	Telenor ASA	Citibank	(25.799)														
(20.010)	Wereldhave NV (Reit)	JP Morgan	15.466							63.242	Telenor ASA	JP Morgan	(84.954)														
10.325	Wolters Kluwer NV	Bank of America								18.843	Telenor ASA	Deutsche Bank	(6.098)														
		Merrill Lynch	17.083							58.136	TGS Nopec																
16.449	Wolters Kluwer NV	Citibank	29.707								Geophysical Co ASA	Citibank	(38.338)														
19.424	Wolters Kluwer NV	JP Morgan	47.980							13.106	TGS Nopec	Credit Suisse	19.686														
69.891	Wolters Kluwer NV	Deutsche Bank	115.635							63.381	Geophysical Co ASA	Deutsche Bank	1.548														
			(8.517.482)								Geophysical Co ASA	Bank of America															
Norvège																											
(4.516)	Aker ASA 'A'	Deutsche Bank	(552)		171.739	TGS Nopec	Bank of America				Geophysical Co ASA	Merrill Lynch	4.195														
(7.795)	Aker ASA 'A'	JP Morgan	(30.462)							39.833	TGS Nopec																
(12.242)	Aker ASA 'A'	Citibank	53.820								Geophysical Co ASA	JP Morgan	59.832														
(28.416)	Aker ASA 'A'	Bank of America			(344.309)	Wallenius Wilhelmsen					Logistics	Deutsche Bank	93.400														
		Merrill Lynch	(3.470)							(69.009)	Yara International ASA	Bank of America															
(6.335)	Aker ASA 'A'	Credit Suisse	(24.756)									Merrill Lynch	38.627														
(27.379)	Aker BP ASA	JP Morgan	(55.503)							(12.930)	Yara International ASA	Credit Suisse	12.790														
14.917	DNB ASA	Bank of America			(136.110)	Yara International ASA	Deutsche Bank		109.661	(61.718)	Yara International ASA	JP Morgan	61.050														
26.966	DNB ASA	Merrill Lynch	(11.385)							(11.384)	Yara International ASA	Citibank	(278)														
4.454	DNB ASA	Credit Suisse	(20.582)										349.992														
19.416	DNB ASA	Deutsche Bank	(3.400)																								
35.199	DNB ASA	Citibank	(20.036)																								
78.193	Equinor ASA	JP Morgan	(26.866)																								
93.789	Equinor ASA	Citibank	(44.880)																								
35.031	Equinor ASA	JP Morgan	73.303																								
45.899	Equinor ASA	Credit Suisse	(15.911)																								
		Bank of America			(9.648.342)	Banco Comercial																					
		Merrill Lynch	(35.873)			Portugues SA 'R'	Credit Suisse		411.684	(3.002.201)	Banco Comercial	Deutsche Bank	100.514														
(19.055)	Gjensidige Forsikring ASA	Credit Suisse	2.560			Portugues SA 'R'				(6.828.422)	Banco Comercial																
(8.343)	Gjensidige Forsikring ASA	Deutsche Bank	1.121			Portugues SA 'R'	JP Morgan		303.924																		
(15.309)	Gjensidige Forsikring ASA	Bank of America																									
		Merrill Lynch	2.056																								

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Portugal suite				Singapour suite			
22.650	EDP - Energias de Portugal SA	Bank of America Merrill Lynch	(1.821)	(58.077)	DBS Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22.114
347.039	EDP - Energias de Portugal SA	Citibank	(31.944)	388.400	Genting Singapore Plc	Citibank	(14.499)
(92.964)	Galp Energia SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	114.686	2.405.100	Genting Singapore Plc	JP Morgan	178.845
(65.572)	Galp Energia SGPS SA	JP Morgan	29.032	5.994.500	Genting Singapore Plc	Credit Suisse	447.551
(111.498)	Galp Energia SGPS SA	Deutsche Bank	147.158	881.300	Genting Singapore Plc	Deutsche Bank	(33.483)
203.953	Jeronimo Martins SGPS SA	JP Morgan	(23.705)	549.700	Genting Singapore Plc	Bank of America Merrill Lynch	(24.624)
70.055	Jeronimo Martins SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(23.263)	(1.332.800)	Golden Agri-Resources Ltd	Deutsche Bank	34.828
76.141	Jeronimo Martins SGPS SA	Citibank	(36.133)	(58.200)	Hongkong Land Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6.402)
7.002	Jeronimo Martins SGPS SA	Credit Suisse	(41)	(305.800)	Hongkong Land Holdings Ltd	JP Morgan	16.240
38.806	Jeronimo Martins SGPS SA	Deutsche Bank	(12.886)	(152.800)	Hongkong Land Holdings Ltd	Citibank	(10.696)
(21.342)	NOS SGPS SA	Credit Suisse	7.211	(293.600)	Hongkong Land Holdings Ltd	Deutsche Bank	(32.785)
(370.239)	NOS SGPS SA	Deutsche Bank	105.258	510.200	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	Citibank	(28.061)
(502.862)	NOS SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	142.962	260.700	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(13.035)
(130.920)	NOS SGPS SA	Citibank	53.390	438.700	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	JP Morgan	(28.516)
(114.147)	NOS SGPS SA	JP Morgan	38.570	862.800	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	Deutsche Bank	(43.140)
1.448.474	Sonae SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(126.953)	30.100	Keppel Corp Ltd	JP Morgan	(7.191)
491.122	Sonae SGPS SA	JP Morgan	(46.351)	295.000	Keppel Corp Ltd	Citibank	(110.124)
233.192	Sonae SGPS SA	Citibank	(27.985)	125.800	Keppel Corp Ltd	Credit Suisse	(32.444)
1.366.514	Sonae SGPS SA	Credit Suisse	(130.783)	405.100	Keppel Corp Ltd	Deutsche Bank	(151.727)
671.531	Sonae SGPS SA	Deutsche Bank	(53.988)	711.900	Mapletree Commercial Trust (Reit)	Deutsche Bank	(13.900)
			938.536	1.866.300	Mapletree Commercial Trust (Reit)	Citibank	(27.868)
Singapour				402.200	Mapletree Commercial Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(9.009)
55.500	Ascendas Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(414)	488.800	Mapletree Commercial Trust (Reit)	JP Morgan	(10.948)
1.341.200	Ascendas Real Estate Investment Trust (Reit)	Credit Suisse	(9.951)	963.500	Mapletree Commercial Trust (Reit)	Credit Suisse	(15.011)
956.000	Ascendas Real Estate Investment Trust (Reit)	Deutsche Bank	(7.138)	1.496.800	Mapletree Industrial Trust (Reit)	Deutsche Bank	(11.175)
263.700	Ascendas Real Estate Investment Trust (Reit)	Citibank	(2.214)	2.268.500	Mapletree Industrial Trust (Reit)	Citibank	16.937
393.400	Ascendas Real Estate Investment Trust (Reit)	JP Morgan	(5.874)	576.200	Mapletree Industrial Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(4.302)
735.900	CapitaLand Commercial Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(21.977)	2.101.000	Mapletree Industrial Trust (Reit)	JP Morgan	2.331
1.156.800	CapitaLand Commercial Trust (Reit)	JP Morgan	(51.820)	399.300	Mapletree Industrial Trust (Reit)	Credit Suisse	1.467
200.400	CapitaLand Commercial Trust (Reit)	Credit Suisse	(8.977)	530.700	Mapletree Logistics Trust (Reit)	Citibank	3.962
60.900	CapitaLand Commercial Trust (Reit)	Deutsche Bank	(1.819)	1.405.300	Mapletree Logistics Trust (Reit)	Deutsche Bank	–
(107.600)	CapitaLand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12.050	1.420.800	Mapletree Logistics Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	–
(204.800)	CapitaLand Ltd	Citibank	19.878	3.400	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.320)
(405.400)	CapitaLand Ltd	Deutsche Bank	35.788	895.400	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	JP Morgan	(346.157)
(1.130.600)	CapitaLand Ltd	JP Morgan	168.822	589.900	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	Deutsche Bank	(229.019)
2.117.800	CapitaLand Mall Trust (Reit)	Deutsche Bank	(63.246)	844.500	SATS Ltd	Credit Suisse	(214.372)
1.860.600	CapitaLand Mall Trust (Reit)	Credit Suisse	–	427.200	SATS Ltd	Citibank	(75.695)
2.131.200	CapitaLand Mall Trust (Reit)	JP Morgan	–	386.700	SATS Ltd	Deutsche Bank	(103.827)
2.673.300	CapitaLand Mall Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(79.836)	239.500	SATS Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(71.525)
1.476.500	CapitaLand Mall Trust (Reit)	Citibank	(29.873)	931.200	SATS Ltd	JP Morgan	(241.625)
(186.000)	City Developments Ltd	Deutsche Bank	113.216	(2.596.800)	Sembcorp Industries Ltd	Deutsche Bank	286.670
(71.100)	City Developments Ltd	JP Morgan	72.194	(278.400)	Sembcorp Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	33.257
(14.000)	City Developments Ltd	Citibank	6.585	(323.100)	Sembcorp Industries Ltd	Citibank	31.360
(18.300)	City Developments Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13.799	(1.493.800)	Sembcorp Industries Ltd	JP Morgan	144.986
1.580.900	ComfortDelGro Corp Ltd	Deutsche Bank	124.092				
3.084.100	ComfortDelGro Corp Ltd	Citibank	161.182				
546.100	ComfortDelGro Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	44.849				
1.114.300	ComfortDelGro Corp Ltd	Credit Suisse	130.488				
(800)	DBS Group Holdings Ltd	Deutsche Bank	305				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Singapour suite				Corée du Sud			
293.500	Singapore Airlines Ltd	Bank of America		(5.572)	Amorepacific Corp	Credit Suisse	79.956
		Merrill Lynch	56.973	(20.281)	Amorepacific Corp	Citibank	(90.129)
348.600	Singapore Airlines Ltd	Credit Suisse	3.925	(974)	Amorepacific Corp	Deutsche Bank	(7.043)
235.400	Singapore Airlines Ltd	Deutsche Bank	45.695	(1.854)	Amorepacific Corp	Bank of America	
603.700	Singapore Airlines Ltd	Citibank	(166.768)			Merrill Lynch	(13.407)
308.400	Singapore Airlines Ltd	JP Morgan	29.933	(171)	Amorepacific Corp	JP Morgan	2.449
(133.400)	Singapore Post Ltd	Credit Suisse	–	(1.384)	BGF retail Co Ltd	Citibank	(5.047)
(939.500)	Singapore Post Ltd	Citibank	14.029	(2.315)	BGF retail Co Ltd	Deutsche Bank	15.471
(1.479.500)	Singapore Post Ltd	JP Morgan	–	(7.821)	BGF retail Co Ltd	JP Morgan	52.535
(1.286.700)	Singapore Post Ltd	Deutsche Bank	28.820	(76.093)	BNK Financial Group Inc	JP Morgan	51.732
(450.400)	Singapore Press Holdings Ltd	Citibank	33.627	(40.032)	BNK Financial Group Inc	Credit Suisse	27.251
464.400	Singapore Technologies Engineering Ltd	Bank of America		(18.024)	BNK Financial Group Inc	Deutsche Bank	12.677
		Merrill Lynch	31.205	(234.351)	BNK Financial Group Inc	Citibank	162.013
2.010.600	Singapore Technologies Engineering Ltd	Citibank	25.360	(4.161)	Celltrion Healthcare Co Ltd	JP Morgan	(87.638)
1.364.800	Singapore Technologies Engineering Ltd	JP Morgan	20.379	(15.035)	Celltrion Healthcare Co Ltd	Citibank	(135.534)
402.000	Singapore Technologies Engineering Ltd	Credit Suisse	6.003	(9.538)	CJ CheilJedang Corp	Credit Suisse	(62.187)
830.300	Singapore Technologies Engineering Ltd	Deutsche Bank	55.791	(403)	CJ CheilJedang Corp	Bank of America	
(1.903.900)	Singapore Telecommunications Ltd	Bank of America		(1.456)	CJ CheilJedang Corp	Merrill Lynch	863
		Merrill Lynch	213.219	(4.148)	CJ CheilJedang Corp	JP Morgan	(10.226)
(2.644.500)	Singapore Telecommunications Ltd	JP Morgan	413.961	2.349	CJ Corp	Deutsche Bank	8.886
(981.900)	Singapore Telecommunications Ltd	Citibank	87.971	1.124	CJ Corp	Bank of America	
1.138.000	StarHub Ltd	Deutsche Bank	(177.706)	21.017	CJ Corp	Merrill Lynch	(43.853)
191.100	StarHub Ltd	Bank of America		12.009	CJ Corp	Citibank	(15.752)
		Merrill Lynch	(29.962)	9.545	CJ Corp	JP Morgan	(291.905)
57.400	StarHub Ltd	Citibank	(9.428)	(17.069)	CJ Logistics Corp	Credit Suisse	(163.977)
916.200	StarHub Ltd	JP Morgan	(225.732)	(3.664)	CJ Logistics Corp	Deutsche Bank	(167.151)
378.700	Suntec Real Estate Investment Trust (Reit)	Citibank	–	(16.305)	CJ Logistics Corp	Citibank	96.982
399.900	Suntec Real Estate Investment Trust (Reit)	Credit Suisse	(32.842)	(3.298)	CJ Logistics Corp	Credit Suisse	9.194
1.130.600	Suntec Real Estate Investment Trust (Reit)	Deutsche Bank	(50.647)	(6.165)	CJ Logistics Corp	JP Morgan	46.017
699.300	Suntec Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America				Deutsche Bank	69.264
		Merrill Lynch	(31.326)	25.441	Coway Co Ltd	Bank of America	
1.550.000	Suntec Real Estate Investment Trust (Reit)	JP Morgan	(127.296)	8.746	Coway Co Ltd	Merrill Lynch	129.475
331.000	United Overseas Bank Ltd	Credit Suisse	(296.551)	6.027	Coway Co Ltd	JP Morgan	(52.860)
252.800	United Overseas Bank Ltd	Deutsche Bank	(242.853)	2.778	Coway Co Ltd	Bank of America	
86.200	UOL Group Ltd	Citibank	(16.733)	19.568	Coway Co Ltd	Merrill Lynch	(32.770)
67.500	UOL Group Ltd	Bank of America		10.225	Daelim Industrial Co Ltd	Citibank	617
		Merrill Lynch	(24.190)			Credit Suisse	(3.916)
85.000	UOL Group Ltd	Credit Suisse	(29.192)	16.363	Daelim Industrial Co Ltd	Deutsche Bank	(73.319)
286.200	UOL Group Ltd	Deutsche Bank	(102.565)	22.044	Daelim Industrial Co Ltd	Bank of America	
336.100	UOL Group Ltd	JP Morgan	(115.429)	33.679	Daelim Industrial Co Ltd	Merrill Lynch	(36.291)
(500.700)	Wilmar International Ltd	JP Morgan	7.476	10.409	Daelim Industrial Co Ltd	Citibank	(31.761)
(3.214.000)	Wilmar International Ltd	Deutsche Bank	(141.214)	17.801	DB Insurance Co Ltd	JP Morgan	(7.597)
(701.600)	Wilmar International Ltd	Citibank	(5.238)			Deutsche Bank	(119.535)
1.541.300	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	Bank of America				Credit Suisse	(126)
		Merrill Lynch	(224.394)			Bank of America	
3.704.000	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	JP Morgan	(677.527)	21.120	DB Insurance Co Ltd	Merrill Lynch	(41.721)
4.399.600	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	Credit Suisse	(804.765)	34.230	DB Insurance Co Ltd	Citibank	(20.697)
620.500	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	Deutsche Bank	(41.143)	23.043	DB Insurance Co Ltd	JP Morgan	(97.713)
2.336.400	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	Citibank	(148.271)	28.726	DB Insurance Co Ltd	Credit Suisse	(65.705)
821.100	Yanlord Land Group Ltd	Bank of America		(3.406)	Dongsuh Cos Inc	Deutsche Bank	(67.327)
		Merrill Lynch	–			Bank of America	
667.100	Yanlord Land Group Ltd	Credit Suisse	24.903	(42.249)	Dongsuh Cos Inc	Merrill Lynch	6.490
574.900	Yanlord Land Group Ltd	Citibank	(17.169)	(10.792)	Dongsuh Cos Inc	Citibank	17.102
1.645.000	Yanlord Land Group Ltd	Deutsche Bank	(6.028)	(26.801)	Dongsuh Cos Inc	JP Morgan	13.768
319.700	Yanlord Land Group Ltd	JP Morgan	11.934	(996)	E-MART Inc	Credit Suisse	34.479
			(2.705.588)	5.639	GS Holdings Corp	Credit Suisse	15.740
				7.153	GS Holdings Corp	JP Morgan	(10.858)
				2.987	GS Holdings Corp	Citibank	(17.605)
				11.885	GS Holdings Corp	Deutsche Bank	(8.389)
				1.442	GS Holdings Corp	Bank of America	
				(15.602)	GS Retail Co Ltd	Merrill Lynch	(33.381)
						Credit Suisse	(2.784)
						Bank of America	
				(43.910)	GS Retail Co Ltd	Merrill Lynch	7.846
				(40.260)	GS Retail Co Ltd	JP Morgan	26.643
				(3.772)	GS Retail Co Ltd	Citibank	(51.829)
				(14.485)	GS Retail Co Ltd	Deutsche Bank	1.897
				4.669	Hana Financial Group Inc	Credit Suisse	24.231
				1.630	Hana Financial Group Inc	JP Morgan	(16.272)
						Citibank	(3.771)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
4.886	Hana Financial Group Inc	Bank of America		(2.010)	Hyundai Heavy		
		Merrill Lynch	(19.128)		Industries Holdings Co Ltd	JP Morgan	41.981
3.225	Hana Financial Group Inc	Deutsche Bank	(12.625)	(2.216)	Hyundai Heavy		
36.035	Hankook Tire Co Ltd	Bank of America			Industries Holdings Co Ltd	Citibank	42.173
		Merrill Lynch	(158.005)	(14.141)	Hyundai Mobis Co Ltd	Citibank	372.638
25.345	Hankook Tire Co Ltd	Citibank	(103.126)	(968)	Hyundai Mobis Co Ltd	Deutsche Bank	19.207
12.634	Hankook Tire Co Ltd	JP Morgan	(62.334)	(4.386)	Hyundai Motor Co	Bank of America	
3.658	Hankook Tire Co Ltd	Deutsche Bank	(16.039)			Merrill Lynch	40.904
12.234	Hankook Tire Co Ltd	Credit Suisse	(56.140)	(8.277)	Hyundai Motor Co	Credit Suisse	68.532
(2.477)	Hanmi Science Co Ltd	Citibank	3.046	(9.596)	Hyundai Motor Co	JP Morgan	153.077
(9.679)	Hanmi Science Co Ltd	JP Morgan	12.010	(58.784)	Hyundai Motor Co	Citibank	280.971
(841)	Hanmi Science Co Ltd	Bank of America		(2.515)	Hyundai Motor Co	Deutsche Bank	23.455
		Merrill Lynch	4.122	(29.104)	Hyundai Steel Co	Citibank	12.146
(8.543)	Hanon Systems	JP Morgan	6.448	(11.239)	Hyundai Steel Co	Credit Suisse	11.900
(153.679)	Hanon Systems	Credit Suisse	116.146	5.392	Industrial Bank of Korea	Bank of America	
(28.958)	Hanon Systems	Citibank	(653)			Merrill Lynch	(5.813)
(33.162)	Hanon Systems	Bank of America		73.301	Industrial Bank of Korea	Citibank	(51.717)
		Merrill Lynch	24.316	35.543	Industrial Bank of Korea	Credit Suisse	(25.456)
(25.941)	Hanon Systems	Deutsche Bank	19.021	51.037	Industrial Bank of Korea	Deutsche Bank	(55.026)
(28.796)	Hanssem Co Ltd	Citibank	(33.913)	91.727	Industrial Bank of Korea	JP Morgan	(65.565)
(6.828)	Hanssem Co Ltd	JP Morgan	(40.327)	(16.240)	Kakao Corp	Bank of America	
(1.134)	Hanssem Co Ltd	Credit Suisse	(6.687)			Merrill Lynch	172.147
(2.941)	Hanssem Co Ltd	Bank of America		(16.163)	Kakao Corp	Credit Suisse	129.713
		Merrill Lynch	(7.067)	(11.434)	Kakao Corp	JP Morgan	91.651
61.760	Hanwha Chemical Corp	Credit Suisse	(89.066)	(78.490)	Kakao Corp	Citibank	635.617
27.695	Hanwha Chemical Corp	Citibank	(39.411)	(105.687)	Kangwon Land Inc	Citibank	52.351
10.340	Hanwha Chemical Corp	JP Morgan	(14.717)	(5.144)	Kangwon Land Inc	Credit Suisse	10.446
125.351	Hanwha Chemical Corp	Deutsche Bank	(398.941)	36.882	KB Financial Group Inc	Credit Suisse	(191.475)
35.227	Hanwha Chemical Corp	Bank of America		7.909	KB Financial Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(122.871)			Merrill Lynch	(41.920)
94.817	Hanwha Life Insurance Co Ltd	Bank of America		58.564	KB Financial Group Inc	Citibank	(188.342)
		Merrill Lynch	(45.969)	24.695	KB Financial Group Inc	JP Morgan	(152.879)
270.629	Hanwha Life Insurance Co Ltd	JP Morgan	(102.303)	18.441	KB Financial Group Inc	Deutsche Bank	(97.742)
231.829	Hanwha Life Insurance Co Ltd	Citibank	(82.936)	(292)	KCC Corp	Bank of America	
149.048	Hanwha Life Insurance Co Ltd	Credit Suisse	(56.420)			Merrill Lynch	8.504
171.848	Hanwha Life Insurance Co Ltd	Deutsche Bank	(77.332)	(6.816)	KCC Corp	Credit Suisse	284.692
(5.831)	Hyosung Corp	Citibank	(7.140)	(1.823)	KCC Corp	JP Morgan	76.082
(8.939)	Hyosung Corp	Deutsche Bank	20.786	(507)	KCC Corp	Deutsche Bank	14.766
(3.513)	Hyosung Corp	JP Morgan	(5.979)	48.230	Kia Motors Corp	Bank of America	
(18.970)	Hyosung Corp	Credit Suisse	(24.230)			Merrill Lynch	(115.218)
18.624	Hyundai Development			37.396	Kia Motors Corp	Citibank	(83.921)
	Co-Engineering &			29.287	Kia Motors Corp	Deutsche Bank	(69.965)
	Construction	Citibank	1.929	(52.373)	Korea Aerospace	Bank of America	
13.096	Hyundai Development				Industries Ltd	Merrill Lynch	(48.119)
	Co-Engineering &			(23.266)	Korea Aerospace		
	Construction	JP Morgan	(707)	(69.607)	Industries Ltd	Citibank	(16.281)
19.905	Hyundai Development				Korea Aerospace	JP Morgan	71.903
	Co-Engineering &	Credit Suisse	(1.154)	(209.544)	Korea Aerospace		
	Construction			(3.911)	Industries Ltd	Credit Suisse	164.056
12.295	Hyundai Development	Deutsche Bank	(1.971)		Korea Aerospace	Deutsche Bank	(3.593)
3.475	Hyundai Engineering &			16.488	Korea Electric Power Corp	Deutsche Bank	(60.229)
	Construction Co Ltd	JP Morgan	34.239	5.480	Korea Electric Power Corp	Bank of America	
4.619	Hyundai Engineering &					Merrill Lynch	(20.018)
	Construction Co Ltd	Citibank	21.707	18.615	Korea Electric Power Corp	Citibank	(47.720)
(4.331)	Hyundai Glovis Co Ltd	Credit Suisse	87.227	34.651	Korea Electric Power Corp	JP Morgan	(117.204)
(14.884)	Hyundai Glovis Co Ltd	Citibank	112.614	9.634	Korea Electric Power Corp	Credit Suisse	(32.617)
(71.327)	Hyundai Heavy			8.602	Korea Investment		
	Industries Co Ltd	Citibank	773.889		Holdings Co Ltd	Credit Suisse	45.337
(358)	Hyundai Heavy			6.230	Korea Investment	Bank of America	
	Industries Co Ltd	JP Morgan	4.204		Holdings Co Ltd	Merrill Lynch	(10.143)
(7.179)	Hyundai Heavy	Bank of America		14.125	Korea Investment		
	Industries Co Ltd	Merrill Lynch	66.345		Holdings Co Ltd	Citibank	4.268
(1.582)	Hyundai Heavy			1.838	Korea Investment		
	Industries Co Ltd	Deutsche Bank	14.620		Holdings Co Ltd	JP Morgan	9.701
(21.948)	Hyundai Heavy			18.367	Korea Investment		
	Industries Holdings Co Ltd	Credit Suisse	439.887		Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(29.902)
(308)	Hyundai Heavy			(2.363)	Korea Zinc Co Ltd	Credit Suisse	59.487
	Industries Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	12.745	(304)	Korea Zinc Co Ltd	Bank of America	
						Merrill Lynch	12.739

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
(1.446)	Korea Zinc Co Ltd	JP Morgan	37.618	(25.975)	Netmarble Corp '144A'	JP Morgan	(538.111)
(1.750)	Korea Zinc Co Ltd	Citibank	37.285	(29.981)	Netmarble Corp '144A'	Deutsche Bank	(472.276)
1.543	KT Corp	Bank of America		(10.407)	Netmarble Corp '144A'	Citibank	(114.406)
		Merrill Lynch	(503)	(29.761)	NH Investment & Securities Co Ltd	Credit Suisse	9.442
313	KT Corp	Deutsche Bank	(102)	(4.103)	Orion Corp/Republic of Korea	Bank of America	
770	KT Corp	Citibank	(132)			Merrill Lynch	(15.356)
72.953	KT Corp	JP Morgan	(26.008)	(6.415)	Orion Corp/Republic of Korea	Credit Suisse	(25.778)
3.504	KT&G Corp	Bank of America		(21.902)	Orion Corp/Republic of Korea	JP Morgan	(73.628)
		Merrill Lynch	(9.319)	(143)	Ottogi Corp	Bank of America	
1.194	KT&G Corp	Citibank	(4.164)			Merrill Lynch	(7.988)
2.351	KT&G Corp	JP Morgan	(2.446)	(738)	Ottogi Corp	Citibank	(26.605)
7.596	KT&G Corp	Credit Suisse	(7.967)	4.482	POSCO	Bank of America	
2.638	KT&G Corp	Deutsche Bank	(7.016)			Merrill Lynch	(134.632)
(1.172)	LG Chem Ltd	Credit Suisse	(4.803)	4.040	POSCO	Citibank	(45.543)
(623)	LG Chem Ltd	Citibank	2.412	4.922	POSCO	JP Morgan	(91.094)
25.715	LG Corp	Bank of America		3.873	POSCO	Credit Suisse	(71.800)
		Merrill Lynch	(157.371)	12.519	POSCO	Deutsche Bank	(376.051)
24.767	LG Corp	Citibank	(87.625)	20.313	S-1 Corp	Credit Suisse	(79.392)
70.539	LG Corp	JP Morgan	(215.394)	16.881	S-1 Corp	JP Morgan	(70.728)
36.084	LG Corp	Credit Suisse	(107.221)	6.696	S-1 Corp	Citibank	(12.931)
66.163	LG Corp	Deutsche Bank	(401.359)	6.722	S-1 Corp	Bank of America	
41.883	LG Display Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(39.608)
		Merrill Lynch	(40.262)	7.414	S-1 Corp	Deutsche Bank	(43.685)
138.018	LG Display Co Ltd	Citibank	(57.025)	(22.195)	S-Oil Corp	Credit Suisse	(27.539)
17.851	LG Display Co Ltd	JP Morgan	(2.948)	(42.974)	S-Oil Corp	Citibank	188.540
42.560	LG Display Co Ltd	Credit Suisse	(10.575)	(6.509)	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	JP Morgan	(386.666)
27.891	LG Display Co Ltd	Deutsche Bank	(26.811)	(13.454)	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	Citibank	(455.077)
10.749	LG Electronics Inc	JP Morgan	(24.122)	(7.329)	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	Credit Suisse	(435.144)
5.532	LG Electronics Inc	Credit Suisse	(24.010)	(2.872)	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	Bank of America	
29.423	LG Electronics Inc	Bank of America		(6.890)	Samsung C&T Corp	Merrill Lynch	(120.035)
		Merrill Lynch	(119.002)	(10.227)	Samsung C&T Corp	Credit Suisse	15.930
38.354	LG Electronics Inc	Citibank	(208.591)			Bank of America	
13.719	LG Electronics Inc	Deutsche Bank	(55.487)	(102.758)	Samsung C&T Corp	Merrill Lynch	33.003
1.433	LG Household & Health Care Ltd	Citibank	132.935	(15.758)	Samsung C&T Corp	Citibank	399.154
2.795	LG Household & Health Care Ltd	Credit Suisse	160.682	(5.876)	Samsung C&T Corp	JP Morgan	31.574
3.549	LG Household & Health Care Ltd	Deutsche Bank	201.636	(6.173)	Samsung Card Co Ltd	Deutsche Bank	18.962
1.735	Lotte Chemical Corp	Bank of America		(118)	Samsung Card Co Ltd	Credit Suisse	13.475
		Merrill Lynch	(19.980)			Bank of America	
6.860	Lotte Chemical Corp	Citibank	(51.495)	(1.933)	Samsung Card Co Ltd	Merrill Lynch	235
1.881	Lotte Chemical Corp	JP Morgan	(26.980)	(5.995)	Samsung Card Co Ltd	JP Morgan	4.213
2.568	Lotte Chemical Corp	Credit Suisse	(43.194)	(1.507)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Deutsche Bank	11.933
2.131	Lotte Chemical Corp	Deutsche Bank	(24.540)	(7.482)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Bank of America	
(68.932)	Lotte Corp	Credit Suisse	165.131	(24.259)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Merrill Lynch	(11.230)
(18.019)	Lotte Corp	Citibank	4.313			JP Morgan	(123.928)
(7.051)	Lotte Corp	JP Morgan	16.854	(2.789)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Citibank	(141.960)
(9.999)	Lotte Corp	Deutsche Bank	18.783	(187)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Credit Suisse	(46.167)
(11.764)	Lotte Corp	Bank of America				Deutsche Bank	(1.393)
		Merrill Lynch	22.099	53.850	Samsung Electronics Co Ltd	JP Morgan	(74.611)
(3.025)	Lotte Shopping Co Ltd	JP Morgan	30.291	7.500	Samsung Electronics Co Ltd	Credit Suisse	(13.712)
(1.660)	Lotte Shopping Co Ltd	Bank of America		58.000	Samsung Electronics Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	20.606			Merrill Lynch	70.849
(3.237)	Lotte Shopping Co Ltd	Deutsche Bank	40.182	101.883	Samsung Electronics Co Ltd	Citibank	(92.187)
(22.309)	Lotte Shopping Co Ltd	Citibank	(11.155)	257.935	Samsung Electronics Co Ltd	Deutsche Bank	295.482
(536.064)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	Credit Suisse	123.803	3.407	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	Bank of America	
(73.152)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	Citibank	18.775	5.356	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	Merrill Lynch	(48.949)
(39.511)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	Deutsche Bank	23.357	2.132	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	Credit Suisse	(106.160)
(20.868)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	Bank of America				Deutsche Bank	(30.631)
		Merrill Lynch	12.336	2.115	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	JP Morgan	(41.871)
(214.054)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	JP Morgan	49.266	2.744	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	Citibank	(27.669)
(3.160)	NAVER Corp	Credit Suisse	110.459				
(9.923)	NAVER Corp	Citibank	122.931				
(476)	NAVER Corp	Deutsche Bank	19.716				
641	NCSOFT Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	(1.080)				
490	NCSOFT Corp	Citibank	840				
440	NCSOFT Corp	Credit Suisse	4.302				
3.994	NCSOFT Corp	Deutsche Bank	(6.731)				
(14.183)	Netmarble Corp '144A'	Credit Suisse	(293.657)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Corée du Sud suite				Espagne			
(231.234)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	JP Morgan	77.188	(11.024)	Acciona SA	Deutsche Bank	25.325
(917.716)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Citibank	298.900	(3.035)	Acciona SA	Bank of America	
(490.636)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Credit Suisse	164.111	(48.572)	Acerinox SA	Merrill Lynch	8.515
(361.405)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Bank of America		(22.026)	Acerinox SA	Deutsche Bank	9.055
3.285	Samsung Life Insurance Co Ltd	Merrill Lynch	93.483	(22.155)	Acerinox SA	Bank of America	4.106
20	Samsung Life Insurance Co Ltd	Citibank	(22.046)	27.840	ACS Actividades de Construcccion y Servicios SA	Citibank	7.486
(6.632)	Samsung SDI Co Ltd	Deutsche Bank	(184)	59.859	ACS Actividades de Construcccion y Servicios SA	Merrill Lynch	(23.355)
(8.458)	Samsung SDI Co Ltd	Bank of America	(23.194)	104.275	ACS Actividades de Construcccion y Servicios SA	Citibank	(59.817)
(2.098)	Samsung SDI Co Ltd	Merrill Lynch	(93.577)	78.944	ACS Actividades de Construcccion y Servicios SA	JP Morgan	(47.383)
(25.313)	Samsung SDI Co Ltd	Credit Suisse	(31.665)	36.849	ACS Actividades de Construcccion y Servicios SA	Credit Suisse	(51.277)
(1.804)	Samsung SDI Co Ltd	JP Morgan	82.375	8.116	ACS Actividades de Construcccion y Servicios SA	Deutsche Bank	(30.913)
1.392	Samsung SDS Co Ltd	Citibank	(6.309)	3.376	Aena SME SA '144A'	Credit Suisse	(97.857)
10.319	Samsung SDS Co Ltd	Deutsche Bank	(12.032)	2.503	Aena SME SA '144A'	Citibank	(26.945)
8.901	Samsung SDS Co Ltd	JP Morgan	(30.627)		Aena SME SA '144A'	Bank of America	
12.498	Samsung Securities Co Ltd	Credit Suisse	(18.718)	1.357	Aena SME SA '144A'	Merrill Lynch	(25.865)
21.685	Samsung Securities Co Ltd	JP Morgan	9.331	3.816	Aena SME SA '144A'	Deutsche Bank	(24.428)
52.818	Samsung Securities Co Ltd	Deutsche Bank	(12.773)	(1.933)	Almirall (Right)	JP Morgan	(59.135)
29.307	Samsung Securities Co Ltd	Citibank	(5.426)	(335.660)	Almirall (Right)	Citibank	20
14.434	Shinhan Financial Group Co Ltd	Credit Suisse	24.212		Almirall (Right)	Bank of America	
18.249	Shinhan Financial Group Co Ltd	Bank of America	(60.646)	(4.127)	Almirall (Right)	Merrill Lynch	(79.001)
19.467	Shinhan Financial Group Co Ltd	Merrill Lynch	(55.171)	(200.747)	Almirall (Right)	JP Morgan	(971)
17.017	Shinhan Financial Group Co Ltd	JP Morgan	(56.650)	(1.933)	Almirall SA	Deutsche Bank	(47.248)
35.676	Shinhan Financial Group Co Ltd	Citibank	(51.515)	(4.127)	Almirall SA	Citibank	1.396
(11.832)	SillaJen Inc	Deutsche Bank	(149.898)	(397.807)	Almirall SA	JP Morgan	(3.510)
(11.156)	SillaJen Inc	Merrill Lynch	(161.479)	(251.412)	Amadeus IT Group SA	Bank of America	121.629
(15.824)	SillaJen Inc	JP Morgan	(152.317)	22.712	Amadeus IT Group SA	Deutsche Bank	50.541
5.951	SK Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(92.174)	63.908	Amadeus IT Group SA	Bank of America	85.740
1.603	SK Holdings Co Ltd	Citibank	(123.678)	44.222	Amadeus IT Group SA	Merrill Lynch	85.740
2.955	SK Holdings Co Ltd	JP Morgan	(33.273)	114.400	Amadeus IT Group SA	Citibank	111.694
9.300	SK Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(70.241)	2.577	Amadeus IT Group SA	JP Morgan	209.107
3.614	SK Holdings Co Ltd	Citibank	(205.115)	67.413	Amadeus IT Group SA	Credit Suisse	515.168
57.958	SK Hynix Inc	Deutsche Bank	(85.905)		Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	Deutsche Bank	9.728
27.267	SK Hynix Inc	Bank of America	526.245	44.671	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	Credit Suisse	(46.488)
47.324	SK Hynix Inc	Merrill Lynch	214.627	196.056	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	Deutsche Bank	(23.161)
54.476	SK Hynix Inc	Credit Suisse	(73.346)	86.006	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	Bank of America	(101.445)
7.289	SK Innovation Co Ltd	JP Morgan	495.022	19.462	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	Merrill Lynch	
4.525	SK Innovation Co Ltd	Citibank	8.386	17.854	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Citibank	(46.096)
13.300	SK Innovation Co Ltd	Bank of America	6.268	45.282	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Bank of America	(19.932)
5.768	SK Innovation Co Ltd	Merrill Lynch	70.935		Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Merrill Lynch	(18.847)
5.830	SK Innovation Co Ltd	Citibank	30.664	485.365	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Credit Suisse	(18.847)
16.854	SK Telecom Co Ltd	JP Morgan	6.707	(1.312.748)	Banco de Sabadell SA	Deutsche Bank	(46.376)
16.721	SK Telecom Co Ltd	Credit Suisse	(98.613)		Banco de Sabadell SA	Citibank	105.187
9.131	SK Telecom Co Ltd	Deutsche Bank	(30.400)	(764.652)	Banco de Sabadell SA	Bank of America	420.626
2.970	SK Telecom Co Ltd	Citibank	(53.246)	(859.785)	Banco de Sabadell SA	Merrill Lynch	420.626
8.838	SK Telecom Co Ltd	JP Morgan	1.870	(1.326.376)	Banco de Sabadell SA	JP Morgan	208.479
29.511	Woori Bank	Deutsche Bank	5.565	(338.001)	Banco de Sabadell SA	Credit Suisse	234.416
47.003	Woori Bank	Merrill Lynch	(12.648)	(252.060)	Banco Santander SA	Deutsche Bank	319.499
56.381	Woori Bank	Citibank	(6.861)	(37.258)	Banco Santander SA	Citibank	244.823
1.577	Yuhan Corp	JP Morgan	(8.859)		Banco Santander SA	JP Morgan	225.699
11.222	Yuhan Corp	Bank of America	2.374	(411.177)	Banco Santander SA	Bank of America	
13.027	Yuhan Corp	Merrill Lynch	107.443	(170.389)	Banco Santander SA	Merrill Lynch	36.965
6.941	Yuhan Corp	JP Morgan	141.367	(1.607.838)	Bankia SA	Credit Suisse	359.824
17.312	Yuhan Corp	Credit Suisse	10.450		Bankia SA	Deutsche Bank	169.047
		Deutsche Bank	57.262	(557.715)	Bankia SA	Bank of America	856.250
		Citibank	(2.846.822)	(406.197)	Bankia SA	Merrill Lynch	209.495
				(287.531)	Bankia SA	Citibank	194.991
					Bankia SA	Deutsche Bank	156.453

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Espagne suite				Espagne suite			
(136.112)	Bankia SA	JP Morgan	48.053	92.591	Gestamp Automocion SA '144A'	Deutsche Bank	7.552
139.736	Bankinter SA	Bank of America		110.960	Gestamp Automocion SA '144A'	Citibank	(33.018)
219.287	Bankinter SA	Merrill Lynch	(154.021)	(15.742)	Grifols SA	Deutsche Bank	(4.823)
48.653	Bankinter SA	Citibank	(165.054)	(20.010)	Grifols SA	Citibank	(6.528)
14.214	Bankinter SA	Credit Suisse	(28.571)	36.932	Grupo Catalana Occidente SA	Citibank	(51.638)
40.458	Bankinter SA	Deutsche Bank	(15.667)	16.924	Grupo Catalana Occidente SA	JP Morgan	(21.268)
(30.885)	Bankinter SA	JP Morgan	(26.906)	3.435	Grupo Catalana Occidente SA	Credit Suisse	(4.603)
	Bolsas y Mercados			14.091	Grupo Catalana Occidente SA	Bank of America	
(105.298)	Espanoles SHMSF SA	Citibank	18.721	635	Grupo Catalana Occidente SA	Merrill Lynch	(13.275)
(331.364)	CaixaBank SA	Credit Suisse	67.110	217.953	Iberdrola SA	Deutsche Bank	(592)
	CaixaBank SA	Bank of America		34.824	Iberdrola SA	Credit Suisse	(113.261)
(105.690)	CaixaBank SA	Merrill Lynch	220.349			Bank of America	
(55.666)	CaixaBank SA	Citibank	63.543	47.449	Indra Sistemas SA	Merrill Lynch	(18.259)
(23.263)	CaixaBank SA	JP Morgan	35.478	195.103	Indra Sistemas SA	Credit Suisse	(32.436)
(151.913)	Cellnex Telecom SA '144A'	Deutsche Bank	16.642			Bank of America	
(43.304)	Cellnex Telecom SA '144A'	Credit Suisse	219.482	17.666	Indra Sistemas SA	Deutsche Bank	(80.016)
(231.505)	Cellnex Telecom SA '144A'	Deutsche Bank	88.297	(36.622)	Industria de Diseno Textil SA	Credit Suisse	(3.911)
		Bank of America		(100.705)	Industria de Diseno Textil SA	Credit Suisse	(20.055)
(42.158)	Cellnex Telecom SA '144A'	Merrill Lynch	400.415	(105.798)	Industria de Diseno Textil SA	Deutsche Bank	(65.708)
(135.249)	Cellnex Telecom SA '144A'	Citibank	46.664			Bank of America	
4.314	Cia de Distribucion Integral	JP Morgan	195.366			Merrill Lynch	(56.989)
	Logista Holdings SA	Citibank	4.524	(111.146)	Industria de Diseno Textil SA	Citibank	7.770
4.330	Cia de Distribucion Integral	JP Morgan	11.654	(94.711)	Industria de Diseno Textil SA	JP Morgan	(51.866)
12.382	Cia de Distribucion Integral			(30.670)	International Consolidated		
	Logista Holdings SA	Deutsche Bank	14.715		Airlines Group SA	JP Morgan	7.004
7.644	Cia de Distribucion Integral			188.375	Mapfre SA	Bank of America	
(30.813)	Logista Holdings SA	Credit Suisse	20.574	163.284	Mapfre SA	Merrill Lynch	(63.429)
	CIE Automotive SA	Bank of America		126.874	Mapfre SA	Citibank	(55.553)
(2.122)	CIE Automotive SA	Merrill Lynch	3.590	4.266	Mapfre SA	JP Morgan	(44.644)
(21.685)	CIE Automotive SA	Citibank	2.571	19.061	Mapfre SA	Credit Suisse	(1.501)
(942)	CIE Automotive SA	JP Morgan	(22.234)	179.268	Mediaset Espana	Deutsche Bank	(6.418)
(9.607)	CIE Automotive SA	Credit Suisse	(966)		Comunicacion SA	Bank of America	
384.988	CIE Automotive SA	Deutsche Bank	1.119	72.187	Mediaset Espana	Merrill Lynch	(101.095)
	Distribuidora Internacional				Comunicacion SA	Citibank	(48.110)
	de Alimentacion SA	Citibank	(89.714)	377.838	Mediaset Espana		
209.901	Distribuidora Internacional	JP Morgan	(147.514)	348.098	Comunicacion SA	JP Morgan	(216.473)
114.045	Distribuidora Internacional	Bank of America			Comunicacion SA	Deutsche Bank	(206.712)
193.666	Distribuidora Internacional	Merrill Lynch	(47.969)	96.940	Mediaset Espana		
	de Alimentacion SA	Credit Suisse	(168.786)		Comunicacion SA	Credit Suisse	(53.312)
180.432	Distribuidora Internacional			(67.636)	Melia Hotels International SA	Credit Suisse	18.235
	de Alimentacion SA	Deutsche Bank	(55.241)	(28.788)	Melia Hotels International SA	Bank of America	
134.769	Ebro Foods SA	Bank of America				Merrill Lynch	1.006
		Merrill Lynch	116.199	(43.714)	Melia Hotels International SA	Deutsche Bank	1.528
41.755	Ebro Foods SA	Citibank	19.460	(73.416)	Melia Hotels International SA	Citibank	(1.711)
11.285	Ebro Foods SA	JP Morgan	6.311	(158.301)	Melia Hotels International SA	JP Morgan	72.121
68.166	Ebro Foods SA	Deutsche Bank	58.773	(108.779)	Prosegur Cia de Seguridad SA	Citibank	30.419
622	Ebro Foods SA	Credit Suisse	348	(277.931)	Prosegur Cia de Seguridad SA	JP Morgan	78.393
65.463	Endesa SA	Bank of America		(86.565)	Prosegur Cia de Seguridad SA	Credit Suisse	37.319
		Merrill Lynch	(73.605)	(47.108)	Prosegur Cia de Seguridad SA	Bank of America	
554	Endesa SA	Citibank	(810)			Merrill Lynch	7.684
26.823	Endesa SA	JP Morgan	(27.659)	(60.323)	Prosegur Cia de Seguridad SA	Deutsche Bank	9.840
14.182	Endesa SA	Deutsche Bank	(15.946)	48.433	Red Electrica Corp SA	Credit Suisse	(40.913)
140.120	Endesa SA	Credit Suisse	(155.273)	13.188	Red Electrica Corp SA	Deutsche Bank	(5.563)
(16.152)	Ferrovial SA	Credit Suisse	2.960	331.098	Repsol SA	Bank of America	
(339.628)	Ferrovial SA	JP Morgan	172.137			Merrill Lynch	(190.960)
(57.519)	Ferrovial SA	Bank of America		230.089	Repsol SA	Citibank	(245.301)
		Merrill Lynch	9.481	216.435	Repsol SA	JP Morgan	29.001
(57.519)	Ferrovial SA (Right)	Bank of America		320.958	Repsol SA	Deutsche Bank	(185.112)
(339.628)	Ferrovial SA (Right)	Merrill Lynch	(20.970)	33.942	Repsol SA	Credit Suisse	(10.619)
(1.756)	Gas Natural SDG SA	JP Morgan	(123.820)	(46.441)	Siemens Gamesa Renewable		
(49.388)	Gas Natural SDG SA	JP Morgan	921		Energy SA	Credit Suisse	34.090
(119.003)	Gas Natural SDG SA	Credit Suisse	43.744	(120.650)	Siemens Gamesa Renewable		
		Bank of America			Energy SA	JP Morgan	88.562
(106.849)	Gas Natural SDG SA	Merrill Lynch	140.043	(490.831)	Siemens Gamesa Renewable	Bank of America	
333.845	Gestamp Automocion	Deutsche Bank	126.653		Energy SA	Merrill Lynch	408.902
	SA '144A'	Bank of America		(2.495)	Siemens Gamesa Renewable		
		Merrill Lynch	27.628		Energy SA	Citibank	3.227

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Espagne suite				Suède suite			
(595.843)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Deutsche Bank	471.150	75.992	Boliden AB	Citibank	78
324.631	Telefonica SA	Bank of America		19.789	Boliden AB	JP Morgan	12.858
		Merrill Lynch	(201.226)	52.498	Castellum AB	Citibank	(595)
386.667	Telefonica SA	Citibank	(194.176)	54.171	Castellum AB	Credit Suisse	(12.897)
647.753	Telefonica SA	JP Morgan	(530.158)	69.391	Castellum AB	Deutsche Bank	(16.128)
146.935	Telefonica SA	Deutsche Bank	(61.200)	28.042	Castellum AB	Bank of America	
81.601	Telefonica SA	Credit Suisse	(76.422)	108.275	Castellum AB	Merrill Lynch	(6.517)
12.779	Viscofan SA	Bank of America		70.622	Electrolux AB 'B'	JP Morgan	(8.626)
		Merrill Lynch	(8.189)			Bank of America	
31.849	Viscofan SA	Citibank	(37.109)	98.049	Electrolux AB 'B'	Merrill Lynch	(69.658)
12.208	Viscofan SA	JP Morgan	(14.029)	95.503	Electrolux AB 'B'	Citibank	(86.706)
30.009	Viscofan SA	Credit Suisse	(10.028)	49.078	Electrolux AB 'B'	Credit Suisse	(135.617)
21.410	Viscofan SA	Deutsche Bank	(13.720)	67.814	Electrolux AB 'B'	Deutsche Bank	(41.821)
(106.327)	Zardoya Otis SA	Citibank	53.891	(20.203)	Elektta AB 'B'	JP Morgan	(89.953)
(9.203)	Zardoya Otis SA	Bank of America		(86.886)	Elektta AB 'B'	Deutsche Bank	(13.399)
		Merrill Lynch	3.968			Bank of America	
(202.242)	Zardoya Otis SA	JP Morgan	112.023	(58.030)	Elektta AB 'B'	Merrill Lynch	(57.626)
(61.848)	Zardoya Otis SA	Credit Suisse	27.972	(69.440)	Essity AB 'B'	JP Morgan	(38.816)
(194.304)	Zardoya Otis SA	Deutsche Bank	83.766			Bank of America	
			3.277.507	(42.261)	Essity AB 'B'	Merrill Lynch	56.683
				(22.759)	Essity AB 'B'	Deutsche Bank	33.230
				32.880	Fabege AB	JP Morgan	16.772
						Bank of America	
				16.014	Fabege AB	Merrill Lynch	8.723
(1.582)	AAK AB	Credit Suisse	(3.139)	48.356	Fabege AB	Credit Suisse	4.067
(23.461)	AAK AB	Deutsche Bank	(72.647)	63.146	Fabege AB	Citibank	9.868
(6.353)	AAK AB	Citibank	(12.965)	31.872	Fabege AB	Deutsche Bank	16.752
(19.012)	AAK AB	Bank of America		10.828	Fastighets AB Balder 'B'	JP Morgan	8.094
		Merrill Lynch	(57.119)			Bank of America	
(32.919)	AAK AB	JP Morgan	(65.312)	14.806	Fastighets AB Balder 'B'	Merrill Lynch	(2.946)
1.632	Ahlsell AB '144A'	Credit Suisse	(65)	86.281	Fastighets AB Balder 'B'	JP Morgan	5.529
273.492	Ahlsell AB '144A'	Citibank	(13.953)	20.335	Fastighets AB Balder 'B'	Credit Suisse	5.869
84.027	Ahlsell AB '144A'	Deutsche Bank	(1.748)	54.262	Fastighets AB Balder 'B'	Citibank	6.455
81.213	Ahlsell AB '144A'	JP Morgan	(3.223)	(87.772)	Getinge AB 'B'	Deutsche Bank	(4.757)
98.431	Ahlsell AB '144A'	Bank of America		(223.838)	Getinge AB 'B'	Citibank	7.961
		Merrill Lynch	928			Bank of America	
(11.892)	Alfa Laval AB	Credit Suisse	12.404	(37.818)	Getinge AB 'B'	Merrill Lynch	1.992
(37.575)	Alfa Laval AB	Bank of America		(92.751)	Getinge AB 'B'	Credit Suisse	13.291
		Merrill Lynch	34.506	(39.165)	Hennes & Mauritz AB 'B'	Deutsche Bank	1.682
(117.018)	Assa Abloy AB 'B'	Deutsche Bank	663	(219.622)	Hennes & Mauritz AB 'B'	Citibank	55.148
(77.859)	Assa Abloy AB 'B'	Bank of America		(31.335)	Hexagon AB 'B'	JP Morgan	402.371
		Merrill Lynch	1.376	(7.200)	Hexagon AB 'B'	Credit Suisse	(46.705)
(144.915)	Assa Abloy AB 'B'	Credit Suisse	9.036	(41.039)	Hexagon AB 'B'	Deutsche Bank	(8.489)
(53.192)	Assa Abloy AB 'B'	Citibank	20.202	(31.748)	Hexagon AB 'B'	JP Morgan	(50.482)
(134.013)	Assa Abloy AB 'B'	JP Morgan	6.275			Bank of America	
32.968	Atlas Copco AB 'A'	JP Morgan	23.174	(29.201)	Hexagon AB 'B'	Merrill Lynch	(37.433)
13.186	Atlas Copco AB 'A'	Bank of America		(172.909)	Hexpol AB	Citibank	(15.229)
		Merrill Lynch	(5.531)	(38.348)	Hexpol AB	Credit Suisse	19.603
213.759	Atlas Copco AB 'A'	Citibank	(292.025)	(92.016)	Hexpol AB	Deutsche Bank	1.739
120.987	Atlas Copco AB 'A'	Citibank	110			Bank of America	
32.968	Atlas Copco AB 'A'	JP Morgan	29.815	(95.366)	Hexpol AB	Merrill Lynch	4.173
13.186	Atlas Copco AB 'A'	Bank of America		(164.748)	Hexpol AB	Citibank	18.921
		Merrill Lynch	(34)	73.826	Holmen AB 'B'	JP Morgan	18.678
86.894	Atlas Copco AB 'A'	Credit Suisse	(15.834)			Bank of America	
75.217	Atlas Copco AB 'A'	Credit Suisse	68.024	54.150	Holmen AB 'B'	Merrill Lynch	(35.518)
(64.545)	BillerudKorsnas AB	Deutsche Bank	(1.822)	66.827	Holmen AB 'B'	Credit Suisse	(11.664)
(15.309)	BillerudKorsnas AB	Citibank	(5.895)	19.320	Holmen AB 'B'	Citibank	(18.269)
(59.888)	BillerudKorsnas AB	JP Morgan	3.224	55.528	Holmen AB 'B'	Deutsche Bank	(3.943)
(40.624)	BillerudKorsnas AB	Bank of America		13.378	Hufvudstaden AB 'A'	JP Morgan	(9.512)
(172.639)	BillerudKorsnas AB	Merrill Lynch	(47.394)	14.484	Hufvudstaden AB 'A'	Credit Suisse	(5.764)
		Bank of America				Bank of America	
189.251	Boliden AB	Merrill Lynch	(248.889)	33.205	Hufvudstaden AB 'A'	Merrill Lynch	(4.434)
		Credit Suisse	(12.782)	72.869	Hufvudstaden AB 'A'	Citibank	(2.259)
13.264	Boliden AB	Citibank	(122.770)	9.184	Hufvudstaden AB 'A'	JP Morgan	(31.393)
75.992	Boliden AB	Deutsche Bank	(52.597)	(95.177)	Husqvarna AB 'B'	Deutsche Bank	(2.811)
39.994	Boliden AB	JP Morgan	(25.936)			Bank of America	
27.426	Boliden AB	Bank of America		(55.105)	Husqvarna AB 'B'	Merrill Lynch	(12.733)
189.251	Boliden AB	Merrill Lynch	122.964	(25.192)	Husqvarna AB 'B'	JP Morgan	1.249
		Deutsche Bank	25.986	(8.993)	ICA Gruppen AB	Citibank	2.171
39.994	Boliden AB	Credit Suisse	8.618			Bank of America	
13.264	Boliden AB					Merrill Lynch	6.933

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

				Plus-values/ (moins-values) latentes USD								Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Suède suite								Suède suite							
(5.944)	ICA Gruppen AB	Deutsche Bank	4.582	(52.528)	Nibe Industrier AB 'B'	Citibank	13.697	(100.350)	ICA Gruppen AB	Citibank	44.370	(426.653)	Nibe Industrier AB 'B'	JP Morgan	139.047
(131.800)	ICA Gruppen AB	JP Morgan	97.127	(111.030)	Nordea Bank AB	JP Morgan	52.253	(2.148)	ICA Gruppen AB	Credit Suisse	1.583	(81.513)	Nordea Bank AB	Credit Suisse	36.592
(86.281)	Industrivarden AB 'C'	JP Morgan	78.518	(499.014)	Nordea Bank AB	Deutsche Bank	359.815	(46.882)	Industrivarden AB 'C'	Deutsche Bank	41.515	(84.327)	Nordea Bank AB	Bank of America	
(159.335)	Industrivarden AB 'C'	Bank of America				Merrill Lynch	60.804			Merrill Lynch	125.547	(68.976)	Nordea Bank AB	Citibank	40.351
(61.818)	Industrivarden AB 'C'	Credit Suisse	77.165	174.078	Peab AB	Deutsche Bank	(90.798)	(8.321)	Indutrade AB	Bank of America		49.328	Peab AB	Credit Suisse	(15.659)
(27.837)	Indutrade AB	Merrill Lynch	(5.283)	158.032	Peab AB	Bank of America				Merrill Lynch	(13.886)			Bank of America	
(8.252)	Intrum AB	JP Morgan				Merrill Lynch	(80.624)			JP Morgan		197.362	Peab AB	Citibank	(59.650)
		Bank of America				Citibank	(59.650)			Bank of America	12.911	54.376	Peab AB	JP Morgan	(17.261)
(76.867)	Intrum AB	Credit Suisse	166.449	(16.328)	Saab AB 'B'	Citibank	(20.363)	(60.346)	Intrum AB	Deutsche Bank	94.414	(19.150)	Saab AB 'B'	Citibank	(20.363)
(89.611)	Intrum AB	JP Morgan	194.046	(22.982)	Saab AB 'B'	JP Morgan	(35.823)	(14.921)	Investor AB 'B'	Deutsche Bank	22.931	(6.025)	Saab AB 'B'	JP Morgan	(35.823)
(34.828)	Investor AB 'B'	Deutsche Bank	22.931	(6.025)	Saab AB 'B'	Deutsche Bank	(63.315)	(34.828)	Investor AB 'B'	Credit Suisse	122.405	260.305	Sandvik AB	Credit Suisse	(11.271)
(73.166)	Investor AB 'B'	Credit Suisse	122.405	260.305	Sandvik AB	Credit Suisse	(101.333)	(73.166)	Investor AB 'B'	Deutsche Bank		23.137	Sandvik AB	Deutsche Bank	(13.378)
		Bank of America		23.137	Sandvik AB	Deutsche Bank	(13.378)			Bank of America	121.738	151.356	Sandvik AB	Bank of America	
(27.033)	Investor AB 'B'	Merrill Lynch	121.738	151.356	Sandvik AB	Bank of America				Merrill Lynch	60.377			Merrill Lynch	(87.514)
(21.034)	Investor AB 'B'	Citibank	60.377			Citibank	(87.514)			Citibank	73.925	281.509	Sandvik AB	Citibank	(314.368)
68.154	JM AB	JP Morgan	73.925	281.509	Sandvik AB	JP Morgan	(1.110)			JP Morgan	(157.030)	27.977	Securitas AB 'B'	JP Morgan	(1.110)
50.567	JM AB	Credit Suisse	(157.030)	27.977	Securitas AB 'B'	Credit Suisse	7.305			Credit Suisse		19.825	Securitas AB 'B'	Deutsche Bank	7.305
		Bank of America		19.825	Securitas AB 'B'	Deutsche Bank	7.305			Bank of America	(53.030)	164.778	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Credit Suisse	(75.146)
72.394	JM AB	Merrill Lynch	(53.030)	164.778	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Credit Suisse	(75.146)			Merrill Lynch	(14.774)		Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Citibank	(28.763)
69.478	JM AB	JP Morgan	(14.774)			Citibank	(28.763)			JP Morgan	(118.548)	50.338	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	JP Morgan	167.787
92.698	JM AB	Citibank	(118.548)	50.338	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	JP Morgan	167.787			Citibank	(97.212)			Bank of America	
(32.144)	Kinnevik AB 'B'	Deutsche Bank	(97.212)			Bank of America				Deutsche Bank	52.842	(195.976)	Skanska AB 'B'	Merrill Lynch	61.602
(7.338)	Kinnevik AB 'B'	Credit Suisse	52.842	(195.976)	Skanska AB 'B'	Merrill Lynch	61.602			Credit Suisse	10.732	(122.103)	Skanska AB 'B'	Deutsche Bank	85.262
(20.737)	Kinnevik AB 'B'	Deutsche Bank	10.732	(122.103)	Skanska AB 'B'	Deutsche Bank	85.262			Deutsche Bank	44.669			Bank of America	
(76.689)	Kinnevik AB 'B'	Citibank	44.669			Bank of America				Citibank	126.070	(169.000)	Skanska AB 'B'	Merrill Lynch	61.602
18.854	L E Lundbergforetagen AB 'B'	JP Morgan	126.070	(169.000)	Skanska AB 'B'	Deutsche Bank	85.262			JP Morgan	(23.085)	(118.483)	Skanska AB 'B'	Deutsche Bank	85.262
2.222	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Citibank	(23.085)	(118.483)	Skanska AB 'B'	Credit Suisse	121.016			Citibank	(5.101)	22.386	SKF AB 'B'	Credit Suisse	121.016
14.582	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Credit Suisse	(5.101)	22.386	SKF AB 'B'	Credit Suisse	(33.755)			Credit Suisse	(30.088)	43.547	SKF AB 'B'	Credit Suisse	(33.755)
18.776	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Deutsche Bank	(30.088)	43.547	SKF AB 'B'	Deutsche Bank	(67.391)			Deutsche Bank		14.279	SKF AB 'B'	Deutsche Bank	(67.391)
		Bank of America		14.279	SKF AB 'B'	Citibank	(25.902)			Citibank	(36.762)	13.197	SKF AB 'B'	Citibank	(25.902)
		Merrill Lynch	(36.762)	13.197	SKF AB 'B'	JP Morgan	(19.899)			JP Morgan	(20.662)	76.704	SKF AB 'B'	JP Morgan	(19.899)
9.000	L E Lundbergforetagen AB 'B'	JP Morgan	(20.662)	76.704	SKF AB 'B'	Bank of America				Bank of America				Merrill Lynch	(123.235)
36.167	Loomis AB 'B'	Merrill Lynch				Merrill Lynch	(123.235)			Merrill Lynch	22.142	233.789	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Credit Suisse	(28.626)
20.540	Loomis AB 'B'	Credit Suisse	22.142	233.789	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Credit Suisse	(28.626)			Credit Suisse	(932)	153.791	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Citibank	(36.964)
20.540	Loomis AB 'B'	Citibank	(932)	153.791	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Citibank	(36.964)			Citibank	4.560	90.066	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Deutsche Bank	(31.858)
9.142	Loomis AB 'B'	Deutsche Bank	4.560	90.066	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Deutsche Bank	(31.858)			Deutsche Bank		492.187	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	JP Morgan	(60.265)
1.506	Loomis AB 'B'	JP Morgan	922	492.187	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	JP Morgan	(60.265)			JP Morgan	20.429	46.752	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Credit Suisse	(13.145)
45.045	Loomis AB 'B'	Bank of America		46.752	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Credit Suisse	(13.145)			Credit Suisse	103.950	(46.312)	Sweco AB 'B'	Citibank	(3.150)
		Merrill Lynch	20.429	(46.312)	Sweco AB 'B'	Citibank	(3.150)			Citibank	(3.568)	(28.273)	Sweco AB 'B'	Deutsche Bank	(12.246)
44.294	Lundin Petroleum AB	Credit Suisse	103.950	(28.273)	Sweco AB 'B'	Deutsche Bank	(12.246)			Deutsche Bank		(84.102)	Sweco AB 'B'	JP Morgan	(136.648)
78.680	Lundin Petroleum AB	Deutsche Bank	(3.568)	(84.102)	Sweco AB 'B'	JP Morgan	(136.648)			JP Morgan	159.954	(47.408)	Sweco AB 'B'	Credit Suisse	(63.899)
68.158	Lundin Petroleum AB	JP Morgan	159.954	(47.408)	Sweco AB 'B'	Credit Suisse	(63.899)			Credit Suisse	(573)	15.447	Swedbank AB 'A'	Bank of America	
500	Lundin Petroleum AB	Citibank	(573)	15.447	Swedbank AB 'A'	Bank of America				Bank of America				Merrill Lynch	(17.075)
81.273	Lundin Petroleum AB	Bank of America				Merrill Lynch	(17.075)			Merrill Lynch	(3.686)	10.037	Swedbank AB 'A'	Credit Suisse	(9.128)
		Merrill Lynch	(3.686)			Credit Suisse	(9.128)			Credit Suisse		1.779	Swedbank AB 'A'	Deutsche Bank	(1.967)
(718)	Modern Times Group MTG AB 'B'	Credit Suisse	961	1.779	Swedbank AB 'A'	Deutsche Bank	(1.967)			Deutsche Bank		6.426	Swedbank AB 'A'	JP Morgan	(4.736)
(38.555)	Modern Times Group MTG AB 'B'	Deutsche Bank	39.340	6.426	Swedbank AB 'A'	JP Morgan	(4.736)			JP Morgan		3.620	Swedbank AB 'A'	Citibank	(3.632)
(45.204)	Modern Times Group MTG AB 'B'	JP Morgan	49.553	3.620	Swedbank AB 'A'	Citibank	(3.632)			Citibank		56.906	Swedish Match AB	Bank of America	
(21.017)	Modern Times Group MTG AB 'B'	Bank of America		56.906	Swedish Match AB	Bank of America				Bank of America				Merrill Lynch	11.613
(30.087)	Modern Times Group MTG AB 'B'	Merrill Lynch	28.836			Merrill Lynch	11.613			Merrill Lynch	98.238	62.397	Swedish Match AB	Citibank	(5.659)
		Citibank	98.238			Citibank	(5.659)			Citibank	15.008	135.626	Swedish Match AB	JP Morgan	107.573
37.680	NCC AB 'B'	Credit Suisse	15.008			JP Morgan	107.573			JP Morgan	16.466	45.390	Swedish Match AB	Credit Suisse	50.431
59.282	NCC AB 'B'	Deutsche Bank	16.466			Credit Suisse	50.431			Credit Suisse		61.327	Swedish Match AB	Deutsche Bank	12.515
76.714	NCC AB 'B'	Bank of America				Deutsche Bank	12.515			Deutsche Bank		40.029	Swedish Orphan Biovitrum AB	Credit Suisse	(27.229)
		Merrill Lynch	826			Citibank	(5.690)			Citibank		37.177	Swedish Orphan Biovitrum AB	Citibank	(5.690)
45.495	NCC AB 'B'	Citibank	(11.347)			Credit Suisse	(63.392)			Credit Suisse		77.659	Tele2 AB 'B'	Credit Suisse	(63.392)
42.306	NCC AB 'B'	JP Morgan	8.686			Tele2 AB 'B'	(63.392)			Tele2 AB 'B'		(287.949)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Credit Suisse	158.786
(380.688)	Nibe Industrier AB 'B'	Credit Suisse	126.026			Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	158.786			Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'		(621.242)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Deutsche Bank	198.206
(41.607)	Nibe Industrier AB 'B'	Deutsche Bank	15.189			Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	198.206			Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'		(219.610)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	JP Morgan	129.967
(385)	Nibe Industrier AB 'B'	Bank of America				Telia Co AB				Telia Co AB		(245.930)	Telia Co AB	Citibank	54.369
		Merrill Lynch	141												

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Suède suite				Suisse suite			
(51.268)	Telia Co AB	Bank of America		3.420	Bucher Industries AG Reg	JP Morgan	(74.644)
		Merrill Lynch	9.433	10.434	Cembra Money Bank AG	Bank of America	
(241.302)	Telia Co AB	JP Morgan	43.290			Merrill Lynch	(44.988)
(7.609)	Trelleborg AB 'B'	Credit Suisse	15.485	22.448	Cembra Money Bank AG	Credit Suisse	(93.370)
(13.766)	Trelleborg AB 'B'	JP Morgan	28.014	2.649	Cembra Money Bank AG	Citibank	(8.062)
(29.715)	Trelleborg AB 'B'	Bank of America		9.186	Cembra Money Bank AG	JP Morgan	(34.459)
		Merrill Lynch	40.595	(25.984)	Cie Financiere Richemont		
47.842	Volvo AB 'B'	Bank of America			SA Reg	Citibank	48.504
		Merrill Lynch	(30.103)	(6.495)	Cie Financiere Richemont	Bank of America	
154.491	Volvo AB 'B'	Citibank	(155.884)		SA Reg	Merrill Lynch	42.293
95.676	Volvo AB 'B'	Deutsche Bank	(64.562)	(33.948)	Cie Financiere Richemont		
113.162	Volvo AB 'B'	JP Morgan	(58.374)		SA Reg	JP Morgan	117.276
(19.757)	Wallenstam AB 'B'	JP Morgan	5.712	(39.590)	Cie Financiere Richemont		
					SA Reg	Credit Suisse	181.543
			749.243	(30.083)	Cie Financiere Richemont		
					SA Reg		
Suisse				(65.018)	Clariant AG Reg	Deutsche Bank	185.558
68.212	ABB Ltd Reg	Deutsche Bank	(95.964)			Bank of America	
1.622	Adecco Group AG Reg	Credit Suisse	(7.635)			Merrill Lynch	17.872
20.265	Adecco Group AG Reg	Deutsche Bank	(85.114)	(94.061)	Clariant AG Reg	Citibank	76.340
18.779	Adecco Group AG Reg	JP Morgan	(88.053)	(53.236)	Clariant AG Reg	Credit Suisse	19.911
62.618	Adecco Group AG Reg	Bank of America		(105)	Cosmo Pharmaceuticals NV	Credit Suisse	4.005
		Merrill Lynch	(262.999)	(6.092)	Cosmo Pharmaceuticals NV	Bank of America	
120.502	Adecco Group AG Reg	Citibank	(537.541)			Merrill Lynch	22.249
5.299	Allreal Holding AG Reg	Credit Suisse	(26.342)	(14.937)	Cosmo Pharmaceuticals NV	Citibank	277.313
5.354	Allreal Holding AG Reg	Citibank	(10.320)	(10.079)	Cosmo Pharmaceuticals NV	JP Morgan	384.468
1.470	Allreal Holding AG Reg	Bank of America		(52.725)	Credit Suisse Group AG Reg	Citibank	99.491
		Merrill Lynch	(6.264)	(97.661)	Credit Suisse Group AG Reg	JP Morgan	154.561
4.828	Allreal Holding AG Reg	Deutsche Bank	(20.572)	(23.064)	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America	
2.445	Allreal Holding AG Reg	JP Morgan	(12.154)			Merrill Lynch	34.089
(38.893)	ams AG	Bank of America		(263.640)	Credit Suisse Group AG Reg	Deutsche Bank	510.858
		Merrill Lynch	252.526	(457)	Dormakaba Holding AG	Citibank	13.445
(29.117)	ams AG	Citibank	171.786	(880)	Dormakaba Holding AG	Bank of America	
(18.211)	ams AG	Credit Suisse	155.192			Merrill Lynch	14.234
(32.436)	ams AG	Deutsche Bank	210.602	(19.891)	Dufry AG Reg	JP Morgan	216.930
(99.010)	Aryzta AG	Bank of America		(7.705)	Dufry AG Reg	Credit Suisse	64.464
		Merrill Lynch	644.112	(4.680)	Dufry AG Reg	Bank of America	
(94.752)	Aryzta AG	JP Morgan	682.980			Merrill Lynch	47.954
(5.537)	Aryzta AG	Citibank	32.552	(42.016)	Dufry AG Reg	Citibank	332.479
(28.859)	Aryzta AG	Credit Suisse	208.018	(213.531)	EFG International AG	Credit Suisse	76.939
(18.063)	Aryzta AG	Deutsche Bank	124.885	(124.964)	EFG International AG	Citibank	27.891
13.491	Baloise Holding AG Reg	Credit Suisse	(130.995)	(71.124)	EFG International AG	Deutsche Bank	23.811
12.376	Baloise Holding AG Reg	Deutsche Bank	(107.978)	(29.616)	EFG International AG	JP Morgan	13.521
9.838	Baloise Holding AG Reg	Bank of America		(93)	Emmi AG Reg	Deutsche Bank	(1.227)
		Merrill Lynch	(85.834)	(262)	Emmi AG Reg	JP Morgan	(8.107)
18.622	Baloise Holding AG Reg	Citibank	(181.365)	(613)	Emmi AG Reg	Citibank	(8.085)
11.871	Baloise Holding AG Reg	JP Morgan	(114.391)	(8.402)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Bank of America	
282	Banque Cantonale					Merrill Lynch	136.382
	Vaudoise Reg	Credit Suisse	(6.866)	(643)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Citibank	14.677
585	Banque Cantonale			(2.892)	EMS-Chemie Holding AG Reg	JP Morgan	27.449
	Vaudoise Reg	Deutsche Bank	(15.431)	(1.685)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Credit Suisse	8.547
573	Banque Cantonale			(2.002)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Deutsche Bank	30.124
	Vaudoise Reg	JP Morgan	(13.951)	(457)	Flughafen Zuerich AG Reg	Credit Suisse	278
2.227	Banque Cantonale	Bank of America		(11.212)	Flughafen Zuerich AG Reg	JP Morgan	6.825
	Vaudoise Reg	Merrill Lynch	(58.742)	(10.810)	Flughafen Zuerich AG Reg	Bank of America	
380	Banque Cantonale					Merrill Lynch	70.188
	Vaudoise Reg	Citibank	(7.710)	(2.726)	Flughafen Zuerich AG Reg	Citibank	13.275
(310)	Barry Callebaut AG Reg	Citibank	10.693	(5.721)	Flughafen Zuerich AG Reg	Deutsche Bank	37.146
(434)	Barry Callebaut AG Reg	JP Morgan	42.709	756	Forbo Holding AG Reg	JP Morgan	(40.649)
(98)	Barry Callebaut AG Reg	Credit Suisse	9.644	811	Forbo Holding AG Reg	Bank of America	
10.722	BKW AG	Bank of America				Merrill Lynch	(27.151)
		Merrill Lynch	(60.914)	41	Forbo Holding AG Reg	Deutsche Bank	(1.373)
1.919	BKW AG	Citibank	(7.982)	101.168	GAM Holding AG	Citibank	(138.558)
1.710	BKW AG	Credit Suisse	(6.245)	100.211	GAM Holding AG	Bank of America	
4.798	BKW AG	Deutsche Bank	(27.259)			Merrill Lynch	(167.491)
4.912	BKW AG	JP Morgan	(17.940)	19.318	GAM Holding AG	JP Morgan	(25.478)
6.780	Bucher Industries AG Reg	Credit Suisse	(156.827)	42.520	GAM Holding AG	Deutsche Bank	(72.901)
7.173	Bucher Industries AG Reg	Deutsche Bank	(154.274)	65.905	GAM Holding AG	Credit Suisse	(80.236)
4.455	Bucher Industries AG Reg	Bank of America		(2.756)	Geberit AG Reg	Credit Suisse	43.897
		Merrill Lynch	(87.396)	(626)	Geberit AG Reg	Deutsche Bank	7.804
4.243	Bucher Industries AG Reg	Citibank	(105.031)	(1.300)	Geberit AG Reg	Bank of America	
						Merrill Lynch	17.013

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Suisse suite				Suisse suite			
(5.833)	Geberit AG Reg	Citibank	93.498	37.627	PSP Swiss Property AG Reg	Citibank	(7.767)
(3.139)	Geberit AG Reg	JP Morgan	49.997	3.826	PSP Swiss Property AG Reg	JP Morgan	(13.003)
1.176	Georg Fischer AG Reg	Bank of America		14.669	PSP Swiss Property AG Reg	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.965			Merrill Lynch	(29.655)
613	Georg Fischer AG Reg	Credit Suisse	13.682	2.654	PSP Swiss Property AG Reg	Credit Suisse	(9.020)
1.334	Georg Fischer AG Reg	Deutsche Bank	(11.165)	23.034	Roche Holding AG	Credit Suisse	(287.428)
531	Georg Fischer AG Reg	Citibank	(45.251)	13.066	Roche Holding AG	Citibank	(139.183)
2.046	Georg Fischer AG Reg	JP Morgan	39.895	30.237	Roche Holding AG	Bank of America	
(1.408)	Givaudan SA Reg	Bank of America				Merrill Lynch	(355.407)
		Merrill Lynch	77.294	7.310	Roche Holding AG	JP Morgan	(91.217)
(556)	Givaudan SA Reg	Citibank	24.255	28.250	Roche Holding AG	Deutsche Bank	(352.516)
(580)	Givaudan SA Reg	Credit Suisse	15.887	1.630	SFS Group AG	Citibank	(8.232)
(607)	Givaudan SA Reg	Deutsche Bank	36.075	(249)	SFS Group AG	JP Morgan	1.263
1.369	Helvetia Holding AG Reg	Bank of America		1.584	SFS Group AG	Credit Suisse	(11.266)
		Merrill Lynch	(54.166)	159	SGS SA Reg	Credit Suisse	11.291
1.341	Helvetia Holding AG Reg	Citibank	(51.017)	1.040	SGS SA Reg	Citibank	(15.137)
773	Helvetia Holding AG Reg	Credit Suisse	(29.016)	683	SGS SA Reg	Deutsche Bank	42.960
401	Helvetia Holding AG Reg	Deutsche Bank	(15.866)	1.452	SGS SA Reg	JP Morgan	103.115
1.144	Helvetia Holding AG Reg	JP Morgan	(42.942)	815	SGS SA Reg	Bank of America	
(45.553)	Idorsia Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	51.263
		Merrill Lynch	(61.002)	199	Sika AG	Bank of America	
(58.413)	Idorsia Ltd	Deutsche Bank	(78.224)			Merrill Lynch	(43.406)
15.145	Julius Baer Group Ltd	Citibank	(79.589)	107	Sika AG	JP Morgan	(22.997)
15.248	Julius Baer Group Ltd	JP Morgan	(45.479)	1.925	Sonova Holding AG Reg	Deutsche Bank	16.893
14.312	Julius Baer Group Ltd	Deutsche Bank	(70.856)	9.220	Sonova Holding AG Reg	JP Morgan	88.965
4.584	Kuehne + Nagel International AG Reg	Deutsche Bank	(21.160)	6	Straumann Holding AG Reg	Credit Suisse	(189)
11.418	Kuehne + Nagel International AG Reg	Bank of America		584	Straumann Holding AG Reg	Bank of America	
		Merrill Lynch	(52.706)			Merrill Lynch	(19.552)
13.718	Kuehne + Nagel International AG Reg	Citibank	(36.184)	2.766	Straumann Holding AG Reg	Citibank	(42.092)
5.711	Kuehne + Nagel International AG Reg	JP Morgan	(41.716)	(796)	Sulzer AG Reg	Bank of America	
600	Kuehne + Nagel International AG Reg	Credit Suisse	(4.383)	(8.057)	Sulzer AG Reg	Merrill Lynch	–
7.455	Logitech International SA Reg	Deutsche Bank	44.155	(2.801)	Sulzer AG Reg	JP Morgan	2.131
1.335	Logitech International SA Reg	Bank of America		(11.455)	Sulzer AG Reg	Deutsche Bank	–
		Merrill Lynch	(176)	(9.617)	Sulzer AG Reg	Citibank	42.773
27.742	Logitech International SA Reg	Citibank	(7.318)	(4.865)	Sunrise Communications Group AG '144A'	JP Morgan	1.464
38.247	Logitech International SA Reg	JP Morgan	(2.328)	(36.800)	Sunrise Communications Group AG '144A'	Credit Suisse	(2.295)
(13.893)	Lonza Group AG Reg	Credit Suisse	(63.425)		Sunrise Communications Group AG '144A'	Bank of America	
(9.828)	Lonza Group AG Reg	Citibank	53.841	4.211	Swiss Life Holding AG Reg	Merrill Lynch	20.419
(4.682)	Lonza Group AG Reg	Deutsche Bank	(3.040)			Bank of America	
(11.707)	Lonza Group AG Reg	Bank of America		7.686	Swiss Life Holding AG Reg	Merrill Lynch	(90.996)
		Merrill Lynch	(32.589)	5.644	Swiss Life Holding AG Reg	Citibank	(160.629)
(15.727)	Nestle SA Reg	Citibank	14.679	24.731	Swiss Prime Site AG Reg	JP Morgan	(81.307)
(11.792)	Nestle SA Reg	JP Morgan	20.098	13.443	Swiss Prime Site AG Reg	Citibank	(10.036)
(19.073)	Nestle SA Reg	Credit Suisse	32.944	4.999	Swiss Prime Site AG Reg	JP Morgan	(18.400)
4.030	Novartis AG Reg	Deutsche Bank	(15.046)			Bank of America	
24.142	Novartis AG Reg	Citibank	(58.292)	2.752	Swiss Prime Site AG Reg	Merrill Lynch	(7.100)
6.316	Novartis AG Reg	Bank of America		17.649	Swiss Re AG	Credit Suisse	(5.584)
		Merrill Lynch	(23.580)	17.857	Swiss Re AG	Credit Suisse	(143.812)
19.723	Novartis AG Reg	JP Morgan	(68.431)	45.214	Swiss Re AG	Deutsche Bank	(136.728)
66.820	Novartis AG Reg	Credit Suisse	(231.840)			Bank of America	
42.901	OC Oerlikon Corp AG Reg	Bank of America		5.708	Swiss Re AG	Merrill Lynch	(382.555)
		Merrill Lynch	(36.560)	7.907	Swiss Re AG	Citibank	(49.222)
79.779	OC Oerlikon Corp AG Reg	Credit Suisse	(73.568)	4.159	Swisscom AG Reg	JP Morgan	(64.976)
32.191	OC Oerlikon Corp AG Reg	Deutsche Bank	(17.259)	2.687	Swisscom AG Reg	Credit Suisse	(49.068)
(14.346)	Panalpina Welttransport Holding AG Reg	JP Morgan	69.548	5.514	Swisscom AG Reg	Deutsche Bank	(37.346)
(12.512)	Panalpina Welttransport Holding AG Reg	Citibank	46.051			Bank of America	
(4.250)	Pargesa Holding SA	JP Morgan	32.122	1.163	Swisscom AG Reg	Merrill Lynch	(72.564)
(9.922)	Pargesa Holding SA	Credit Suisse	74.991	4.606	Swisscom AG Reg	Citibank	(16.282)
(5.962)	Pargesa Holding SA	Citibank	31.150	8.221	Temenos AG Reg	JP Morgan	(79.905)
(5.769)	Pargesa Holding SA	Deutsche Bank	28.971			Bank of America	
1.038	Partners Group Holding AG	JP Morgan	(27.906)	3.945	Temenos AG Reg	Merrill Lynch	34.350
282	Partners Group Holding AG	Credit Suisse	(7.581)	(53.366)	UBS Group AG Reg	Deutsche Bank	17.610
31	Partners Group Holding AG	Citibank	(865)			Bank of America	
2.246	Partners Group Holding AG	Deutsche Bank	(50.585)	(61.034)	UBS Group AG Reg	Merrill Lynch	59.196
5.491	PSP Swiss Property AG Reg	Deutsche Bank	(12.813)	(467)	Valiant Holding AG Reg	Credit Suisse	73.818
						Bank of America	
				(158)	Valiant Holding AG Reg	Merrill Lynch	4.738
				(280)	Valiant Holding AG Reg	Citibank	1.379
						JP Morgan	2.386

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Suisse suite				Taiwan suite			
(607) (2.978)	Valiant Holding AG Reg VAT Group AG '144A'	Credit Suisse Bank of America	4.755	(789.000)	China Steel Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	44.714	(8.912.000)	China Steel Corp	Citibank	(4.194)
(9.295)	VAT Group AG '144A'	JP Morgan	81.097	(196.000)	China Steel Corp	JP Morgan	(80.785)
(25.488)	Vifor Pharma AG	Citibank	(60.766)	(1.945.000)	Chunghwa Telecom Co Ltd	Bank of America	(370)
(27.389)	Vifor Pharma AG	Bank of America				Merrill Lynch	
		Merrill Lynch	114.432	(7.000)	Chunghwa Telecom Co Ltd	JP Morgan	(5.083)
(19.051)	Vifor Pharma AG	JP Morgan	154.619	4.257.000	Compal Electronics Inc	Citibank	861
(24.015)	Vifor Pharma AG	Credit Suisse	191.226	1.084.000	Compal Electronics Inc	JP Morgan	(24.025)
(15.606)	Vifor Pharma AG	Deutsche Bank	121.118	3.468.000	Compal Electronics Inc	Bank of America	2.893
9.538	Vontobel Holding AG Reg	Citibank	(11.612)			Merrill Lynch	(37.914)
28.233	Vontobel Holding AG Reg	JP Morgan	(22.914)	1.031.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	Citibank	
9.568	Vontobel Holding AG Reg	Bank of America					(19.856)
		Merrill Lynch	(7.280)	2.891.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	11.497
206.127	Vontobel Holding AG Reg	Credit Suisse	(167.294)	(481.000)	Delta Electronics Inc	Bank of America	
24.563	Vontobel Holding AG Reg	Deutsche Bank	(18.689)			Merrill Lynch	71.392
3.993	Zurich Insurance Group AG	Citibank	(69.319)	(2.044.000)	Delta Electronics Inc	Citibank	248.302
4.534	Zurich Insurance Group AG	Credit Suisse	(95.722)	(2.259.303)	E.Sun Financial Holding Co Ltd	Bank of America	
2.514	Zurich Insurance Group AG	Deutsche Bank	(54.070)			Merrill Lynch	25.050
			(104.954)	(241.668)	E.Sun Financial Holding Co Ltd	Citibank	3.032
Taiwan				(362.275)	Eclat Textile Co Ltd	Citibank	138.565
(654.949)	Advantech Co Ltd	Citibank	125.787	(67.407)	Eclat Textile Co Ltd	JP Morgan	(5.052)
(51.000)	Advantech Co Ltd	Bank of America		(111.180)	Eclat Textile Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	5.615			Merrill Lynch	22.042
(1.130.500)	ASE Industrial Holding Co Ltd	Bank of America		3.141.470	Eva Airways Corp	JP Morgan	(19.177)
		Merrill Lynch	151.295	203.631	Eva Airways Corp	Bank of America	
(538.859)	ASE Industrial Holding Co Ltd	Citibank	55.688			Merrill Lynch	282
(3.364.000)	Asia Cement Corp	Citibank	119.893	1.437.570	Eva Airways Corp	Citibank	3.917
(1.603.000)	Asia Cement Corp	JP Morgan	(24.152)	3.818.000	Far Eastern New Century Corp		
(1.946.000)	Asia Cement Corp	Bank of America				Citibank	(54.447)
		Merrill Lynch	53.985	657.000	Far Eastern New Century Corp	Bank of America	
(42.000)	Asustek Computer Inc	Bank of America				Merrill Lynch	6.372
		Merrill Lynch	3.590	5.106.000	Far Eastern New Century Corp	JP Morgan	(4.096)
(162.000)	Asustek Computer Inc	Citibank	20.738	(489.000)	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Bank of America	
5.875.000	AU Optronics Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(19.730)
		Merrill Lynch	58.877	(638.000)	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	JP Morgan	20.683
25.694.000	AU Optronics Corp	JP Morgan	253.775			JP Morgan	411
13.841.000	AU Optronics Corp	Citibank	154.479	123.000	Feng TAY Enterprise Co Ltd	Citibank	983
203.000	Catcher Technology Co Ltd	JP Morgan	70.740	87.000	Feng TAY Enterprise Co Ltd	Citibank	(34.455)
30.000	Catcher Technology Co Ltd	Citibank	(6.942)	2.751.080	First Financial Holding Co Ltd	Bank of America	
(241.000)	Cathay Financial Holding Co Ltd	Bank of America		6.991.820	First Financial Holding Co Ltd	Merrill Lynch	(65.311)
		Merrill Lynch	4.906			JP Morgan	(6.335)
(366.000)	Cathay Financial Holding Co Ltd	Citibank	14.252	1.521.840	First Financial Holding Co Ltd	Bank of America	
330.000	Chailease Holding Co Ltd	Bank of America		200.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	Merrill Lynch	13.769
		Merrill Lynch	(37.751)				
391.000	Chailease Holding Co Ltd	Citibank	(8.236)	1.259.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	JP Morgan	106.816
5.782.650	Chang Hwa Commercial Bank Ltd	JP Morgan	73.196	2.381.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp	Citibank	(130.495)
2.279.550	Chang Hwa Commercial Bank Ltd	Citibank	(12.969)	(102.000)	Formosa Petrochemical Corp	Bank of America	
1.679.700	Chang Hwa Commercial Bank Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	5.025
		Merrill Lynch	7.432	(18.000)	Formosa Petrochemical Corp	JP Morgan	447
(957.000)	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	Citibank	33.325	(68.000)	Formosa Petrochemical Corp	Citibank	8.290
(355.109)	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	JP Morgan	10.467	1.329.000	Formosa Plastics Corp	Citibank	(94.638)
(763.000)	China Development Financial Holding Corp	JP Morgan	(3.369)	1.368.000	Formosa Plastics Corp	JP Morgan	(9.877)
(1.926.000)	China Development Financial Holding Corp	Bank of America		(156.000)	Foxconn Technology Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(416)			Merrill Lynch	8.811
(1.448.000)	China Development Financial Holding Corp	Citibank	12.760	(177.000)	Fubon Financial Holding Co Ltd	Citibank	9.839
642.538	China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	Bank of America		(203.000)	Fubon Financial Holding Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.545)			Merrill Lynch	(4.749)
1.475.697	China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	Citibank	(70.928)	61.000	Globalwafers Co Ltd	Citibank	102.487
892.849	China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	JP Morgan	3.251	(4.788.554)	Hon Hai Precision Industry Co Ltd		
						Citibank	(257.948)
				(131.915)	Hotai Motor Co Ltd	JP Morgan	59.904
				(76.000)	Hotai Motor Co Ltd	Citibank	23.703
				(49.000)	Hotai Motor Co Ltd	Bank of America	
						Merrill Lynch	23.903

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Taiwan suite				Taiwan suite			
3.440.598	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19.518)	6.175.000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	60.649
583.050	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	Citibank	1.523	38.000	Taiwan High Speed Rail Corp	Bank of America Merrill Lynch	(432)
4.973.950	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.511)	88.000	Taiwan High Speed Rail Corp	Citibank	(1.700)
9.260.000	Innolux Corp	Citibank	(12.322)	461.000	Taiwan High Speed Rail Corp	JP Morgan	10.202
15.405.000	Innolux Corp	Bank of America Merrill Lynch	28.442	(1.539.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(132.736)
13.504.000	Innolux Corp	JP Morgan	(43.686)	(158.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	JP Morgan	3.555
(1.354.000)	Inventec Corp	Citibank	(48.434)	800.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Citibank	(140.963)
(1.378.000)	Inventec Corp	JP Morgan	(52.882)	1.432.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(257.962)
(8.236.000)	Inventec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(277.641)	673.000	Uni-President Enterprises Corp	Bank of America Merrill Lynch	18.423
(16.550)	Largan Precision Co Ltd	JP Morgan	(47.254)	1.989.000	Uni-President Enterprises Corp	Citibank	80.488
(93.000)	Largan Precision Co Ltd	Citibank	(366.427)	1.327.000	Uni-President Enterprises Corp	JP Morgan	127.212
(2.000)	Largan Precision Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	394	5.615.000	United Microelectronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	25.499
1.633.686	Lite-On Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	40.978	6.227.000	United Microelectronics Corp	Citibank	89.417
1.257.234	Lite-On Technology Corp	Citibank	25.307	2.985.000	United Microelectronics Corp	JP Morgan	70.024
1.588.000	Lite-On Technology Corp	JP Morgan	25.820	14.000	Yageo Corp	JP Morgan	106.817
(245.136)	MediaTek Inc	Bank of America Merrill Lynch	71.507	214.000	Yageo Corp	Citibank	(172.763)
(736.891)	MediaTek Inc	Citibank	230.966	9.841.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	Citibank	(135.635)
(6.977.000)	Mega Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	35.449	2.022.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	(19.237)
(8.761.000)	Mega Financial Holding Co Ltd	Citibank	170.768	2.522.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(34.188)
(1.036.000)	Mega Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	3.823				7.037
(52.000)	Nan Ya Plastics Corp	Citibank	5.390	Royaume-Uni			
(370.000)	Nan Ya Plastics Corp	Bank of America Merrill Lynch	22.613	(6.364)	Abcam Plc	Bank of America Merrill Lynch	3.092
(650.000)	Nanya Technology Corp	Citibank	(49.495)	(32.865)	Abcam Plc	Citibank	(5.951)
(309.000)	Nanya Technology Corp	JP Morgan	(51.813)	(13.164)	Abcam Plc	JP Morgan	4.200
1.165.000	Novatek Microelectronics Corp	Citibank	(25.891)	(39.612)	Admiral Group Plc	JP Morgan	29.751
423.000	Novatek Microelectronics Corp	JP Morgan	57.247	(2.175)	Admiral Group Plc	Credit Suisse	1.634
46.000	Novatek Microelectronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3.120)	(32.766)	Admiral Group Plc	Deutsche Bank	(1.282)
535.000	Pegatron Corp	Bank of America Merrill Lynch	(68.926)	(16.663)	Admiral Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	886
1.899.000	Pegatron Corp	Citibank	(113.201)	(49.941)	Admiral Group Plc	Citibank	10.622
1.269.000	Pegatron Corp	JP Morgan	(301.944)	(65.221)	Aggreko Plc	Bank of America Merrill Lynch	18.380
1.325.000	Pou Chen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(46.264)	(43.790)	Aggreko Plc	JP Morgan	14.087
4.066.000	Pou Chen Corp	Citibank	41.480	55.316	Anglo American Plc	Citibank	(91.473)
1.690.000	Pou Chen Corp	JP Morgan	(20.669)	52.337	Anglo American Plc	JP Morgan	50.787
311.000	President Chain Store Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7.175)	381.037	Anglo American Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3.039)
216.000	President Chain Store Corp	Citibank	8.128	194.228	Anglo American Plc	Deutsche Bank	(113.742)
155.000	President Chain Store Corp	JP Morgan	60.534	257.760	Anglo American Plc	Credit Suisse	211.675
(1.463.000)	Quanta Computer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.451)	(176.400)	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	(14.069)
(2.311.000)	Quanta Computer Inc	JP Morgan	1.525	43.520	Ashmore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(17.702)
(8.915.653)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	43.751	376.519	Ashmore Group Plc	Citibank	(151.392)
1.676.461	Taishin Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5.217	184.345	Ashmore Group Plc	JP Morgan	(74.931)
6.749.341	Taishin Financial Holding Co Ltd	Citibank	(26.610)	51.661	Ashmore Group Plc	Credit Suisse	(19.091)
3.523.836	Taishin Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	24.867	216.465	Ashmore Group Plc	Deutsche Bank	(88.051)
(2.381.000)	Taiwan Cement Corp	Bank of America Merrill Lynch	5.488	9.989	Ashtead Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	11.287
(9.000)	Taiwan Cement Corp	Citibank	617	15.953	Ashtead Group Plc	JP Morgan	32.701
(3.391.094)	Taiwan Cement Corp	JP Morgan	(125.512)	13.609	Ashtead Group Plc	Citibank	(4.523)
4.609.576	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	20.334	(17.616)	ASOS Plc	Bank of America Merrill Lynch	(73.160)
2.317.090	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	Citibank	(5.537)	(7.555)	ASOS Plc	JP Morgan	(41.979)
				(19.287)	ASOS Plc	Deutsche Bank	(93.930)
				(28.403)	ASOS Plc	Credit Suisse	(158.040)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(5.228)	ASOS Plc	Citibank	(1.112)	33.994	Bodycote Plc	Citibank	22.594
105.015	Associated British Foods Plc	Bank of America		118.868	Bodycote Plc	JP Morgan	136.680
		Merrill Lynch	(74.676)	115.040	Bodycote Plc	Deutsche Bank	111.488
29.255	Associated British Foods Plc	Credit Suisse	(14.189)	8.228	Bodycote Plc	Credit Suisse	9.461
58.232	Associated British Foods Plc	Citibank	(66.571)	(427.445)	boohoo.com Plc	Credit Suisse	(121.027)
(19.437)	AstraZeneca Plc	Citibank	(11.885)	(569.604)	boohoo.com Plc	Citibank	21.201
(4.318)	AstraZeneca Plc	Deutsche Bank	(11.939)	(98.767)	boohoo.com Plc	Deutsche Bank	(8.074)
123.380	Auto Trader Group Plc '144A'	Credit Suisse	(26.855)	(812.291)	boohoo.com Plc	JP Morgan	(229.993)
45.334	Auto Trader Group Plc '144A'	Citibank	(14.448)	(408.447)	boohoo.com Plc	Bank of America	
214.695	Auto Trader Group Plc '144A'	Deutsche Bank	(46.234)			Merrill Lynch	(33.391)
47.835	Aviva Plc	Bank of America		(168.389)	BP Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(20.520)			Merrill Lynch	6.715
61.856	Aviva Plc	JP Morgan	(24.599)	(442.324)	BP Plc	JP Morgan	(139.939)
42.423	Aviva Plc	Credit Suisse	(15.564)	(404.417)	BP Plc	Credit Suisse	(127.947)
26.469	Aviva Plc	Deutsche Bank	(11.330)	(72.074)	BP Plc	Citibank	13.605
(301.891)	B&M European Value Retail SA	Citibank	(73.979)	(66.134)	British American Tobacco Plc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(31.102)
(47.211)	B&M European Value Retail SA	JP Morgan	(13.807)	(41.148)	British American Tobacco Plc	Citibank	(48.681)
(428.731)	B&M European Value Retail SA	Deutsche Bank	(125.278)	(79.971)	British American Tobacco Plc	Deutsche Bank	(22.587)
(10.956)	Babcock International Group Plc	Credit Suisse	(12.554)	(92.375)	British American Tobacco Plc	JP Morgan	(52.187)
(84.487)	Babcock International Group Plc	Deutsche Bank	(101.752)	(33.492)	British American Tobacco Plc	Credit Suisse	(18.921)
(187.205)	Babcock International Group Plc	Bank of America	(225.459)	104.952	British Land Co Plc/The (Reit)	Credit Suisse	(6.139)
(64.127)	Babcock International Group Plc	JP Morgan	(71.997)	134.353	British Land Co Plc/The (Reit)	Citibank	(31.790)
134.962	BAE Systems Plc	Citibank	(359)	47.871	British Land Co Plc/The (Reit)	Deutsche Bank	(6.281)
169.794	BAE Systems Plc	Credit Suisse	33.597	101.950	British Land Co Plc/The (Reit)	JP Morgan	(10.399)
111.824	BAE Systems Plc	Deutsche Bank	12.784	201.892	Britvic Plc	Deutsche Bank	159.683
240.069	BAE Systems Plc	Bank of America		206.631	Britvic Plc	Credit Suisse	181.285
		Merrill Lynch	27.445	48.694	Britvic Plc	Bank of America	
(238.004)	Balfour Beatty Plc	Credit Suisse	(5.951)			Merrill Lynch	38.514
(121.062)	Balfour Beatty Plc	Deutsche Bank	–	188.776	Britvic Plc	Citibank	127.979
(853.173)	Balfour Beatty Plc	Bank of America	–	95.394	Britvic Plc	JP Morgan	83.693
		Merrill Lynch	–	784.094	BT Group Plc	Citibank	(23.404)
(332.327)	Balfour Beatty Plc	Citibank	10.602	90.594	BT Group Plc	JP Morgan	(38.777)
(189.262)	Balfour Beatty Plc	JP Morgan	(6.541)	87.175	BT Group Plc	Credit Suisse	(37.314)
122.832	Barratt Developments Plc	Bank of America		6.819	BT Group Plc	Deutsche Bank	(231)
		Merrill Lynch	(32.330)	(87.212)	BTG Plc	Citibank	13.332
265.203	Barratt Developments Plc	JP Morgan	(41.822)	(28.243)	BTG Plc	Credit Suisse	8.079
121.383	Barratt Developments Plc	Credit Suisse	(19.040)	(46.267)	BTG Plc	Deutsche Bank	(8.610)
59.058	Barratt Developments Plc	Deutsche Bank	(15.544)	(51.406)	BTG Plc	Bank of America	
49.168	Barratt Developments Plc	Citibank	(12.287)			Merrill Lynch	(9.567)
(532.516)	BBA Aviation Plc	Credit Suisse	(4.247)	(150.153)	BTG Plc	JP Morgan	150.697
(423.455)	BBA Aviation Plc	Deutsche Bank	(3.877)	(125.759)	Bunzl Plc	Bank of America	
(974.428)	BBA Aviation Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(142.096)
		Merrill Lynch	(28.951)	(23.613)	Bunzl Plc	JP Morgan	(39.864)
(149.212)	BBA Aviation Plc	Citibank	9.521	(15.080)	Bunzl Plc	Credit Suisse	(13.796)
(425.510)	BBA Aviation Plc	JP Morgan	(3.394)	61.554	Burberry Group Plc	Credit Suisse	159.494
57.270	Beazley Plc	Credit Suisse	(15.987)	66.270	Burberry Group Plc	Deutsche Bank	237.410
54.420	Beazley Plc	Bank of America		8.469	Burberry Group Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.511)			Merrill Lynch	30.340
39.277	Beazley Plc	JP Morgan	(10.964)	(1.419.030)	Cairn Energy Plc	Bank of America	
108.277	Beazley Plc	Deutsche Bank	(12.954)			Merrill Lynch	381.695
19.937	Bellway Plc	Bank of America		(937.248)	Cairn Energy Plc	Citibank	387.479
		Merrill Lynch	(33.948)	(145.351)	Cairn Energy Plc	JP Morgan	6.569
17.707	Bellway Plc	JP Morgan	(12.710)	(974.774)	Cairn Energy Plc	Credit Suisse	61.513
22.678	Bellway Plc	Citibank	(40.697)	(507.955)	Cairn Energy Plc	Deutsche Bank	133.694
3.887	Bellway Plc	Credit Suisse	(2.790)	(111.025)	Capital & Counties Properties Plc	Citibank	(22.433)
4.392	Bellway Plc	Deutsche Bank	(8.524)			JP Morgan	(93.486)
21.211	Berkeley Group Holdings Plc	Citibank	1.692	(188.546)	Capital & Counties Properties Plc	Deutsche Bank	(109.850)
28.512	Berkeley Group Holdings Plc	JP Morgan	44.558	(472.214)	Capital & Counties Properties Plc	Bank of America	
57.153	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America		(260.288)	Capital & Counties Properties Plc	Merrill Lynch	(60.550)
		Merrill Lynch	54.499	197.901	Centrica Plc	Bank of America	
91.382	Berkeley Group Holdings Plc	Deutsche Bank	70.455			Merrill Lynch	(10.128)
7.361	Berkeley Group Holdings Plc	Credit Suisse	14.286	178.565	Centrica Plc	Citibank	(6.884)
42.274	Bodycote Plc	Bank of America		326.580	Centrica Plc	Deutsche Bank	(16.714)
		Merrill Lynch	42.146	182.755	Centrica Plc	Credit Suisse	(22.107)
				(791.658)	Cineworld Group Plc	Credit Suisse	88.397
				(548.525)	Cineworld Group Plc	Deutsche Bank	47.670

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
39.959	Close Brothers Group Plc	Bank of America		(1.087)	Domino's Pizza Group Plc	JP Morgan	(270)
		Merrill Lynch	(54.180)	(80.669)	Domino's Pizza Group Plc	Citibank	(7.292)
32.977	Close Brothers Group Plc	Citibank	(63.563)	(300.043)	Drax Group Plc	Bank of America	
52.891	Close Brothers Group Plc	JP Morgan	(63.277)			Merrill Lynch	66.209
50.163	Close Brothers Group Plc	Deutsche Bank	(70.237)	(197.505)	Drax Group Plc	Citibank	71.412
37.207	Close Brothers Group Plc	Credit Suisse	(48.663)	(325.665)	Drax Group Plc	JP Morgan	(55.412)
(3.266.546)	Cobham Plc	Bank of America		(319.287)	DS Smith Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(258.362)			Merrill Lynch	(44.275)
(503.792)	Cobham Plc	JP Morgan	(48.553)	(158.184)	DS Smith Plc	JP Morgan	(32.382)
(562.508)	Cobham Plc	Deutsche Bank	(43.040)	80.656	Dunelm Group Plc	JP Morgan	(52.801)
(527.366)	Cobham Plc	Citibank	(42.062)	94.240	Dunelm Group Plc	Credit Suisse	(28.186)
(1.408.347)	Cobham Plc	Credit Suisse	(130.536)	67.631	Dunelm Group Plc	Bank of America	
(22.327)	Compass Group Plc	Credit Suisse	(11.723)			Merrill Lynch	(60.468)
(44.061)	Compass Group Plc	JP Morgan	(23.135)	51.391	Dunelm Group Plc	Citibank	(48.503)
(20.815)	Compass Group Plc	Bank of America		57.660	Dunelm Group Plc	Deutsche Bank	(49.821)
		Merrill Lynch	(21.726)	(52.893)	easyJet Plc	Credit Suisse	(30.234)
(580.716)	ConvaTec Group Plc '144A'	Credit Suisse	(22.853)	(6.671)	easyJet Plc	Deutsche Bank	2.926
(428.238)	ConvaTec Group Plc '144A'	Citibank	(106.680)	(14.897)	easyJet Plc	Citibank	14.357
(446.655)	ConvaTec Group Plc '144A'	JP Morgan	(126.087)	(56.739)	easyJet Plc	Bank of America	
(386.370)	ConvaTec Group Plc '144A'	Deutsche Bank	(7.704)			Merrill Lynch	22.216
(17.669)	Croda International Plc	Bank of America		(121.526)	easyJet Plc	JP Morgan	(71.359)
		Merrill Lynch	(30.805)	112.502	Electrocomponents Plc	Citibank	118.443
(2.788)	Croda International Plc	Citibank	1.964	152.182	Electrocomponents Plc	JP Morgan	182.840
(3.860)	Croda International Plc	JP Morgan	(6.876)	105.601	Electrocomponents Plc	Bank of America	
(2.650)	Croda International Plc	Credit Suisse	(4.720)			Merrill Lynch	140.937
(9.173)	Croda International Plc	Deutsche Bank	(16.827)	273.174	Electrocomponents Plc	Deutsche Bank	374.750
177.132	CYBG Plc	Bank of America		159.048	Electrocomponents Plc	Credit Suisse	186.155
		Merrill Lynch	(33.906)	(78.793)	Essentra Plc	Deutsche Bank	(11.940)
50.041	CYBG Plc	JP Morgan	(20.621)	(542.378)	Essentra Plc	Bank of America	
(44.467)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	JP Morgan	15.664			Merrill Lynch	(63.629)
(15.280)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	Bank of America		(128.372)	Essentra Plc	Citibank	12.628
(59.458)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	Merrill Lynch	11.476	(480.062)	Essentra Plc	JP Morgan	(153.155)
		Credit Suisse	20.945	72.507	Experian Plc	Credit Suisse	100.829
(37.911)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'			45.156	Ferguson Plc	Bank of America	
(117.204)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	Deutsche Bank	28.473			Merrill Lynch	120.052
		Citibank	135.545	6.809	Ferguson Plc	Citibank	-
(10.588)	DCC Plc	Citibank	48.557	(88.392)	Fevertree Drinks Plc	Credit Suisse	(159.799)
(2.244)	DCC Plc	JP Morgan	7.223	(22.116)	Fevertree Drinks Plc	JP Morgan	(39.982)
(7.825)	DCC Plc	Bank of America		(21.135)	Fevertree Drinks Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	12.876			Merrill Lynch	(25.942)
(11.652)	Dechra Pharmaceuticals Plc	Bank of America		(122.147)	Fresnillo Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(11.939)	(44.267)	Fresnillo Plc	Merrill Lynch	(175.360)
(31.251)	Dechra Pharmaceuticals Plc	Credit Suisse	8.201	(189.302)	Fresnillo Plc	Citibank	(20.890)
(17.138)	Derwent London Plc (Reit)	Bank of America		(144.372)	Fresnillo Plc	JP Morgan	(186.213)
		Merrill Lynch	16.858	(169.392)	Fresnillo Plc	Credit Suisse	(165.386)
(14.327)	Derwent London Plc (Reit)	Citibank	10.284	(196.976)	G4S Plc	Deutsche Bank	(193.132)
(22.871)	Derwent London Plc (Reit)	JP Morgan	31.852			Bank of America	
(5.091)	Derwent London Plc (Reit)	Credit Suisse	8.392	(421.722)	G4S Plc	Merrill Lynch	(30.635)
(9.537)	Derwent London Plc (Reit)	Deutsche Bank	9.381	(265.046)	G4S Plc	Deutsche Bank	(65.590)
(41.851)	Diageo Plc	Bank of America		121.155	GlaxoSmithKline Plc	Citibank	(4.228)
		Merrill Lynch	(47.844)	183.993	GlaxoSmithKline Plc	Citibank	32.532
(452)	Diageo Plc	JP Morgan	(604)	229.677	GlaxoSmithKline Plc	Credit Suisse	110.197
(80)	Diageo Plc	Deutsche Bank	(91)	86.341	GlaxoSmithKline Plc	Deutsche Bank	181.354
(23.635)	Diageo Plc	Credit Suisse	(19.159)			Bank of America	
(58.152)	Diageo Plc	Citibank	(32.467)	293.261	GlaxoSmithKline Plc	Merrill Lynch	68.175
56.011	Direct Line Insurance Group Plc	Bank of America		(298.582)	Glencore Plc	JP Morgan	226.102
		Merrill Lynch	(9.084)	(925.864)	Glencore Plc	JP Morgan	(59.734)
317.882	Direct Line Insurance Group Plc	Citibank	(76.483)	(245.722)	Glencore Plc	Credit Suisse	(159.113)
4.408	Direct Line Insurance Group Plc	JP Morgan	(639)	(1.292.124)	Glencore Plc	Deutsche Bank	16.169
171.650	Direct Line Insurance Group Plc	Credit Suisse	(28.731)			Bank of America	
498.944	Direct Line Insurance Group Plc	Deutsche Bank	(93.934)	(483.747)	Glencore Plc	Merrill Lynch	86.709
141.567	Dixons Carphone Plc	Citibank	(93.622)	181.243	Grafton Group Plc (Unit)	Citibank	99.350
243.631	Dixons Carphone Plc	Credit Suisse	(112.884)			Bank of America	
637.229	Dixons Carphone Plc	Deutsche Bank	(325.698)	215.788	Grafton Group Plc (Unit)	Merrill Lynch	(9.637)
				21.356	Grafton Group Plc (Unit)	Credit Suisse	(105.331)
				123.772	Grafton Group Plc (Unit)	Deutsche Bank	(1.136)
				210.521	Grafton Group Plc (Unit)	Citibank	(15.630)
				(122.546)	Great Portland Estates Plc (Reit)	JP Morgan	(62.987)
						Bank of America	
						Merrill Lynch	(8.294)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(92.951)	Great Portland Estates Plc (Reit)	Credit Suisse	4.353	23.514	Imperial Brands Plc	Citibank	(22.427)
(40.074)	Great Portland Estates Plc (Reit)	Citibank	(5.167)	13.417	Imperial Brands Plc	Credit Suisse	16.631
(63.151)	Great Portland Estates Plc (Reit)	Deutsche Bank	839	7.834	Imperial Brands Plc	JP Morgan	9.711
(97.013)	Great Portland Estates Plc (Reit)	JP Morgan	23.857	107.948	Inchcape Plc	Credit Suisse	(10.045)
14	Greencore Group PLC	Deutsche Bank	4	88.909	Inchcape Plc	Deutsche Bank	(18.910)
(78.905)	Greene King Plc	Credit Suisse	(43.613)	217.729	Inchcape Plc	Bank of America	
(163.593)	Greene King Plc	Deutsche Bank	(50.408)	198.783	Inchcape Plc	Merrill Lynch	(32.007)
(36.416)	Greene King Plc	Bank of America	(11.221)	395.760	Inchcape Plc	Citibank	(9.248)
(5.520)	Greene King Plc	Merrill Lynch	721	499.407	Indivior Plc	JP Morgan	(59.449)
(450.205)	Greene King Plc	JP Morgan	(233.306)			Bank of America	
(63.463)	GVC Holdings Plc	Bank of America	(87.764)	119.754	Indivior Plc	Merrill Lynch	135.658
(61.074)	GVC Holdings Plc	Citibank	(27.342)	428.978	Indivior Plc	Citibank	14.486
(177.624)	GVC Holdings Plc	JP Morgan	(343.424)	322.079	Indivior Plc	JP Morgan	51.322
(41.477)	GVC Holdings Plc	Credit Suisse	(79.946)	204.763	Indivior Plc	Credit Suisse	61.606
(42.007)	GVC Holdings Plc	Deutsche Bank	(55.561)	(86.304)	Informa Plc	Deutsche Bank	60.426
(57.100)	Halma Plc	Bank of America	(50.096)	(138.227)	Informa Plc	Credit Suisse	(32.811)
(48.074)	Halma Plc	JP Morgan	(52.402)	(234.538)	Informa Plc	Deutsche Bank	(63.208)
(22.340)	Hammerson Plc (Reit)	Credit Suisse	950	(208.748)	Informa Plc	JP Morgan	(94.458)
(69.767)	Hammerson Plc (Reit)	Citibank	3.339	(99.266)	Informa Plc	Bank of America	
(53.099)	Hammerson Plc (Reit)	Deutsche Bank	705	(12.960)	Inmarsat Plc	Merrill Lynch	(95.456)
(92.256)	Hammerson Plc (Reit)	JP Morgan	502			Citibank	(24.280)
(18.235)	Hargreaves Lansdown Plc	Credit Suisse	(5.856)	(15.057)	Inmarsat Plc	Bank of America	
(26.301)	Hargreaves Lansdown Plc	Deutsche Bank	(1.573)	(106.248)	Inmarsat Plc	Merrill Lynch	1.344
(30.225)	Hargreaves Lansdown Plc	Citibank	13.661	(145.491)	Inmarsat Plc	Deutsche Bank	1.561
(41.773)	Hargreaves Lansdown Plc	JP Morgan	(47.199)	(251.987)	Inmarsat Plc	Credit Suisse	22.880
(58.506)	Hargreaves Lansdown Plc	Bank of America	12.623	16.527	InterContinental Hotels Group Plc	Citibank	(26.109)
(161.325)	Hays Plc	JP Morgan	(1.287)	11.842	InterContinental Hotels Group Plc	JP Morgan	11.980
(5.162)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Bank of America	(609)	97	InterContinental Hotels Group Plc	Deutsche Bank	144
(5.267)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Citibank	499	54.653	Intermediate Capital Group Plc	Bank of America	
(733)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Deutsche Bank	(87)	10.653	Intermediate Capital Group Plc	Merrill Lynch	(13.077)
(2.755)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Credit Suisse	(691)	16.112	Intermediate Capital Group Plc	Citibank	(8.921)
(255.213)	Hikma Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	(64.051)	23.195	Intermediate Capital Group Plc	JP Morgan	1.071
2.327	Hiscox Ltd	Credit Suisse	(124)	6.502	Intermediate Capital Group Plc	Credit Suisse	1.542
1.532	Hiscox Ltd	Deutsche Bank	41	(9.498)	Intertek Group Plc	Deutsche Bank	(1.556)
413	Hiscox Ltd	Bank of America	11	(12.160)	Intertek Group Plc	Bank of America	
9.890	Hiscox Ltd	JP Morgan	(526)	(122.191)	Investec Plc	Merrill Lynch	(53.463)
70.371	HomeServe Plc	Bank of America	109.914	(28.420)	Investec Plc	JP Morgan	(81.468)
30.831	HomeServe Plc	JP Morgan	46.295	(190.459)	Investec Plc	Bank of America	
255.312	Howden Joinery Group Plc	Bank of America	(21.818)	(91.623)	Investec Plc	Merrill Lynch	13.644
171.749	Howden Joinery Group Plc	Citibank	(30.136)	(1.663)	Investec Plc	Citibank	11.183
221.251	Howden Joinery Group Plc	JP Morgan	(50.587)	478.474	ITV Plc	JP Morgan	53.674
515.294	Howden Joinery Group Plc	Credit Suisse	(104.560)	309.579	ITV Plc	Credit Suisse	25.820
376.050	Howden Joinery Group Plc	Deutsche Bank	(25.994)	(172.382)	IWG Plc	Deutsche Bank	186
(332.092)	HSBC Holdings Plc	Bank of America	76.380	(147.459)	IWG Plc	Bank of America	
(31.374)	HSBC Holdings Plc	JP Morgan	(4.421)	(153.500)	IWG Plc	Merrill Lynch	(10.813)
42.095	IG Group Holdings Plc	JP Morgan	770	423.052	J Sainsbury Plc	Credit Suisse	24.802
73.068	IG Group Holdings Plc	Bank of America	4.856	128.663	J Sainsbury Plc	Bank of America	(8.004)
13.133	IG Group Holdings Plc	Credit Suisse	4.103	235.283	J Sainsbury Plc	JP Morgan	(151.717)
107.787	IG Group Holdings Plc	Citibank	(25.791)	650.262	J Sainsbury Plc	Credit Suisse	(163.883)
312.028	IMI Plc	Credit Suisse	377.449	1.171.550	J Sainsbury Plc	Citibank	7.873
97.602	IMI Plc	Deutsche Bank	51.897			JP Morgan	42.074
41.696	IMI Plc	Bank of America	22.171	85.799	JD Sports Fashion Plc	Deutsche Bank	38.947
36.183	IMI Plc	JP Morgan	43.769	423.510	JD Sports Fashion Plc	Credit Suisse	212.641
65.802	IMI Plc	Citibank	(22.742)	171.677	JD Sports Fashion Plc	Bank of America	249.175
16.551	Imperial Brands Plc	Bank of America	(7.425)	131.025	JD Sports Fashion Plc	Merrill Lynch	(13.116)
		Merrill Lynch		(898.313)	John Wood Group Plc	Citibank	(57.986)
						JP Morgan	(685)
						Deutsche Bank	(20.030)
							59.706

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(341.605)	John Wood Group Plc	Credit Suisse	(451.371)	104.428	Man Group Plc	Credit Suisse	(9.856)
(136.141)	John Wood Group Plc	Citibank	25.336	497.369	Man Group Plc	Deutsche Bank	(71.404)
(244.823)	John Wood Group Plc	Bank of America		412.591	Man Group Plc	Citibank	(82.817)
		Merrill Lynch	16.788	650.047	Marks & Spencer Group Plc	Credit Suisse	(54.439)
(49.197)	Johnson Matthey Plc	Bank of America		629.100	Marks & Spencer Group Plc	Citibank	(56.030)
		Merrill Lynch	(20.019)	119.013	Marks & Spencer Group Plc	Deutsche Bank	(4.588)
(33.010)	Johnson Matthey Plc	Credit Suisse	(65.381)	516.444	Marks & Spencer Group Plc	Bank of America	
(4.163)	Johnson Matthey Plc	JP Morgan	(8.245)			Merrill Lynch	(41.023)
(37.307)	Johnson Matthey Plc	Deutsche Bank	(22.812)	320.034	Marks & Spencer Group Plc	JP Morgan	(26.802)
(15.646)	Johnson Matthey Plc	Citibank	4.928	(99.693)	Mediclinic International Plc	Credit Suisse	81.837
206.003	Jupiter Fund	Bank of America		(66.239)	Mediclinic International Plc	Deutsche Bank	56.353
	Management Plc	Merrill Lynch	(21.907)	(265.730)	Mediclinic International Plc	Bank of America	
186.357	Jupiter Fund					Merrill Lynch	226.070
	Management Plc	Citibank	(81.501)	(366.424)	Mediclinic International Plc	Citibank	317.581
410.702	Jupiter Fund			(406.231)	Mediclinic International Plc	JP Morgan	422.282
	Management Plc	JP Morgan	(38.762)	(56.990)	Meggitt Plc	JP Morgan	(5.833)
355.673	Jupiter Fund			(1.661.050)	Melrose Industries Plc	Citibank	238.468
	Management Plc	Credit Suisse	(33.569)	(1.537.025)	Melrose Industries Plc	JP Morgan	(61.295)
182.918	Jupiter Fund			(682.831)	Melrose Industries Plc	Bank of America	
	Management Plc	Deutsche Bank	(19.452)			Merrill Lynch	(32.677)
(64.979)	Just Eat Plc	Credit Suisse	(37.660)	(634.750)	Melrose Industries Plc	Credit Suisse	(25.313)
(32.813)	Just Eat Plc	Bank of America		(850.145)	Melrose Industries Plc	Deutsche Bank	(14.137)
		Merrill Lynch	(14.332)	(621.235)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Bank of America	
(106.653)	Just Eat Plc	Citibank	11.909			Merrill Lynch	26.426
(370.810)	Just Eat Plc	JP Morgan	(214.912)	(82.733)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Deutsche Bank	3.519
65.248	KAZ Minerals Plc	Credit Suisse	24.700	(1.065.951)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Credit Suisse	38.725
61.896	KAZ Minerals Plc	Citibank	(40.316)				
30.495	KAZ Minerals Plc	Bank of America		(142.621)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Citibank	26.732
		Merrill Lynch	(1.216)	(415.479)	Merlin Entertainments Plc '144A'	JP Morgan	18.226
198.754	KAZ Minerals Plc	Deutsche Bank	(7.926)			Bank of America	
116.840	KAZ Minerals Plc	JP Morgan	82.783	(40.244)	Metro Bank Plc	Merrill Lynch	60.897
(769.488)	Kingfisher Plc	Citibank	(81.044)	(35.711)	Metro Bank Plc	Citibank	65.266
(119.792)	Lancashire Holdings Ltd	Citibank	12.739	(2.232)	Metro Bank Plc	Deutsche Bank	21.836
(97.110)	Lancashire Holdings Ltd	Credit Suisse	(9.036)	(36.405)	Metro Bank Plc	Credit Suisse	237
(81.632)	Lancashire Holdings Ltd	Deutsche Bank	5.973	62.250	Mondi Plc	JP Morgan	3.871
(103.090)	Lancashire Holdings Ltd	Bank of America				Bank of America	
(40.552)	Lancashire Holdings Ltd	Merrill Lynch	2.056			Merrill Lynch	44.431
54.274	Land Securities	JP Morgan	(476)	41.032	Mondi Plc	Citibank	(13.636)
	Group Plc (Reit)	Bank of America		19.779	Mondi Plc	JP Morgan	31.288
20.947	Land Securities	Merrill Lynch	(14.862)	22.141	Mondi Plc	Credit Suisse	35.024
	Group Plc (Reit)	Credit Suisse	(15.315)	1.132.086	Moneysupermarket.com Group Plc	Citibank	(1.505)
4.874	Land Securities						
	Group Plc (Reit)	Citibank	(1.594)	313.910	Moneysupermarket.com Group Plc	Credit Suisse	5.842
47.972	Land Securities	JP Morgan	(35.073)	287.729	Moneysupermarket.com Group Plc	Bank of America	
	Group Plc (Reit)	Deutsche Bank	(2.017)	378.610	Moneysupermarket.com Group Plc	Merrill Lynch	1.005
615.146	Legal & General Group Plc	Bank of America				Deutsche Bank	7.783
1.063.763	Legal & General Group Plc	Merrill Lynch	(99.761)	547.138	National Express Group Plc	Bank of America	
178.933	Legal & General Group Plc	Citibank	(222.007)			Merrill Lynch	(37.870)
293.359	Legal & General Group Plc	JP Morgan	(28.340)	179.996	National Express Group Plc	Citibank	(32.541)
132.651	Legal & General Group Plc	Credit Suisse	(15.988)	283.699	National Express Group Plc	JP Morgan	(7.489)
891.878	Lloyds Banking Group Plc	Deutsche Bank	(21.513)	146.575	National Express Group Plc	Credit Suisse	11.301
2.207.926	Lloyds Banking Group Plc	JP Morgan	(31.559)	161.856	National Express Group Plc	Deutsche Bank	(5.164)
		Bank of America		(127.624)	National Grid Plc	Citibank	80.584
89.558	Lloyds Banking Group Plc	Merrill Lynch	(94.800)	(120.687)	National Grid Plc	JP Morgan	4.813
1.513.997	Lloyds Banking Group Plc	Credit Suisse	(2.774)	(181.986)	National Grid Plc	Credit Suisse	(7.125)
608.998	Lloyds Banking Group Plc	Citibank	(69.836)	(164.292)	National Grid Plc	Deutsche Bank	(4.368)
(15.634)	London Stock Exchange	Deutsche Bank	(26.148)	(52.178)	NEX Group Plc	Deutsche Bank	(10.404)
	Group Plc	Citibank	12.469	(129.304)	NEX Group Plc	Citibank	(32.700)
(21.092)	London Stock Exchange			(16.026)	NEX Group Plc	JP Morgan	(5.645)
	Group Plc	Credit Suisse	(5.096)	17.468	Next Plc	Bank of America	
(3.365)	London Stock Exchange					Merrill Lynch	47.369
	Group Plc	Deutsche Bank	(313)	30.210	Next Plc	JP Morgan	262.634
(29.599)	London Stock Exchange	Bank of America		24.487	Next Plc	Citibank	1.953
	Group Plc	Merrill Lynch	(1.005)	21.621	Next Plc	Credit Suisse	187.965
1.070.502	Man Group Plc	JP Morgan	(106.401)	1.468	Next Plc	Deutsche Bank	3.981
1.039.471	Man Group Plc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(149.231)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(39.011)	NMC Health Plc	Bank of America		50.236	RELX Plc	Credit Suisse	51.420
		Merrill Lynch	18.407	147.440	RELX Plc	Deutsche Bank	143.074
(61.109)	NMC Health Plc	Citibank	136.470	(54.755)	Rentokil Initial Plc	Citibank	(4.003)
(20.746)	NMC Health Plc	Deutsche Bank	(7.722)	(204.413)	Rentokil Initial Plc	Bank of America	
(275.317)	Ocado Group Plc	JP Morgan	(1.233.348)			Merrill Lynch	(56.645)
(271.515)	Ocado Group Plc	Citibank	9.384	(819.288)	Rentokil Initial Plc	Credit Suisse	(261.173)
(111.714)	Ocado Group Plc	Bank of America		(282.759)	Rentokil Initial Plc	JP Morgan	(90.961)
		Merrill Lynch	(519.183)	42.105	Rightmove Plc	Bank of America	
(200.373)	Old Mutual Plc	JP Morgan	46.346			Merrill Lynch	117.537
(104.712)	Old Mutual Plc	Credit Suisse	24.220	27.256	Rightmove Plc	Citibank	32.687
259.146	Pagegroup Plc	Bank of America		51.696	Rightmove Plc	JP Morgan	226.774
		Merrill Lynch	(53.395)	52.089	Rightmove Plc	Deutsche Bank	141.042
396.677	Pagegroup Plc	Citibank	(84.368)	(6.338.809)	Rolls Royce	Bank of America	
416.910	Pagegroup Plc	Credit Suisse	(19.397)		Holdings Plc 'C' (Pref)	Merrill Lynch	–
139.933	Pagegroup Plc	Deutsche Bank	(19.594)	(3.349.141)	Rolls Royce		
21.162	Pagegroup Plc	JP Morgan	(985)		Holdings Plc 'C' (Pref)	Credit Suisse	–
74.934	Pearson Plc	Bank of America		(5.985.939)	Rolls Royce		
		Merrill Lynch	(7.006)		Holdings Plc 'C' (Pref)	Citibank	(7.956)
24.454	Pearson Plc	Deutsche Bank	(3.564)	(9.839.890)	Rolls Royce Holdings		
270.460	Pearson Plc	Credit Suisse	(19.287)		Plc 'C' (Pref)	Deutsche Bank	–
109.092	Pearson Plc	Citibank	(18.272)	(7.466.999)	Rolls Royce		
(163.960)	Pennon Group Plc	Credit Suisse	(81.781)		Holdings Plc 'C' (Pref)	JP Morgan	(9.926)
(122.235)	Pennon Group Plc	Deutsche Bank	(69.544)	(215.727)	Rolls-Royce	Bank of America	
(169.355)	Pennon Group Plc	JP Morgan	(93.319)		Holdings Plc	Merrill Lynch	38.984
(168.748)	Pennon Group Plc	Bank of America		(84.309)	Rolls-Royce		
		Merrill Lynch	(96.007)		Holdings Plc	Citibank	42.587
(104.236)	Pennon Group Plc	Citibank	(23.555)	(105.169)	Rolls-Royce		
63.826	Persimmon Plc	Bank of America			Holdings Plc	JP Morgan	22.368
		Merrill Lynch	22.908	(84.636)	Rolls-Royce		
68.668	Persimmon Plc	Citibank	(4.564)		Holdings Plc	Credit Suisse	13.237
38.782	Persimmon Plc	Credit Suisse	47.526	(138.590)	Rolls-Royce		
134.570	Persimmon Plc	Deutsche Bank	47.011		Holdings Plc	Deutsche Bank	25.423
64.602	Petrofac Ltd	Credit Suisse	(26.621)	(235.867)	Rotork Plc	Credit Suisse	20.133
34.305	Petrofac Ltd	Deutsche Bank	(26.267)	(40.151)	Rotork Plc	Deutsche Bank	5.444
407.843	Petrofac Ltd	Bank of America		(276.379)	Rotork Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(209.029)			Merrill Lynch	40.163
358.615	Petrofac Ltd	Citibank	(79.133)	(452.981)	Rotork Plc	Citibank	108.989
167.604	Petrofac Ltd	JP Morgan	(69.067)	(146.689)	Rotork Plc	JP Morgan	2.535
(283.342)	Phoenix Group Holdings	Deutsche Bank	32.768	(482.732)	Royal Bank of Scotland		
(527.451)	Phoenix Group Holdings	Credit Suisse	5.762		Group Plc	Credit Suisse	(8.628)
(72.261)	Phoenix Group Holdings	Bank of America		(336.759)	Royal Bank of Scotland		
		Merrill Lynch	8.357		Group Plc	Deutsche Bank	80.578
(417.690)	Phoenix Group Holdings	Citibank	100.040	(197.441)	Royal Bank of Scotland	Bank of America	
(177.681)	Phoenix Group Holdings	JP Morgan	472		Group Plc	Merrill Lynch	47.242
(145.297)	Playtech Plc	Deutsche Bank	60.840	(666.751)	Royal Bank of Scotland		
(67.588)	Prudential Plc	Citibank	104.709		Group Plc	Citibank	181.263
161.606	QinetiQ Group Plc	Bank of America		(291.409)	Royal Bank of Scotland		
		Merrill Lynch	67.669		Group Plc	JP Morgan	(8.135)
389.918	QinetiQ Group Plc	Citibank	105.737	(78.143)	Royal Dutch Shell Plc 'B'	Bank of America	
36.975	QinetiQ Group Plc	JP Morgan	18.628			Merrill Lynch	87.775
10.782	QinetiQ Group Plc	Credit Suisse	5.432	(47.675)	Royal Dutch Shell Plc 'B'	JP Morgan	(34.856)
240.302	QinetiQ Group Plc	Deutsche Bank	100.622	83.371	Royal Mail Plc	Credit Suisse	(95.309)
(8.555)	Randgold Resources Ltd	Deutsche Bank	(21.607)	1.751.477	Royal Mail Plc	Bank of America	
(30.755)	Randgold Resources Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(1.918.689)
		Merrill Lynch	(79.353)	1.176.138	Royal Mail Plc	JP Morgan	(1.347.174)
(9.034)	Randgold Resources Ltd	JP Morgan	961	(200.521)	RPC Group Plc	JP Morgan	(30.920)
(12.546)	Randgold Resources Ltd	Citibank	(38.358)	(152.018)	RPC Group Plc	Credit Suisse	(9.881)
(7.348)	Randgold Resources Ltd	Credit Suisse	(14.036)	(261.735)	RPC Group Plc	Deutsche Bank	(50.101)
(66.968)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America		(138.540)	RPC Group Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(65.984)			Merrill Lynch	(19.385)
(55.149)	Reckitt Benckiser Group Plc	Deutsche Bank	(64.512)	(221.446)	RPC Group Plc	Citibank	81.246
(49.083)	Reckitt Benckiser Group Plc	Credit Suisse	(74.310)	15.428	RSA Insurance Group Plc	Credit Suisse	2.338
(6.314)	Reckitt Benckiser Group Plc	JP Morgan	(14.184)	9.315	RSA Insurance Group Plc	Citibank	(2.699)
48.501	Redrow Plc	Bank of America		70.502	RSA Insurance Group Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(23.855)			Merrill Lynch	(1.484)
44.321	Redrow Plc	Deutsche Bank	(8.534)	(940.768)	Saga Plc	Bank of America	
96.485	Redrow Plc	Credit Suisse	(23.235)			Merrill Lynch	92.542
134.410	RELX Plc	Bank of America		(113.242)	Saga Plc	JP Morgan	11.440
		Merrill Lynch	116.576	(639.718)	Saga Plc	Credit Suisse	63.046
145.590	RELX Plc	Citibank	35.804	(146.755)	Saga Plc	Deutsche Bank	4.515
177.279	RELX Plc	JP Morgan	181.456				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
68.711	Sage Group Plc/The	Bank of America		(27.269)	St James's Place Plc	Credit Suisse	(8.156)
		Merrill Lynch	3.836	(58.705)	St James's Place Plc	Deutsche Bank	(11.627)
174.795	Sage Group Plc/The	JP Morgan	31.136	(67.948)	St James's Place Plc	Citibank	23.484
89.289	Sage Group Plc/The	Deutsche Bank	4.985	(65.176)	St James's Place Plc	JP Morgan	(19.494)
40.187	Schroders Plc	Bank of America		(64.753)	St James's Place Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(89.212)			Merrill Lynch	(8.673)
36.769	Schroders Plc	JP Morgan	(67.261)	(243.707)	Standard Life Aberdeen Plc	Bank of America	
28.648	Schroders Plc	Credit Suisse	(51.215)			Merrill Lynch	51.510
39.662	Schroders Plc	Deutsche Bank	(88.047)	(661.550)	Standard Life Aberdeen Plc	Deutsche Bank	139.824
11.491	Schroders Plc	Citibank	(34.063)	(769.055)	Standard Life Aberdeen Plc	Citibank	196.282
(2.485)	Severn Trent Plc	Deutsche Bank	(628)	(118.978)	Standard Life Aberdeen Plc	Credit Suisse	23.244
(28.621)	Severn Trent Plc	Credit Suisse	435	310.940	TalkTalk Telecom Group Plc	Bank of America	
(30.098)	Severn Trent Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(85.146)
		Merrill Lynch	(7.602)	52.315	TalkTalk Telecom Group Plc	Citibank	(8.484)
(26.173)	Severn Trent Plc	Citibank	26.616	20.451	TalkTalk Telecom Group Plc	JP Morgan	(6.144)
(3.759)	Severn Trent Plc	JP Morgan	700	198.070	TalkTalk Telecom Group Plc	Deutsche Bank	(54.239)
(158.821)	Shaftesbury Plc (Reit)	Bank of America		275.446	Tate & Lyle Plc	Citibank	318.551
		Merrill Lynch	124.095	200.633	Tate & Lyle Plc	JP Morgan	246.432
(13.326)	Shaftesbury Plc (Reit)	Citibank	10.894	2.970	Tate & Lyle Plc	Credit Suisse	3.648
(44.535)	Shaftesbury Plc (Reit)	JP Morgan	48.840	527.568	Tate & Lyle Plc	Bank of America	
(161.913)	Shaftesbury Plc (Reit)	Deutsche Bank	129.816			Merrill Lynch	631.940
(33.853)	Shaftesbury Plc (Reit)	Credit Suisse	37.126	196.275	Tate & Lyle Plc	Deutsche Bank	243.688
(39.870)	Shire Plc	Citibank	54.854	276.611	Taylor Wimpey Plc	Bank of America	
(12.206)	Shire Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(42.837)
		Merrill Lynch	15.889	532.999	Taylor Wimpey Plc	JP Morgan	(12.753)
(27.834)	Shire Plc	JP Morgan	(29.785)	1.112.641	Taylor Wimpey Plc	Credit Suisse	(38.025)
(91.662)	Sky Plc	Credit Suisse	15.190	996.944	Taylor Wimpey Plc	Deutsche Bank	(145.902)
(87.933)	Sky Plc	Bank of America		191.683	Taylor Wimpey Plc	Citibank	(36.564)
		Merrill Lynch	28.638	(616.367)	Tesco Plc	Deutsche Bank	(8.193)
(12.600)	Sky Plc	Citibank	3.099	(383.663)	Tesco Plc	Citibank	(2.040)
(14.314)	Sky Plc	JP Morgan	951	(281.532)	Tesco Plc	JP Morgan	(18.452)
187.801	Smith & Nephew Plc	Bank of America		1.447.698	Thomas Cook Group Plc	Citibank	(86.599)
		Merrill Lynch	167.261	1.448.999	Thomas Cook Group Plc	Credit Suisse	(431.626)
465.245	Smith & Nephew Plc	Citibank	264.982	742.221	Thomas Cook Group Plc	Deutsche Bank	(249.618)
30.460	Smith & Nephew Plc	JP Morgan	26.926	1.386.071	Thomas Cook Group Plc	Bank of America	
24.081	Smith & Nephew Plc	Credit Suisse	21.287			Merrill Lynch	(315.075)
269.734	Smith & Nephew Plc	Deutsche Bank	228.231	635.579	Thomas Cook Group Plc	JP Morgan	(161.371)
98.994	Smiths Group Plc	Bank of America		23.708	TP ICAP Plc	Citibank	(5.578)
		Merrill Lynch	130.935	26.639	TP ICAP Plc	Deutsche Bank	(7.720)
47.034	Smiths Group Plc	Citibank	21.883	94.799	TP ICAP Plc	Bank of America	
6.068	Smiths Group Plc	Credit Suisse	8.349			Merrill Lynch	(27.472)
36.680	Smiths Group Plc	Deutsche Bank	48.515	79.043	TP ICAP Plc	JP Morgan	(40.424)
(328.139)	Sophos Group Plc '144A'	Deutsche Bank	(187.564)	60.523	Travis Perkins Plc	Credit Suisse	34.997
(73.688)	Sophos Group Plc '144A'	JP Morgan	(48.977)	48.593	Travis Perkins Plc	Citibank	(323)
(13.120)	Sophos Group Plc '144A'	Citibank	(3.488)	93.731	Travis Perkins Plc	JP Morgan	54.200
17.423	Spectris Plc	Citibank	3.474	33.076	TUI AG	Credit Suisse	(3.078)
52.205	Spectris Plc	Credit Suisse	40.852	19.593	TUI AG	Deutsche Bank	(9.376)
18.299	Spectris Plc	Deutsche Bank	11.433	87.201	TUI AG	Bank of America	
52.999	Spectris Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(36.828)
		Merrill Lynch	33.112	32.954	TUI AG	Citibank	(9.637)
(544)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Credit Suisse	(2.025)	(1.260.649)	Tullow Oil Plc	JP Morgan	(425.648)
(29.955)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Deutsche Bank	(89.593)	(216.786)	UBM Plc	Bank of America	
(5.461)	Spirax-Sarco Engineering Plc	JP Morgan	(20.326)			Merrill Lynch	(138.323)
(11.574)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Bank of America		(43.434)	UBM Plc	Citibank	(15.012)
		Merrill Lynch	(30.652)	(87.118)	UBM Plc	Credit Suisse	(49.995)
(2.338)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Citibank	(932)	(8.228)	UBM Plc	JP Morgan	(4.594)
(302.505)	Sports Direct International Plc	Credit Suisse	(8.292)	13.459	UDG Healthcare Plc	Citibank	3.220
(252.279)	Sports Direct International Plc	Citibank	43.931	18.703	UDG Healthcare Plc	Bank of America	
(243.019)	Sports Direct International Plc	JP Morgan	5.486			Merrill Lynch	(7.086)
58.918	SSE Plc	Bank of America		(61.591)	United Utilities Group Plc	Deutsche Bank	(15.392)
		Merrill Lynch	(37.321)	(160.785)	United Utilities Group Plc	Bank of America	
11.168	SSE Plc	Citibank	(8.685)			Merrill Lynch	(38.652)
21.107	SSE Plc	JP Morgan	(5.050)	(109.413)	United Utilities Group Plc	Citibank	29.670
60.129	SSE Plc	Credit Suisse	(14.387)	(108.138)	United Utilities Group Plc	JP Morgan	(11.212)
205.194	SSE Plc	Deutsche Bank	(73.638)	27.699	Vedanta Resources Plc	Credit Suisse	(10.825)
27.239	SSP Group Plc	Bank of America		12.753	Vedanta Resources Plc	Citibank	(23.293)
		Merrill Lynch	9.088	5.644	Vedanta Resources Plc	Deutsche Bank	(5.702)
322.682	SSP Group Plc	Credit Suisse	(15.013)	13.680	Vedanta Resources Plc	Bank of America	
209.899	SSP Group Plc	Citibank	10.324			Merrill Lynch	(13.820)
449.955	SSP Group Plc	Deutsche Bank	150.129	10.293	Vedanta Resources Plc	JP Morgan	(4.023)
339.246	SSP Group Plc	JP Morgan	(11.860)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Royaume-Uni suite				Etats-Unis suite			
(12.008)	Victrex Plc	Bank of America		2.469	Aaron's Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(28.732)			Merrill Lynch	198
(15.585)	Victrex Plc	Credit Suisse	(26.104)	17.120	Aaron's Inc	JP Morgan	14.811
(2.091)	Victrex Plc	JP Morgan	(3.502)	(12.304)	Abbott Laboratories	Bank of America	
(172.213)	Virgin Money Holdings UK Plc	Credit Suisse	(2.291)			Merrill Lynch	(18.702)
(7.713)	Virgin Money Holdings UK Plc	Deutsche Bank	(174)	(20.541)	Abbott Laboratories	Credit Suisse	(68.812)
(55.701)	Virgin Money Holdings UK Plc	Bank of America		(20.913)	Abbott Laboratories	Deutsche Bank	(31.788)
		Merrill Lynch	(1.259)	(7.084)	Abbott Laboratories	JP Morgan	(23.731)
(16.398)	Virgin Money Holdings UK Plc	Citibank	(22)	24.822	AbbVie Inc	JP Morgan	(3.816)
(80.794)	Virgin Money Holdings UK Plc	JP Morgan	(1.181)	58.673	AbbVie Inc	Bank of America	
840.415	Vodafone Group Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(194.208)
		Merrill Lynch	(52.406)	2.702	AbbVie Inc	Citibank	(14.483)
360.690	Vodafone Group Plc	Citibank	(32.604)	18.396	AbbVie Inc	Deutsche Bank	(60.891)
206.788	Vodafone Group Plc	JP Morgan	(47.120)	(1.672)	Abiomed Inc	Credit Suisse	(67.933)
371.767	Vodafone Group Plc	Deutsche Bank	(29.849)	(3.656)	Abiomed Inc	Citibank	(6.069)
482.884	Vodafone Group Plc	Credit Suisse	(62.778)	(10.546)	Acadia Healthcare Co Inc	Bank of America	
(23.951)	Weir Group Plc/The	Citibank	42.026			Merrill Lynch	17.083
(28.253)	Weir Group Plc/The	JP Morgan	13.896	(39.131)	Acadia Healthcare Co Inc	Citibank	59.870
(130.898)	Weir Group Plc/The	Credit Suisse	67.195	(47.455)	Acadia Healthcare Co Inc	JP Morgan	33.465
(46.640)	Weir Group Plc/The	Deutsche Bank	58.279	(75.372)	Acadia Healthcare Co Inc	Credit Suisse	38.440
(59.015)	Weir Group Plc/The	Bank of America		(21.779)	Acadia Healthcare Co Inc	Deutsche Bank	18.294
		Merrill Lynch	77.440	(65.681)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
128.896	WH Smith Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(12.689)
		Merrill Lynch	(75.390)	(36.963)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Citibank	(36.224)
89.371	WH Smith Plc	Citibank	(62.964)	(101.851)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	(4.760)
117.003	WH Smith Plc	JP Morgan	(26.440)	(14.571)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	(1.749)
61.881	WH Smith Plc	Deutsche Bank	(36.194)	(29.225)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Deutsche Bank	10.229
47.127	WH Smith Plc	Credit Suisse	(31.167)	(6.051)	Acadia Realty Trust (Reit)	Citibank	(6.475)
(4.461)	Whitbread Plc	Citibank	474	(7.373)	Acadia Realty Trust (Reit)	Bank of America	
(31.443)	Whitbread Plc	Bank of America				Merrill Lynch	(14.304)
		Merrill Lynch	(18.809)	(7.089)	Acadia Realty Trust (Reit)	JP Morgan	(10.775)
(1.054)	Whitbread Plc	Credit Suisse	420	(6.288)	Acadia Realty Trust (Reit)	Credit Suisse	(9.558)
(19.894)	Whitbread Plc	Deutsche Bank	(12.170)	(10.383)	Acadia Realty Trust (Reit)	Deutsche Bank	(20.143)
(31.460)	Whitbread Plc	JP Morgan	12.546	22.353	Accenture Plc 'A'	Citibank	23.247
220.561	William Hill Plc	Citibank	(31.665)	3.942	Accenture Plc 'A'	Bank of America	
93.653	William Hill Plc	JP Morgan	47.681			Merrill Lynch	9.067
1.166.734	William Hill Plc	Bank of America		(63.551)	ACI Worldwide Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	72.189			Merrill Lynch	(123.289)
134.565	William Hill Plc	Credit Suisse	40.834	(42.067)	ACI Worldwide Inc	Citibank	(26.082)
444.515	William Hill Plc	Deutsche Bank	28.954	(37.699)	ACI Worldwide Inc	JP Morgan	(34.078)
284.982	Wm Morrison	Bank of America		(5.466)	ACI Worldwide Inc	Credit Suisse	(5.466)
	Supermarkets Plc	Merrill Lynch	(15.532)	(61.235)	ACI Worldwide Inc	Deutsche Bank	(118.796)
383.712	Wm Morrison			9.330	Activision Blizzard Inc	Bank of America	
	Supermarkets Plc	Citibank	(43.866)			Merrill Lynch	12.502
271.252	Wm Morrison			10.492	Activision Blizzard Inc	JP Morgan	19.935
	Supermarkets Plc	JP Morgan	4.327	1.318	Activision Blizzard Inc	Credit Suisse	2.504
89.516	Wm Morrison			6.591	Activision Blizzard Inc	Citibank	1.055
	Supermarkets Plc	Deutsche Bank	(4.879)	10.757	Acuity Brands Inc	Bank of America	
(15.421)	Workspace Group Plc (Reit)	Citibank	(1.025)			Merrill Lynch	44.621
(2.252)	Workspace Group Plc (Reit)	Deutsche Bank	(958)	14.166	Acuity Brands Inc	Citibank	27.199
(2.922)	Workspace Group Plc (Reit)	Bank of America		2.434	Acuity Brands Inc	Deutsche Bank	3.822
		Merrill Lynch	(1.243)	(55.660)	Acxiom Corp	Deutsche Bank	(128.575)
(33.498)	Workspace Group Plc (Reit)	JP Morgan	(15.585)	(27.965)	Acxiom Corp	Credit Suisse	(37.199)
(181.984)	WPP Plc	Bank of America		(25.162)	Adient Plc	Citibank	86.054
		Merrill Lynch	103.719	(38.716)	Adient Plc	Credit Suisse	143.479
(17.465)	WPP Plc	Citibank	28.672	(20.303)	Adient Plc	JP Morgan	77.151
(36.123)	WPP Plc	Deutsche Bank	19.688	7.625	Adobe Systems Inc	Bank of America	
			(6.994.442)			Merrill Lynch	88.327
				981	Adobe Systems Inc	JP Morgan	13.724
				5.694	Adobe Systems Inc	Deutsche Bank	68.043
				10.575	Adobe Systems Inc	Credit Suisse	134.156
				(11.411)	Advance Auto Parts Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(73.030)
				(16.782)	Advance Auto Parts Inc	Credit Suisse	(159.765)
				(4.253)	Advance Auto Parts Inc	Deutsche Bank	(27.219)
				15.220	Advanced Energy Industries Inc		
						Credit Suisse	35.638
				12.550	Advanced Energy Industries Inc	Citibank	20.833
				6.183	Advanced Energy Industries Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	11.377
Etats-Unis							
(46.022)	2U Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	(62.590)				
(10.209)	2U Inc	Citibank	(32.056)				
3.408	3M Co	JP Morgan	(12.610)	(16.782)	Advance Auto Parts Inc	Credit Suisse	(159.765)
4.154	3M Co	Bank of America		(4.253)	Advance Auto Parts Inc	Deutsche Bank	(27.219)
		Merrill Lynch	(18.153)	15.220	Advanced Energy Industries Inc		
5.442	3M Co	Deutsche Bank	(23.782)			Credit Suisse	35.638
6.595	Aaron's Inc	Credit Suisse	8.442	12.550	Advanced Energy Industries Inc	Citibank	20.833
9.722	Aaron's Inc	Deutsche Bank	778	6.183	Advanced Energy Industries Inc	Bank of America	
19.775	Aaron's Inc	Citibank	7.910			Merrill Lynch	11.377

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
9.415	Advanced Energy Industries Inc	Deutsche Bank	17.324	(8.186)	Akorn Inc	Bank of America	
11.929	Advanced Energy Industries Inc	JP Morgan	30.300	(12.242)	Albemarle Corp	Merrill Lynch	327
(43.694)	Advanced Micro Devices Inc	Citibank	(39.325)	(15.630)	Albemarle Corp	Credit Suisse	85.327
(307.427)	Advanced Micro Devices Inc	Credit Suisse	(669.619)	(20.124)	Albemarle Corp	Deutsche Bank	110.348
(63.386)	Advanced Micro Devices Inc	Deutsche Bank	(90.642)			Bank of America	
(3.007)	Advanced Micro Devices Inc	Bank of America		(4.634)	Albemarle Corp	Merrill Lynch	145.833
		Merrill Lynch	(4.300)	(9.798)	Albemarle Corp	Citibank	39.806
(94.177)	Advanced Micro Devices Inc	JP Morgan	(213.782)	30.274	Alcoa Corp	JP Morgan	68.292
(44.640)	AECOM	Bank of America		142.558	Alcoa Corp	Credit Suisse	(136.536)
		Merrill Lynch	16.826			Bank of America	
(61.067)	AECOM	Citibank	7.939	44.125	Alcoa Corp	Merrill Lynch	(165.218)
(16.644)	AECOM	Deutsche Bank	2.969	1.805	Alexander's Inc (Reit)	Citibank	(19.415)
(22.571)	AECOM	Credit Suisse	49.656			Bank of America	
(3.564)	AECOM	JP Morgan	7.841	628	Alexander's Inc (Reit)	Merrill Lynch	10.902
111.338	AerCap Holdings NV	Bank of America		905	Alexander's Inc (Reit)	Credit Suisse	955
		Merrill Lynch	(56.157)	251	Alexander's Inc (Reit)	Citibank	3.330
81.435	AerCap Holdings NV	Citibank	(17.101)	138	Alexander's Inc (Reit)	Deutsche Bank	1.516
79.240	AerCap Holdings NV	JP Morgan	32.488	(2.007)	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	JP Morgan	210
4.939	AerCap Holdings NV	Credit Suisse	2.025			Deutsche Bank	(1.846)
21.322	AerCap Holdings NV	Deutsche Bank	(9.382)	(4.777)	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	JP Morgan	15.621
70.997	AES Corp/VA	Deutsche Bank	26.624	(7.994)	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Bank of America	
133.042	AES Corp/VA	Bank of America				Merrill Lynch	(7.354)
		Merrill Lynch	55.921	(8.062)	Alexion Pharmaceuticals Inc	Citibank	20.074
48.561	AES Corp/VA	JP Morgan	45.890	(6.326)	Alexion Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
108.234	AES Corp/VA	Citibank	51.411			Merrill Lynch	30.845
176.607	AES Corp/VA	Credit Suisse	137.014	3.713	Align Technology Inc	Citibank	145.958
1.029	Affiliated Managers Group Inc	Deutsche Bank	(7.244)	3.025	Align Technology Inc	JP Morgan	216.923
142.152	Aflac Inc	Citibank	(82.448)	2.650	Align Technology Inc	Bank of America	
36.966	Aflac Inc	JP Morgan	6.654			Merrill Lynch	141.510
34.932	Aflac Inc	Bank of America		(5.863)	Alkermes Plc	Citibank	(11.140)
		Merrill Lynch	(3.493)	(53.341)	Alkermes Plc	Credit Suisse	(165.866)
36.354	Aflac Inc	Credit Suisse	6.544	(21.314)	Alkermes Plc	JP Morgan	(70.123)
11.636	Aflac Inc	Deutsche Bank	(1.164)	(1.026)	Alkermes Plc	Deutsche Bank	(1.272)
14.726	AGCO Corp	Credit Suisse	15.163	(567)	Alleghany Corp	Credit Suisse	1.400
1.334	AGCO Corp	Deutsche Bank	614	(2.666)	Alleghany Corp	Deutsche Bank	37.648
8.116	AGCO Corp	Bank of America		(1.688)	Alleghany Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.733			Merrill Lynch	23.029
6.131	AGCO Corp	JP Morgan	9.871	(1.303)	Alleghany Corp	Citibank	15.401
5.275	AGCO Corp	Citibank	(12.818)	(40.430)	Allegheny Technologies Inc	Citibank	(4.852)
10.826	Agilent Technologies Inc	Bank of America		(87.875)	Allegheny Technologies Inc	JP Morgan	8.866
		Merrill Lynch	1.949	(71.447)	Allegheny Technologies Inc	Credit Suisse	1.429
45.231	Agilent Technologies Inc	JP Morgan	(174.908)	(70.874)	Allegheny Technologies Inc	Deutsche Bank	(13.692)
28.798	Agilent Technologies Inc	Credit Suisse	(50.276)	(2.367)	Allegiant Travel Co	Bank of America	
25.516	Agilent Technologies Inc	Deutsche Bank	4.593			Merrill Lynch	8.876
(11.336)	Agios Pharmaceuticals Inc	Citibank	(72.210)	(8.754)	Allegiant Travel Co	JP Morgan	55.596
(8.306)	Agios Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	(50.520)	(10.007)	Allegiant Travel Co	Citibank	(5.004)
(11.159)	Agios Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	(120.406)	(3.116)	Allegiant Travel Co	Credit Suisse	24.772
(30.768)	Agios Pharmaceuticals Inc	Deutsche Bank	(211.376)	8.669	Allegion Plc	Credit Suisse	22.626
16.383	AGNC Investment Corp (Reit)	Credit Suisse	5.161	8.322	Allegion Plc	Bank of America	
4.927	AGNC Investment Corp (Reit)	Deutsche Bank	1.207			Merrill Lynch	8.827
150	AGNC Investment Corp (Reit)	Bank of America		10.316	Allegion Plc	Citibank	(1.754)
		Merrill Lynch	37	4.148	Allegion Plc	JP Morgan	10.826
17.364	AGNC Investment Corp (Reit)	Citibank	87	10.279	Allegion Plc	Deutsche Bank	20.969
9.898	AGNC Investment Corp (Reit)	JP Morgan	3.118	(13.139)	Allergan Plc	Citibank	40.862
(10.285)	Air Lease Corp	Citibank	6.891	(7.349)	Allergan Plc	JP Morgan	25.190
(4.919)	Air Lease Corp	Bank of America		(13.735)	Allergan Plc	Credit Suisse	(98.469)
		Merrill Lynch	1.574	(15.645)	Allergan Plc	Deutsche Bank	14.706
(20.056)	Air Lease Corp	JP Morgan	(3.270)	(16.083)	ALLETE Inc	Bank of America	
(8.049)	Air Lease Corp	Deutsche Bank	2.576			Merrill Lynch	(41.172)
5.478	Air Products & Chemicals Inc	Bank of America		(8.918)	ALLETE Inc	Citibank	(23.187)
		Merrill Lynch	(18.132)	(9.356)	ALLETE Inc	JP Morgan	(5.614)
1.352	Air Products & Chemicals Inc	Citibank	(6.679)	(226)	ALLETE Inc	Credit Suisse	(136)
4.960	Air Products & Chemicals Inc	JP Morgan	(7.482)	(983)	ALLETE Inc	Deutsche Bank	(2.516)
(173.646)	AK Steel Holding Corp	Credit Suisse	(53.830)	(2.529)	Alliance Data Systems Corp	Citibank	1.087
(657.460)	AK Steel Holding Corp	Deutsche Bank	(203.813)	(4.365)	Alliance Data Systems Corp	Deutsche Bank	(19.424)
(63.945)	AK Steel Holding Corp	Citibank	(12.150)	(273)	Alliance Data Systems Corp	Credit Suisse	(2.883)
22.949	Akamai Technologies Inc	Citibank	(18.359)	10.863	Alliant Energy Corp	Bank of America	
18.930	Akamai Technologies Inc	Deutsche Bank	(13.251)			Merrill Lynch	3.042
(13.372)	Akorn Inc	Citibank	(5.215)	9.713	Alliant Energy Corp	Citibank	10.199

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
1.971	Alliant Energy Corp	JP Morgan	(769)	17.183	Ameren Corp	Bank of America	
9.730	Alliant Energy Corp	Credit Suisse	(3.795)			Merrill Lynch	47.425
2.397	Alliant Energy Corp	Deutsche Bank	671	30.990	Ameren Corp	JP Morgan	77.789
64.775	Allison Transmission Holdings Inc	Bank of America		17.860	Ameren Corp	Citibank	44.293
		Merrill Lynch	(92.100)	33.331	Ameren Corp	Deutsche Bank	91.994
99.109	Allison Transmission Holdings Inc	Citibank	(232.906)	8.591	American Airlines Group Inc	JP Morgan	1.375
30.365	Allison Transmission Holdings Inc	JP Morgan	(17.004)	33.447	American Airlines Group Inc	Bank of America	
57.947	Allison Transmission Holdings Inc	Credit Suisse	(32.450)			Merrill Lynch	(22.092)
14.758	Allison Transmission Holdings Inc	Deutsche Bank	(16.824)	10.686	American Airlines Group Inc	Citibank	2.992
(17.940)	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Bank of America		51.354	American Airlines Group Inc	Credit Suisse	25.116
		Merrill Lynch	(4.664)	(13.421)	American Campus Communities Inc (Reit)	Citibank	(33.418)
(7.544)	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Citibank	(1.961)	(64.961)	American Campus Communities Inc (Reit)	Bank of America	
3.629	Allstate Corp/The	JP Morgan	(8.238)			Merrill Lynch	(129.752)
1.194	Allstate Corp/The	Credit Suisse	(2.710)	(45.831)	American Campus Communities Inc (Reit)	JP Morgan	(56.202)
21.830	Allstate Corp/The	Deutsche Bank	(52.829)	(22.981)	American Campus Communities Inc (Reit)	Credit Suisse	(2.988)
39.171	Allstate Corp/The	Bank of America		(11.716)	American Campus Communities Inc (Reit)	Deutsche Bank	(20.972)
		Merrill Lynch	(94.794)	64.116	American Eagle Outfitters Inc	Credit Suisse	88.495
24.023	Allstate Corp/The	Citibank	(58.616)	11.952	American Eagle Outfitters Inc	Deutsche Bank	10.876
(17.686)	Ally Financial Inc	Citibank	26.529	89.802	American Eagle Outfitters Inc	JP Morgan	231.136
(700)	Ally Financial Inc	JP Morgan	427	83.743	American Eagle Outfitters Inc	Bank of America	
(13.764)	Ally Financial Inc	Bank of America				Merrill Lynch	76.206
		Merrill Lynch	8.809	4.699	American Eagle Outfitters Inc	Citibank	1.833
(7.780)	Ally Financial Inc	Credit Suisse	4.746	11.350	American Electric Power Co Inc	JP Morgan	4.654
(9.117)	Ally Financial Inc	Deutsche Bank	5.835	498	American Electric Power Co Inc	Deutsche Bank	423
(16.824)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Citibank	(49.463)	9.629	American Electric Power Co Inc	Bank of America	
(2.638)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	(15.195)			Merrill Lynch	8.185
(6.847)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	(11.591)	3.329	American Electric Power Co Inc	Citibank	7.390
(222)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Bank of America		5.723	American Electric Power Co Inc	Credit Suisse	2.346
		Merrill Lynch	20			Credit Suisse	(23.998)
(939)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Deutsche Bank	85	10.691	American Express Co	Bank of America	
2.644	Alphabet Inc 'A'	Bank of America		7.107	American Express Co	Merrill Lynch	(14.996)
		Merrill Lynch	26.546	13.171	American Express Co	Deutsche Bank	(27.791)
1.689	Alphabet Inc 'A'	Citibank	33.104	4.646	American Express Co	JP Morgan	(5.157)
345	Alphabet Inc 'A'	JP Morgan	12.530	13.682	American Express Co	Citibank	(55.686)
448	Alphabet Inc 'A'	Deutsche Bank	4.498	12.105	American Financial Group Inc/OH	Bank of America	
(876)	Alphabet Inc 'C'	JP Morgan	448			Merrill Lynch	5.084
(1.695)	Alphabet Inc 'C'	Citibank	(23.679)	11.129	American Financial Group Inc/OH	JP Morgan	(4.659)
(21.375)	Altria Group Inc	Credit Suisse	(12.398)	22.902	American Financial Group Inc/OH	Credit Suisse	411
(10.986)	Altria Group Inc	Citibank	(7.031)	3.938	American Financial Group Inc/OH	Deutsche Bank	1.654
(37.143)	Altria Group Inc	JP Morgan	(21.543)	27.143	American Financial Group Inc/OH	Citibank	(35.014)
(6.318)	Altria Group Inc	Bank of America		(15.881)	American Homes 4 Rent 'A' (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.413)			Merrill Lynch	2.620
(1.296)	Amazon.com Inc	JP Morgan	(47.746)	(48.687)	American Homes 4 Rent 'A' (Reit)	Citibank	(14.363)
(1.730)	Amazon.com Inc	Credit Suisse	(60.654)	(20.208)	American Homes 4 Rent 'A' (Reit)	Credit Suisse	6.648
(604)	Amazon.com Inc	Deutsche Bank	(31.003)	(40.690)	American International Group Inc	JP Morgan	30.876
(2.162)	Amazon.com Inc	Bank of America		(11.532)	American International Group Inc	Credit Suisse	6.343
		Merrill Lynch	(110.975)	(23.775)	American International Group Inc	Bank of America	
(481)	Amazon.com Inc	Citibank	(22.150)			Merrill Lynch	16.643
(19.530)	Ambarella Inc	Citibank	7.421	4.900	American National Insurance Co	Credit Suisse	(13.746)
(12.775)	Ambarella Inc	JP Morgan	1.150	(7.739)	American Tower Corp (Reit)	Deutsche Bank	(6.036)
(4.923)	Ambarella Inc	Credit Suisse	443	(6.120)	American Tower Corp (Reit)	Citibank	(2.020)
(73.652)	Ambarella Inc	Deutsche Bank	18.233	(3.912)	American Tower Corp (Reit)	Credit Suisse	(2.364)
40.874	AMC Networks Inc 'A'	JP Morgan	140.470	(3.503)	American Tower Corp (Reit)	Bank of America	
16.561	AMC Networks Inc 'A'	Credit Suisse	87.111			Merrill Lynch	(2.732)
45.749	AMC Networks Inc 'A'	Deutsche Bank	62.219				
8.403	AMC Networks Inc 'A'	Bank of America					
		Merrill Lynch	11.428				
33.009	AMC Networks Inc 'A'	Citibank	6.272				
(1.491)	AMERCO	Deutsche Bank	35.575				
(68)	AMERCO	Credit Suisse	254				
(7.462)	AMERCO	Bank of America					
		Merrill Lynch	174.026				
(1.266)	AMERCO	Citibank	26.548				
(2.300)	AMERCO	JP Morgan	49.696				
29.745	Ameren Corp	Credit Suisse	67.521				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(19.445)	American Water Works Co Inc	Bank of America		(5.465)	Anixter International Inc	Credit Suisse	(6.831)
(12.135)	American Water Works Co Inc	Merrill Lynch	(56.466)	(4.293)	Anixter International Inc	Deutsche Bank	4.046
(9.688)	American Water Works Co Inc	Deutsche Bank	(32.036)	38.888	Annaly Capital Management Inc (Reit)	Deutsche Bank	8.166
(11.378)	American Water Works Co Inc	Citibank	(34.974)	5.385	Anslys Inc	Credit Suisse	(20.301)
6.605	Ameriprise Financial Inc	JP Morgan	(40.094)	430	Anslys Inc	Deutsche Bank	(761)
21.447	Ameriprise Financial Inc	Bank of America	2.774	51	Anslys Inc	JP Morgan	(192)
15.362	Ameriprise Financial Inc	Merrill Lynch	(121.390)	13.504	Antero Resources Corp	Bank of America	135
1.513	Ameriprise Financial Inc	Citibank	65.596	44.869	Antero Resources Corp	Merrill Lynch	135
8.471	Ameriprise Financial Inc	JP Morgan	6.461	38.291	Antero Resources Corp	Credit Suisse	7.531
13.673	AmerisourceBergen Corp	Credit Suisse	3.558	11.036	Antero Resources Corp	Citibank	(3.829)
9.541	AmerisourceBergen Corp	Deutsche Bank	(33.196)	57.325	Antero Resources Corp	Deutsche Bank	110
6.079	AmerisourceBergen Corp	Bank of America	(12.749)	7.396	Anthem Inc	JP Morgan	13.777
2.959	AmerisourceBergen Corp	Merrill Lynch	(8.085)	4.964	Anthem Inc	Bank of America	(8.505)
585	AmerisourceBergen Corp	JP Morgan	(3.403)	2.467	Anthem Inc	Merrill Lynch	(20.898)
(8.691)	AMETEK Inc	Credit Suisse	(1.351)	854	Anthem Inc	Citibank	(3.935)
(24.597)	AMETEK Inc	Deutsche Bank	(8.778)	17.721	AO Smith Corp	Deutsche Bank	(3.698)
(5.467)	AMETEK Inc	Bank of America	(5.165)	41.419	AO Smith Corp	Credit Suisse	16.303
33.330	Amgen Inc	Merrill Lynch	6.068	12.568	AO Smith Corp	Merrill Lynch	31.577
24.605	Amgen Inc	Citibank	387.961	16.646	AO Smith Corp	Citibank	2.639
37.691	Amgen Inc	Credit Suisse	191.673	47.806	AO Smith Corp	JP Morgan	15.314
20.703	Amgen Inc	Deutsche Bank	66.713	3.298	AO Smith Corp	Deutsche Bank	33.619
11.931	Amgen Inc	Aon Plc	237.269	2.632	AO Smith Corp	Deutsche Bank	(3.595)
33.759	Amkor Technology Inc	Citibank	48.246	16.853	Apache Corp	Citibank	674
22.475	Amkor Technology Inc	JP Morgan	24.644	11.950	Apache Corp	Credit Suisse	
175	Amkor Technology Inc	Bank of America	81	10.179	Apache Corp	Bank of America	(28.202)
4.186	AMN Healthcare Services Inc	Merrill Lynch	3.056	33.982	Apache Corp	Merrill Lynch	(30.232)
29.510	AMN Healthcare Services Inc	Citibank	74.949	579	Apartment Investment & Management Co 'A' (Reit)	JP Morgan	(32.727)
9.143	AMN Healthcare Services Inc	Credit Suisse	(5.029)	2.516	Apartment Investment & Management Co 'A' (Reit)	Credit Suisse	(197)
20.635	AMN Healthcare Services Inc	JP Morgan	(10.318)	12.155	Apartment Investment & Management Co 'A' (Reit)	Citibank	3.623
(53.285)	Amphenol Corp 'A'	Deutsche Bank	(57.124)	6.814	Apartment Investment & Management Co 'A' (Reit)	JP Morgan	(4.133)
(2.420)	Amphenol Corp 'A'	Citibank	(4.429)	10.210	Apartment Investment & Management Co 'A' (Reit)	Deutsche Bank	6.269
(7.671)	Amphenol Corp 'A'	JP Morgan	2.225	26.970	Apartment Investment & Management Co 'A' (Reit)	Bank of America	9.393
(35.627)	Amphenol Corp 'A'	Credit Suisse	18.882	31.207	Apple Hospitality Inc (Reit)	Merrill Lynch	25.622
(160.272)	AmTrust Financial Services Inc	Deutsche Bank	(14.424)	33.696	Apple Hospitality Inc (Reit)	Bank of America	25.902
(18.964)	AmTrust Financial Services Inc	Citibank	8.155	28.972	Apple Hospitality Inc (Reit)	Merrill Lynch	27.968
(72.436)	AmTrust Financial Services Inc	Credit Suisse	(3.622)	12.539	Apple Hospitality Inc (Reit)	JP Morgan	27.523
(695)	AmTrust Financial Services Inc	JP Morgan	(63)	(6.207)	Apple Inc	Citibank	6.896
6.426	Anadarko Petroleum Corp	Citibank	(40)	(8.292)	Apple Inc	Deutsche Bank	(6.393)
5.117	Anadarko Petroleum Corp	Bank of America	3.531	(1.192)	Apple Inc	Bank of America	(8.541)
37.922	Anadarko Petroleum Corp	Merrill Lynch	(5.309)	(6.795)	Apple Inc	Merrill Lynch	(370)
30.766	Anadarko Petroleum Corp	Citibank	102.758	3.427	Applied Industrial Technologies Inc	Citibank	2.203
6.502	Anadarko Petroleum Corp	JP Morgan	4.486	43.536	Applied Industrial Technologies Inc	Credit Suisse	3.941
(24.596)	Analog Devices Inc	Deutsche Bank	(93.219)	34.224	Applied Industrial Technologies Inc	Deutsche Bank	—
(33.777)	Analog Devices Inc	Merrill Lynch	(168.939)	7.973	Applied Industrial Technologies Inc	Bank of America	—
(22.985)	Analog Devices Inc	Citibank	(37.695)	32.578	Applied Industrial Technologies Inc	Merrill Lynch	3.588
(9.574)	Analog Devices Inc	JP Morgan	(36.285)	128.992	Applied Materials Inc	JP Morgan	30.034
(28.163)	Analog Devices Inc	Credit Suisse	(119.415)	41.563	Applied Materials Inc	Bank of America	(242.660)
4.082	Andeavor	Deutsche Bank	29.350	30.500	Applied Materials Inc	Merrill Lynch	(82.087)
(10.163)	Anixter International Inc	JP Morgan	15.245	32.636	Applied Materials Inc	Citibank	37.362
(6.740)	Anixter International Inc	Bank of America	4.718	1.526	Applied Materials Inc	Credit Suisse	(73.566)
(10.721)	Anixter International Inc	Merrill Lynch	(13.401)	4.673	Applied Materials Inc	Deutsche Bank	(3.990)
		Citibank		8.373	AptarGroup Inc	Citibank	(2.103)
		JP Morgan		2.485	AptarGroup Inc	JP Morgan	14.653
					AptarGroup Inc	Deutsche Bank	3.504

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(23.640)	Aptiv Plc	Credit Suisse	(82.740)	18.193	Aspen Technology Inc	Citibank	(4.912)
(10.876)	Aptiv Plc	JP Morgan	(7.850)	4.686	Aspen Technology Inc	JP Morgan	16.167
(2.329)	Aptiv Plc	Citibank	2.329	(25.004)	Associated Banc-Corp	JP Morgan	6.666
(60.886)	Aqua America Inc	Citibank	(104.724)	(10.042)	Associated Banc-Corp	Credit Suisse	(5.022)
(21.833)	Aqua America Inc	Bank of America		(35.246)	Associated Banc-Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(39.954)			Merrill Lynch	(20.587)
(18.539)	Aqua America Inc	Deutsche Bank	(33.926)	7.085	Assurant Inc	Bank of America	
(26.140)	Aqua America Inc	JP Morgan	(22.219)			Merrill Lynch	36.063
(75.408)	Aqua America Inc	Credit Suisse	(127.806)	9.752	Assurant Inc	Citibank	(12.580)
(34.115)	Aramark	Bank of America		3.245	Assurant Inc	JP Morgan	26.901
		Merrill Lynch	(30.421)	697	Assurant Inc	Deutsche Bank	3.548
(22.216)	Aramark	Citibank	(1.111)	15.336	Assured Guaranty Ltd	Bank of America	
(20.763)	Aramark	JP Morgan	2.229			Merrill Lynch	(3.221)
(25.877)	Aramark	Credit Suisse	(8.436)	23.135	Assured Guaranty Ltd	Citibank	(17.351)
(37.414)	Aramark	Deutsche Bank	(31.802)	21.469	Assured Guaranty Ltd	JP Morgan	7.085
5	Arch Capital Group Ltd	Credit Suisse	(8)	14.505	Assured Guaranty Ltd	Credit Suisse	4.787
8.966	Arch Capital Group Ltd	JP Morgan	(14.615)	16.241	Assured Guaranty Ltd	Deutsche Bank	(3.411)
705	Arch Capital Group Ltd	Bank of America		33.258	AT&T Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	155			Merrill Lynch	6.485
(17.337)	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America		100.936	AT&T Inc	Citibank	(14.636)
		Merrill Lynch	(14.563)	13.718	AT&T Inc	Credit Suisse	8.025
(24.993)	Archer-Daniels-Midland Co	Credit Suisse	7.254	2.199	AT&T Inc	Deutsche Bank	429
(18.405)	Archer-Daniels-Midland Co	Deutsche Bank	6.810	111.800	AT&T Inc	JP Morgan	14.047
(10.741)	Archer-Daniels-Midland Co	JP Morgan	(967)	2.562	athenahealth Inc	Bank of America	
(140.755)	Arconic Inc	Credit Suisse	30.245			Merrill Lynch	6.066
(2.023)	Arconic Inc	Citibank	1.416	1.408	athenahealth Inc	Deutsche Bank	(2.880)
(39.740)	Arconic Inc	Deutsche Bank	4.371	19.674	Athene Holding Ltd 'A'	JP Morgan	(27.476)
(142.083)	Arconic Inc	Bank of America		101.478	Athene Holding Ltd 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	17.936			Merrill Lynch	(174.599)
(22.431)	Arconic Inc	JP Morgan	(1.570)	18.794	Athene Holding Ltd 'A'	Deutsche Bank	(33.265)
(2.516)	Arista Networks Inc	Bank of America		13.803	Athene Holding Ltd 'A'	Citibank	(29.262)
		Merrill Lynch	(12.078)	1.021	Atmos Energy Corp	Credit Suisse	2.001
(5.636)	Arista Networks Inc	Citibank	(26.884)	5.672	Atmos Energy Corp	Citibank	19.852
1.340	Armstrong World Industries Inc	JP Morgan	3.886	1.988	Atmos Energy Corp	Deutsche Bank	6.262
9.207	Armstrong World Industries Inc	Credit Suisse	26.700	4.551	Atmos Energy Corp	JP Morgan	8.920
7.000	Armstrong World Industries Inc			(21.956)	Autodesk Inc	Bank of America	
(98.235)	Array BioPharma Inc	Citibank	5.250			Merrill Lynch	113.293
		Bank of America		(1.085)	Autodesk Inc	Credit Suisse	1.910
(26.600)	Array BioPharma Inc	Merrill Lynch	(99.438)	(4.695)	Autodesk Inc	Citibank	26.808
(58.169)	Array BioPharma Inc	Credit Suisse	(74.480)	(27.146)	Autodesk Inc	Deutsche Bank	141.363
(17.061)	Array BioPharma Inc	Deutsche Bank	(61.659)	(927)	Autoliv Inc	Citibank	983
20.753	ARRIS International Plc	JP Morgan	(11.340)	(15.704)	Autoliv Inc	Deutsche Bank	(30.466)
17.989	ARRIS International Plc	JP Morgan	(29.469)	6.390	Automatic Data Processing Inc	Bank of America	
		Bank of America		4.830	Automatic Data Processing Inc	Merrill Lynch	17.171
		Merrill Lynch	(14.751)	19.073	Automatic Data Processing Inc	Credit Suisse	22.846
(8.809)	Arrow Electronics Inc	Bank of America				Deutsche Bank	65.420
		Merrill Lynch	97	(6.644)	AutoNation Inc	Deutsche Bank	399
(9.774)	Arrow Electronics Inc	Credit Suisse	3.546	(12.821)	AutoNation Inc	JP Morgan	18.334
(6.956)	Arrow Electronics Inc	JP Morgan	(184)	1.639	AutoZone Inc	Bank of America	
(25.261)	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America				Merrill Lynch	(9.185)
		Merrill Lynch	21.127	738	AutoZone Inc	JP Morgan	(5.122)
(13.081)	Arthur J Gallagher & Co	JP Morgan	32.964	7	AvalonBay Communities Inc (Reit)		1
7.458	ASGN Inc	Credit Suisse	(42.277)	4.114	AvalonBay Communities Inc (Reit)	Credit Suisse	782
11.136	ASGN Inc	Bank of America		5.398	AvalonBay Communities Inc (Reit)	Deutsche Bank	21.646
		Merrill Lynch	(53.230)	3.630	AvalonBay Communities Inc (Reit)	Bank of America	
5.446	ASGN Inc	Citibank	(27.829)			Merrill Lynch	14.556
11.036	ASGN Inc	Deutsche Bank	(52.752)	6.726	Avery Dennison Corp	Credit Suisse	9.215
(17.439)	Ashland Global Holdings Inc	Credit Suisse	(46.804)	14.482	Avery Dennison Corp	Citibank	(48.370)
(5.506)	Ashland Global Holdings Inc	JP Morgan	521	33.310	Avery Dennison Corp	Deutsche Bank	17.654
(5.317)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Deutsche Bank	(1.861)	9.398	Avery Dennison Corp	Bank of America	
(8.642)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	4.981
		Merrill Lynch	(3.025)	35.553	Avery Dennison Corp	JP Morgan	48.708
(15.026)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Credit Suisse	(3.367)	20.089	Avis Budget Group Inc	Credit Suisse	(83.168)
(16.977)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Citibank	(3.395)	27.735	Avis Budget Group Inc	Citibank	(95.408)
(41.649)	Aspen Insurance Holdings Ltd	JP Morgan	(10.274)	1.640	Avista Corp	Bank of America	
10.837	Aspen Technology Inc	Credit Suisse	37.388			Merrill Lynch	328
18.204	Aspen Technology Inc	Deutsche Bank	25.850				
35.188	Aspen Technology Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	49.967				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
3.867	Avista Corp	JP Morgan	2.243	6.214	Barnes Group Inc	Deutsche Bank	5.033
570	Avista Corp	Citibank	(11)	65.548	Baxter International Inc	Bank of America	
(44.846)	Avnet Inc	Deutsche Bank	65.027			Merrill Lynch	100.857
(147.463)	Avnet Inc	Credit Suisse	160.195	26.535	Baxter International Inc	JP Morgan	70.318
(48.733)	Avnet Inc	JP Morgan	33.962	5.557	Baxter International Inc	Credit Suisse	14.726
(36.074)	Avnet Inc	Bank of America		17.199	Baxter International Inc	Citibank	6.536
		Merrill Lynch	52.307	(7.617)	BB&T Corp	Bank of America	
(42.707)	Avnet Inc	Citibank	13.666			Merrill Lynch	22.013
2.026	AVX Corp	Credit Suisse	(263)	(12.199)	BB&T Corp	Citibank	35.743
17.064	AVX Corp	Deutsche Bank	(1.877)	(6.162)	BB&T Corp	Deutsche Bank	17.808
47.368	AVX Corp	Bank of America		(5.276)	BB&T Corp	JP Morgan	8.547
		Merrill Lynch	(5.210)	(92.107)	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America	
3.969	AVX Corp	Citibank	(635)			Merrill Lynch	(173.232)
18.468	AVX Corp	JP Morgan	(2.401)	(6.173)	Beacon Roofing Supply Inc	Credit Suisse	50.032
(53.526)	Axalta Coating Systems Ltd	Bank of America		(9.850)	Becton Dickinson and Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	15.487			Merrill Lynch	2.650
(6.988)	Axalta Coating Systems Ltd	JP Morgan	7.241	(15.384)	Becton Dickinson and Co	JP Morgan	(24.839)
(38.711)	Axalta Coating Systems Ltd	Credit Suisse	19.356	(1.753)	Becton Dickinson and Co	Credit Suisse	(4.437)
(35.629)	Axalta Coating Systems Ltd	Deutsche Bank	4.632	49.578	Bed Bath & Beyond Inc	Credit Suisse	60.981
10.775	Axis Capital Holdings Ltd	JP Morgan	(5.603)	86.662	Bed Bath & Beyond Inc	Bank of America	
2.670	Axis Capital Holdings Ltd	Deutsche Bank	(2.430)			Merrill Lynch	47.791
4.926	Axis Capital Holdings Ltd	Bank of America		65.526	Bed Bath & Beyond Inc	Citibank	23.589
		Merrill Lynch	(4.483)	45.196	Bed Bath & Beyond Inc	JP Morgan	55.591
(20.759)	B&G Foods Inc	Bank of America		(12.277)	Belden Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(24.911)			Merrill Lynch	2.701
(14.861)	B&G Foods Inc	Citibank	(22.292)	(2.138)	Belden Inc	Citibank	4.062
(17.850)	B&G Foods Inc	Credit Suisse	(35.700)	(6.944)	Belden Inc	Credit Suisse	9.786
(30.485)	B&G Foods Inc	Deutsche Bank	(36.582)	(7.004)	Belden Inc	Deutsche Bank	1.541
(109.559)	B&G Foods Inc	JP Morgan	(174.341)	(1.268)	Belden Inc	JP Morgan	4.184
(1.902)	Balchem Corp	Credit Suisse	(5.231)	4.820	Bemis Co Inc	Bank of America	
(8.784)	Balchem Corp	JP Morgan	(24.156)			Merrill Lynch	3.181
(9.304)	Balchem Corp	Deutsche Bank	(57.127)	1.797	Bemis Co Inc	JP Morgan	791
(12.339)	Balchem Corp	Bank of America		9.922	Bemis Co Inc	Credit Suisse	(1.506)
		Merrill Lynch	(75.761)	(25.591)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Credit Suisse	106.154
(19.079)	Balchem Corp	Citibank	(36.250)	(16.094)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Deutsche Bank	70.975
(28.875)	Ball Corp	Credit Suisse	14.878	(15.010)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Bank of America	
(3.293)	Ball Corp	Deutsche Bank	823			Merrill Lynch	66.194
(50.327)	Ball Corp	Bank of America		(20.006)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Citibank	103.631
		Merrill Lynch	18.136	16.072	Berry Global Group Inc	Credit Suisse	4.742
(78.620)	Ball Corp	Citibank	68.399	25.499	Berry Global Group Inc	Bank of America	
(17.510)	Ball Corp	JP Morgan	10.156			Merrill Lynch	35.137
(13.755)	BancorpSouth Bank	Credit Suisse	11.122	1.977	Berry Global Group Inc	JP Morgan	969
(11.585)	BancorpSouth Bank	Citibank	8.689	4.025	Berry Global Group Inc	Deutsche Bank	5.555
8.037	Bank of Hawaii Corp	Credit Suisse	2.786	23.701	Best Buy Co Inc	Credit Suisse	(205.699)
9.111	Bank of Hawaii Corp	Bank of America		16.318	Best Buy Co Inc	Deutsche Bank	(143.229)
		Merrill Lynch	4.009	18.094	Best Buy Co Inc	Bank of America	
6.592	Bank of Hawaii Corp	Citibank	(6.790)			Merrill Lynch	(179.492)
10.626	Bank of Hawaii Corp	JP Morgan	4.463	23.323	Best Buy Co Inc	Citibank	(158.363)
12.843	Bank of Hawaii Corp	Deutsche Bank	(2.018)	18.347	Best Buy Co Inc	JP Morgan	(127.512)
3.264	Bank of New York Mellon Corp/The	Citibank	(9.792)	44.483	BGC Partners Inc 'A'	Deutsche Bank	(20.959)
2.282	Bank of New York Mellon Corp/The	JP Morgan	(3.400)	1.048	BGC Partners Inc 'A'	Bank of America	
12.413	Bank of New York Mellon Corp/The	Bank of America		31.122	BGC Partners Inc 'A'	Merrill Lynch	(487)
5.509	Bank of New York Mellon Corp/The	Merrill Lynch	(36.580)	7.709	BGC Partners Inc 'A'	JP Morgan	(21.941)
(17.184)	Bank of the Ozarks Inc	Deutsche Bank	(12.671)	40.832	Big Lots Inc	Credit Suisse	(5.435)
(18.971)	Bank of the Ozarks Inc	Deutsche Bank	10.310	77.403	Big Lots Inc	Credit Suisse	(55.649)
		Merrill Lynch	11.383	29.788	Big Lots Inc	Deutsche Bank	(79.859)
(39.096)	Bank of the Ozarks Inc	Citibank	37.923	51.242	Big Lots Inc	Bank of America	
(7.352)	Bank of the Ozarks Inc	Credit Suisse	1.781	50.734	Big Lots Inc	Merrill Lynch	(46.469)
(20.976)	Bank of the Ozarks Inc	JP Morgan	8.824	(2.921)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Citibank	30.233
(10.806)	BankUnited Inc	Bank of America		(706)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	JP Morgan	42.617
		Merrill Lynch	(11.670)	(4.452)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Credit Suisse	(106.208)
(12.034)	BankUnited Inc	Citibank	8.544	(11.375)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Deutsche Bank	(4.243)
(2.191)	BankUnited Inc	Deutsche Bank	(2.366)			JP Morgan	(137.023)
(248)	BankUnited Inc	JP Morgan	(474)	(1.764)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Merrill Lynch	(68.364)
(2.937)	BankUnited Inc	Credit Suisse	(5.610)	10.737	Bio-Techne Corp	Citibank	(1.217)
11.349	Barnes Group Inc	Credit Suisse	18.292	3.238	Bio-Techne Corp	Deutsche Bank	1.718
1.660	Barnes Group Inc	Citibank	(1.461)	2.573	Bio-Techne Corp	JP Morgan	1.166
				6.112	Bio-Techne Corp	Credit Suisse	629
						Citibank	(16.197)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
3.650	Bio-Techne Corp	Bank of America		25.647	Booz Allen Hamilton Holding Corp	JP Morgan	120.797
8.207	Biogen Inc	Merrill Lynch	(7.550)	31.938	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Deutsche Bank	132.862
14.387	Biogen Inc	Credit Suisse	238.003	28.933	BorgWarner Inc	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	(52.658)
5.957	Biogen Inc	Merrill Lynch	326.153	21.339	BorgWarner Inc	Credit Suisse	(46.016)
6.685	Biogen Inc	Citibank	113.421	7.955	BorgWarner Inc	Citibank	(29.752)
6.841	Biogen Inc	JP Morgan	169.072	20.546	BorgWarner Inc	Deutsche Bank	(51.599)
(9.993)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Deutsche Bank	155.085	8.491	BorgWarner Inc	JP Morgan	(6.684)
(9.245)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Citibank	(35.175)	2.390	Boston Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	(2.701)
		Bank of America		7.342	Boston Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	18.019
(22.883)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Merrill Lynch	(22.465)	18.079	Boston Properties Inc (Reit)	Bank of America	
(43.936)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Credit Suisse	(98.855)			Merrill Lynch	63.891
(1.766)	Black Hills Corp	Deutsche Bank	(115.900)	9.036	Boston Properties Inc (Reit)	Citibank	21.686
(28.370)	Black Hills Corp	Deutsche Bank	(1.907)	2.075	Boston Properties Inc (Reit)	JP Morgan	(2.345)
(8.796)	Black Hills Corp	Citibank	(47.094)	(38.480)	Boston Scientific Corp	Credit Suisse	(30.591)
(17.923)	Black Hills Corp	Credit Suisse	(10.421)	(37.210)	Boston Scientific Corp	JP Morgan	(32.745)
(18.417)	Black Hills Corp	JP Morgan	(9.386)	(30.907)	Boyd Gaming Corp	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	(59.651)
(1.745)	Black Knight Inc	Merrill Lynch	(19.890)	(2.511)	Boyd Gaming Corp	Credit Suisse	(10.370)
(26.142)	Black Knight Inc	Credit Suisse	(175)	(30.849)	Boyd Gaming Corp	Deutsche Bank	(56.285)
(29.080)	Black Knight Inc	Citibank	(27.449)	(10.959)	Boyd Gaming Corp	JP Morgan	(45.261)
(22.368)	Black Knight Inc	JP Morgan	(26.088)	(27.479)	Boyd Gaming Corp	Citibank	(45.340)
		Bank of America		41.106	Brandywine Realty Trust (Reit)	Credit Suisse	3.163
(10.435)	Blackbaud Inc	Merrill Lynch	(8.947)	86.007	Brandywine Realty Trust (Reit)	Bank of America	
(8.119)	Blackbaud Inc	Credit Suisse	28.797			Merrill Lynch	41.283
(12.546)	Blackbaud Inc	JP Morgan	27.767	90.881	Brandywine Realty Trust (Reit)	Citibank	39.988
		Bank of America		34.806	Brandywine Realty Trust (Reit)	JP Morgan	10.002
(7.612)	Blackhawk Network Holdings Inc	Merrill Lynch	4.266	9.230	Brandywine Realty Trust (Reit)	Deutsche Bank	4.430
(5.239)	Blackhawk Network Holdings Inc	Bank of America	(952)	(5.428)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Bank of America	
(60.374)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Merrill Lynch	(952)	(3.735)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Merrill Lynch	(14.371)
(8.845)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	JP Morgan	(655)	(15.167)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Citibank	(6.611)
(49.826)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Citibank	(10.867)	(7.903)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Credit Suisse	(40.799)
(8.656)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	(5.307)	(1.454)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Deutsche Bank	(25.764)
(48.693)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America	(24.913)	(23.082)	Brighthouse Financial Inc	JP Morgan	(3.911)
66.955	Bloomin' Brands Inc	Merrill Lynch	(4.328)	(5.536)	Brighthouse Financial Inc	Credit Suisse	75.016
53.793	Bloomin' Brands Inc	JP Morgan	(29.216)	(10.183)	Brighthouse Financial Inc	Deutsche Bank	7.806
		Citibank	36.156	(18.241)	Brighthouse Financial Inc	JP Morgan	13.657
81.901	Bloomin' Brands Inc	Bank of America		(10.266)	Brighthouse Financial Inc	Bank of America	
22.077	Bloomin' Brands Inc	Merrill Lynch	11.618	6.786	Brink's Co/The	Merrill Lynch	21.702
67.548	Bloomin' Brands Inc	JP Morgan	(210.486)	7.733	Brink's Co/The	Citibank	7.084
(1.706)	Bluebird Bio Inc	Deutsche Bank	(3.753)	604	Brink's Co/The	JP Morgan	11.989
		Credit Suisse	(104.267)	2.565	Brink's Co/The	Deutsche Bank	2.899
(6.300)	Bluebird Bio Inc	Bank of America		1.934	Brinker International Inc	Credit Suisse	3.976
(12.203)	Bluebird Bio Inc	Merrill Lynch	3.683	37.900	Brinker International Inc	Credit Suisse	(4.390)
(6.109)	Bluebird Bio Inc	JP Morgan	(72.135)	15.071	Brinker International Inc	Deutsche Bank	12.886
(13.161)	Blueprint Medicines Corp	Credit Suisse	(126.699)	14.279	Brinker International Inc	Bank of America	
		Deutsche Bank	(56.814)	47.095	Bristol-Myers Squibb Co	Merrill Lynch	5.124
(12.654)	Blueprint Medicines Corp	Bank of America	(47.854)	45.942	Bristol-Myers Squibb Co	Citibank	2.856
(3.151)	Blueprint Medicines Corp	Merrill Lynch	(61.036)	1.734	Bristol-Myers Squibb Co	JP Morgan	(106.906)
5.300	Boeing Co/The	Credit Suisse	(21.238)	60.129	Bristol-Myers Squibb Co	Credit Suisse	113.017
3.350	Boeing Co/The	JP Morgan	86.761			Deutsche Bank	1.196
5.082	Boeing Co/The	Credit Suisse	42.277			Bank of America	
(398)	BOK Financial Corp	JP Morgan	83.192			Merrill Lynch	38.956
(6.760)	BOK Financial Corp	Credit Suisse	80			Citibank	5.245
(2.008)	BOK Financial Corp	JP Morgan	1.352			JP Morgan	5.774
		Bank of America				Bank of America	
(5.545)	BOK Financial Corp	Merrill Lynch	5.422			Merrill Lynch	(37.845)
(1.175)	Booking Holdings Inc	Deutsche Bank	14.972			Citibank	
		Bank of America				JP Morgan	
(979)	Booking Holdings Inc	Merrill Lynch	(46.424)			Bank of America	
(712)	Booking Holdings Inc	Citibank	(29.439)			Merrill Lynch	
59.572	Booz Allen Hamilton Holding Corp	JP Morgan	(20.843)			Citibank	(20.058)
		Bank of America					
		Merrill Lynch	247.820				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(3.233)	Brixmor Property Group Inc (Reit)	Deutsche Bank	(4.801)	2.039	CACI International Inc 'A'	Deutsche Bank	7.861
(3.285)	Brixmor Property Group Inc (Reit)	JP Morgan	(3.334)	4.327	CACI International Inc 'A'	Bank of America	
(6.684)	Broadcom Inc	Credit Suisse	(88.392)	3.268	CACI International Inc 'A'	Merrill Lynch	17.502
(9.338)	Broadcom Inc	Citibank	(121.207)	21.410	Cadence Design Systems Inc	Credit Suisse	22.397
(7.333)	Broadcom Inc	JP Morgan	(85.370)	36.399	Cadence Design Systems Inc	Credit Suisse	37.039
16.817	Broadridge Financial Solutions Inc	Credit Suisse	46.523	8.845	Cadence Design Systems Inc	Bank of America	56.418
19.876	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America		135.003	Cadence Design Systems Inc	Merrill Lynch	15.302
	Broadridge Financial Solutions Inc	Merrill Lynch	22.261	4.348	Cadence Design Systems Inc	JP Morgan	15.302
2.459	Broadridge Financial Solutions Inc	JP Morgan	11.139	(248.062)	Caesars Entertainment Corp	Citibank	78.302
35.955	Broadridge Financial Solutions Inc	Citibank	87.011	(49.130)	Caesars Entertainment Corp	Deutsche Bank	6.739
4.782	Broadridge Financial Solutions Inc	Deutsche Bank	5.356	(231.933)	Caesars Entertainment Corp	Bank of America	86.822
(30.978)	Brown & Brown Inc	Bank of America		(17.385)	Caesars Entertainment Corp	Citibank	17.196
(8.370)	Brown & Brown Inc	Merrill Lynch	(13.940)	(466.551)	Caesars Entertainment Corp	JP Morgan	81.177
(10.416)	Brown & Brown Inc	Citibank	837	(27.267)	Cal-Maine Foods Inc	Credit Suisse	(9.562)
17.168	Brown-Forman Corp 'B'	Credit Suisse	(2.916)	(15.221)	Cal-Maine Foods Inc	Deutsche Bank	(124.132)
	Brown-Forman Corp 'B'	Merrill Lynch	(17.855)		Cal-Maine Foods Inc	Deutsche Bank	(21.814)
7.421	Brown-Forman Corp 'B'	JP Morgan	10.909		Callon Petroleum Co	Bank of America	
18.986	Brucker Corp	Bank of America		(54.542)	Callon Petroleum Co	Merrill Lynch	(12.177)
	Brucker Corp	Merrill Lynch	18.606	(219.570)	Callon Petroleum Co	JP Morgan	(13.636)
37.127	Brucker Corp	Citibank	(9.653)	(127.885)	Callon Petroleum Co	Deutsche Bank	375.465
21.852	Brucker Corp	JP Morgan	14.381	(205.295)	Callon Petroleum Co	Credit Suisse	280.068
14.501	Brucker Corp	Deutsche Bank	14.211	(177.825)	Callon Petroleum Co	JP Morgan	449.596
5.620	Brucker Corp	Credit Suisse	2.136		Callon Petroleum Co	Bank of America	
13.251	Brunswick Corp/DE	Credit Suisse	37.979	(82.754)	Callon Petroleum Co	Merrill Lynch	304.081
11.705	Brunswick Corp/DE	Deutsche Bank	33.125	4.783	Camden Property Trust (Reit)	Citibank	120.821
10.498	Brunswick Corp/DE	JP Morgan	38.447	420	Camden Property Trust (Reit)	Credit Suisse	10.941
16.256	Brunswick Corp/DE	Bank of America		4.767	Camden Property Trust (Reit)	JP Morgan	428
	Brunswick Corp/DE	Merrill Lynch	46.004	1.436	Camden Property Trust (Reit)	Citibank	18.353
(947)	Bunge Ltd	JP Morgan	(114)	32.983	Campbell Soup Co	Bank of America	5.241
(2.304)	Bunge Ltd	Bank of America		10.352	Campbell Soup Co	Citibank	(8.246)
	Bunge Ltd	Merrill Lynch	3.226		Cantel Medical Corp	Bank of America	(11.380)
(60)	Bunge Ltd	Citibank	20	(2.828)	Cantel Medical Corp	Bank of America	
6.232	Burlington Stores Inc	Bank of America		2.201	Capital One Financial Corp	Merrill Lynch	9.643
	Burlington Stores Inc	Merrill Lynch	50.645	(13.666)	Capital One Financial Corp	JP Morgan	(12.878)
11.136	Burlington Stores Inc	Citibank	132.518	(10.205)	Capital One Financial Corp	Bank of America	
13.028	Burlington Stores Inc	JP Morgan	139.878	(4.305)	Capital One Financial Corp	Merrill Lynch	21.456
5.895	Burlington Stores Inc	Deutsche Bank	49.754	(5.409)	Capital One Financial Corp	Credit Suisse	(29.595)
9.305	BWX Technologies Inc	Bank of America		(5.951)	Capital One Financial Corp	Deutsche Bank	6.759
	BWX Technologies Inc	Merrill Lynch	(5.862)	109.728	Capitol Federal Financial Inc	Citibank	19.797
11.587	BWX Technologies Inc	Citibank	(9.965)	11.204	Capitol Federal Financial Inc	JP Morgan	(17.258)
11.400	BWX Technologies Inc	JP Morgan	6.156	19.541	Capitol Federal Financial Inc	Credit Suisse	3.249
5.145	BWX Technologies Inc	Deutsche Bank	(3.241)	41.625	Capitol Federal Financial Inc	Deutsche Bank	3.517
9.344	BWX Technologies Inc	Credit Suisse	5.046	46.772	Capitol Federal Financial Inc	Bank of America	
10.413	CA Inc	Deutsche Bank	1.978	(15.367)	Cardinal Health Inc	Merrill Lynch	7.493
17.545	CA Inc	Bank of America		(9.758)	Cardinal Health Inc	Citibank	(1.871)
	CA Inc	Merrill Lynch	3.334	(7.214)	Cardinal Health Inc	Deutsche Bank	24.280
84.026	CA Inc	JP Morgan	76.464	(7.163)	Cardinal Health Inc	JP Morgan	585
51.594	CA Inc	Citibank	9.803	(25.223)	Carlisle Cos Inc	Citibank	2.813
51.054	CA Inc	Credit Suisse	32.756	(18.341)	Carlisle Cos Inc	Credit Suisse	(5.587)
(517)	Cable One Inc	Deutsche Bank	9.037	(9.413)	CarMax Inc	Deutsche Bank	(70.404)
(528)	Cable One Inc	JP Morgan	(21.648)		CarMax Inc	Citibank	(22.009)
(443)	Cable One Inc	Credit Suisse	12.564	(58.178)	CarMax Inc	Bank of America	
15.122	Cabot Corp	Bank of America		(9.935)	CarMax Inc	Merrill Lynch	(35.864)
	Cabot Corp	Merrill Lynch	(11.342)	(73.214)	CarMax Inc	Citibank	(212.350)
14.381	Cabot Corp	Citibank	13.231	(32.863)	CarMax Inc	JP Morgan	(56.232)
6.399	Cabot Corp	JP Morgan	2.688	33.949	Carnival Corp	Credit Suisse	(351.976)
7.701	Cabot Corp	Credit Suisse	3.234		Carnival Corp	Deutsche Bank	(121.398)
5.911	Cabot Corp	Deutsche Bank	(4.433)	10.192	Carnival Corp	Bank of America	
51.364	Cabot Oil & Gas Corp	Credit Suisse	(21.573)	917	Carnival Corp	Merrill Lynch	(81.271)
19.897	Cabot Oil & Gas Corp	Deutsche Bank	(5.571)	10.506	Carnival Corp	JP Morgan	(1.936)
37.100	Cabot Oil & Gas Corp	JP Morgan	(15.582)	(9.126)	Carpenter Technology Corp	Credit Suisse	(174)
53.809	Cabot Oil & Gas Corp	Citibank	6.995	(6.847)	Carpenter Technology Corp	Deutsche Bank	(23.323)
10.682	Cabot Oil & Gas Corp	Bank of America		(3.335)	Carpenter Technology Corp	Credit Suisse	(19.300)
	Cabot Oil & Gas Corp	Merrill Lynch	(2.991)	(12.819)	Carpenter Technology Corp	Citibank	(8.490)
					Carpenter Technology Corp	Deutsche Bank	(7.104)
					Carpenter Technology Corp	Bank of America	
					Carpenter Technology Corp	Merrill Lynch	(27.304)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(17.050)	Carpenter Technology Corp	JP Morgan	(58.522)	30.026	Celgene Corp	Bank of America	
14.438	Carter's Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(113.986)
		Merrill Lynch	46.635	9.053	Celgene Corp	Citibank	13.398
21.407	Carter's Inc	JP Morgan	120.724	5.414	Celgene Corp	JP Morgan	(27.287)
7.212	Carter's Inc	Credit Suisse	50.772	15.027	Centene Corp	Citibank	39.220
4.425	Carter's Inc	Citibank	(3.275)	2.957	Centene Corp	Bank of America	
19.617	Carter's Inc	Deutsche Bank	63.363			Merrill Lynch	15.495
(21.238)	Casey's General Stores Inc	Credit Suisse	15.795	5.331	Centene Corp	Deutsche Bank	27.934
(4.730)	Casey's General Stores Inc	Deutsche Bank	11.920	(48.639)	Centennial Resource		
(18.522)	Casey's General Stores Inc	Bank of America			Development Inc/DE 'A'	JP Morgan	74.457
		Merrill Lynch	55.863	(81.995)	Centennial Resource		
(4.836)	Casey's General Stores Inc	JP Morgan	4.111		Development Inc/DE 'A'	Credit Suisse	93.474
(2.678)	Casey's General Stores Inc	Citibank	(2.839)	(119.597)	Centennial Resource		
(7.414)	Catalent Inc	JP Morgan	(2.595)		Development Inc/DE 'A'	Citibank	171.024
(24.868)	Catalent Inc	Bank of America		(451.391)	Centennial Resource		
		Merrill Lynch	(8.260)		Development Inc/DE 'A'	Deutsche Bank	618.406
(9.073)	Catalent Inc	Citibank	4.083	99.543	CenterPoint Energy Inc	Bank of America	
(20.655)	Catalent Inc	Credit Suisse	(4.432)			Merrill Lynch	-
(3.071)	Catalent Inc	Deutsche Bank	(1.167)	183.228	CenterPoint Energy Inc	Citibank	119.098
2.676	Caterpillar Inc	Citibank	(8.001)	83.237	CenterPoint Energy Inc	JP Morgan	8.598
1.355	Caterpillar Inc	JP Morgan	4.444	36.646	CenterPoint Energy Inc	Credit Suisse	(17.957)
31.055	Cathay General Bancorp	Citibank	(11.490)	11.426	CenterPoint Energy Inc	Deutsche Bank	-
2.315	Cathay General Bancorp	Bank of America		(11.217)	CenturyLink Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.690			Merrill Lynch	12.339
52.484	Cathay General Bancorp	JP Morgan	30.350	(147.797)	CenturyLink Inc	Deutsche Bank	162.577
45.111	Cathay General Bancorp	Credit Suisse	38.989	(27.086)	CenturyLink Inc	JP Morgan	(4.202)
9.042	Cathay General Bancorp	Deutsche Bank	6.601	(20.349)	CenturyLink Inc	Credit Suisse	21.401
(8.462)	Cavium Inc	Bank of America		(134.783)	CenturyLink Inc	Citibank	137.479
		Merrill Lynch	(55.511)	(11.167)	Cerner Corp	Bank of America	
(12.841)	Cavium Inc	Citibank	(48.924)			Merrill Lynch	(18.091)
(965)	Cavium Inc	Deutsche Bank	(6.330)	(23.922)	Cerner Corp	Citibank	(4.784)
(18.745)	Cavium Inc	JP Morgan	(166.456)	(37.689)	CF Industries Holdings Inc	Bank of America	
(2.043)	Choe Global Markets Inc	Citibank	11.911			Merrill Lynch	17.337
(6.769)	Choe Global Markets Inc	JP Morgan	33.567	(23.024)	CF Industries Holdings Inc	JP Morgan	(80.354)
(2.276)	Choe Global Markets Inc	Deutsche Bank	21.622	8.709	CH Robinson Worldwide Inc	Credit Suisse	23.350
(7.255)	Choe Global Markets Inc	Bank of America		8.488	CH Robinson Worldwide Inc	Deutsche Bank	15.945
		Merrill Lynch	71.417	2.947	CH Robinson Worldwide Inc	JP Morgan	13.999
(9.189)	Choe Global Markets Inc	Credit Suisse	34.551	5.149	Charles River Laboratories		
13.150	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America			International Inc	Credit Suisse	12.049
		Merrill Lynch	395	2.049	Charles River Laboratories	Bank of America	
13.397	CBRE Group Inc 'A'	Citibank	(9.646)		International Inc	Merrill Lynch	6.393
100.726	CBRE Group Inc 'A'	JP Morgan	13.092	4.920	Charles River Laboratories		
20.411	CBRE Group Inc 'A'	Deutsche Bank	612		International Inc	Citibank	2.903
8.863	CBRE Group Inc 'A'	Credit Suisse	4.254	11.249	Charles River Laboratories		
12.400	CBS Corp				International Inc	JP Morgan	23.130
	'B non-voting share'	Citibank	(14.384)	3.503	Charles River Laboratories		
13.155	CBS Corp				International Inc	Deutsche Bank	10.929
	'B non-voting share'	JP Morgan	(11.971)	(16.529)	Charles Schwab Corp/The	Citibank	65.785
29.851	CBS Corp			(3.965)	Charles Schwab Corp/The	Bank of America	
	'B non-voting share'	Deutsche Bank	(105.658)			Merrill Lynch	12.728
6.450	CDK Global Inc	Credit Suisse	(839)	(3.113)	Charles Schwab Corp/The	Deutsche Bank	9.993
29.663	CDK Global Inc	Bank of America		(1.890)	Charles Schwab Corp/The	JP Morgan	3.194
		Merrill Lynch	22.841	6.895	Cheesecake Factory Inc/The	Credit Suisse	(14.480)
22.732	CDK Global Inc	JP Morgan	(2.955)	14.656	Cheesecake Factory Inc/The	Bank of America	
21.013	CDK Global Inc	Citibank	31.520			Merrill Lynch	3.371
8.249	CDK Global Inc	Deutsche Bank	6.352	8.337	Cheesecake Factory Inc/The	Citibank	12.839
4.374	CDW Corp/DE	Citibank	9.098	16.493	Cheesecake Factory Inc/The	JP Morgan	(34.635)
771	CDW Corp/DE	JP Morgan	3.454	11.365	Cheesecake Factory Inc/The	Deutsche Bank	2.614
2.589	CDW Corp/DE	Bank of America		10.311	Chemed Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	7.689			Merrill Lynch	677
5.314	CDW Corp/DE	Credit Suisse	23.807	3.104	Chemed Corp	Citibank	1.707
4.435	CDW Corp/DE	Deutsche Bank	13.172	19.638	Chemed Corp	JP Morgan	62.559
16.260	Celanese Corp 'A'	Bank of America		7.841	Chemed Corp	Credit Suisse	47.203
		Merrill Lynch	78.806	4.383	Chemed Corp	Deutsche Bank	307
10.201	Celanese Corp 'A'	Citibank	11.323	(26.397)	Chemical Financial Corp	Citibank	40.651
8.451	Celanese Corp 'A'	JP Morgan	53.072	(14.457)	Chemical Financial Corp	Bank of America	
12.375	Celanese Corp 'A'	Credit Suisse	77.715			Merrill Lynch	3.824
11.932	Celanese Corp 'A'	Deutsche Bank	57.788	(22.197)	Chemical Financial Corp	Credit Suisse	(15.538)
39.972	Celgene Corp	Credit Suisse	(83.121)	(1.698)	Chemical Financial Corp	Deutsche Bank	(645)
61.917	Celgene Corp	Deutsche Bank	(240.857)	(3.971)	Chemical Financial Corp	JP Morgan	(2.780)
				13.036	Chemours Co/The	JP Morgan	(13.773)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
14.484	Chemours Co/The	Deutsche Bank	(20.133)	1.500	Cintas Corp	JP Morgan	3.823
17.074	Chemours Co/The	Bank of America		8.019	Cintas Corp	Credit Suisse	39.876
		Merrill Lynch	(23.733)	321	Cirrus Logic Inc	Bank of America	
12.259	Chemours Co/The	Citibank	(22.802)			Merrill Lynch	(173)
3.287	Chemours Co/The	Credit Suisse	(2.137)	15.943	Cirrus Logic Inc	Citibank	(6.377)
(32.012)	Cheniere Energy Inc	JP Morgan	(153.183)	12.338	Cirrus Logic Inc	JP Morgan	(7.033)
(58.542)	Cheniere Energy Inc	Bank of America		6.178	Cirrus Logic Inc	Deutsche Bank	(3.336)
		Merrill Lynch	(290.602)	287	Cirrus Logic Inc	Credit Suisse	(164)
(9.495)	Cheniere Energy Inc	Citibank	(48.140)	7.075	Cisco Systems Inc	Credit Suisse	(16.015)
(40.852)	Cheniere Energy Inc	Deutsche Bank	(203.443)	20.739	Cisco Systems Inc	Deutsche Bank	(51.433)
(178.155)	Chesapeake Energy Corp	Deutsche Bank	(134.507)	55.844	Cisco Systems Inc	Bank of America	
(15.223)	Chesapeake Energy Corp	JP Morgan	(20.323)			Merrill Lynch	(138.493)
24.061	Chevron Corp	Credit Suisse	(63.040)	1.029	Cisco Systems Inc	Citibank	(669)
7.491	Chevron Corp	Bank of America		37.056	Cisco Systems Inc	JP Morgan	(82.872)
		Merrill Lynch	(43.373)	31.956	CIT Group Inc	Citibank	(166.171)
5.970	Chevron Corp	Citibank	(25.552)	22.579	CIT Group Inc	Deutsche Bank	(81.284)
22.476	Chevron Corp	JP Morgan	(70.381)	29.733	CIT Group Inc	JP Morgan	(110.167)
11.640	Chevron Corp	Deutsche Bank	(67.396)	30.165	CIT Group Inc	Bank of America	
67.232	Chimera Investment Corp (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(108.594)
		Merrill Lynch	13.876	(26.841)	Citigroup Inc	Bank of America	
45.262	Chimera Investment Corp (Reit)	JP Morgan	28.103	(10.874)	Citigroup Inc	Merrill Lynch	176.555
27.402	Chimera Investment Corp (Reit)	Citibank	2.740	15.726	Citizens Financial Group Inc	JP Morgan	54.370
56.623	Chimera Investment Corp (Reit)	Deutsche Bank	7.463	82.333	Citizens Financial Group Inc	Credit Suisse	(26.881)
(3.736)	Chipotle Mexican Grill Inc	JP Morgan	(41.157)	28.213	Citizens Financial Group Inc	Citibank	(139.966)
(7.130)	Chipotle Mexican Grill Inc	Bank of America		20.233	Citizens Financial Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(60.277)	2.409	Citizens Financial Group Inc	Merrill Lynch	(62.915)
(4.395)	Chipotle Mexican Grill Inc	Deutsche Bank	(45.576)	32.890	Citrix Systems Inc	JP Morgan	(16.793)
7.708	Choice Hotels International Inc	Bank of America		8.202	Citrix Systems Inc	Deutsche Bank	(5.372)
		Merrill Lynch	13.489	10.934	Citrix Systems Inc	Credit Suisse	(20.063)
25.049	Choice Hotels International Inc	Credit Suisse	(31.030)			Deutsche Bank	4.429
20.519	Choice Hotels International Inc	Citibank	25.649	16.571	Citrix Systems Inc	Bank of America	
(5.246)	Chubb Ltd	Citibank	23.974	18.387	Citrix Systems Inc	Merrill Lynch	8.510
(11.768)	Chubb Ltd	JP Morgan	25.772	(50.353)	Clean Harbors Inc	Citibank	21.045
(1.120)	Chubb Ltd	Credit Suisse	2.453	(36.252)	Clean Harbors Inc	JP Morgan	(11.216)
(6.909)	Chubb Ltd	Deutsche Bank	26.461	(29.311)	Clean Harbors Inc	Bank of America	
(6.683)	Church & Dwight Co Inc	Credit Suisse	4.344	(22.898)	Clean Harbors Inc	Merrill Lynch	(88.118)
(25.766)	Church & Dwight Co Inc	Bank of America		(24.650)	Clean Harbors Inc	Credit Suisse	(60.739)
		Merrill Lynch	(14.448)	(94.449)	Cleveland-Cliffs Inc	Deutsche Bank	(51.294)
(2.709)	Churchill Downs Inc	Bank of America		(94.389)	Cleveland-Cliffs Inc	Citibank	(27.936)
		Merrill Lynch	(12.205)	11.387	Clorox Co/The	JP Morgan	(38.947)
(36.836)	Ciena Corp	Bank of America		328	Clorox Co/The	Credit Suisse	(87.838)
		Merrill Lynch	43.098	2.078	Clorox Co/The	Citibank	(15.102)
(22.672)	Ciena Corp	Credit Suisse	60.988	13.985	Clorox Co/The	Deutsche Bank	56.821
(37.469)	Ciena Corp	Deutsche Bank	43.839			Credit Suisse	1.207
8.202	Cigna Corp	Deutsche Bank	(30.511)	1.280	Clorox Co/The	JP Morgan	7.647
2.660	Cigna Corp	Credit Suisse	(13.718)	(734)	Clovis Oncology Inc	Bank of America	
29.261	Cigna Corp	Citibank	(143.379)	(32.761)	Clovis Oncology Inc	Merrill Lynch	69.785
7.490	Cigna Corp	JP Morgan	(18.951)	(19.712)	Clovis Oncology Inc	Citibank	3.622
26.699	Cimarex Energy Co	Credit Suisse	(156.990)			Citibank	1.527
30.077	Cimarex Energy Co	JP Morgan	(176.853)	(10.838)	Clovis Oncology Inc	Deutsche Bank	94.024
4.937	Cimarex Energy Co	Bank of America		(39.443)	Clovis Oncology Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(25.884)	(8.226)	CME Group Inc	Merrill Lynch	52.240
15.291	Cimarex Energy Co	Citibank	(79.054)	28.828	CMS Energy Corp	JP Morgan	(56.791)
36.799	Cimarex Energy Co	Deutsche Bank	(155.660)	46.788	CMS Energy Corp	Credit Suisse	(206.681)
(6.628)	Cimpress NV	Citibank	(27.506)			Credit Suisse	(50.425)
(2.176)	Cincinnati Financial Corp	Deutsche Bank	4.178	6.444	CMS Energy Corp	Credit Suisse	29.981
(18.958)	Cincinnati Financial Corp	JP Morgan	26.135	18.184	CMS Energy Corp	Bank of America	
(7.727)	Cincinnati Financial Corp	Bank of America		10.545	CMS Energy Corp	Merrill Lynch	72.807
		Merrill Lynch	14.836	13.940	CNX Resources Corp	Citibank	12.308
(12.215)	Cincinnati Financial Corp	Citibank	30.293			JP Morgan	31.503
(567)	Cincinnati Financial Corp	Credit Suisse	686			Deutsche Bank	14.763
(18.738)	Cinemark Holdings Inc	Bank of America		(62.565)	Coca-Cola Co/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	50.593			Merrill Lynch	(627)
(16.544)	Cinemark Holdings Inc	Citibank	15.386	(16.852)	Coca-Cola Co/The	Merrill Lynch	(61.939)
(7.110)	Cinemark Holdings Inc	Deutsche Bank	19.197	(27.057)	Coca-Cola Co/The	JP Morgan	(15.167)
(13.673)	Cinemark Holdings Inc	Credit Suisse	69.869	(109.341)	Coca-Cola European Partners Plc	Credit Suisse	(29.046)
4.777	Cintas Corp	Citibank	12.898			JP Morgan	21.868
1.714	Cintas Corp	Deutsche Bank	720	(6.961)	Coca-Cola European Partners Plc	Deutsche Bank	1.183

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(31.123)	Cognex Corp	Credit Suisse	38.605	(10.328)	Commercial Metals Co	JP Morgan	(22.161)
(3.076)	Cognex Corp	Deutsche Bank	3.630	(18.431)	CommScope Holding Co Inc	Bank of America	
(9.392)	Cognex Corp	Citibank	1.221			Merrill Lynch	(184)
(20.492)	Cognex Corp	JP Morgan	8.745	(52.029)	CommScope Holding Co Inc	JP Morgan	13.772
(31.410)	Cognex Corp	Bank of America		(1.768)	CommScope Holding Co Inc	Deutsche Bank	(18)
		Merrill Lynch	37.064	(44.246)	CommScope Holding Co Inc	Credit Suisse	18.968
16.775	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Deutsche Bank	9.730	4.322	Community Bank System Inc	Credit Suisse	4.797
10.507	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Citibank	8.406	5.743	Community Bank System Inc	Citibank	(1.551)
6.167	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	JP Morgan	3.022	7.026	Community Bank System Inc	JP Morgan	7.799
1.193	Coherent Inc	Bank of America		9.527	CommVault Systems Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.319)	6.099	CommVault Systems Inc	Merrill Lynch	4.287
507	Coherent Inc	JP Morgan	127	5.155	CommVault Systems Inc	Citibank	5.489
3.364	Coherent Inc	Deutsche Bank	(12.178)	1.594	CommVault Systems Inc	JP Morgan	(258)
1.227	Coherent Inc	Credit Suisse	(9.429)	(19.298)	Compass Minerals International Inc	Deutsche Bank	717
(70.130)	Colfax Corp	Bank of America		(80.646)	Compass Minerals International Inc	Credit Suisse	55.964
		Merrill Lynch	20.338			Deutsche Bank	239.537
(93.562)	Colfax Corp	Citibank	75.785	(10.605)	Compass Minerals International Inc	Citibank	10.075
(29.910)	Colfax Corp	JP Morgan	9.571	(12.832)	Compass Minerals International Inc	JP Morgan	37.213
(6.809)	Colfax Corp	Credit Suisse	2.179			JP Morgan	–
(25.946)	Colfax Corp	Deutsche Bank	17.392	35.347	Conagra Brands Inc	Citibank	21.109
5.875	Colgate-Palmolive Co	Credit Suisse	7.579	39.828	Conagra Brands Inc	Credit Suisse	6.977
31.358	Colgate-Palmolive Co	Citibank	36.375	47.910	Conagra Brands Inc	Deutsche Bank	(16.588)
2.237	Colgate-Palmolive Co	JP Morgan	2.886	51.839	Conagra Brands Inc	Bank of America	
24.755	Colgate-Palmolive Co	Bank of America		25.235	Conagra Brands Inc	Merrill Lynch	(8.075)
		Merrill Lynch	47.530			Bank of America	
31.335	Colgate-Palmolive Co	Deutsche Bank	51.590	(14.864)	Concho Resources Inc	Merrill Lynch	140.332
(8.677)	Columbia Banking System Inc	Credit Suisse	1.135	(3.925)	Concho Resources Inc	Citibank	29.595
(7.238)	Columbia Banking System Inc	JP Morgan	6.329	(22.874)	Concho Resources Inc	Deutsche Bank	223.021
32.253	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Bank of America		(1.047)	Concho Resources Inc	Credit Suisse	19.286
27.676	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Merrill Lynch	14.836	(24.238)	Conduent Inc	JP Morgan	4.242
60.227	Columbia Property Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(9.410)	(40.292)	Conduent Inc	Bank of America	
75.757	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Citibank	21.682			Merrill Lynch	(6.648)
48.032	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	(28.255)	78.161	ConocoPhillips	Credit Suisse	(89.713)
(5.623)	Columbia Sportswear Co	Deutsche Bank	18.451	73.190	ConocoPhillips	Citibank	(194.685)
		Bank of America		66.287	ConocoPhillips	JP Morgan	(17.897)
(1.320)	Columbia Sportswear Co	Merrill Lynch	(31.320)	48.059	ConocoPhillips	Bank of America	
(5.720)	Columbia Sportswear Co	Citibank	(3.828)			Merrill Lynch	(125.915)
(6.423)	Comcast Corp 'A'	JP Morgan	(35.064)	27.795	ConocoPhillips	Deutsche Bank	(80.417)
(18.133)	Comcast Corp 'A'	Credit Suisse	(2.826)	18.867	Consolidated Edison Inc	Bank of America	
(31.350)	Comcast Corp 'A'	Deutsche Bank	17.770			Merrill Lynch	22.263
		Bank of America		7.453	Consolidated Edison Inc	Credit Suisse	4.630
(27.211)	Comcast Corp 'A'	Merrill Lynch	30.723	9.301	Consolidated Edison Inc	Deutsche Bank	12.980
(4.547)	Comcast Corp 'A'	Citibank	40.272	7.782	Consolidated Edison Inc	Citibank	15.097
33.357	Comerica Inc	JP Morgan	(2.001)	2.361	Consolidated Edison Inc	JP Morgan	(354)
472	Comerica Inc	Credit Suisse	(201.476)	(10.777)	Constellation Brands Inc 'A'	Citibank	(74.685)
2.418	Comerica Inc	Deutsche Bank	(9.986)	(1.335)	Constellation Brands Inc 'A'	Bank of America	
31.391	Comerica Inc	JP Morgan	(103.076)			Merrill Lynch	(9.231)
6.414	Commerce Bancshares Inc/MO	Bank of America		(3.948)	Constellation Brands Inc 'A'	Deutsche Bank	(4.264)
19.438	Commerce Bancshares Inc/MO	Merrill Lynch	(2.437)	(1.383)	Constellation Brands Inc 'A'	Credit Suisse	(1.842)
11.450	Commerce Bancshares Inc/MO	Credit Suisse	(2.527)	(19.654)	Continental Resources Inc/OK	JP Morgan	(27.319)
30.578	Commerce Bancshares Inc/MO	Citibank	(9.046)	124.472	Convergys Corp	Credit Suisse	83.267
11.836	Commerce Bancshares Inc/MO	Deutsche Bank	(17.553)	50.998	Convergys Corp	Deutsche Bank	(54.058)
(27.396)	Commercial Metals Co	JP Morgan	(1.539)	32.310	Convergys Corp	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	(34.249)
(12.259)	Commercial Metals Co	Merrill Lynch	(35.341)	105.489	Convergys Corp	Citibank	13.714
(10.936)	Commercial Metals Co	Citibank	(4.536)	72.865	Convergys Corp	JP Morgan	42.990
		Deutsche Bank	(14.107)	2.705	Cooper Cos Inc/The	Bank of America	
						Merrill Lynch	(8.115)
				1.676	Cooper Cos Inc/The	Deutsche Bank	(5.028)
				123	Cooper Cos Inc/The	JP Morgan	300
				4.013	Cooper Cos Inc/The	Citibank	(11.236)
				36.988	Copart Inc	JP Morgan	101.347
				3.777	Copart Inc	Citibank	11.104
				19.131	Copart Inc	Credit Suisse	18.772
				10.202	Copart Inc	Deutsche Bank	5.611
				19.706	Core Laboratories NV	Credit Suisse	17.144
				21.846	Core Laboratories NV	Citibank	(49.809)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
5.115	Core Laboratories NV	Bank of America		9.784	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Deutsche Bank	32.972
15.393	Core Laboratories NV	Merrill Lynch	3.785	5.077	Crane Co	Deutsche Bank	(4.315)
30.440	Core Laboratories NV	Deutsche Bank	11.391	7.303	Crane Co	Citibank	(15.774)
(9.984)	CoreCivic Inc (Reit)	JP Morgan	(1.311)	19.865	Crane Co	JP Morgan	(24.574)
(36.781)	CoreCivic Inc (Reit)	Deutsche Bank	(10.583)	4.739	Crane Co	Bank of America	
18.145	CoreLogic Inc/United States	JP Morgan	(28.460)	19.118	Crane Co	Merrill Lynch	(4.028)
6.950	CoreLogic Inc/United States	Credit Suisse	24.859	2.372	Credit Acceptance Corp	Credit Suisse	(23.161)
17.405	CoreLogic Inc/United States	Citibank	6.881	1.023	Credit Acceptance Corp	Citibank	(33.801)
16.747	CoreLogic Inc/United States	JP Morgan	23.845		Credit Acceptance Corp	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	7.130
13.352	CoreLogic Inc/United States	Merrill Lynch	25.958	2.038	Credit Acceptance Corp	Credit Suisse	42.961
5.085	CoreSite Realty Corp (Reit)	Deutsche Bank	20.696	121	Credit Acceptance Corp	Deutsche Bank	843
		Bank of America		187	Credit Acceptance Corp	JP Morgan	3.942
		Merrill Lynch	8.645	(32.338)	Cree Inc	Bank of America	
2.314	CoreSite Realty Corp (Reit)	Citibank	11.339			Merrill Lynch	(122.238)
6.377	CoreSite Realty Corp (Reit)	JP Morgan	25.253	(42.300)	Cree Inc	Citibank	(90.945)
426	CoreSite Realty Corp (Reit)	Credit Suisse	1.687	(21.792)	Cree Inc	JP Morgan	(139.687)
5.108	CoreSite Realty Corp (Reit)	Deutsche Bank	8.684	(30.048)	Cree Inc	Deutsche Bank	(113.581)
(26.151)	Cornerstone OnDemand Inc	Citibank	(61.716)	(4.626)	Crown Castle International Corp (Reit)	Bank of America	
(9.839)	Cornerstone OnDemand Inc	JP Morgan	(46.932)	(6.909)	Crown Castle International Corp (Reit)	Merrill Lynch	(3.574)
(26.104)	Cornerstone OnDemand Inc	Bank of America				Citibank	(13.542)
		Merrill Lynch	(87.448)	(9.777)	Crown Castle International Corp (Reit)	JP Morgan	(9.190)
(23.407)	Cornerstone OnDemand Inc	Credit Suisse	(111.651)	(4.217)	Crown Castle International Corp (Reit)	Deutsche Bank	(1.687)
(9.832)	Cornerstone OnDemand Inc	Deutsche Bank	(32.937)	45.743	Crown Holdings Inc	Bank of America	
(40.546)	Corning Inc	Citibank	12.569	23.653	Crown Holdings Inc	Merrill Lynch	(2.569)
(90.976)	Corning Inc	JP Morgan	(48.217)	10.446	Crown Holdings Inc	JP Morgan	(30.400)
(33.389)	Corning Inc	Deutsche Bank	11.456	11.028	Crown Holdings Inc	Credit Suisse	(2.820)
(24.541)	Corning Inc	Credit Suisse	(7.392)	11.711	Crown Holdings Inc	Citibank	(15.329)
(8.473)	Corporate Office Properties Trust (Reit)			(23.104)	CSX Corp	Deutsche Bank	586
(17.285)	Corporate Office Properties Trust (Reit)	Credit Suisse	(6.057)			Bank of America	
(16.115)	Corporate Office Properties Trust (Reit)	JP Morgan	(1.079)	(34.580)	CSX Corp	Merrill Lynch	(63.767)
(7.330)	CoStar Group Inc	Citibank	(11.442)	(3.925)	CSX Corp	JP Morgan	(165.984)
		Bank of America		21.780	CubeSmart (Reit)	Citibank	(7.458)
(6.666)	CoStar Group Inc	Merrill Lynch	8.269	56.804	CubeSmart (Reit)	Citibank	20.038
(2.217)	CoStar Group Inc	Citibank	(47.662)			Bank of America	
11.711	Costco Wholesale Corp	JP Morgan	4.168	21.186	CubeSmart (Reit)	Merrill Lynch	41.421
2.509	Costco Wholesale Corp	Deutsche Bank	39.232	60.936	CubeSmart (Reit)	Credit Suisse	3.813
(6.441)	Cotiviti Holdings Inc	JP Morgan	791	7.296	CubeSmart (Reit)	Deutsche Bank	38.999
(36.473)	Cotiviti Holdings Inc	Deutsche Bank	(2.448)	4.655	Cullen/Frost Bankers Inc	JP Morgan	1.313
(28.810)	Cotiviti Holdings Inc	JP Morgan	(35.379)			Bank of America	
		Bank of America		9.142	Cullen/Frost Bankers Inc	Merrill Lynch	(15.608)
(884)	Cotiviti Holdings Inc	Merrill Lynch	(10.948)	2.936	Cullen/Frost Bankers Inc	Citibank	(38.671)
(147.408)	Coty Inc 'A'	Citibank	(919)	2.812	Cullen/Frost Bankers Inc	JP Morgan	(4.580)
(43.642)	Coty Inc 'A'	Citibank	79.600	4.788	Cullen/Frost Bankers Inc	Credit Suisse	(4.387)
(375.017)	Coty Inc 'A'	Deutsche Bank	33.168	8.183	Cummins Inc	Deutsche Bank	(15.896)
		Bank of America		86.243	Cummins Inc	Credit Suisse	(10.474)
(140.866)	Coty Inc 'A'	Merrill Lynch	349.435			Bank of America	
(14.369)	Coty Inc 'A'	JP Morgan	200.359	13.374	Cummins Inc	Merrill Lynch	(167.533)
(78.919)	Cousins Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	37.216	2.747	Cummins Inc	Citibank	(58.177)
(6.156)	Cousins Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	(15.389)	8.011	Cummins Inc	JP Morgan	(3.516)
(84.766)	Cousins Properties Inc (Reit)	Citibank	(3.170)	6.242	Cummins Inc	Deutsche Bank	(35.870)
		Bank of America				Bank of America	
(52.185)	Cousins Properties Inc (Reit)	Merrill Lynch	(41.112)	1.609	Curtiss-Wright Corp	Merrill Lynch	(6.304)
(11.688)	Cousins Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	(25.310)	3.633	Curtiss-Wright Corp	Citibank	(579)
(52.225)	Covanta Holding Corp	JP Morgan	(2.279)	19.379	Curtiss-Wright Corp	Credit Suisse	7.121
(24.769)	Covanta Holding Corp	Credit Suisse	(45.204)	12.368	Curtiss-Wright Corp	Deutsche Bank	(17.689)
(28.974)	Covanta Holding Corp	Deutsche Bank	(22.911)	(8.811)	CVR Energy Inc	JP Morgan	(7.794)
(39.545)	Covanta Holding Corp	JP Morgan	(23.904)	(10.258)	CVS Health Corp	JP Morgan	31.340
(55.273)	Covanta Holding Corp	Citibank	(36.579)	(24.104)	CVS Health Corp	Deutsche Bank	10.668
		Bank of America		(15.431)	Cypress Semiconductor Corp	Credit Suisse	(87.688)
		Merrill Lynch	(48.510)	(105.747)	Cypress Semiconductor Corp	Citibank	(5.015)
13.786	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Credit Suisse	(45.016)	(69.326)	CyrusOne Inc (Reit)	Credit Suisse	(102.046)
8.751	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Bank of America				Bank of America	
6.907	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Merrill Lynch	29.491	(16.607)	CyrusOne Inc (Reit)	Merrill Lynch	(141.934)
		Citibank		(22.776)	CyrusOne Inc (Reit)	Citibank	(56.464)
17.990	Cracker Barrel Old Country Store Inc	JP Morgan	(27.267)	(4.891)	CyrusOne Inc (Reit)	JP Morgan	(45.552)
						Credit Suisse	(9.782)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(14.602)	CyrusOne Inc (Reit)	Deutsche Bank	(24.093)	(47.981)	DENTSPLY SIRONA Inc	Citibank	111.316
63.144	Dana Inc	JP Morgan	(87.139)	(7.170)	DENTSPLY SIRONA Inc	Credit Suisse	(3.298)
31.692	Dana Inc	Bank of America		(40.909)	DENTSPLY SIRONA Inc	Deutsche Bank	114.337
		Merrill Lynch	(43.101)	11.929	Devon Energy Corp	Credit Suisse	32.328
34.057	Dana Inc	Citibank	(53.810)	150.534	Devon Energy Corp	Bank of America	
134.998	Dana Inc	Credit Suisse	(209.944)			Merrill Lynch	67.740
19.514	Dana Inc	Deutsche Bank	(26.539)	48.001	Devon Energy Corp	Citibank	(3.360)
(5.521)	Danaher Corp	Bank of America		24.949	Devon Energy Corp	JP Morgan	67.612
		Merrill Lynch	(3.589)	921	Devon Energy Corp	Deutsche Bank	414
(23.132)	Danaher Corp	Citibank	12.029	(14.153)	DexCom Inc	Citibank	(26.608)
8.273	Darden Restaurants Inc	Credit Suisse	13.712	(24.146)	DexCom Inc	JP Morgan	(71.472)
12.360	Darden Restaurants Inc	Bank of America		(7.601)	DexCom Inc	Credit Suisse	(22.499)
		Merrill Lynch	13.843	(37.639)	DexCom Inc	Deutsche Bank	(39.830)
4.594	Darden Restaurants Inc	Citibank	11.393	86.622	Diamond Offshore Drilling Inc	Credit Suisse	(81.727)
4.102	Darden Restaurants Inc	JP Morgan	(15.793)	80.488	Diamond Offshore Drilling Inc	Bank of America	
28.615	Darden Restaurants Inc	Deutsche Bank	32.049			Merrill Lynch	(97.390)
(35.968)	Darling Ingredients Inc	Credit Suisse	(58.586)	20.794	Diamond Offshore Drilling Inc	Citibank	(36.597)
(5.455)	Darling Ingredients Inc	Deutsche Bank	(7.964)	39.126	Diamond Offshore Drilling Inc	JP Morgan	(34.822)
(42.330)	Darling Ingredients Inc	Citibank	(27.938)	38.560	Diamond Offshore Drilling Inc	Deutsche Bank	(46.658)
(38.600)	Darling Ingredients Inc	JP Morgan	(87.236)	(14.395)	Diamondback Energy Inc	Bank of America	
(75.855)	Darling Ingredients Inc	Bank of America				Merrill Lynch	100.765
		Merrill Lynch	(110.748)	(10.020)	Diamondback Energy Inc	JP Morgan	89.454
3.070	Dave & Buster's Entertainment Inc	Bank of America		(2.770)	Diamondback Energy Inc	Credit Suisse	36.536
		Merrill Lynch	5.741	(10.459)	Diamondback Energy Inc	Deutsche Bank	73.213
12.790	Dave & Buster's Entertainment Inc	Credit Suisse	4.349	3.785	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Bank of America	
21.452	Dave & Buster's Entertainment Inc			85	DiamondRock	Merrill Lynch	4.674
		Citibank	18.020			Citibank	47
8.064	DaVita Inc	Deutsche Bank	13.548	12.576	DiamondRock Hospitality Co (Reit)		
4.388	DaVita Inc	Bank of America				Deutsche Bank	15.531
		Merrill Lynch	4.955	22.103	Dick's Sporting Goods Inc	JP Morgan	164.225
20.510	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(7.179)	58.102	Dick's Sporting Goods Inc	Bank of America	
4.170	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	(1.460)			Merrill Lynch	285.281
22.681	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	Bank of America		31.246	Dick's Sporting Goods Inc	Citibank	237.782
		Merrill Lynch	15.196	7.470	Dick's Sporting Goods Inc	Credit Suisse	55.502
35.615	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	Deutsche Bank	23.862	64.224	Dick's Sporting Goods Inc	Deutsche Bank	363.846
9.309	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	Citibank	11.450	(13.802)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Citibank	(14.216)
(29.482)	DDR Corp (Reit)	Bank of America		(3.629)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(13.562)			Merrill Lynch	(508)
(19.529)	DDR Corp (Reit)	Credit Suisse	(7.421)	(5.847)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Deutsche Bank	(819)
(39.430)	DDR Corp (Reit)	Citibank	(63.877)	(31.106)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(88.030)
(39.837)	DDR Corp (Reit)	Deutsche Bank	(18.325)	(4.128)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	(4.551)
(129.992)	DDR Corp (Reit)	JP Morgan	(7.253)	795	Discover Financial Services	Credit Suisse	835
20.537	Deckers Outdoor Corp	JP Morgan	295.280	11.355	Discover Financial Services	JP Morgan	11.923
4.303	Deckers Outdoor Corp	Credit Suisse	51.812	570	Discover Financial Services	Citibank	(2.451)
14.728	Deckers Outdoor Corp	Citibank	134.614	22.974	Discovery Inc 'A'	Credit Suisse	(52.932)
3.193	Deckers Outdoor Corp	Deutsche Bank	39.338	55.259	Discovery Inc 'A'	Bank of America	
(4.524)	Deere & Co	Deutsche Bank	(28.411)			Merrill Lynch	(112.176)
(20.214)	Deere & Co	JP Morgan	(170.938)	12.084	Discovery Inc 'A'	JP Morgan	(25.618)
4.665	Delek US Holdings Inc	Citibank	30.229	53.577	Discovery Inc 'A'	Citibank	(119.477)
8.492	Delek US Holdings Inc	Deutsche Bank	62.926	40.108	Discovery Inc 'A'	Deutsche Bank	(81.419)
5.819	Dell Technologies Inc 'V'	Bank of America		(49.877)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	41.955			Merrill Lynch	152.125
37.049	Dell Technologies Inc 'V'	Deutsche Bank	267.123	(8.022)	DISH Network Corp 'A'	Citibank	24.307
15.279	Delphi Technologies Plc	Citibank	(47.365)	4.717	Dolby Laboratories Inc 'A'	Credit Suisse	3.632
37.026	Delphi Technologies Plc	Deutsche Bank	(22.216)	9.669	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America	
19.855	Delta Air Lines Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(483)
		Merrill Lynch	35.938	3.159	Dolby Laboratories Inc 'A'	Citibank	2.306
17.303	Delta Air Lines Inc	Citibank	11.420	14.960	Dolby Laboratories Inc 'A'	JP Morgan	11.519
3.061	Delta Air Lines Inc	Credit Suisse	5.540	1.155	Dolby Laboratories Inc 'A'	Deutsche Bank	(58)
16.461	Delta Air Lines Inc	JP Morgan	29.794	4.234	Dollar General Corp	Credit Suisse	(21.170)
29.014	Delta Air Lines Inc	Deutsche Bank	52.515	3.659	Dollar General Corp	Bank of America	
31.671	Deluxe Corp	Credit Suisse	(92.796)			Merrill Lynch	(18.734)
21.593	Deluxe Corp	Deutsche Bank	(98.248)	4.103	Dollar General Corp	JP Morgan	(30.761)
51.617	Deluxe Corp	Bank of America		(4.054)	Dollar Tree Inc	Credit Suisse	38.148
		Merrill Lynch	(234.857)	(11.569)	Dollar Tree Inc	Citibank	107.823
53.666	Deluxe Corp	Citibank	(119.675)	(3.179)	Dollar Tree Inc	JP Morgan	28.356
2.449	Deluxe Corp	JP Morgan	(7.176)	(22.300)	Dollar Tree Inc	Bank of America	
(4.922)	DENTSPLY SIRONA Inc	JP Morgan	(2.264)			Merrill Lynch	236.629
(47.462)	DENTSPLY SIRONA Inc	Bank of America		(42.926)	Dominion Energy Inc	Citibank	13.307
		Merrill Lynch	142.804	(51.404)	Dominion Energy Inc	JP Morgan	(11.871)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(26.500)	Dominion Energy Inc	Bank of America		3.759	DXC Technology Co	Credit Suisse	(38.304)
		Merrill Lynch	26.765	(6.562)	Dycom Industries Inc	Credit Suisse	90.752
(27.368)	Dominion Energy Inc	Credit Suisse	(10.126)	(3.852)	Dycom Industries Inc	Deutsche Bank	65.561
2.804	Domino's Pizza Inc	Bank of America		(4.431)	Dycom Industries Inc	Citibank	(10.989)
		Merrill Lynch	6.644	(4.297)	Dycom Industries Inc	Bank of America	
445	Domino's Pizza Inc	Citibank	881			Merrill Lynch	73.135
2.189	Domino's Pizza Inc	JP Morgan	(482)	(7.947)	Dycom Industries Inc	JP Morgan	132.627
8.693	Domino's Pizza Inc	Deutsche Bank	26.861	12.063	E*TRADE Financial Corp	Credit Suisse	(13.468)
13.402	Domtar Corp	Credit Suisse	50.928	19.452	E*TRADE Financial Corp	Deutsche Bank	(10.504)
17.539	Domtar Corp	Bank of America		8.871	E*TRADE Financial Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	43.321			Merrill Lynch	(4.790)
56.475	Domtar Corp	Citibank	114.079	43.293	E*TRADE Financial Corp	Citibank	(88.751)
19.835	Domtar Corp	JP Morgan	75.373	14.139	E*TRADE Financial Corp	JP Morgan	10.180
22.788	Domtar Corp	Deutsche Bank	56.286	(4.787)	Eagle Materials Inc	Deutsche Bank	(3.112)
7.803	Donaldson Co Inc	Citibank	780	(6.049)	Eagle Materials Inc	Credit Suisse	(30.910)
110	Donaldson Co Inc	Deutsche Bank	42	(5.778)	Eagle Materials Inc	Bank of America	
22.302	Donaldson Co Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(3.756)
		Merrill Lynch	8.475	(3.413)	Eagle Materials Inc	Citibank	(1.331)
32.621	Donaldson Co Inc	JP Morgan	38.819	8.465	East West Bancorp Inc	Bank of America	
(15.360)	Dorman Products Inc	Credit Suisse	21.965			Merrill Lynch	(4.656)
(3.785)	Dorman Products Inc	Bank of America		18.544	East West Bancorp Inc	Citibank	(35.790)
		Merrill Lynch	1.438	3.070	East West Bancorp Inc	JP Morgan	4.759
(6.744)	Dorman Products Inc	Citibank	540	21.048	East West Bancorp Inc	Credit Suisse	15.670
(13.951)	Dorman Products Inc	Deutsche Bank	5.301	22.203	East West Bancorp Inc	Deutsche Bank	(12.212)
(10.264)	Dorman Products Inc	JP Morgan	9.474	5.630	EastGroup Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	3.660
6.713	Douglas Emmett Inc (Reit)	Bank of America		14.395	EastGroup Properties Inc (Reit)	Citibank	49.231
		Merrill Lynch	6.780	22.491	EastGroup Properties Inc (Reit)	Bank of America	
20.950	Douglas Emmett Inc (Reit)	Citibank	30.378			Merrill Lynch	73.030
4.048	Douglas Emmett Inc (Reit)	JP Morgan	(81)	8.765	EastGroup Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	25.156
7.020	Douglas Emmett Inc (Reit)	Deutsche Bank	7.090	15.883	EastGroup Properties Inc (Reit)	JP Morgan	10.324
(6.307)	Dover Corp	Bank of America		17.898	Eastman Chemical Co	Credit Suisse	(12.887)
		Merrill Lynch	(6.875)	21.850	Eastman Chemical Co	JP Morgan	(15.732)
(34.593)	DR Horton Inc	Credit Suisse	(6.090)	17.977	Eastman Chemical Co	Bank of America	
(6.089)	DR Horton Inc	Deutsche Bank	(11.204)			Merrill Lynch	(65.216)
(17.351)	DR Horton Inc	Bank of America		6.914	Eastman Chemical Co	Citibank	(25.098)
		Merrill Lynch	(31.926)	4.540	Eastman Chemical Co	Deutsche Bank	(12.213)
(26.790)	DR Horton Inc	Citibank	(41.525)	(18.372)	Eaton Corp Plc	Citibank	29.579
(34.035)	DR Horton Inc	JP Morgan	43.125	(10.922)	Eaton Corp Plc	Credit Suisse	(29.817)
(2.544)	Dril-Quip Inc	Citibank	1.018	19.932	Eaton Vance Corp	Credit Suisse	(28.104)
(1.018)	Dril-Quip Inc	JP Morgan	(3.258)	750	Eaton Vance Corp	Bank of America	
(8.783)	Dril-Quip Inc	Credit Suisse	(18.434)			Merrill Lynch	(1.800)
(3.750)	Dril-Quip Inc	Bank of America		11.540	Eaton Vance Corp	Citibank	(14.310)
		Merrill Lynch	(6.563)	5.590	Eaton Vance Corp	JP Morgan	(7.882)
22.529	DTE Energy Co	Credit Suisse	38.440	8.483	eBay Inc	Bank of America	
16.558	DTE Energy Co	Bank of America				Merrill Lynch	(4.666)
		Merrill Lynch	9.604	21.797	eBay Inc	Citibank	(5.231)
17.227	DTE Energy Co	Citibank	33.248	12.780	eBay Inc	JP Morgan	(7.285)
9.410	DTE Energy Co	JP Morgan	8.940	25.848	eBay Inc	Deutsche Bank	(14.216)
7.009	DTE Energy Co	Deutsche Bank	4.065	10.288	EchoStar Corp 'A'	Credit Suisse	(40.535)
(7.111)	Duke Energy Corp	Bank of America		385	EchoStar Corp 'A'	JP Morgan	(1.517)
		Merrill Lynch	(10.282)	3.556	EchoStar Corp 'A'	Bank of America	
(17.200)	Duke Energy Corp	Citibank	(48.160)			Merrill Lynch	(13.299)
(22.544)	Duke Energy Corp	JP Morgan	(2.050)	4.074	EchoStar Corp 'A'	Citibank	(10.796)
(9.487)	Duke Energy Corp	Credit Suisse	9.582	6.860	EchoStar Corp 'A'	Deutsche Bank	(25.656)
(12.560)	Duke Energy Corp	Deutsche Bank	754	(17.181)	Ecolab Inc	Bank of America	
21.077	Duke Realty Corp (Reit)	Deutsche Bank	3.162			Merrill Lynch	53.605
26.977	Duke Realty Corp (Reit)	Bank of America		(3.684)	Ecolab Inc	Citibank	12.599
		Merrill Lynch	4.047	(11.542)	Ecolab Inc	JP Morgan	27.701
41.982	Duke Realty Corp (Reit)	Citibank	26.029	(19.655)	Ecolab Inc	Deutsche Bank	61.324
72.618	Duke Realty Corp (Reit)	JP Morgan	(13.797)	(3.944)	Edgewell Personal Care Co	Citibank	(276)
32	Duke Realty Corp (Reit)	Credit Suisse	(6)	(7.104)	Edgewell Personal Care Co	JP Morgan	(10.380)
5.756	Dun & Bradstreet Corp/The	Credit Suisse	44.077	(24.070)	Edison International	Citibank	(1.444)
5.982	Dun & Bradstreet Corp/The	Bank of America		(1.305)	Education Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.170			Merrill Lynch	(3.471)
2.973	Dun & Bradstreet Corp/The	Citibank	2.884	(32.357)	Education Realty Trust Inc (Reit)	Citibank	(99.983)
10.755	Dun & Bradstreet Corp/The	JP Morgan	31.765				
6.249	Dun & Bradstreet Corp/The	Deutsche Bank	3.312				
(8.687)	Dunkin' Brands Group Inc	Bank of America					
		Merrill Lynch	5.820				
(5.689)	Dunkin' Brands Group Inc	Citibank	5.973				
(16.721)	Dunkin' Brands Group Inc	Deutsche Bank	11.203				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(20.749)	Education Realty Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	(47.100)	722	Enstar Group Ltd	Bank of America	
(46.999)	Education Realty Trust Inc (Reit)	Deutsche Bank	(129.213)	899	Enstar Group Ltd	Merrill Lynch	(3.646)
(9.443)	Education Realty Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(21.436)	785	Enstar Group Ltd	Deutsche Bank	(4.540)
25.873	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America		42	Enstar Group Ltd	Citibank	(6.516)
		Merrill Lynch	65.593	15.040	Entegris Inc	JP Morgan	(193)
21.687	Edwards Lifesciences Corp	JP Morgan	93.328	5.090	Entegris Inc	Bank of America	(2.256)
(13.694)	Eldorado Resorts Inc	Credit Suisse	(43.279)	16.436	Entegris Inc	Merrill Lynch	(4.033)
(8.583)	Eldorado Resorts Inc	JP Morgan	(24.860)	3.119	Entegris Inc	Credit Suisse	(2.465)
271	Electronic Arts Inc	Credit Suisse	2.114	13.532	Entegris Inc	Deutsche Bank	2.651
1.720	Electronic Arts Inc	Citibank	(843)	30.908	Entergy Corp	JP Morgan	9.472
9.247	Electronic Arts Inc	JP Morgan	53.821			Bank of America	
705	Electronic Arts Inc	Deutsche Bank	1.114	8.364	Entergy Corp	Merrill Lynch	79.124
18.724	Eli Lilly & Co	Credit Suisse	103.169	60.640	Entergy Corp	Citibank	28.689
18.334	Eli Lilly & Co	Bank of America		34.490	Entergy Corp	JP Morgan	168.705
		Merrill Lynch	39.968	2.117	Entergy Corp	Credit Suisse	24.488
59.464	Eli Lilly & Co	Citibank	129.037	(40.305)	Envision Healthcare Corp	Deutsche Bank	5.420
3.596	Eli Lilly & Co	Deutsche Bank	7.839	(21.792)	Envision Healthcare Corp	JP Morgan	(172.102)
75	Eli Lilly & Co	JP Morgan	413	(16.169)	Envision Healthcare Corp	Credit Suisse	(93.052)
(33.599)	Ellie Mae Inc	JP Morgan	(118.268)	13.354	EOG Resources Inc	Deutsche Bank	(21.343)
(27.051)	Ellie Mae Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(167.279)	28.987	EOG Resources Inc	Merrill Lynch	(10.683)
(8.326)	Ellie Mae Inc	Citibank	(49.290)	25.893	EOG Resources Inc	Citibank	(125.514)
(14.301)	Ellie Mae Inc	Credit Suisse	(79.886)	17.118	EOG Resources Inc	JP Morgan	56.187
(21.565)	Ellie Mae Inc	Deutsche Bank	(134.781)	3.490	EOG Resources Inc	Credit Suisse	70.869
17.328	EMCOR Group Inc	Deutsche Bank		(16.412)	EPAM Systems Inc	Deutsche Bank	(2.792)
		Bank of America				Bank of America	
8.961	EMCOR Group Inc	Merrill Lynch	34.656	(20.585)	EPAM Systems Inc	Merrill Lynch	7.878
19.977	EMCOR Group Inc	Citibank	4.122	(8.576)	EPAM Systems Inc	Citibank	(22.232)
9.977	EMCOR Group Inc	JP Morgan	(11.091)	(2.079)	EPAM Systems Inc	JP Morgan	(52.559)
2.474	EMCOR Group Inc	Credit Suisse	812	29.947	EPAM Systems Inc	Credit Suisse	(365)
7.780	Emerson Electric Co	Deutsche Bank	4.948		EPR Properties (Reit)	Bank of America	
		Bank of America		9.909	EPR Properties (Reit)	Merrill Lynch	72.172
5.809	Emerson Electric Co	Merrill Lynch	(7.953)	7.923	EPR Properties (Reit)	Citibank	11.494
6.344	Emerson Electric Co	Citibank	(10.979)	(56.807)	EQT Corp	JP Morgan	29.315
605	Emerson Electric Co	JP Morgan	(4.543)			Bank of America	
91	Empire State Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	974	(117.750)	EQT Corp	Merrill Lynch	45.446
11.440	Empire State Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	34	(12.938)	EQT Corp	JP Morgan	(107.153)
		Citibank	9.324	(30.948)	EQT Corp	Citibank	14.232
577	Empire State Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America		(5.957)	Equifax Inc	Deutsche Bank	24.758
		Merrill Lynch	216	(7.650)	Equifax Inc	Deutsche Bank	(9.769)
9.502	Empire State Realty Trust Inc 'A' (Reit)	JP Morgan	(3.658)	(3.715)	Equifax Inc	JP Morgan	(33.660)
9.322	Encompass Health Corp	Bank of America		(16.838)	Equifax Inc	Credit Suisse	(16.346)
		Merrill Lynch	24.237			Bank of America	
15.719	Encompass Health Corp	Credit Suisse	29.866	(9.098)	Equifax Inc	Merrill Lynch	(18.955)
48.343	Encompass Health Corp	Citibank	70.097	(8.020)	Equinix Inc (Reit)	Citibank	(182)
34.221	Encompass Health Corp	Deutsche Bank	88.975	(1.731)	Equinix Inc (Reit)	Citibank	(127.759)
16.751	Encompass Health Corp	JP Morgan	28.156	(948)	Equinix Inc (Reit)	Credit Suisse	(19.172)
30.289	Encompass Health Corp	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	49.977	(841)	Equinix Inc (Reit)	Merrill Lynch	(10.238)
31.219	Energen Corp	Deutsche Bank	22.046	(2.893)	Equinix Inc (Reit)	JP Morgan	(9.066)
20.338	Energizer Holdings Inc	Credit Suisse	118.774	36.924	Equity Commonwealth (Reit)	Deutsche Bank	(31.244)
27.024	Energizer Holdings Inc	Bank of America		19.172	Equity Commonwealth (Reit)	Credit Suisse	(12.923)
		Merrill Lynch	110.440			Bank of America	
7.433	Energizer Holdings Inc	Citibank	17.170	11.881	Equity Commonwealth (Reit)	Merrill Lynch	8.052
18.799	Energizer Holdings Inc	JP Morgan	109.181	41.628	Equity Commonwealth (Reit)	Citibank	6.416
1.902	Energizer Holdings Inc	Deutsche Bank	10.062	17.638	Equity Commonwealth (Reit)	JP Morgan	(3.807)
3.302	EnerSys	Bank of America		26.703	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	7.408
		Merrill Lynch	22.222	29.720	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Bank of America	
2.396	EnerSys	JP Morgan	15.718			Merrill Lynch	71.790
4.937	EnerSys	Citibank	2.814	25.810	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	JP Morgan	48.075
17.808	EnLink Midstream LLC	Citibank	6.233	16.119	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	7.993
(223.344)	Ensco Plc 'A'	Citibank	176.442	23.950	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Citibank	53.354
(12.724)	Ensco Plc 'A'	Credit Suisse	(4.581)			Deutsche Bank	56.761
(14.454)	Ensco Plc 'A'	JP Morgan	(5.203)	9.886	Equity Residential (Reit)	Deutsche Bank	28.373
(1.001.939)	Ensco Plc 'A'	Deutsche Bank	490.950	16.125	Equity Residential (Reit)	Credit Suisse	27.896

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
13.277	Equity Residential (Reit)	Bank of America		(15.771)	Expedia Group Inc	Credit Suisse	(120.935)
		Merrill Lynch	38.105	(5.255)	Expedia Group Inc	Deutsche Bank	(27.957)
17.164	Equity Residential (Reit)	JP Morgan	29.694	(6.288)	Expedia Group Inc	JP Morgan	(22.069)
(4.083)	Erie Indemnity Co 'A'	Credit Suisse	9.636	17.178	Expeditors International		
(8.967)	Erie Indemnity Co 'A'	JP Morgan	21.162		of Washington Inc	Credit Suisse	91.405
(2.428)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America		17.139	Expeditors International	Deutsche Bank	59.472
		Merrill Lynch	753		of Washington Inc		
(8.556)	Erie Indemnity Co 'A'	Citibank	14.973	31.838	Expeditors International	Citibank	69.725
(3.100)	Erie Indemnity Co 'A'	Deutsche Bank	961		of Washington Inc		
22.434	Essent Group Ltd	Bank of America		11.215	Expeditors International	JP Morgan	66.393
		Merrill Lynch	(17.274)		of Washington Inc	Bank of America	
23.150	Essent Group Ltd	Citibank	(19.678)	7.457	Expeditors International	Merrill Lynch	25.876
24.398	Essent Group Ltd	JP Morgan	(35.621)		of Washington Inc		
4.337	Essent Group Ltd	Deutsche Bank	(3.339)	13.989	Express Scripts Holding Co	Bank of America	
29.057	Essent Group Ltd	Credit Suisse	(42.423)			Merrill Lynch	39.519
3.670	Essex Property	Bank of America		8.060	Express Scripts Holding Co	Citibank	(13.581)
	Trust Inc (Reit)	Merrill Lynch	20.222	57.580	Express Scripts Holding Co	JP Morgan	457.473
1.608	Essex Property			20.405	Express Scripts Holding Co	Credit Suisse	162.118
	Trust Inc (Reit)	Deutsche Bank	8.860	22.084	Express Scripts Holding Co	Deutsche Bank	62.387
1.955	Essex Property			(14.859)	Extended Stay		
	Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(4.242)		America Inc (Unit)	Citibank	(16.048)
3.044	Essex Property			(6.150)	Extended Stay		
	Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	(6.605)		America Inc (Unit)	Credit Suisse	(6.519)
8.249	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Bank of America		(16.367)	Extended Stay		
		Merrill Lynch	67.889		America Inc (Unit)	JP Morgan	(17.349)
31.264	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	JP Morgan	337.070	(17.686)	Extended Stay	Bank of America	
18.939	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Citibank	47.537		America Inc (Unit)	Merrill Lynch	(23.346)
8.922	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Credit Suisse	86.836	4.554	Extra Space		
12.804	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Deutsche Bank	105.377		Storage Inc (Reit)	Citibank	17.806
7.396	Etsy Inc	Credit Suisse	20.406	12.465	Extra Space		
48.323	Etsy Inc	JP Morgan	103.648		Storage Inc (Reit)	Credit Suisse	36.896
5.592	Euronet Worldwide Inc	Credit Suisse	2.460	5.411	Extra Space		
13.125	Euronet Worldwide Inc	Bank of America			Storage Inc (Reit)	Deutsche Bank	21.398
		Merrill Lynch	(1.706)	4.835	Extra Space	Bank of America	
3.355	Euronet Worldwide Inc	Citibank	839		Storage Inc (Reit)	Merrill Lynch	21.004
1.499	Euronet Worldwide Inc	JP Morgan	660	11.021	Extra Space		
7.465	Euronet Worldwide Inc	Deutsche Bank	(970)		Storage Inc (Reit)	JP Morgan	32.622
4.269	Evercore Inc 'A'	Citibank	(25.614)	1.653	Exxon Mobil Corp	Credit Suisse	4.397
9.986	Evercore Inc 'A'	Bank of America		4.744	Exxon Mobil Corp	Deutsche Bank	(4.934)
		Merrill Lynch	(27.961)	56.786	Exxon Mobil Corp	Bank of America	
16.406	Evercore Inc 'A'	JP Morgan	(7.383)			Merrill Lynch	(59.057)
532	Evercore Inc 'A'	Credit Suisse	(239)	17.017	Exxon Mobil Corp	Citibank	(15.145)
2.231	Evercore Inc 'A'	Deutsche Bank	(6.247)	89.907	Exxon Mobil Corp	JP Morgan	113.452
1.981	Everest Re Group Ltd	Citibank	(8.360)	14.845	F5 Networks Inc	Bank of America	
6.750	Everest Re Group Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	35.331
		Merrill Lynch	(21.600)	15.095	F5 Networks Inc	JP Morgan	59.625
5.425	Everest Re Group Ltd	Deutsche Bank	(17.360)	9.089	F5 Networks Inc	Citibank	(3.454)
4.917	Everest Re Group Ltd	JP Morgan	(11.555)	6.345	F5 Networks Inc	Credit Suisse	25.063
(14.220)	Eversource Energy	Citibank	10.096	11.850	F5 Networks Inc	Deutsche Bank	19.048
(13.848)	Eversource Energy	Credit Suisse	3.462	(14.517)	Facebook Inc 'A'	Bank of America	
(55.528)	Eversource Energy	Bank of America				Merrill Lynch	(75.707)
		Merrill Lynch	22.624	(2.347)	Facebook Inc 'A'	Citibank	(12.603)
(13.163)	Eversource Energy	JP Morgan	(1.677)	(4.501)	Facebook Inc 'A'	Credit Suisse	(30.996)
(4.941)	Eversource Energy	Deutsche Bank	1.581	5.729	FactSet Research	Bank of America	
(3.351)	Exact Sciences Corp	Bank of America			Systems Inc	Merrill Lynch	30.310
		Merrill Lynch	(35.521)	5.958	FactSet Research		
(19.946)	Exact Sciences Corp	Citibank	(167.147)		Systems Inc	Citibank	8.103
(8.561)	Exact Sciences Corp	JP Morgan	(82.055)	2.147	FactSet Research		
(20.076)	Exact Sciences Corp	Credit Suisse	(209.393)		Systems Inc	JP Morgan	17.927
(8.602)	Exact Sciences Corp	Deutsche Bank	(91.181)	332	FactSet Research		
(9.964)	Exelixis Inc	Citibank	4.285		Systems Inc	Deutsche Bank	1.906
(40.093)	Exelixis Inc	JP Morgan	5.633	2.043	Fair Isaac Corp	Credit Suisse	15.746
74.171	Exelon Corp	JP Morgan	49.902	1.310	Fair Isaac Corp	Deutsche Bank	10.113
30.475	Exelon Corp	Bank of America		4.617	Fair Isaac Corp	Citibank	25.809
		Merrill Lynch	27.885	2.694	Fair Isaac Corp	JP Morgan	26.698
25.642	Exelon Corp	Citibank	32.181	6.539	Fair Isaac Corp	Bank of America	
55.545	Exelon Corp	Credit Suisse	66.636			Merrill Lynch	50.481
20.154	Exelon Corp	Deutsche Bank	18.441	32.520	Fastenal Co	Deutsche Bank	(4.553)
(7.827)	Expedia Group Inc	Citibank	(23.716)	6.008	Federal Realty Investment		
(13.509)	Expedia Group Inc	Bank of America			Trust (Reit)	Deutsche Bank	22.049
		Merrill Lynch	(71.868)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
3.618	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	10.485	(4.485)	First Financial Bankshares Inc	Deutsche Bank	(5.831)
3.035	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Citibank	6.586	(4.703)	First Financial Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.114)
5.365	Federal Realty Investment Trust (Reit)	JP Morgan	5.365	(2.968)	First Financial Bankshares Inc	JP Morgan	(3.116)
30.186	Federated Investors Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(16.904)	3.748	First Hawaiian Inc	Bank of America Merrill Lynch	3.561
815	Federated Investors Inc 'B'	JP Morgan	(334)	4.512	First Hawaiian Inc	Credit Suisse	4.467
3.038	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	15.199	(9.900)	First Horizon National Corp	Bank of America Merrill Lynch	6.138
1.799	FedEx Corp	Citibank	180	(50.402)	First Horizon National Corp	Citibank	49.394
(28.167)	FibroGen Inc	Citibank	(14.084)	(15.683)	First Horizon National Corp	Deutsche Bank	9.723
(10.428)	FibroGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18.844)	(129.513)	First Horizon National Corp	JP Morgan	50.825
(7.151)	FibroGen Inc	Credit Suisse	(1.789)	20.937	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	15.075
(9.974)	FibroGen Inc	JP Morgan	(63.939)	31.424	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Citibank	37.080
(21.731)	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	38.464	76.513	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	JP Morgan	55.089
(9.321)	Fidelity National Information Services Inc	JP Morgan	4.683	25.815	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	35.367
(8.578)	Fidelity National Information Services Inc	Deutsche Bank	15.183	22.647	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Deutsche Bank	31.026
(26.212)	Fidelity National Information Services Inc	Credit Suisse	33.102	(9.815)	First Republic Bank/CA	Citibank	8.146
33.001	Fifth Third Bancorp	Credit Suisse	(112.739)	(19.864)	First Republic Bank/CA	Deutsche Bank	(21.928)
62.286	Fifth Third Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(235.441)	(11.625)	First Republic Bank/CA	Bank of America Merrill Lynch	(14.289)
3.525	Fifth Third Bancorp	Citibank	(4.794)	(20.324)	First Republic Bank/CA	JP Morgan	(59.346)
25.627	Fifth Third Bancorp	JP Morgan	(53.890)	(12.365)	First Republic Bank/CA	Credit Suisse	(36.106)
4.299	Fifth Third Bancorp	Deutsche Bank	(16.250)	3.199	First Solar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13.279)
(46.045)	Financial Engines Inc	Citibank	(4.605)	(4.593)	FirstCash Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10.794)
(12.940)	Financial Engines Inc	Bank of America Merrill Lynch	—	(8.293)	FirstCash Inc	Deutsche Bank	(19.489)
(17.071)	Financial Engines Inc	Credit Suisse	(2.561)	69.742	FirstEnergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	44.635
(3.397)	Financial Engines Inc	JP Morgan	(510)	13.603	FirstEnergy Corp	Citibank	9.658
(4.081)	Financial Engines Inc	Deutsche Bank	—	36.694	FirstEnergy Corp	Credit Suisse	37.795
(15.484)	Finisar Corp	Bank of America Merrill Lynch	3.252	60.811	FirstEnergy Corp	Deutsche Bank	41.878
(33.005)	Finisar Corp	Citibank	15.512	121.796	FirstEnergy Corp	JP Morgan	103.436
(98.245)	Finisar Corp	Credit Suisse	25.634	17.500	Fiserv Inc	Bank of America Merrill Lynch	9.100
(47.598)	Finisar Corp	Deutsche Bank	9.996	21.822	Fiserv Inc	Citibank	20.731
(177.961)	Finisar Corp	JP Morgan	55.479	14.902	Fiserv Inc	JP Morgan	32.784
(65.374)	FireEye Inc	Citibank	(1.961)	1.335	Fiserv Inc	Deutsche Bank	694
(88.412)	FireEye Inc	JP Morgan	95.485	(18.925)	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	53.558
(90.698)	FireEye Inc	Bank of America Merrill Lynch	74.478	(12.484)	Five Below Inc	Citibank	13.358
(7.700)	FireEye Inc	Deutsche Bank	8.162	(14.821)	FleetCor Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14.525)
(14.202)	FireEye Inc	Credit Suisse	15.338	(10.237)	FleetCor Technologies Inc	Citibank	(36.853)
38.331	First American Financial Corp	Credit Suisse	2.756	(7.926)	FleetCor Technologies Inc	JP Morgan	2.184
12.527	First American Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(125)	(1.644)	FleetCor Technologies Inc	Credit Suisse	115
2.463	First American Financial Corp	Citibank	(3.350)	(1.778)	FleetCor Technologies Inc	Deutsche Bank	(1.742)
46.046	First American Financial Corp	JP Morgan	(59.194)	(20.629)	Flex Ltd	Citibank	4.126
30.247	First American Financial Corp	Deutsche Bank	(302)	(33.510)	Flex Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9.383
(506)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Citibank	6.826	(70.815)	Flex Ltd	JP Morgan	12.747
(124)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	JP Morgan	22	(32.570)	Flex Ltd	Credit Suisse	13.741
(774)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Credit Suisse	139	(16.551)	Flex Ltd	Deutsche Bank	4.019
(81)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Deutsche Bank	787	(17.135)	FLIR Systems Inc	Citibank	(1.028)
(162)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1.575	(19.044)	Floor & Decor Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27.804)
40.960	First Data Corp 'A'	Citibank	(13.926)	(17.394)	Floor & Decor Holdings Inc	Credit Suisse	(24.873)
10.980	First Data Corp 'A'	Deutsche Bank	(6.478)	(28.170)	Floor & Decor Holdings Inc	JP Morgan	(40.283)
51.307	First Data Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(30.271)	28.556	Flowers Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40.264)
(1.447)	First Financial Bankshares Inc	Citibank	145	23.903	Flowers Foods Inc	Citibank	21.035
				56.590	Flowers Foods Inc	JP Morgan	(100.823)
				23.258	Flowers Foods Inc	Deutsche Bank	(32.794)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(41.556)	Flowserve Corp	Credit Suisse	185.180	82.713	Freeport-McMoRan Inc	Deutsche Bank	108.354
(15.645)	Flowserve Corp	JP Morgan	81.041	23.273	Freeport-McMoRan Inc	Bank of America	
(67.126)	Flowserve Corp	Bank of America				Merrill Lynch	30.488
		Merrill Lynch	126.197	38.051	Freeport-McMoRan Inc	Citibank	3.805
(18.511)	Flowserve Corp	Citibank	54.607	9.301	Fresh Del Monte Produce Inc	Deutsche Bank	(17.300)
(24.406)	Flowserve Corp	Deutsche Bank	45.883	20.176	Fresh Del Monte Produce Inc	Bank of America	
(7.750)	Fluor Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(37.527)
		Merrill Lynch	(1.085)	5.294	Fresh Del Monte Produce Inc	Citibank	(4.288)
(11.229)	Fluor Corp	Credit Suisse	(44.355)	1.419	Fresh Del Monte Produce Inc	JP Morgan	(3.022)
(10.744)	Fluor Corp	Citibank	16.223	2.800	FTI Consulting Inc	JP Morgan	10.253
(26.324)	FMC Corp	Bank of America		5.279	FTI Consulting Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	57.123			Merrill Lynch	16.893
(8.058)	FMC Corp	JP Morgan	22.873	15.275	FTI Consulting Inc	Deutsche Bank	48.880
(1.115)	FMC Corp	Citibank	3.635	36.990	Fulton Financial Corp	Bank of America	
(20.022)	FNB Corp/PA	Credit Suisse	(1.402)			Merrill Lynch	9.248
(106.010)	FNB Corp/PA	Deutsche Bank	40.528	25.020	Fulton Financial Corp	Citibank	(6.255)
(156.663)	FNB Corp/PA	Bank of America		25.045	Fulton Financial Corp	JP Morgan	3.757
		Merrill Lynch	45.432	7.824	Fulton Financial Corp	Credit Suisse	1.174
(258.637)	FNB Corp/PA	Citibank	126.732	4.264	Fulton Financial Corp	Deutsche Bank	1.066
(65.046)	FNB Corp/PA	JP Morgan	(4.553)	28.931	Gaming and Leisure		
(17.312)	FNF Group	Citibank	9.522		Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	14.469
(32.132)	FNF Group	JP Morgan	(742)	33.668	Gaming and Leisure		
2.567	Foot Locker Inc	Bank of America			Properties Inc (Reit)	JP Morgan	37.035
		Merrill Lynch	27.749	179	Gaming and Leisure		
3.621	Foot Locker Inc	Citibank	36.789		Properties Inc (Reit)	Citibank	127
17.582	Foot Locker Inc	JP Morgan	228.330	20.551	Gaming and Leisure	Bank of America	
10.004	Foot Locker Inc	Deutsche Bank	108.143		Properties Inc (Reit)	Merrill Lynch	17.263
106.114	Ford Motor Co	Credit Suisse	33.956	28.809	Gaming and Leisure		
17.286	Ford Motor Co	Bank of America			Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	21.998
		Merrill Lynch	6.396	115.567	Gap Inc/The	Citibank	(361.725)
74.554	Ford Motor Co	Citibank	5.219	50.908	Gap Inc/The	JP Morgan	(5.091)
63.692	Ford Motor Co	JP Morgan	20.381	62.376	Gap Inc/The	Bank of America	
101.835	Ford Motor Co	Deutsche Bank	37.679			Merrill Lynch	(158.435)
(6.267)	Forest City Realty	Bank of America		82.886	Gap Inc/The	Credit Suisse	(115.671)
	Trust Inc 'A' (Reit)	Merrill Lynch	(3.760)	18.067	Gap Inc/The	Deutsche Bank	(53.042)
(12.299)	Forest City Realty			(72.141)	Gardner Denver Holdings Inc	Bank of America	
	Trust Inc 'A' (Reit)	Citibank	(7.133)			Merrill Lynch	42.563
(7.337)	Forest City Realty			(55.467)	Gardner Denver Holdings Inc	Deutsche Bank	32.726
	Trust Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	(3.228)	(14.658)	Gardner Denver Holdings Inc	Credit Suisse	(22.427)
(3.532)	Forest City Realty			(9.541)	Gardner Denver Holdings Inc	JP Morgan	14.596
	Trust Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	(2.119)	9.493	Garmin Ltd	Citibank	475
(3.115)	Forest City Realty			(14.086)	Gartner Inc	Citibank	(18.171)
	Trust Inc 'A' (Reit)	JP Morgan	(1.371)	(21.616)	Gartner Inc	Credit Suisse	(40.633)
49.257	Fortinet Inc	Credit Suisse	236.926	(7.247)	Gartner Inc	JP Morgan	1.465
28.159	Fortinet Inc	Citibank	83.914	(29.478)	Gartner Inc	Deutsche Bank	74.579
5.146	Fortinet Inc	Deutsche Bank	12.659	2.343	GATX Corp	Credit Suisse	5.553
25.188	Fortinet Inc	Bank of America		5.568	GATX Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	61.962			Merrill Lynch	(2.728)
629	Fortinet Inc	JP Morgan	3.025	27.298	GATX Corp	JP Morgan	64.696
571	Fortive Corp	Citibank	(1.428)	19.298	GATX Corp	Citibank	(17.175)
11.631	Fortive Corp	JP Morgan	(7.444)	14.185	GATX Corp	Deutsche Bank	(6.951)
2.893	Fortive Corp	Deutsche Bank	(7.638)	(24.966)	GCI Liberty Inc 'A'	Credit Suisse	49.765
2.587	Fortive Corp	Credit Suisse	(1.656)	(10.610)	GCI Liberty Inc 'A'	Citibank	19.629
2.787	Fortune Brands Home &	Bank of America		(5.191)	GCI Liberty Inc 'A'	Deutsche Bank	7.838
	Security Inc	Merrill Lynch	3.094	(28.046)	GCI Liberty Inc 'A'	JP Morgan	68.811
13.788	Fortune Brands Home &			(30.842)	GCI Liberty Inc 'A'	Bank of America	
	Security Inc	Citibank	2.068			Merrill Lynch	46.571
1.589	Fortune Brands Home &			23.334	Generac Holdings Inc	Credit Suisse	68.369
	Security Inc	Deutsche Bank	1.764	29.415	Generac Holdings Inc	JP Morgan	49.664
2.310	Fortune Brands Home &			9.864	Generac Holdings Inc	Bank of America	
	Security Inc	JP Morgan	3.812			Merrill Lynch	18.643
3.741	Fortune Brands Home &			29.254	Generac Holdings Inc	Citibank	9.361
	Security Inc	Credit Suisse	6.173	(131.726)	General Electric Co	JP Morgan	28.321
25.767	Franklin Resources Inc	Credit Suisse	3.607	(171.565)	General Electric Co	Bank of America	
47.698	Franklin Resources Inc	Bank of America				Merrill Lynch	154.406
		Merrill Lynch	(5.247)	(543.756)	General Electric Co	Credit Suisse	116.908
9.279	Franklin Resources Inc	Citibank	(9.465)	(153.313)	General Electric Co	Deutsche Bank	100.420
45.293	Franklin Resources Inc	JP Morgan	6.341	(24.476)	General Mills Inc	Citibank	(9.301)
9.583	Franklin Resources Inc	Deutsche Bank	(1.054)	(8.186)	General Mills Inc	JP Morgan	(3.984)
116.520	Freeport-McMoRan Inc	JP Morgan	146.130	39.543	General Motors Co	Bank of America	
27.227	Freeport-McMoRan Inc	Credit Suisse	53.637			Merrill Lynch	181.408

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
158.240	General Motors Co	Citibank	599.730	1.413	Graham Holdings Co 'B'	Bank of America	
53.706	General Motors Co	JP Morgan	289.328			Merrill Lynch	(21.389)
9.170	General Motors Co	Credit Suisse	52.636	762	Graham Holdings Co 'B'	JP Morgan	(10.478)
(23.024)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Credit Suisse	(68.346)	1.116	Graham Holdings Co 'B'	Citibank	(10.937)
(23.823)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Bank of America		1.753	Graham Holdings Co 'B'	Deutsche Bank	(37.602)
		Merrill Lynch	(39.415)	(8.332)	Gramercy Property Trust (Reit)	Bank of America	
(49.099)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Citibank	(93.779)			Merrill Lynch	(500)
(26.012)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	JP Morgan	(82.198)	(6.910)	Gramercy Property Trust (Reit)	Citibank	(622)
(4.690)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Deutsche Bank	(7.739)	(34.333)	Gramercy Property Trust (Reit)	JP Morgan	(1.717)
2.959	Gentex Corp	Credit Suisse	2.367	(9.523)	Gramercy Property Trust (Reit)	Credit Suisse	(476)
8.784	Gentex Corp	Citibank	(4.480)	(13.368)	Gramercy Property Trust (Reit)	Deutsche Bank	(802)
37.714	Gentex Corp	JP Morgan	15.695	(775)	Grand Canyon Education Inc	Deutsche Bank	(1.907)
7.110	Gentex Corp	Bank of America		(9.025)	Grand Canyon Education Inc	Citibank	(8.213)
		Merrill Lynch	2.417	23.389	Graphic Packaging Holding Co	Credit Suisse	21.986
218	Gentex Corp	Deutsche Bank	74	37.680	Graphic Packaging Holding Co	Bank of America	
(20.910)	Genuine Parts Co	Bank of America		18.044	Graphic Packaging Holding Co	Merrill Lynch	25.999
		Merrill Lynch	31.125			Citibank	(5.233)
(33.394)	Genuine Parts Co	Credit Suisse	(16.318)	14.682	Graphic Packaging Holding Co	JP Morgan	13.801
(19.112)	Genuine Parts Co	Deutsche Bank	19.112	14.961	Graphic Packaging Holding Co	Deutsche Bank	10.323
(47.895)	GEO Group Inc/The (Reit)	Credit Suisse	(34.963)	(8.264)	Great Plains Energy Inc	Bank of America	
(49.443)	GEO Group Inc/The (Reit)	Citibank	(48.949)	(13.929)	Great Plains Energy Inc	Merrill Lynch	(12.479)
(35.161)	GEO Group Inc/The (Reit)	Bank of America		(6.349)	Great Plains Energy Inc	Citibank	(25.351)
		Merrill Lynch	(65.399)	6.390	Green Dot Corp 'A'	Credit Suisse	(11.492)
(25.656)	GEO Group Inc/The (Reit)	Deutsche Bank	(47.720)	42.014	Green Dot Corp 'A'	Citibank	76.886
(281)	GEO Group Inc/The (Reit)	JP Morgan	(205)	8.920	Green Dot Corp 'A'	Deutsche Bank	2.587
(23.855)	GGP Inc (Reit)	Bank of America		57.106	Groupon Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.147)			Merrill Lynch	(5.425)
(6.073)	GGP Inc (Reit)	Credit Suisse	(2.794)	138.258	Groupon Inc	Credit Suisse	(15.026)
(11.251)	GGP Inc (Reit)	Citibank	(1.463)	86.705	Groupon Inc	Citibank	13.439
(4.458)	GGP Inc (Reit)	Deutsche Bank	(401)	40.600	Groupon Inc	JP Morgan	(2.639)
(15.122)	GGP Inc (Reit)	JP Morgan	(6.956)	2.820	GrubHub Inc	Credit Suisse	12.468
77.793	Gilead Sciences Inc	Bank of America		3.339	GrubHub Inc	JP Morgan	18.453
		Merrill Lynch	46.189	3.643	GrubHub Inc	Bank of America	
32.783	Gilead Sciences Inc	Citibank	(328)			Merrill Lynch	26.302
20.806	Gilead Sciences Inc	JP Morgan	54.096	(31.000)	Guidewire Software Inc	Citibank	(58.280)
38.153	Gilead Sciences Inc	Credit Suisse	99.198	(33.253)	Guidewire Software Inc	JP Morgan	(144.651)
75.865	Gilead Sciences Inc	Deutsche Bank	62.968	(19.756)	Guidewire Software Inc	Bank of America	
2.268	Glacier Bancorp Inc	Citibank	(1.882)	(50.751)	Guidewire Software Inc	Merrill Lynch	(50.970)
1.852	Glacier Bancorp Inc	Deutsche Bank	500	(7.585)	Guidewire Software Inc	Credit Suisse	(177.689)
7.567	Glacier Bancorp Inc	Credit Suisse	7.945	(39.700)	Gulfport Energy Corp	Deutsche Bank	(19.569)
894	Glacier Bancorp Inc	JP Morgan	939	(148.884)	Gulfport Energy Corp	Citibank	(18.262)
(20.578)	Global Payments Inc	Bank of America		(77.640)	Gulfport Energy Corp	JP Morgan	(306.701)
		Merrill Lynch	61.436	43.395	H&R Block Inc	Credit Suisse	(159.938)
(25.753)	Global Payments Inc	Citibank	(6.181)	4.570	H&R Block Inc	Citibank	1.736
(22.620)	Global Payments Inc	Credit Suisse	25.747	32.810	H&R Block Inc	Deutsche Bank	640
(11.492)	Global Payments Inc	Deutsche Bank	26.891			Bank of America	
(9.628)	Global Payments Inc	JP Morgan	17.330	14.512	H&R Block Inc	Merrill Lynch	4.593
12.815	Globus Medical Inc 'A'	Citibank	42.802	15.833	H&R Block Inc	JP Morgan	1.741
(20.250)	GoDaddy Inc 'A'	Bank of America		3.704	Haemonetics Corp	Credit Suisse	1.900
		Merrill Lynch	(61.552)			Bank of America	
(26.256)	GoDaddy Inc 'A'	Credit Suisse	(83.015)	2.706	Haemonetics Corp	Merrill Lynch	13.853
(219)	Goldman Sachs Group Inc/The	JP Morgan	2.350	25.309	Haemonetics Corp	Credit Suisse	24.029
(3.252)	Goldman Sachs Group Inc/The	Citibank	38.146	2.765	Haemonetics Corp	Deutsche Bank	94.656
(6.320)	Goldman Sachs Group Inc/The	Deutsche Bank	96.633	5.653	Haemonetics Corp	Citibank	6.249
18.573	Goodyear Tire & Rubber Co/The	JP Morgan	(8.544)	(39.740)	Hain Celestial Group Inc/The	JP Morgan	50.199
7.661	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Bank of America		(75.770)	Hain Celestial Group Inc/The	Bank of America	
9.495	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Merrill Lynch	(9.959)	(17.387)	Hain Celestial Group Inc/The	Merrill Lynch	28.613
8.202	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Citibank	(11.964)	(30.926)	Hain Celestial Group Inc/The	Citibank	(3.789)
14.823	Graco Inc	Credit Suisse	(3.773)	(15.266)	Hain Celestial Group Inc/The	JP Morgan	25.211
		Bank of America		20.700	Halliburton Co	Credit Suisse	51.322
64.243	Graco Inc	Merrill Lynch	6.967			Deutsche Bank	10.992
11.207	Graco Inc	Citibank	(38.546)			Credit Suisse	(38.502)
17.389	Graco Inc	Deutsche Bank	449				
2.419	Graham Holdings Co 'B'	JP Morgan	16.346				
		Credit Suisse	(41.340)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
35.136	Halliburton Co	Bank of America		38.514	HD Supply Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(99.032)			Merrill Lynch	4.286
29.901	Halliburton Co	Deutsche Bank	(81.032)	62	Healthcare Realty		
9.054	Halliburton Co	JP Morgan	(16.840)		Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(16)
112.371	Halliburton Co	Citibank	(362.958)	9.931	Healthcare Realty		
1.063	Hancock Holding Co	Bank of America			Trust Inc (Reit)	Citibank	7.448
		Merrill Lynch	(797)	4.160	Healthcare Realty		
897	Hancock Holding Co	JP Morgan	247		Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	(1.082)
1.764	Hancock Holding Co	Credit Suisse	485	8.225	Healthcare Realty		
(18.534)	Hanesbrands Inc	Citibank	(3.892)		Trust Inc (Reit)	Deutsche Bank	5.922
(7.395)	Hanesbrands Inc	Credit Suisse	(12.498)	1.938	Healthcare Realty	Bank of America	
(2.761)	Hanesbrands Inc	Bank of America			Trust Inc (Reit)	Merrill Lynch	1.395
		Merrill Lynch	(3.230)	(48.533)	Healthcare Services	Bank of America	
(43.346)	Hanesbrands Inc	Deutsche Bank	(50.715)		Group Inc	Merrill Lynch	29.605
(16.535)	Hanesbrands Inc	JP Morgan	(27.944)	(43.138)	Healthcare Services		
8.773	Hanover Insurance				Group Inc	Citibank	6.039
	Group Inc/The	Credit Suisse	30.713	(673)	Healthcare Services		
12.490	Hanover Insurance				Group Inc	JP Morgan	996
	Group Inc/The	Citibank	22.232	(83.011)	Healthcare Services		
5.065	Hanover Insurance				Group Inc	Credit Suisse	96.739
	Group Inc/The	JP Morgan	22.843	(2.593)	Healthcare Services		
1.828	Hanover Insurance				Group Inc	Deutsche Bank	1.582
	Group Inc/The	Deutsche Bank	4.808	(7.962)	Healthcare Trust of		
8.518	Hanover Insurance	Bank of America			America Inc 'A' (Reit)	Citibank	(7.564)
	Group Inc/The	Merrill Lynch	22.402	(36.417)	Healthcare Trust of	Bank of America	
(4.368)	Harley-Davidson Inc	Bank of America			America Inc 'A' (Reit)	Merrill Lynch	(15.891)
		Merrill Lynch	(917)	(31.047)	Healthcare Trust of		
(28.454)	Harley-Davidson Inc	Citibank	36.706		America Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	(8.072)
(8.917)	Harley-Davidson Inc	Credit Suisse	(10.062)	(28.596)	Healthcare Trust of		
(54.513)	Harley-Davidson Inc	Deutsche Bank	(11.448)		America Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	8.293
(6.077)	Harris Corp	Deutsche Bank	21.209	(21.612)	Healthcare Trust of		
(3.085)	Harris Corp	Citibank	(2.036)		America Inc 'A' (Reit)	JP Morgan	6.267
(1.643)	Harris Corp	Bank of America		(6.037)	HealthEquity Inc	JP Morgan	(43.285)
		Merrill Lynch	5.734	(23.088)	HealthEquity Inc	Bank of America	
(9.382)	Harris Corp	JP Morgan	23.924			Merrill Lynch	(134.141)
16.017	Hartford Financial Services	Bank of America		(41.996)	HealthEquity Inc	Citibank	(93.651)
	Group Inc/The	Merrill Lynch	(1.602)	11.634	Heartland Express Inc	Credit Suisse	15.706
6.029	Hartford Financial Services			10.020	Heartland Express Inc	Bank of America	
	Group Inc/The	Citibank	(6.752)			Merrill Lynch	10.421
5.565	Hartford Financial Services			4.742	Heartland Express Inc	Deutsche Bank	4.932
	Group Inc/The	Deutsche Bank	(557)	24.887	Heartland Express Inc	JP Morgan	33.597
23.097	Hartford Financial Services			11.183	Heartland Express Inc	Citibank	2.908
	Group Inc/The	JP Morgan	1.617	(7.413)	HEICO Corp	Credit Suisse	(14.678)
6.863	Hasbro Inc	Bank of America		(3.441)	HEICO Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.235)			Merrill Lynch	(9.119)
2.871	Hasbro Inc	JP Morgan	(890)	(8.955)	HEICO Corp	Citibank	(24.179)
201	Hasbro Inc	Credit Suisse	(62)	(4.933)	HEICO Corp 'A'	Bank of America	
1.848	Hasbro Inc	Deutsche Bank	(333)			Merrill Lynch	(3.453)
5.962	Hawaiian Holdings Inc	Credit Suisse	5.068	(2.291)	HEICO Corp 'A'	JP Morgan	(3.437)
14.759	Hawaiian Holdings Inc	Bank of America		(345)	HEICO Corp 'A'	Credit Suisse	(518)
		Merrill Lynch	4.428	(1.427)	HEICO Corp 'A'	Citibank	(3.425)
5.595	Hawaiian Holdings Inc	Citibank	(8.672)	(2.847)	HEICO Corp 'A'	Deutsche Bank	(1.993)
13.757	Hawaiian Holdings Inc	JP Morgan	11.693	19.949	Helen of Troy Ltd	Bank of America	
539	Hawaiian Holdings Inc	Deutsche Bank	162			Merrill Lynch	17.650
(12.944)	HB Fuller Co	Deutsche Bank	(6.468)	4.677	Helen of Troy Ltd	Credit Suisse	2.572
(10.387)	HB Fuller Co	Bank of America		13.125	Helen of Troy Ltd	JP Morgan	8.723
		Merrill Lynch	(8.829)	3.689	Helen of Troy Ltd	Citibank	3.320
(11.248)	HB Fuller Co	Citibank	1.687	375	Helen of Troy Ltd	Deutsche Bank	450
12.953	HCA Healthcare Inc	Bank of America		(4.700)	Helmerich & Payne Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	43.652			Merrill Lynch	20.692
77.731	HCA Healthcare Inc	Citibank	79.286	(7.531)	Helmerich & Payne Inc	Citibank	29.898
18.843	HCA Healthcare Inc	JP Morgan	132.466	(3.690)	Henry Schein Inc	Bank of America	
626	HCA Healthcare Inc	Deutsche Bank	2.110			Merrill Lynch	5.572
11.083	HCA Healthcare Inc	Credit Suisse	77.913	(3.385)	Henry Schein Inc	Citibank	1.219
(62.476)	HCP Inc (Reit)	Citibank	(45.607)	(4.739)	Henry Schein Inc	Deutsche Bank	7.156
(35.355)	HCP Inc (Reit)	JP Morgan	(17.934)	60.279	Herman Miller Inc	Bank of America	
(63.806)	HCP Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	64.447
		Merrill Lynch	(29.351)	17.854	Herman Miller Inc	JP Morgan	22.318
(11.053)	HCP Inc (Reit)	Credit Suisse	(3.426)	12.162	Herman Miller Inc	Citibank	8.513
(21.535)	HCP Inc (Reit)	Deutsche Bank	(9.906)	29.648	Herman Miller Inc	Credit Suisse	37.060
10.343	HD Supply Holdings Inc	Credit Suisse	11.998	64.226	Herman Miller Inc	Deutsche Bank	73.860

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
26.126	Hershey Co/The	Bank of America		(45.721)	Home BancShares Inc/AR	Bank of America	
		Merrill Lynch	(54.228)			Merrill Lynch	18.817
8.235	Hershey Co/The	Credit Suisse	(7.089)	(23.195)	Home BancShares Inc/AR	Credit Suisse	11.079
21.647	Hershey Co/The	Deutsche Bank	(37.882)	(8.173)	Home BancShares Inc/AR	Deutsche Bank	3.024
3.169	Hershey Co/The	Citibank	(2.377)	(60.574)	Home BancShares Inc/AR	JP Morgan	29.681
8.793	Hershey Co/The	JP Morgan	(10.991)	10.101	Home Depot Inc/The	Bank of America	
(25.656)	Hess Corp	Credit Suisse	10.519			Merrill Lynch	(13.838)
(6.361)	Hess Corp	JP Morgan	2.608	5.916	Home Depot Inc/The	JP Morgan	9.288
48.298	Hewlett Packard	Bank of America		5.894	Home Depot Inc/The	Credit Suisse	9.254
	Enterprise Co	Merrill Lynch	(91.283)	2.372	Home Depot Inc/The	Deutsche Bank	(2.299)
233.275	Hewlett Packard			(10.484)	Honeywell International Inc	JP Morgan	(41.681)
	Enterprise Co	Citibank	(443.223)	(3.130)	Honeywell International Inc	Citibank	4.257
145.092	Hewlett Packard			(55.920)	Hope Bancorp Inc	Bank of America	
	Enterprise Co	JP Morgan	(290.826)			Merrill Lynch	(7.829)
36.045	Hewlett Packard			(27.416)	Hope Bancorp Inc	Citibank	7.676
	Enterprise Co	Credit Suisse	(67.765)	(68.070)	Hope Bancorp Inc	Credit Suisse	273
64.098	Hewlett Packard			(34.674)	Hope Bancorp Inc	Deutsche Bank	(4.854)
	Enterprise Co	Deutsche Bank	(121.145)	(78.387)	Hope Bancorp Inc	JP Morgan	(9.049)
(13.000)	Hexcel Corp	JP Morgan	(22.892)	(58.316)	Horizon Pharma Plc	Citibank	(76.394)
(18.129)	Hexcel Corp	Bank of America		(16.684)	Horizon Pharma Plc	JP Morgan	(29.698)
		Merrill Lynch	(29.369)	(38.070)	Horizon Pharma Plc	Deutsche Bank	(58.247)
(15.141)	Hexcel Corp	Citibank	(1.363)	45.489	Hormel Foods Corp	JP Morgan	39.666
(4.252)	Hexcel Corp	Deutsche Bank	(6.888)	28.394	Hormel Foods Corp	Credit Suisse	13.737
(14.299)	Hexcel Corp	Credit Suisse	(42.897)	50.003	Hormel Foods Corp	Deutsche Bank	42.688
7.331	Highwoods			42.825	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America	
	Properties Inc (Reit)	JP Morgan	8.577			Merrill Lynch	59.527
21.222	Highwoods	Bank of America		32.489	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)		
	Properties Inc (Reit)	Merrill Lynch	54.753			Citibank	16.569
14.380	Highwoods			22.062	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)		
	Properties Inc (Reit)	Citibank	21.426			Credit Suisse	21.150
5.588	Highwoods			18.099	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)		
	Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	6.538			Deutsche Bank	25.158
44.728	Highwoods			45.317	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)		
	Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	115.398			JP Morgan	69.713
3.884	Hill-Rom Holdings Inc	Credit Suisse	23.731	(2.341)	Howard Hughes Corp/The	Deutsche Bank	7.749
13.357	Hill-Rom Holdings Inc	Bank of America		(1.451)	Howard Hughes Corp/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	67.186			Merrill Lynch	3.983
2.867	Hill-Rom Holdings Inc	Citibank	8.286	100.744	HP Inc	Credit Suisse	8.642
1.643	Hill-Rom Holdings Inc	JP Morgan	10.039	75.479	HP Inc	Bank of America	
6.981	Hill-Rom Holdings Inc	Deutsche Bank	35.114			Merrill Lynch	16.983
4.864	Hillenbrand Inc	JP Morgan	4.864	22.628	HP Inc	Citibank	4.412
22.479	Hillenbrand Inc	Bank of America		188.986	HP Inc	JP Morgan	57.641
		Merrill Lynch	10.116	48.228	HP Inc	Deutsche Bank	10.851
46.162	Hillenbrand Inc	Citibank	(50.778)	(14.697)	HRG Group Inc	Credit Suisse	(25.299)
40.711	Hillenbrand Inc	Deutsche Bank	(23.803)	(16.698)	HRG Group Inc	Citibank	(7.180)
(22.348)	Hilltop Holdings Inc	Bank of America		2.227	Hubbell Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(22.705)			Merrill Lynch	8.708
(46.056)	Hilltop Holdings Inc	Credit Suisse	(37.551)	4.597	Hubbell Inc	JP Morgan	14.258
(15.050)	Hilltop Holdings Inc	Deutsche Bank	(16.856)	5.077	Hubbell Inc	Credit Suisse	26.654
(19.161)	Hilltop Holdings Inc	JP Morgan	(19.736)	2.272	Hubbell Inc	Citibank	(3.453)
(28.095)	Hilltop Holdings Inc	Citibank	(6.181)	2.426	Hubbell Inc	Deutsche Bank	(3.882)
(34.658)	Hilton Grand Vacations Inc	Bank of America		(5.059)	HubSpot Inc	Credit Suisse	(50.166)
		Merrill Lynch	(44.362)	(57.695)	Hudson Pacific Properties Inc (Reit)	Bank of America	
(17.613)	Hilton Grand Vacations Inc	JP Morgan	(7.045)			Merrill Lynch	(87.119)
(39.526)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Deutsche Bank	63.713	(25.411)	Hudson Pacific Properties Inc (Reit)		
(6.911)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Credit Suisse	7.118			JP Morgan	(20.583)
(3.114)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Bank of America		(22.406)	Hudson Pacific Properties Inc (Reit)		
		Merrill Lynch	5.045			Credit Suisse	(18.149)
(9.629)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Citibank	13.095	(26.684)	Hudson Pacific Properties Inc (Reit)		
(12.249)	Hilton Worldwide Holdings Inc	JP Morgan	12.616			Deutsche Bank	(40.293)
23.671	HollyFrontier Corp	Bank of America		1.961	Humana Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	252.333			Merrill Lynch	8.295
36.708	HollyFrontier Corp	Citibank	243.007	1.517	Humana Inc	Credit Suisse	24.014
14.844	HollyFrontier Corp	JP Morgan	184.956	5.597	Humana Inc	Deutsche Bank	19.792
14.617	HollyFrontier Corp	Deutsche Bank	155.817	11.385	Humana Inc	JP Morgan	128.009
(60.538)	Hologic Inc	Bank of America		12.743	Humana Inc	Citibank	28.672
		Merrill Lynch	(67.803)	(30.091)	Huntington Bancshares Inc/OH	Bank of America	
(49.652)	Hologic Inc	Credit Suisse	(81.778)			Merrill Lynch	11.435
(24.735)	Hologic Inc	Citibank	(2.721)	(29.081)	Huntington Bancshares Inc/OH		
						Credit Suisse	2.617

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(64.639)	Huntington Bancshares Inc/OH	Citibank	38.137	6.506	Ingersoll-Rand Plc	JP Morgan	(1.328)
(72.022)	Huntington Bancshares Inc/OH	Deutsche Bank	27.368	8.211	Ingersoll-Rand Plc	Deutsche Bank	(3.367)
(13.664)	Huntington Bancshares Inc/OH	JP Morgan	1.230	(1.459)	Ingevity Corp	Bank of America	
410	Huntington Ingalls Industries Inc	Bank of America	1.931	(218)	Ingevity Corp	Merrill Lynch	2.524
6.212	Huntington Ingalls Industries Inc	Merrill Lynch	14.225	(9.461)	Ingevity Corp	Citibank	545
1.574	Huntington Ingalls Industries Inc	Citibank	1.920	(4.349)	Ingevity Corp	JP Morgan	19.584
6.412	Huntington Ingalls Industries Inc	JP Morgan	11.773	9.497	Ingevity Corp	Credit Suisse	9.002
6.932	Huntington Ingalls Industries Inc	Credit Suisse	29.042		Ingredion Inc	Bank of America	
40.056	Huntsman Corp	Deutsche Bank	7.611		Ingredion Inc	Merrill Lynch	10.734
22.914	Huntsman Corp	Bank of America	10.770	14.426	Ingredion Inc	JP Morgan	18.268
108.509	Huntsman Corp	Merrill Lynch	144.262	8.628	Ingredion Inc	Citibank	12.511
66.073	Huntsman Corp	Citibank	189.630	2.228	Ingredion Inc	Credit Suisse	5.280
54.820	Huntsman Corp	JP Morgan	10.416	8.439	Ingredion Inc	Deutsche Bank	10.042
7.223	IAC/InterActiveCorp	Deutsche Bank	123.152	(6.431)	Insulet Corp	Bank of America	
521	IAC/InterActiveCorp	Deutsche Bank	5.325		Insulet Corp	Merrill Lynch	(50.548)
(1.980)	Iberiabank Corp	Citibank	1.485	(14.988)	Insulet Corp	JP Morgan	(148.187)
(23.601)	Iberiabank Corp	Bank of America	(47.202)	(13.356)	Insulet Corp	Credit Suisse	(147.050)
(718)	Iberiabank Corp	Merrill Lynch	(2.549)	(8.480)	Insulet Corp	Citibank	(57.579)
(1.378)	Iberiabank Corp	Credit Suisse	(4.892)	(6.994)	Insulet Corp	Deutsche Bank	(54.973)
(15.192)	Iberiabank Corp	JP Morgan	(30.384)	(31.356)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Bank of America	
4.382	ICU Medical Inc	Bank of America	100.750	(11.420)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Merrill Lynch	(44.259)
10.183	IDACORP Inc	Bank of America	32.076		Integra LifeSciences Holdings Corp	Citibank	(13.247)
6.788	IDACORP Inc	Merrill Lynch	21.586	(102)	Integra LifeSciences Holdings Corp	JP Morgan	13
13.193	IDACORP Inc	Citibank	17.811	(54.983)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Credit Suisse	(10.945)
21.421	IDACORP Inc	JP Morgan	68.126	(2.242)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Deutsche Bank	(3.296)
10.948	IDACORP Inc	Deutsche Bank	14.780	(12.474)	Integrated Device Technology Inc	JP Morgan	(52.141)
9.102	IDEX Corp	Bank of America	20.662	(8.095)	Integrated Device Technology Inc	Bank of America	
14.288	IDEX Corp	Merrill Lynch	(13.431)	(6.118)	Integrated Device Technology Inc	Merrill Lynch	(22.180)
391	IDEX Corp	Citibank	1.181	(4.477)	Integrated Device Technology Inc	Credit Suisse	(25.573)
6.265	IDEX Corp	JP Morgan	14.222		Integrated Device Technology Inc	Citibank	(6.268)
2.666	IDEX Corp	Deutsche Bank	(3.435)	(18.617)	Integrated Device Technology Inc	Deutsche Bank	(51.011)
4.277	IDEXX Laboratories Inc	Credit Suisse	46.021	31.078	Intel Corp	Bank of America	50.864
5.060	IDEXX Laboratories Inc	Citibank	29.297	8.827	Intel Corp	Merrill Lynch	17.654
12.502	IDEXX Laboratories Inc	JP Morgan	22.879	10.043	Interactive Brokers Group Inc 'A'	JP Morgan	
2.990	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America	17.312	6.217	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Credit Suisse	(36.657)
2.198	IDEXX Laboratories Inc	Merrill Lynch	21.153	22.923	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Citibank	(28.412)
(61.637)	ILG Inc	Credit Suisse	(49.310)	6.479	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Bank of America	
(46.163)	ILG Inc	Deutsche Bank	(20.312)	(6.956)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Merrill Lynch	(101.216)
(82.296)	ILG Inc	Citibank	(40.325)		Intercept Pharmaceuticals Inc	Deutsche Bank	(30.548)
(17.241)	ILG Inc	JP Morgan	(13.793)	(23.420)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Bank of America	435
(50.451)	ILG Inc	Deutsche Bank	(22.957)	(7.191)	Intercept Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	1.171
11.887	Illinois Tool Works Inc	JP Morgan	(19.851)	(33.376)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	8.260
1.708	Illinois Tool Works Inc	Citibank	1.879	(16.896)	Intercontinental Exchange Inc	Deutsche Bank	37.715
9.887	Illinois Tool Works Inc	Bank of America	(3.658)		Intercontinental Exchange Inc	Bank of America	
7.179	Illinois Tool Works Inc	Merrill Lynch	7.897	(24.659)	Intercontinental Exchange Inc	Merrill Lynch	6.083
15.719	Illinois Tool Works Inc	Credit Suisse	(8.281)	(13.057)	Intercontinental Exchange Inc	Citibank	5.178
(8.313)	Illumina Inc	Deutsche Bank	(13.467)	(32.715)	Intercontinental Exchange Inc	JP Morgan	(3.298)
(2.976)	Illumina Inc	Citibank	(27.793)	(15.629)	Intercontinental Exchange Inc	Credit Suisse	1.097
(31.280)	Incyte Corp	JP Morgan	(109.542)	(5.949)	InterDigital Inc/PA	Deutsche Bank	5.626
(54.175)	Incyte Corp	Credit Suisse	(69.344)	(5.382)	InterDigital Inc/PA	Credit Suisse	(9.015)
2.070	Ingersoll-Rand Plc	Bank of America	807	(1.401)	International Bancshares Corp	Citibank	(8.880)
5.099	Ingersoll-Rand Plc	Merrill Lynch	(2.091)	(5.638)	International Bancshares Corp	JP Morgan	(3.327)
13.702	Ingersoll-Rand Plc	Citibank	(33.159)	(4.629)	International Bancshares Corp	Citibank	987
				(4.787)	International Bancshares Corp	Credit Suisse	(10.994)
				(4.018)	International Bancshares Corp	Deutsche Bank	(6.702)
				2.943	International Business Machines Corp	Bank of America	(5.625)
						Merrill Lynch	
						Deutsche Bank	(6.771)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
4.904	International Business Machines Corp	Bank of America		(61.342)	Iron Mountain Inc (Reit)	Deutsche Bank	(38.032)
4.625	International Business Machines Corp	Merrill Lynch	(7.601)	(9.313)	Itron Inc	Bank of America	
(7.491)	International Flavors & Fragrances Inc	JP Morgan	(11.321)	(6.769)	Itron Inc	Merrill Lynch	28.405
(9.435)	International Flavors & Fragrances Inc	JP Morgan	18.869	(16.395)	Itron Inc	Citibank	5.754
(4.139)	International Flavors & Fragrances Inc	Citibank	8.963	(5.768)	ITT Inc	Credit Suisse	83.913
(1.071)	International Flavors & Fragrances Inc	Deutsche Bank	(290)	45.327	ITT Inc	JP Morgan	53.642
(41.602)	International Paper Co	Credit Suisse	2.645	68.594	ITT Inc	Credit Suisse	(14.696)
63.760	Interpublic Group of Cos Inc/The	JP Morgan	(57.849)	26.820	ITT Inc	Citibank	(139.246)
56.859	Interpublic Group of Cos Inc/The	Credit Suisse	(68.705)	11.327	ITT Inc	JP Morgan	(27.383)
59.409	Interpublic Group of Cos Inc/The	Citibank	(72.211)	(4.396)	ITT Inc	Deutsche Bank	(8.155)
(66.109)	InterXion Holding NV	Deutsche Bank	(100.995)	(7.952)	j2 Global Inc	Deutsche Bank	(3.385)
(130.272)	InterXion Holding NV	Credit Suisse	(25.500)	(4.573)	j2 Global Inc	Citibank	(8.747)
(52.656)	InterXion Holding NV	Citibank	(161.537)	(5.441)	j2 Global Inc	Bank of America	(3.521)
(120.848)	InterXion Holding NV	Deutsche Bank	45.284	(3.359)	j2 Global Inc	Merrill Lynch	
7.471	Intuit Inc	JP Morgan	(54.840)	31.384	Jabil Inc	Credit Suisse	189
7.143	Intuit Inc	Bank of America		61.928	Jabil Inc	JP Morgan	(1.815)
17.490	Intuit Inc	Merrill Lynch	86.962	71.058	Jabil Inc	Citibank	15.692
5.565	Intuit Inc	Citibank	79.073		Jack Henry & Associates Inc	JP Morgan	74.304
1.588	Intuitive Surgical Inc	JP Morgan	199.747	3.611	Jack Henry & Associates Inc	Bank of America	65.434
52.589	Invesco Ltd	Deutsche Bank	65.890	15.474	Jack Henry & Associates Inc	Credit Suisse	7.980
5.770	Invesco Ltd	Citibank	13.069		Jack Henry & Associates Inc	Bank of America	
10.457	Invesco Ltd	Merrill Lynch	(56.270)	1.178	Jack Henry & Associates Inc	Merrill Lynch	44.565
20.952	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	JP Morgan	(4.616)	8.254	Jack Henry & Associates Inc	Deutsche Bank	3.393
56.670	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Deutsche Bank	(11.189)	1.649	Jack Henry & Associates Inc	Citibank	33.841
45.814	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Citibank	8.934	5.749	Jack in the Box Inc	JP Morgan	3.644
39.380	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Deutsche Bank	4.245	2.984	Jack in the Box Inc	Citibank	(2.989)
9.969	Investors Bancorp Inc	Bank of America		6.151	Jack in the Box Inc	Bank of America	
40.231	Investors Bancorp Inc	Merrill Lynch	(56.270)	(12.816)	Jacobs Engineering Group Inc	Merrill Lynch	(25.901)
47.155	Investors Bancorp Inc	JP Morgan	(4.616)	(6.725)	Jacobs Engineering Group Inc	Credit Suisse	(55.851)
11.933	Investors Bancorp Inc	Deutsche Bank	(7.073)	(16.949)	Jacobs Engineering Group Inc	JP Morgan	(32.937)
5.852	Investors Bancorp Inc	Bank of America		(19.878)	Jacobs Engineering Group Inc	Deutsche Bank	(5.771)
(153.161)	Invitation Homes Inc (Reit)	Merrill Lynch	(1.790)	(91.205)	Jagged Peak Energy Inc	Bank of America	
(16.892)	Invitation Homes Inc (Reit)	Citibank	(33.695)	(56.582)	Jagged Peak Energy Inc	Merrill Lynch	(33.559)
(36.127)	Invitation Homes Inc (Reit)	JP Morgan	(1.463)	(72.301)	Jagged Peak Energy Inc	Credit Suisse	(29.605)
(18.211)	Invitation Homes Inc (Reit)	Deutsche Bank	6.010	(184.357)	Jagged Peak Energy Inc	Bank of America	
(12.327)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Citibank	8.934	(24.671)	Janus Henderson Group Plc	Merrill Lynch	100.206
(2.818)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	10.436	(19.813)	Janus Henderson Group Plc	Citibank	104.111
(4.275)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Citibank	(2.492)	(4.397)	Janus Henderson Group Plc	JP Morgan	133.034
(1.942)	IPG Photonics Corp	JP Morgan	(14.081)	1.741	Jazz Pharmaceuticals Plc	Deutsche Bank	200.949
(7.451)	IPG Photonics Corp	Citibank	(7.073)		Jazz Pharmaceuticals Plc	Citibank	32.566
(1.796)	IPG Photonics Corp	Deutsche Bank	(7.073)	1.223	Jazz Pharmaceuticals Plc	Credit Suisse	7.133
(20.585)	IQVIA Holdings Inc	Bank of America		4.912	Jazz Pharmaceuticals Plc	Deutsche Bank	9.893
(14.728)	IQVIA Holdings Inc	Merrill Lynch	(1.790)	2.976	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America	
(6.632)	IQVIA Holdings Inc	Citibank	(33.695)	(4.706)	JB Hunt Transport Services Inc	Merrill Lynch	12.301
(2.305)	IQVIA Holdings Inc	JP Morgan	(1.463)	(2.447)	JB Hunt Transport Services Inc	JP Morgan	25.365
(5.731)	IQVIA Holdings Inc	Deutsche Bank	6.010	(10.008)	JB Hunt Transport Services Inc	Citibank	5.944
(6.712)	iRobot Corp	Citibank	8.934	(5.199)	JB Hunt Transport Services Inc	Deutsche Bank	16.189
(30.289)	iRobot Corp	Credit Suisse	10.436	(4.963)	JB Hunt Transport Services Inc	Bank of America	
(20.008)	Iron Mountain Inc (Reit)	JP Morgan	(24.645)	(4.963)	JB Hunt Transport Services Inc	Merrill Lynch	(28.001)
(18.341)	Iron Mountain Inc (Reit)	Citibank	(2.525)	20.696	JBG SMITH Properties (Reit)	Citibank	(11.134)
(19.165)	Iron Mountain Inc (Reit)	Deutsche Bank	(7.073)	18.647	JBG SMITH Properties (Reit)	Credit Suisse	(103.983)
		Bank of America		13.734	JBG SMITH Properties (Reit)	JP Morgan	(54.018)
		Merrill Lynch	31.812		Jefferies Financial Group	Deutsche Bank	(29.530)
		Citibank	17.840	(71.017)	Jefferies Financial Group	Credit Suisse	18.833
		Deutsche Bank	4.979	(19.713)	Jefferies Financial Group	Citibank	19.020
		JP Morgan	(9.685)	(12.400)	JELD-WEN Holding Inc	Bank of America	31.176
		Credit Suisse	(17.854)	(1.670)	JELD-WEN Holding Inc	Merrill Lynch	112.620
		Deutsche Bank	(103.947)	(1.547)	JELD-WEN Holding Inc	Citibank	28.387
		Citibank	(17.007)	(6.149)	JELD-WEN Holding Inc	JP Morgan	29.388
		Bank of America		(50.787)	JELD-WEN Holding Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(11.371)		JELD-WEN Holding Inc	Merrill Lynch	(217)
		Credit Suisse	2.300		JELD-WEN Holding Inc	Credit Suisse	2.893
					JELD-WEN Holding Inc	Citibank	2.521
					JELD-WEN Holding Inc	Deutsche Bank	(6.602)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(2.914)	JELD-WEN Holding Inc	JP Morgan	5.449	(35.919)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	JP Morgan	(25.143)
2.130	JM Smucker Co/The	Bank of America		(123.097)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Credit Suisse	(86.168)
		Merrill Lynch	(4.305)	(75.731)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Deutsche Bank	(26.506)
14.387	JM Smucker Co/The	Deutsche Bank	(52.225)	(7.337)	KeyCorp	JP Morgan	2.421
(7.263)	John Bean Technologies Corp	Credit Suisse	(2.179)	(90.391)	KeyCorp	Bank of America	
(9.459)	John Bean Technologies Corp	Deutsche Bank	(28.877)			Merrill Lynch	89.990
(22.678)	John Bean Technologies Corp	Citibank	(35.151)	(9.131)	KeyCorp	Citibank	10.501
(9.656)	John Bean Technologies Corp	Bank of America		(627)	KeyCorp	Deutsche Bank	633
		Merrill Lynch	(31.132)	(2.281)	KeyCorp	Credit Suisse	753
18.820	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America		(19.000)	Keysight Technologies Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	36.699			Merrill Lynch	(121.838)
17.466	John Wiley & Sons Inc 'A'	Citibank	9.606	(14.661)	Keysight Technologies Inc	Citibank	(89.579)
28.233	John Wiley & Sons Inc 'A'	JP Morgan	33.329	(27.741)	Keysight Technologies Inc	JP Morgan	(200.013)
7.441	John Wiley & Sons Inc 'A'	Deutsche Bank	14.510	(22.245)	Keysight Technologies Inc	Credit Suisse	(153.691)
8.864	John Wiley & Sons Inc 'A'	Credit Suisse	10.637	(30.272)	Keysight Technologies Inc	Deutsche Bank	(196.465)
44.987	Johnson & Johnson	Bank of America		(8.450)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Citibank	(21.125)
		Merrill Lynch	(192.371)	(5.960)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Credit Suisse	(15.913)
6.242	Johnson & Johnson	JP Morgan	(10.050)	(5.895)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Deutsche Bank	(20.750)
14.637	Johnson & Johnson	Citibank	(27.957)	(19.283)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Bank of America	
41.591	Johnson & Johnson	Credit Suisse	(70.860)			Merrill Lynch	(67.876)
8.069	Johnson & Johnson	Deutsche Bank	(33.325)	1.212	Kimberly-Clark Corp	Credit Suisse	945
2.377	Jones Lang LaSalle Inc	Bank of America		9.477	Kimberly-Clark Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.275)			Merrill Lynch	(15.141)
13.800	Jones Lang LaSalle Inc	Citibank	(68.586)	1.979	Kimberly-Clark Corp	Citibank	(4.255)
1.544	Jones Lang LaSalle Inc	JP Morgan	(17.355)	1.548	Kimberly-Clark Corp	Deutsche Bank	(2.121)
8.995	Jones Lang LaSalle Inc	Deutsche Bank	(29.336)	2.860	Kimberly-Clark Corp	JP Morgan	2.231
24.962	JPMorgan Chase & Co	Bank of America		(21.487)	Kimco Realty Corp (Reit)	Credit Suisse	(18.479)
		Merrill Lynch	(154.636)	(19.375)	Kimco Realty Corp (Reit)	Citibank	(4.069)
9.161	JPMorgan Chase & Co	Credit Suisse	(36.461)	(18.590)	Kimco Realty Corp (Reit)	JP Morgan	(15.987)
9.974	JPMorgan Chase & Co	Citibank	(59.844)	(26.706)	Kimco Realty Corp (Reit)	Bank of America	
9.324	JPMorgan Chase & Co	Deutsche Bank	(56.130)			Merrill Lynch	(35.519)
154.075	Juniper Networks Inc	Bank of America		(90.803)	Kinder Morgan Inc/DE	Bank of America	
		Merrill Lynch	18.735			Merrill Lynch	(8.172)
61.530	Juniper Networks Inc	Citibank	(12.306)	(41.711)	Kinder Morgan Inc/DE	Citibank	(24.609)
5.334	Juniper Networks Inc	JP Morgan	5.707	(79.992)	Kinder Morgan Inc/DE	Deutsche Bank	(7.199)
36.781	Juniper Networks Inc	Deutsche Bank	6.253	(40.384)	Kinder Morgan Inc/DE	JP Morgan	(20.618)
43.455	Juniper Networks Inc	Credit Suisse	46.497	(96.510)	Kinder Morgan Inc/DE	Credit Suisse	(44.395)
(11.361)	Kansas City Southern	Bank of America		(35.409)	Kirby Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.544)			Merrill Lynch	(129.243)
(10.719)	Kansas City Southern	Citibank	(9.861)	(23.819)	Kirby Corp	Citibank	(42.874)
(2.641)	Kansas City Southern	Deutsche Bank	(1.536)	(3.236)	Kirby Corp	JP Morgan	(18.122)
14.916	KAR Auction Services Inc	Bank of America		(4.623)	Kirby Corp	Credit Suisse	(25.889)
		Merrill Lynch	7.011	(10.935)	Kirby Corp	Deutsche Bank	(39.913)
952	KAR Auction Services Inc	Citibank	19	(11.647)	KLX Inc	Credit Suisse	(26.788)
12.068	KAR Auction Services Inc	JP Morgan	(4.586)	(4.112)	KLX Inc	Citibank	370
11.390	KAR Auction Services Inc	Credit Suisse	(4.328)	(4.681)	KLX Inc	Deutsche Bank	(6.600)
12.274	KAR Auction Services Inc	Deutsche Bank	5.769	(6.123)	KLX Inc	JP Morgan	(14.083)
44.360	KBR Inc	Credit Suisse	70.532	(223.088)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America	
17.854	KBR Inc	Bank of America		(50.611)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Merrill Lynch	(263.893)
		Merrill Lynch	27.495			Credit Suisse	(43.868)
21.192	KBR Inc	Citibank	11.656	(48.483)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Deutsche Bank	(60.604)
9.513	Kellogg Co	Credit Suisse	39.669	(9.254)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc		
1.705	Kellogg Co	JP Morgan	7.110			Citibank	(3.424)
10.909	Kellogg Co	Bank of America		(61.528)	Kosmos Energy Ltd	Credit Suisse	(43.070)
		Merrill Lynch	33.785	(90.034)	Kosmos Energy Ltd	Deutsche Bank	(45.917)
9.801	Kellogg Co	Deutsche Bank	31.559	(97.497)	Kosmos Energy Ltd	Citibank	(27.299)
17.597	Kellogg Co	Citibank	51.911	(55.240)	Kosmos Energy Ltd	JP Morgan	(38.668)
(8.981)	Kemper Corp	Bank of America		(65.426)	Kraft Heinz Co/The	Citibank	(90.942)
		Merrill Lynch	(45.354)	(54.797)	Kraft Heinz Co/The	JP Morgan	(32.505)
(8.188)	Kemper Corp	Citibank	(4.913)	(76.823)	Kraft Heinz Co/The	Bank of America	
(815)	Kemper Corp	Credit Suisse	(3.953)			Merrill Lynch	82.201
(4.679)	Kemper Corp	Deutsche Bank	(23.629)			Credit Suisse	86.575
(7.327)	Kemper Corp	JP Morgan	(35.536)	(102.506)	Kraft Heinz Co/The	Deutsche Bank	71.656
6.431	Kennametal Inc	Bank of America		(66.968)	Kroger Co/The	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.431)	28.798		Merrill Lynch	6.048
9.598	Kennametal Inc	Citibank	(16.701)			Citibank	5.979
4.887	Kennametal Inc	JP Morgan	(9.925)	22.997	Kroger Co/The	JP Morgan	6.085
468	Kennametal Inc	Deutsche Bank	(468)	6.994	Kroger Co/The	Deutsche Bank	4.637
(25.565)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Bank of America		22.080	Kroger Co/The	Credit Suisse	524
		Merrill Lynch	(49.852)	13.652	Kroger Co/The		
(24.059)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Citibank	(36.089)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
12.340	Kronos Worldwide Inc	Citibank	2.345	(1.961)	LCI Industries	Credit Suisse	1.373
39.212	Kronos Worldwide Inc	Deutsche Bank	39.996	(5.666)	LCI Industries	Citibank	18.415
69.193	Kronos Worldwide Inc	Bank of America		(5.407)	LCI Industries	Deutsche Bank	(14.329)
		Merrill Lynch	42.401	39.726	Lear Corp	Bank of America	
78.800	Kronos Worldwide Inc	Credit Suisse	50.460			Merrill Lynch	52.041
6.315	Kronos Worldwide Inc	JP Morgan	4.926	13.816	Lear Corp	JP Morgan	94.940
(7.400)	L Brands Inc	Credit Suisse	(4.884)	16.019	Lear Corp	Citibank	(66.639)
(10.479)	L Brands Inc	JP Morgan	(6.916)	17.135	Lear Corp	Credit Suisse	46.646
(16.024)	L Brands Inc	Bank of America		16.868	Lear Corp	Deutsche Bank	22.097
		Merrill Lynch	(11.622)	36.445	Legg Mason Inc	Bank of America	
2.623	L3 Technologies Inc	Citibank	12.485			Merrill Lynch	(58.129)
695	L3 Technologies Inc	JP Morgan	4.650	30.523	Legg Mason Inc	JP Morgan	(29.607)
(35.234)	La Quinta Holdings Inc	Citibank	(30.654)	4.744	Legg Mason Inc	Credit Suisse	(4.602)
(33.888)	La Quinta Holdings Inc	JP Morgan	(68.454)	(6.611)	Leggett & Platt Inc	Bank of America	
(26.484)	La Quinta Holdings Inc	Deutsche Bank	(30.721)			Merrill Lynch	(3.434)
(91.941)	La Quinta Holdings Inc	Bank of America		(11.978)	Leggett & Platt Inc	Citibank	(6.947)
		Merrill Lynch	(97.716)	(2.437)	Leidos Holdings Inc	Credit Suisse	2.266
356	Laboratory Corp of America Holdings	Bank of America		(17.373)	Leidos Holdings Inc	Citibank	(13.725)
		Merrill Lynch	2.289	(23.458)	Leidos Holdings Inc	Bank of America	
3.882	Laboratory Corp of America Holdings	Citibank	21.700			Merrill Lynch	22.510
5.732	Laboratory Corp of America Holdings	JP Morgan	57.922	(1.565)	Leidos Holdings Inc	JP Morgan	1.455
3.581	Laboratory Corp of America Holdings			(6.485)	Leidos Holdings Inc	Deutsche Bank	(3.696)
1.552	Laboratory Corp of America Holdings	Deutsche Bank	23.026	(512)	LendingTree Inc	Credit Suisse	8.499
				(5.040)	LendingTree Inc	Deutsche Bank	51.660
5.740	Lam Research Corp	Credit Suisse	11.470	(27.467)	Lennar Corp 'A'	Credit Suisse	5.161
		Bank of America		(105.080)	Lennar Corp 'A'	Bank of America	
15.082	Lam Research Corp	Merrill Lynch	(2.411)			Merrill Lynch	(102.978)
9.552	Lam Research Corp	Citibank	(18.249)	(27.987)	Lennar Corp 'A'	Citibank	(36.943)
15.297	Lam Research Corp	JP Morgan	(36.552)	4.284	Lennox International Inc	JP Morgan	10.067
8.530	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Deutsche Bank	(6.425)	10.107	Lennox International Inc	Credit Suisse	23.751
		Bank of America		8.602	Lennox International Inc	Bank of America	
3.569	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Merrill Lynch	15.610			Merrill Lynch	60.902
4.869	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Citibank	3.676	4.813	Lennox International Inc	Citibank	10.155
2.156	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	JP Morgan	18.307	5.181	Lennox International Inc	Deutsche Bank	24.844
5.342	Lamb Weston Holdings Inc	Credit Suisse	8.107	(32.535)	Lexington Realty Trust (Reit)	Citibank	(10.411)
		Bank of America		(146.094)	Lexington Realty Trust (Reit)	Bank of America	
5.229	Lamb Weston Holdings Inc	Merrill Lynch	(14.049)			Merrill Lynch	(75.085)
30.508	Lamb Weston Holdings Inc	Credit Suisse	(10.353)	(9.392)	Lexington Realty Trust (Reit)	Credit Suisse	(1.503)
13.765	Lamb Weston Holdings Inc	Deutsche Bank	(80.236)	(18.956)	Lexington Realty Trust (Reit)	Deutsche Bank	(11.184)
3.261	Lancaster Colony Corp	JP Morgan	(27.255)	(30.915)	Lexington Realty Trust (Reit)	JP Morgan	(4.946)
1.471	Lancaster Colony Corp	JP Morgan	4.207	(57.028)	Liberty Broadband Corp 'C'	Bank of America	
		Bank of America				Merrill Lynch	142.808
1.606	Lancaster Colony Corp	Merrill Lynch	2.633	(40.578)	Liberty Broadband Corp 'C'	Citibank	53.157
1.386	Lancaster Colony Corp	Citibank	5.669	(4.936)	Liberty Broadband Corp 'C'	JP Morgan	14.068
2.548	Lancaster Colony Corp	Credit Suisse	1.788	(17.461)	Liberty Broadband Corp 'C'	Credit Suisse	49.764
29.773	Landstar System Inc	Deutsche Bank	4.561	(5.465)	Liberty Broadband Corp 'C'	Deutsche Bank	12.843
49.324	Landstar System Inc	JP Morgan	165.240	(9.882)	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'		
10.286	Landstar System Inc	Credit Suisse	231.724			Citibank	(15.218)
8.908	Landstar System Inc	Deutsche Bank	33.044	(7.731)	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Bank of America	
		Bank of America		(4.968)	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Merrill Lynch	(17.781)
11.256	Landstar System Inc	Merrill Lynch	47.212				
(15.333)	Laredo Petroleum Inc	Citibank	34.894	(11.149)	Liberty Global Plc 'A'	Credit Suisse	(18.282)
		Bank of America		(6.939)	Liberty Global Plc 'A'	Citibank	7.135
(47.628)	Laredo Petroleum Inc	Merrill Lynch	10.043	(8.481)	Liberty Global Plc 'A'	Deutsche Bank	4.542
(92.227)	Laredo Petroleum Inc	Citibank	25.005	(2.078)	Liberty Latin America 'C'	Credit Suisse	10.259
(19.785)	Laredo Petroleum Inc	JP Morgan	71.476	(50.104)	Liberty Latin America 'C'	Credit Suisse	(3.491)
(25.027)	Laredo Petroleum Inc	Deutsche Bank	12.959	(42.457)	Liberty Latin America 'C'	Citibank	(22.547)
(15.849)	Las Vegas Sands Corp	Credit Suisse	19.396	(3.405)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	JP Morgan	74.633
		Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(41.207)	(12.574)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Merrill Lynch	(4.154)
(12.511)	Las Vegas Sands Corp	Citibank	(18.516)				
(9.051)	LaSalle Hotel Properties (Reit)	Credit Suisse	(36.023)	(9.400)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Citibank	6.538
(46.262)	LaSalle Hotel Properties (Reit)	Bank of America				Credit Suisse	2.256
		Merrill Lynch	(151.277)	(6.431)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Deutsche Bank	(7.846)
(10.854)	LaSalle Hotel Properties (Reit)	Citibank	(8.900)	(33.388)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'		
(28.736)	LaSalle Hotel Properties (Reit)	Deutsche Bank	(93.967)			JP Morgan	(24.190)
(4.728)	LCI Industries	JP Morgan	(1.209)	(9.060)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Bank of America	
(1.486)	LCI Industries	Bank of America				Merrill Lynch	(6.175)
		Merrill Lynch	(3.938)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(9.038)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	JP Morgan	(34.616)	(34.056)	Loews Corp	JP Morgan	100.125
(3.678)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Citibank	(588)	(3.796)	Loews Corp	Credit Suisse	11.593
61.385	Liberty Property Trust (Reit)	Bank of America		(533)	LogMeln Inc	Citibank	959
		Merrill Lynch	88.832	(15.454)	LogMeln Inc	Bank of America	
25.003	Liberty Property Trust (Reit)	Citibank	44.505	(1.836)	LogMeln Inc	Merrill Lynch	25.025
10.842	Liberty Property Trust (Reit)	JP Morgan	10.950	(50)	LogMeln Inc	JP Morgan	13.954
14.636	Liberty Property Trust (Reit)	Credit Suisse	14.782	(6.919)	LogMeln Inc	Deutsche Bank	73
16.120	Liberty Property Trust (Reit)	Deutsche Bank	22.084	51.117	Louisiana-Pacific Corp	Credit Suisse	52.584
6.283	Life Storage Inc (Reit)	Deutsche Bank	14.262	140.765	Louisiana-Pacific Corp	Deutsche Bank	117.058
11.512	Life Storage Inc (Reit)	Credit Suisse	21.030			Bank of America	
5.653	Life Storage Inc (Reit)	JP Morgan	4.579	239.531	Louisiana-Pacific Corp	Merrill Lynch	250.436
7.347	Life Storage Inc (Reit)	Citibank	22.261	39.088	Louisiana-Pacific Corp	Citibank	239.531
7.109	LifePoint Health Inc	Credit Suisse	4.621	2.657	Lowe's Cos Inc	JP Morgan	80.912
8.662	LifePoint Health Inc	Bank of America		2.830	Lowe's Cos Inc	JP Morgan	34.966
		Merrill Lynch	(15.592)	(4.537)	Loxo Oncology Inc	Deutsche Bank	33.168
11.153	LifePoint Health Inc	JP Morgan	7.249	(2.332)	Loxo Oncology Inc	Deutsche Bank	(194.410)
4.507	LifePoint Health Inc	Citibank	(8.338)	(4.379)	Loxo Oncology Inc	Citibank	(39.061)
14.916	LifePoint Health Inc	Deutsche Bank	(26.849)	15.447	LPL Financial Holdings Inc	Credit Suisse	(247.086)
12.033	Ligand Pharmaceuticals Inc	Bank of America		3.946	LPL Financial Holdings Inc	Citibank	(62.406)
		Merrill Lynch	105.340	26.010	LPL Financial Holdings Inc	JP Morgan	(1.302)
9.323	Ligand Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	351.664			Bank of America	
2.894	Ligand Pharmaceuticals Inc	Citibank	22.892	4.494	LPL Financial Holdings Inc	Merrill Lynch	(40.836)
4.817	Ligand Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	181.697	2.819	Lululemon Athletica Inc	Credit Suisse	(1.483)
16.555	Lincoln Electric Holdings Inc	Credit Suisse	77.643			Bank of America	
5.932	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America		(26.148)	Lumentum Holdings Inc	Merrill Lynch	8.396
		Merrill Lynch	15.245	(2.485)	Lumentum Holdings Inc	Credit Suisse	84.701
12.416	Lincoln Electric Holdings Inc	Citibank	12.664			Bank of America	
9.498	Lincoln Electric Holdings Inc	JP Morgan	44.546	(31.815)	Lumentum Holdings Inc	Merrill Lynch	8.201
29.081	Lincoln Electric Holdings Inc	Deutsche Bank	63.847	(6.465)	Lumentum Holdings Inc	Deutsche Bank	104.989
16.316	Lincoln National Corp	Bank of America		(5.788)	Lumentum Holdings Inc	Citibank	19.395
		Merrill Lynch	(28.879)	18.521	LyondellBasell Industries NV 'A'	JP Morgan	19.100
33.804	Lincoln National Corp	Citibank	(136.568)		LyondellBasell Industries NV 'A'	Bank of America	
13.116	Lincoln National Corp	JP Morgan	(26.101)	59.895	LyondellBasell Industries NV 'A'	Merrill Lynch	17.039
3.144	Lincoln National Corp	Credit Suisse	(6.257)	5.439	LyondellBasell Industries NV 'A'	Credit Suisse	319.489
13.718	Lincoln National Corp	Deutsche Bank	(24.281)		LyondellBasell Industries NV 'A'	Citibank	(16.752)
(12.962)	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	JP Morgan	(14.647)	50.542	LyondellBasell Industries NV 'A'	JP Morgan	395.275
(25.907)	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Bank of America		37.758	LyondellBasell Industries NV 'A'	Deutsche Bank	3.876
		Merrill Lynch	(8.290)		M&T Bank Corp	Citibank	46.171
(2.005)	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Credit Suisse	(2.266)	(3.838)	M&T Bank Corp	JP Morgan	17.397
(4.099)	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Citibank	(451)	(1.891)	Macerich Co/The (Reit)	Bank of America	
(13.344)	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Deutsche Bank	(4.270)	(36.310)	Macerich Co/The (Reit)	Merrill Lynch	(48.286)
(12.662)	Lithia Motors Inc 'A'	Bank of America			Macerich Co/The (Reit)	Citibank	(4.327)
		Merrill Lynch	(1.519)	(8.484)	Macerich Co/The (Reit)	Credit Suisse	14.326
(12.525)	Lithia Motors Inc 'A'	Citibank	5.762	(6.602)	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	Credit Suisse	19.989
(4.216)	Lithia Motors Inc 'A'	Credit Suisse	(1.939)	15.991	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	Citibank	1.286
(3.625)	Lithia Motors Inc 'A'	Deutsche Bank	(435)	804	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	JP Morgan	486
(9.855)	Lithia Motors Inc 'A'	JP Morgan	(1.367)	389	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	Bank of America	
(3.515)	Littelfuse Inc	JP Morgan	(33.252)	4.170	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	Merrill Lynch	6.714
(1.666)	Littelfuse Inc	Credit Suisse	(15.760)			Bank of America	
(1.636)	Littelfuse Inc	Deutsche Bank	(9.931)	(37.332)	Macquarie Infrastructure Corp	Bank of America	
1.956	LivaNova Plc	Citibank	17.017		Macquarie Infrastructure Corp	Merrill Lynch	(38.452)
3.925	LivaNova Plc	Bank of America		(62.498)	Macquarie Infrastructure Corp	Citibank	(48.123)
		Merrill Lynch	30.380	(35.181)	Macquarie Infrastructure Corp	JP Morgan	(16.958)
2.184	LivaNova Plc	Deutsche Bank	16.904	(66.118)	Macquarie Infrastructure Corp	Deutsche Bank	(68.102)
(28.448)	Live Nation Entertainment Inc	Credit Suisse	19.231	10.251	Macy's Inc	Bank of America	
(38.112)	Live Nation Entertainment Inc	Deutsche Bank	34.682		Macy's Inc	Merrill Lynch	56.175
(86.429)	LKQ Corp	Bank of America		75.592	Macy's Inc	Citibank	173.106
		Merrill Lynch	(67.334)	8.880	Macy's Inc	JP Morgan	49.994
(51.856)	LKQ Corp	Citibank	(51.337)	26.070	Macy's Inc	Credit Suisse	140.857
(10.385)	LKQ Corp	JP Morgan	(6.335)	45.470	Macy's Inc	Deutsche Bank	249.176
(7.774)	LKQ Corp	Credit Suisse	(4.742)	(6.178)	Madison Square Garden Co/The 'A'	Credit Suisse	(18.313)
(18.820)	LKQ Corp	Deutsche Bank	(15.432)	(4.806)	Madison Square Garden Co/The 'A'	Bank of America	
(4.617)	Loews Corp	Bank of America		(3.689)	Madison Square Garden Co/The 'A'	Merrill Lynch	10.717
		Merrill Lynch	13.850		Madison Square Garden Co/The 'A'	Deutsche Bank	8.226
(22.178)	Loews Corp	Deutsche Bank	67.643	(1.004)	Madison Square Garden Co/The 'A'	JP Morgan	(15.000)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie	USD	Nombre	Description	Contrepartie	USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(1.521)	Madison Square Garden Co/The 'A'	Citibank	(1.186)	14.444	Marvell Technology Group Ltd	JP Morgan	9.822
4.587	Magellan Health Inc	JP Morgan	33.026	37.665	Marvell Technology Group Ltd	Bank of America	
104	Magellan Health Inc	Citibank	359			Merrill Lynch	(463)
6.279	Magellan Health Inc	Credit Suisse	45.209	26.925	Marvell Technology Group Ltd	Credit Suisse	4.348
1.173	Magellan Health Inc	Deutsche Bank	3.871	14.062	Marvell Technology Group Ltd	Deutsche Bank	844
4.566	Magellan Health Inc	Bank of America		38.202	Masco Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	15.068			Merrill Lynch	32.547
4.309	Manhattan Associates Inc	Deutsche Bank	(4.352)	30.815	Masco Corp	Citibank	35.437
7.052	Manhattan Associates Inc	Citibank	(3.738)	62.878	Masco Corp	JP Morgan	10.910
4.593	Manhattan Associates Inc	JP Morgan	(4.501)	20.727	Masco Corp	Credit Suisse	(622)
15.063	Manhattan Associates Inc	Bank of America		3.927	Masco Corp	Deutsche Bank	3.142
		Merrill Lynch	(15.214)	7.756	Masimo Corp	Credit Suisse	13.883
1.110	Manhattan Associates Inc	Credit Suisse	(1.088)	4.041	Masimo Corp	Bank of America	
16.052	ManpowerGroup Inc	Bank of America				Merrill Lynch	16.285
		Merrill Lynch	(54.737)	6.543	Masimo Corp	Citibank	15.245
31.271	ManpowerGroup Inc	JP Morgan	(107.113)	5.628	Masimo Corp	JP Morgan	10.074
18.598	ManpowerGroup Inc	Citibank	(33.104)	(6.259)	MasTec Inc	Credit Suisse	626
8.394	ManpowerGroup Inc	Credit Suisse	(35.171)	(1.666)	MasTec Inc	Deutsche Bank	2.166
5.645	ManpowerGroup Inc	Deutsche Bank	(19.249)	(27.733)	MasTec Inc	Bank of America	
96.535	Marathon Oil Corp	Bank of America				Merrill Lynch	36.053
		Merrill Lynch	20.174	(17.433)	MasTec Inc	Citibank	18.305
48.276	Marathon Oil Corp	JP Morgan	32.163	(7.410)	MasTec Inc	JP Morgan	7.838
51.797	Marathon Oil Corp	Citibank	(4.662)	(24.989)	Matador Resources Co	Citibank	73.967
7.950	Marathon Oil Corp	Credit Suisse	8.030	(13.149)	Matador Resources Co	Deutsche Bank	42.470
11.565	Marathon Oil Corp	Deutsche Bank	2.082	(11.671)	Matador Resources Co	Bank of America	
23.049	Marathon Petroleum Corp	Bank of America				Merrill Lynch	47.034
		Merrill Lynch	91.274	(33.234)	Matador Resources Co	Credit Suisse	157.861
4.782	Marathon Petroleum Corp	Citibank	13.198	(87.635)	Matador Resources Co	JP Morgan	416.266
10.136	Marathon Petroleum Corp	Credit Suisse	60.208	(83.915)	Mattel Inc	Credit Suisse	(88.950)
84.233	Marathon Petroleum Corp	JP Morgan	484.290	(77.090)	Mattel Inc	Bank of America	
23.212	Marathon Petroleum Corp	Deutsche Bank	82.956			Merrill Lynch	(31.607)
(1.018)	Markel Corp	Credit Suisse	27.303	(48.283)	Mattel Inc	JP Morgan	(51.180)
(1.298)	Markel Corp	Bank of America		(31.060)	Mattel Inc	Citibank	(13.977)
		Merrill Lynch	24.234	(19.283)	Mattel Inc	Deutsche Bank	(7.906)
(1.990)	Markel Corp	Citibank	81.490	13.625	Maxim Integrated Products Inc	Bank of America	
(190)	Markel Corp	Deutsche Bank	3.547			Merrill Lynch	18.394
(1.067)	Markel Corp	JP Morgan	28.617	30.905	Maxim Integrated Products Inc	JP Morgan	44.776
(4.699)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America		26.127	Maxim Integrated Products Inc	Citibank	15.676
		Merrill Lynch	(41.592)				
(12.086)	MarketAxess Holdings Inc	Credit Suisse	(172.230)	28.450	Maxim Integrated Products Inc	Credit Suisse	57.066
(4.436)	MarketAxess Holdings Inc	JP Morgan	(59.133)				
(6.382)	MarketAxess Holdings Inc	Citibank	(40.015)	37.054	Maxim Integrated Products Inc	Deutsche Bank	50.023
(10.674)	MarketAxess Holdings Inc	Deutsche Bank	(162.885)	8.572	MAXIMUS Inc	Bank of America	
(2.567)	Marriott International Inc/MD 'A'	Credit Suisse	8.394			Merrill Lynch	(3.816)
(8.117)	Marriott International Inc/MD 'A'	Bank of America		15.947	MAXIMUS Inc	JP Morgan	(81.822)
		Merrill Lynch	22.890	3.054	MAXIMUS Inc	Deutsche Bank	(794)
(5.474)	Marriott International Inc/MD 'A'	JP Morgan	17.900	(12.584)	MB Financial Inc	Bank of America	
4.261	Marriott Vacations Worldwide Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(71.947)
1.100	Marriott Vacations Worldwide Corp	Merrill Lynch	19.388	(28.507)	MB Financial Inc	Credit Suisse	(177.599)
6.530	Marriott Vacations Worldwide Corp	Citibank	2.970	(33.106)	MB Financial Inc	Citibank	45.686
941	Marriott Vacations Worldwide Corp	JP Morgan	15.165	(12.847)	MB Financial Inc	Deutsche Bank	(78.624)
365	Marriott Vacations Worldwide Corp	Credit Suisse	1.967	(2.459)	MB Financial Inc	JP Morgan	(15.320)
(7.335)	Marsh & McLennan Cos Inc	Deutsche Bank	1.661	(6.126)	McCormick & Co Inc/MD 'non-voting share'		
		Bank of America		2.512	McDonald's Corp	Citibank	184
(10.541)	Marsh & McLennan Cos Inc	Merrill Lynch	4.013	3.686	McDonald's Corp	Credit Suisse	(9.470)
(16.766)	Martin Marietta Materials Inc	JP Morgan	10.541	5.407	McDonald's Corp	JP Morgan	(13.896)
		Merrill Lynch	(80.432)		McKesson Corp	Bank of America	
(15.047)	Martin Marietta Materials Inc	Citibank	(86.069)	1.405	McKesson Corp	Merrill Lynch	(37.200)
(6.972)	Martin Marietta Materials Inc	JP Morgan	(58.495)	2.177	McKesson Corp	Citibank	(5.241)
(4.839)	Martin Marietta Materials Inc	Credit Suisse	(42.947)	790	McKesson Corp	JP Morgan	(2.830)
(2.520)	Martin Marietta Materials Inc	Deutsche Bank	(11.869)	6.066	McKesson Corp	Credit Suisse	(1.027)
56.625	Marvell Technology Group Ltd	Citibank	(9.060)	1.479	MDC Holdings Inc	Deutsche Bank	(41.734)
						Bank of America	
						Merrill Lynch	4.126
				16.984	MDC Holdings Inc	Credit Suisse	(7.982)
				(50.236)	MDU Resources Group Inc	JP Morgan	41.696
				(11.125)	MDU Resources Group Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	890

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(4.868)	MDU Resources Group Inc	Citibank	(487)	52.445	Michaels Cos Inc/The	Credit Suisse	19.884
45.929	Medical Properties Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	19.832	64.727	Michaels Cos Inc/The	Citibank	12.945
41.135	Medical Properties Trust Inc (Reit)	JP Morgan	14.155	49.716	Michaels Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	7.457
(80.836)	Medicines Co/The	Citibank	(189.156)	3.967	Michaels Cos Inc/The	Deutsche Bank	595
(224.949)	Medicines Co/The	Credit Suisse	(682.958)	18.417	Michaels Cos Inc/The	JP Morgan	11.234
(16.199)	Medicines Co/The	JP Morgan	(36.603)	(2.227)	Microchip Technology Inc	JP Morgan	(16.279)
(36.319)	Medicines Co/The	Deutsche Bank	(56.294)	(4.687)	Microchip Technology Inc	Citibank	(17.014)
(11.193)	Medidata Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21.602)	(15.166)	Microchip Technology Inc	Deutsche Bank	(69.764)
(8.056)	Medidata Solutions Inc	Citibank	(16.515)	(1.756)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8.078)
(9.066)	Medidata Solutions Inc	JP Morgan	(5.893)	(3.440)	Microchip Technology Inc	Credit Suisse	(15.276)
(18.663)	Medidata Solutions Inc	Credit Suisse	(19.996)	63.111	Micron Technology Inc	Credit Suisse	552.416
(6.657)	Medidata Solutions Inc	Deutsche Bank	(13.609)	90.499	Micron Technology Inc	Deutsche Bank	425.803
(27.703)	MEDNAX Inc	Bank of America Merrill Lynch	30.750	5.973	Micron Technology Inc	Citibank	717
(15.330)	MEDNAX Inc	JP Morgan	(8.278)	5.696	Micron Technology Inc	JP Morgan	60.264
(6.437)	MEDNAX Inc	Credit Suisse	(3.476)	23.310	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	48.951
(33.269)	Medtronic Plc	Citibank	(40.089)	4.277	Microsoft Corp	Citibank	8.212
(39.356)	Medtronic Plc	JP Morgan	(117.084)	2.120	Microsoft Corp	JP Morgan	7.653
(12.275)	Medtronic Plc	Deutsche Bank	(22.156)	(25.764)	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	JP Morgan	(45.761)
(41.037)	Medtronic Plc	Credit Suisse	(68.882)	(15.542)	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Citibank	(52.843)
(2.825)	Mellanox Technologies Ltd	Citibank	(4.520)	(3.733)	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Credit Suisse	(4.480)
(2.360)	Mellanox Technologies Ltd	Credit Suisse	(11.328)	(1.850)	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Deutsche Bank	(7.400)
(26.338)	Mellanox Technologies Ltd	Deutsche Bank	(88.232)	(16.368)	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(65.472)
(6.529)	Mellanox Technologies Ltd	JP Morgan	(31.339)	(5.204)	Middleby Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	21.545
35.619	Merck & Co Inc	Citibank	46.661	(7.238)	Middleby Corp/The	Citibank	13.680
8.384	Merck & Co Inc	JP Morgan	25.152	(22.147)	Middleby Corp/The	JP Morgan	188.693
3.358	Merck & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.880	(6.959)	Middleby Corp/The	Credit Suisse	215.172
17.414	Merck & Co Inc	Deutsche Bank	13.391	(20.454)	Middleby Corp/The	Deutsche Bank	84.680
(21.822)	Mercury General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16.556)	(9.996)	Minerals Technologies Inc	JP Morgan	(24.188)
(11.476)	Mercury General Corp	Citibank	7.115	(2.334)	Minerals Technologies Inc	Credit Suisse	(5.018)
(10.567)	Mercury General Corp	JP Morgan	(27.580)	(6.156)	Minerals Technologies Inc	Citibank	(5.848)
(9.480)	Mercury General Corp	Credit Suisse	(24.743)	(6.035)	Minerals Technologies Inc	Deutsche Bank	(11.165)
(23.025)	Mercury General Corp	Deutsche Bank	(12.209)	(10.817)	Minerals Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11.853)
(15.782)	MetLife Inc	JP Morgan	14.519	26.026	MKS Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	57.284
(34.130)	MetLife Inc	Citibank	96.588	6.394	MKS Instruments Inc	Citibank	27.814
(15.776)	MetLife Inc	Credit Suisse	14.514	22.626	MKS Instruments Inc	Credit Suisse	66.369
(21.137)	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	39.103	11.684	MKS Instruments Inc	Deutsche Bank	18.694
(44.281)	MetLife Inc	Deutsche Bank	81.920	(1.105)	Mohawk Industries Inc	Deutsche Bank	3.216
1.920	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6.470)	(7.122)	Mohawk Industries Inc	JP Morgan	52.418
3.301	Mettler-Toledo International Inc	Citibank	(69.420)	(2.293)	Mohawk Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	13.832
4.769	Mettler-Toledo International Inc	JP Morgan	31.666	(6.766)	Mohawk Industries Inc	Credit Suisse	29.657
951	Mettler-Toledo International Inc	Credit Suisse	6.315	(5.773)	Mohawk Industries Inc	Citibank	52.072
4.861	Mettler-Toledo International Inc	Deutsche Bank	(39.611)	13.322	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	24.646
66.137	MFA Financial Inc (Reit)	JP Morgan	16.865	29.008	Molina Healthcare Inc	Citibank	69.329
9.431	MFA Financial Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1.179	3.962	Molina Healthcare Inc	JP Morgan	18.027
8.652	MFA Financial Inc (Reit)	Citibank	303	6.500	Molina Healthcare Inc	Credit Suisse	29.575
72.639	MGIC Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6.174)	4.124	Molina Healthcare Inc	Deutsche Bank	7.629
26.287	MGIC Investment Corp	Citibank	(6.177)	(33.207)	Molson Coors Brewing Co 'B'	JP Morgan	(35.531)
44.603	MGIC Investment Corp	JP Morgan	(8.252)	(29.561)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(36.258)
90.322	MGIC Investment Corp	Credit Suisse	(16.710)	(17.456)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Citibank	(7.506)
42.616	MGIC Investment Corp	Deutsche Bank	(3.622)	(7.453)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Credit Suisse	(5.073)
(65.849)	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	(9.735)	(21.450)	Mondelez International Inc 'A'	JP Morgan	(14.586)
(90.405)	MGM Resorts International	Citibank	(24.409)	(36.973)	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5.546
(8.083)	MGM Resorts International	JP Morgan	1.697	(2.634)	Mondelez International Inc 'A'	Credit Suisse	(1.791)
(56.646)	MGM Resorts International	Credit Suisse	15.658	(35.462)	Mondelez International Inc 'A'	Citibank	6.029
(26.766)	MGM Resorts International	Deutsche Bank	(3.212)	(4.240)	Monolithic Power Systems Inc	Credit Suisse	(40.874)
49.881	Michael Kors Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(268.567)				
11.658	Michael Kors Holdings Ltd	Credit Suisse	(29.620)				
2.525	Michael Kors Holdings Ltd	JP Morgan	(5.353)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(7.028)	Monolithic Power Systems Inc	Citibank	(29.588)	(38.954)	Mueller Industries Inc	JP Morgan	(50.541)
(8.204)	Monolithic Power Systems Inc	Bank of America		(19.053)	Mueller Industries Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(61.694)			Merrill Lynch	(24.578)
(6.416)	Monolithic Power Systems Inc	Deutsche Bank	(35.324)	108.871	Murphy Oil Corp	Credit Suisse	45.997
(10.577)	Monolithic Power Systems Inc	JP Morgan	(81.960)	88.131	Murphy Oil Corp	Bank of America	
(174)	Monsanto Co	JP Morgan	(458)			Merrill Lynch	(23.795)
(45.496)	Monster Beverage Corp	Citibank	(80.755)	94.447	Murphy Oil Corp	Citibank	(102.947)
(23.362)	Monster Beverage Corp	Bank of America		47.743	Murphy Oil Corp	Deutsche Bank	(12.891)
		Merrill Lynch	(60.479)	4.490	Murphy Oil Corp	JP Morgan	3.996
(32.041)	Monster Beverage Corp	Credit Suisse	(3.497)	8.657	Murphy USA Inc	Bank of America	
(2.895)	Monster Beverage Corp	Deutsche Bank	(9.423)			Merrill Lynch	(15.669)
(9.640)	Monster Beverage Corp	JP Morgan	15.665	(1.098)	Mylan NV	JP Morgan	(3.507)
3.716	Moody's Corp	Deutsche Bank	6.169	(39.437)	Mylan NV	Citibank	13.803
7.948	Moody's Corp	Bank of America		1.098	Mylan NV	JP Morgan	(302.750)
		Merrill Lynch	13.194	(44.422)	Nabors Industries Ltd	Citibank	20.878
19.583	Moody's Corp	Citibank	(35.445)	(426.203)	Nabors Industries Ltd	Bank of America	
2.846	Moody's Corp	Credit Suisse	13.262			Merrill Lynch	234.412
2.049	Moog Inc 'A'	Bank of America		(381.396)	Nabors Industries Ltd	Credit Suisse	181.294
		Merrill Lynch	(1.045)	(74.564)	Nabors Industries Ltd	JP Morgan	29.826
1.059	Moog Inc 'A'	Citibank	(1.101)	8.434	Nasdaq Inc	Citibank	11.049
1.177	Moog Inc 'A'	JP Morgan	(1.777)	6.201	Nasdaq Inc	JP Morgan	15.685
993	Moog Inc 'A'	Credit Suisse	(1.499)	5.683	Nasdaq Inc	Bank of America	
6.681	Moog Inc 'A'	Deutsche Bank	(3.407)			Merrill Lynch	16.310
(20.606)	Morgan Stanley	Citibank	91.903	13.903	Nasdaq Inc	Credit Suisse	62.007
(30.775)	Morgan Stanley	JP Morgan	91.094	1.623	Nasdaq Inc	Deutsche Bank	4.658
(1.822)	Morningstar Inc	Bank of America		12.834	National Beverage Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(12.954)			Merrill Lynch	83.678
(105)	Morningstar Inc	Citibank	(445)	6.609	National Beverage Corp	Citibank	38.927
(599)	Morningstar Inc	Credit Suisse	(6.343)	307	National Beverage Corp	JP Morgan	2.054
(47.417)	Mosaic Co/The	Credit Suisse	(76.837)	6.842	National Beverage Corp	Credit Suisse	45.773
(23.891)	Mosaic Co/The	Citibank	239	4.470	National Beverage Corp	Deutsche Bank	29.144
(66.572)	Mosaic Co/The	Bank of America		5.656	National Fuel Gas Co	Bank of America	
		Merrill Lynch	(24.632)			Merrill Lynch	7.466
(16.437)	Mosaic Co/The	Deutsche Bank	(6.082)	7.253	National Fuel Gas Co	Citibank	10.227
(36.714)	Mosaic Co/The	JP Morgan	(67.554)	28.143	National Fuel Gas Co	JP Morgan	35.076
14.661	Motorola Solutions Inc	JP Morgan	20.965	1.374	National Fuel Gas Co	Credit Suisse	2.157
7.473	Motorola Solutions Inc	Citibank	(299)	12.639	National Fuel Gas Co	Deutsche Bank	16.683
55.847	Motorola Solutions Inc	Bank of America		(14.632)	National General		
		Merrill Lynch	62.113		Holdings Corp	Citibank	(5.999)
22.339	Motorola Solutions Inc	Credit Suisse	35.399	(61.138)	National General		
11.436	Motorola Solutions Inc	Deutsche Bank	14.752		Holdings Corp	Credit Suisse	(58.692)
(94.043)	MRC Global Inc	Citibank	10.345	(18.807)	National General		
(110.286)	MRC Global Inc	Deutsche Bank	(40.806)		Holdings Corp	Deutsche Bank	(26.518)
(113.379)	MRC Global Inc	Bank of America		(19.569)	National General		
		Merrill Lynch	(41.950)		Holdings Corp	JP Morgan	(18.786)
(42.680)	MRC Global Inc	Credit Suisse	(29.876)	9.581	National Health		
(17.292)	MRC Global Inc	JP Morgan	(12.104)		Investors Inc (Reit)	Credit Suisse	32.959
4.129	MSA Safety Inc	Credit Suisse	13.543	36.216	National Health	Bank of America	
11.542	MSA Safety Inc	Bank of America			Investors Inc (Reit)	Merrill Lynch	153.556
		Merrill Lynch	46.514	19.583	National Health		
5.447	MSA Safety Inc	Citibank	18.683		Investors Inc (Reit)	Citibank	59.924
7.206	MSA Safety Inc	JP Morgan	29.325	12.166	National Health		
9.249	MSA Safety Inc	Deutsche Bank	37.273		Investors Inc (Reit)	JP Morgan	41.851
23.914	MSC Industrial			15.655	National Health		
	Direct Co Inc 'A'	Citibank	(69.351)		Investors Inc (Reit)	Deutsche Bank	66.377
5.607	MSC Industrial			(13.471)	National Instruments Corp	Citibank	(808)
	Direct Co Inc 'A'	Credit Suisse	(16.359)	(18.266)	National Oilwell Varco Inc	Citibank	37.263
3.215	MSC Industrial			43.767	National Retail		
	Direct Co Inc 'A'	Deutsche Bank	(5.916)		Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	73.573
18.825	MSC Industrial	Bank of America		4.710	National Retail		
	Direct Co Inc 'A'	Merrill Lynch	(54.259)		Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	10.598
11.112	MSC Industrial			4.204	National Retail		
	Direct Co Inc 'A'	JP Morgan	(16.335)		Properties Inc (Reit)	Citibank	6.054
8.718	MSCI Inc	Bank of America		19.488	National Retail		
		Merrill Lynch	36.963		Properties Inc (Reit)	JP Morgan	28.258
10.424	MSCI Inc	JP Morgan	74.844	18.466	National Retail	Bank of America	
5.146	MSCI Inc	Citibank	30.670		Properties Inc (Reit)	Merrill Lynch	30.035
5.930	MSCI Inc	Deutsche Bank	22.415	9.342	Navient Corp	Deutsche Bank	(561)
4.064	MSCI Inc	Credit Suisse	15.553				
(17.002)	Mueller Industries Inc	Credit Suisse	(21.993)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(4.280)	Navient Corp	Bank of America		(96.474)	New York Community Bancorp Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	257			Merrill Lynch	38.281
(5.404)	Navient Corp	JP Morgan	(5.026)	(153.691)	New York Community Bancorp Inc	Citibank	76.845
(20.060)	Navistar International Corp	Credit Suisse	(5.982)	(86.245)	New York Community Bancorp Inc	JP Morgan	–
(21.611)	Navistar International Corp	Deutsche Bank	7.564	(32.427)	New York Community Bancorp Inc	Deutsche Bank	12.322
(1.222)	Navistar International Corp	JP Morgan	(391)	32.350	New York Times Co/The 'A'	Bank of America	
(41.139)	Navistar International Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(3.235)
		Merrill Lynch	14.399	(13.418)	Newell Brands Inc	Bank of America	
(42.205)	Navistar International Corp	Citibank	67.950			Merrill Lynch	28.044
19.323	NCR Corp	Credit Suisse	(12.779)	(210.106)	Newell Brands Inc	Credit Suisse	605.190
12.142	NCR Corp	Bank of America		(118.481)	Newell Brands Inc	Deutsche Bank	247.625
		Merrill Lynch	(6.314)	(41.378)	Newell Brands Inc	JP Morgan	126.617
1.859	NCR Corp	Citibank	(1.840)	77.897	Newfield Exploration Co	Bank of America	
11.739	NCR Corp	JP Morgan	8.452			Merrill Lynch	18.695
19.377	NCR Corp	Deutsche Bank	(13.662)	60.725	Newfield Exploration Co	Citibank	(22.468)
(15.390)	Nektar Therapeutics	Deutsche Bank	5.233	25.423	Newfield Exploration Co	JP Morgan	37.626
(39.214)	Nektar Therapeutics	Bank of America		58.039	Newfield Exploration Co	Credit Suisse	85.898
		Merrill Lynch	18.393	36.277	Newfield Exploration Co	Deutsche Bank	8.706
(25.796)	Neogen Corp	Credit Suisse	(118.920)	424	NewMarket Corp	Bank of America	
(15.597)	Neogen Corp	JP Morgan	(71.902)			Merrill Lynch	9.587
(1.897)	Neogen Corp	Bank of America		1.912	NewMarket Corp	JP Morgan	29.674
		Merrill Lynch	(6.640)	33.666	Newmont Mining Corp	Citibank	8.753
(18.989)	Neogen Corp	Citibank	(39.117)	25.472	Newmont Mining Corp	JP Morgan	(9.536)
6.072	NetApp Inc	Credit Suisse	(5.586)	11.726	Newmont Mining Corp	Credit Suisse	(10.905)
17.873	NetApp Inc	Bank of America		53.223	Newmont Mining Corp	Deutsche Bank	(24.483)
		Merrill Lynch	(32.708)	31.758	Newmont Mining Corp	Bank of America	
27.749	NetApp Inc	Citibank	46.896			Merrill Lynch	(14.609)
25.086	NetApp Inc	JP Morgan	7.176	9.476	News Corp 'A'	JP Morgan	(10.424)
58.469	NetApp Inc	Deutsche Bank	(106.998)	80.100	News Corp 'A'	Credit Suisse	(61.308)
(4.146)	Netflix Inc	Bank of America		6.263	News Corp 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(118.617)			Merrill Lynch	(3.257)
(7.116)	Netflix Inc	Citibank	(164.522)	64.677	News Corp 'A'	Citibank	(21.990)
(2.167)	Netflix Inc	JP Morgan	(47.745)	4.866	News Corp 'A'	Deutsche Bank	(2.530)
(6.609)	Netflix Inc	Credit Suisse	(184.061)	(14.521)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Credit Suisse	(60.988)
(9.180)	Netflix Inc	Deutsche Bank	(262.640)	(3.503)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Deutsche Bank	2.277
10.397	NetScout Systems Inc	Credit Suisse	(4.669)	(4.146)	Nexstar Media Group Inc 'A'	JP Morgan	(17.413)
48.431	NetScout Systems Inc	Citibank	(19.372)	(27.591)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America	
11.443	NetScout Systems Inc	Deutsche Bank	(1.144)			Merrill Lynch	34.797
11.857	NetScout Systems Inc	JP Morgan	(9.486)	(20.863)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Citibank	59.460
(23.321)	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America		(2.146)	NextEra Energy Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(94.365)			Merrill Lynch	(12.618)
(11.443)	Neurocrine Biosciences Inc	Citibank	(41.195)	(4.342)	NextEra Energy Inc	Citibank	(23.013)
(8.135)	Neurocrine Biosciences Inc	JP Morgan	(113.809)	(911)	NextEra Energy Inc	JP Morgan	(4.391)
(9.311)	Neurocrine Biosciences Inc	Credit Suisse	(130.261)	(50.851)	Nielsen Holdings Plc	Citibank	57.970
(1.956)	Neurocrine Biosciences Inc	Deutsche Bank	(8.020)	(25.097)	Nielsen Holdings Plc	Credit Suisse	(3.514)
(23.913)	Nevro Corp	Citibank	(164.761)	(27.242)	Nielsen Holdings Plc	Deutsche Bank	19.614
(53.497)	Nevro Corp	Bank of America		(2.327)	Nielsen Holdings Plc	JP Morgan	(326)
		Merrill Lynch	(124.669)	(4.077)	NIKE Inc 'B'	Credit Suisse	(14.351)
(28.630)	Nevro Corp	Credit Suisse	(107.403)	(9.192)	NIKE Inc 'B'	Deutsche Bank	(22.796)
(14.360)	Nevro Corp	Deutsche Bank	(14.647)	46.933	NiSource Inc	Credit Suisse	1.877
(21.035)	New Jersey Resources Corp	Citibank	(29.449)	19.640	NiSource Inc	Bank of America	
(8.905)	New Jersey Resources Corp	Bank of America				Merrill Lynch	8.838
		Merrill Lynch	(14.439)	7.671	NiSource Inc	Citibank	5.677
(3.347)	New Jersey Resources Corp	Credit Suisse	(5.523)	24.092	NiSource Inc	JP Morgan	964
(17.506)	New Jersey Resources Corp	JP Morgan	(28.885)	22.079	NiSource Inc	Deutsche Bank	9.936
29.848	New Relic Inc	Bank of America		(30.910)	Noble Energy Inc	Credit Suisse	(80.366)
		Merrill Lynch	451.302	(34.442)	Noble Energy Inc	JP Morgan	(89.549)
17.824	New Relic Inc	Deutsche Bank	269.499	(3.134)	Nordson Corp	Citibank	3.353
3.659	New Relic Inc	JP Morgan	91.146	(8.044)	Nordson Corp	Deutsche Bank	32.417
(24.062)	New Residential Investment Corp (Reit)	Bank of America		(3.895)	Nordson Corp	Credit Suisse	19.053
		Merrill Lynch	120	(1.385)	Nordson Corp	JP Morgan	4.903
(24.528)	New Residential Investment Corp (Reit)	Citibank	2.575	22.999	Nordstrom Inc	Citibank	72.907
(15.287)	New Residential Investment Corp (Reit)	Credit Suisse	(2.369)	6.773	Nordstrom Inc	JP Morgan	3.657
(7.582)	New Residential Investment Corp (Reit)	JP Morgan	(1.175)	29.353	Nordstrom Inc	Credit Suisse	15.851
(31.538)	New Residential Investment Corp (Reit)	Deutsche Bank	158	19.196	Nordstrom Inc	Deutsche Bank	(17.660)
				(5.222)	Norfolk Southern Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(14.361)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(3.386)	Norfolk Southern Corp	Citibank	(5.722)	6.642	OGE Energy Corp	Citibank	9.033
(6.569)	Norfolk Southern Corp	Credit Suisse	(48.611)	5.811	OGE Energy Corp	Deutsche Bank	7.961
(8.746)	Norfolk Southern Corp	Deutsche Bank	(24.052)	21.892	Old Dominion Freight Line Inc	Citibank	211.039
(9.234)	Norfolk Southern Corp	JP Morgan	(22.983)	3.707	Old Dominion Freight Line Inc	JP Morgan	61.165
11.184	Northern Trust Corp	Bank of America		4.837	Old Dominion Freight Line Inc	Credit Suisse	79.810
		Merrill Lynch	(64.545)	6.199	Old Dominion Freight Line Inc	Deutsche Bank	82.199
10.924	Northern Trust Corp	JP Morgan	(50.674)	(12.535)	Old National Bancorp/IN	JP Morgan	(5.641)
2.471	Northrop Grumman Corp	Bank of America		(41.845)	Old National Bancorp/IN	Citibank	4.185
		Merrill Lynch	23.549	(8.554)	Old National Bancorp/IN	Bank of America	
6.117	Northrop Grumman Corp	Citibank	30.585			Merrill Lynch	(3.849)
6.739	NorthWestern Corp	Citibank	7.009	(14.274)	Old National Bancorp/IN	Credit Suisse	(6.423)
18.400	NorthWestern Corp	Deutsche Bank	20.976	(64.111)	Old National Bancorp/IN	Deutsche Bank	(28.850)
10.029	NorthWestern Corp	JP Morgan	11.703	16.008	Old Republic	Bank of America	
(23.557)	Norwegian Cruise Line				International Corp	Merrill Lynch	6.243
	Holdings Ltd	Citibank	13.899	8.162	Old Republic		
(23.921)	Norwegian Cruise Line				International Corp	Citibank	(1.551)
	Holdings Ltd	JP Morgan	(46.407)	130	Old Republic		
(27.041)	Norwegian Cruise Line				International Corp	JP Morgan	75
	Holdings Ltd	Deutsche Bank	(23.796)	(80.674)	Olin Corp	Bank of America	
13.400	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	2.420
		Merrill Lynch	65.526	(9.562)	Olin Corp	JP Morgan	(3.538)
20.581	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	JP Morgan	97.760	(46.104)	Olin Corp	Citibank	53.942
9.396	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Citibank	17.758	(8.355)	Olin Corp	Deutsche Bank	251
32.168	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Credit Suisse	205.626	(18.818)	Olin Corp	Credit Suisse	(6.963)
36.259	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Deutsche Bank	177.307	(4.218)	Ollie's Bargain Outlet		
(26.253)	Nuance Communications Inc	Credit Suisse	41.095		Holdings Inc	Deutsche Bank	(9.491)
(85.045)	Nuance Communications Inc	Deutsche Bank	(73.989)	(64.797)	Omega Healthcare		
(105.265)	Nuance Communications Inc	Bank of America			Investors Inc (Reit)	Deutsche Bank	(150.977)
		Merrill Lynch	211.352	(9.572)	Omega Healthcare		
(12.092)	Nuance Communications Inc	Citibank	5.320		Investors Inc (Reit)	Citibank	(12.826)
(12.657)	Nuance Communications Inc	JP Morgan	19.618	(5.867)	Omega Healthcare		
(34.363)	Nucor Corp	Citibank	(5.842)		Investors Inc (Reit)	Credit Suisse	(16.428)
(888)	Nucor Corp	Bank of America		5.184	Omnicom Group Inc	Deutsche Bank	(19.129)
		Merrill Lynch	(1.971)	33.644	Omnicom Group Inc	Bank of America	
(16.298)	Nutanix Inc 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	(142.140)
		Merrill Lynch	38.327	47.368	Omnicom Group Inc	JP Morgan	(145.893)
(5.119)	Nutanix Inc 'A'	Deutsche Bank	11.723	5.188	Omnicom Group Inc	Citibank	(23.190)
(22.731)	NuVasive Inc	Bank of America		9.288	Omnicom Group Inc	Credit Suisse	(30.661)
		Merrill Lynch	(48.872)	63.315	ON Semiconductor Corp	Bank of America	
(18.249)	NuVasive Inc	Citibank	(35.951)			Merrill Lynch	131.695
(43.331)	NuVasive Inc	Credit Suisse	(71.128)	4.128	ON Semiconductor Corp	Citibank	6.440
(10.456)	NuVasive Inc	Deutsche Bank	(22.480)	23.135	ON Semiconductor Corp	Deutsche Bank	48.121
(15.833)	NuVasive Inc	JP Morgan	(31.328)	10.661	ONE Gas Inc	JP Morgan	27.612
(3.220)	NVIDIA Corp	Bank of America		4.472	ONE Gas Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(26.549)			Merrill Lynch	18.290
(1.157)	NVIDIA Corp	Credit Suisse	(12.293)	1.652	ONE Gas Inc	Citibank	4.824
(2.079)	NVIDIA Corp	Deutsche Bank	(17.141)	10.873	ONE Gas Inc	Credit Suisse	28.161
666	NVR Inc	Credit Suisse	38.611	26.471	ONE Gas Inc	Deutsche Bank	108.266
565	NVR Inc	Bank of America		(10.255)	OneMain Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	80.795			Merrill Lynch	13.639
206	NVR Inc	JP Morgan	(9.221)	(41.182)	OneMain Holdings Inc	Citibank	75.363
245	NVR Inc	Citibank	22.028	(23.048)	OneMain Holdings Inc	Deutsche Bank	30.654
581	NVR Inc	Deutsche Bank	68.717	(4.945)	OneMain Holdings Inc	JP Morgan	692
(2.695)	NXP Semiconductors NV	Citibank	1.348	(29.954)	ONEOK Inc	Citibank	(60.507)
1.568	O'Reilly Automotive Inc	Deutsche Bank	(4.124)	(75.159)	ONEOK Inc	Credit Suisse	(311.158)
696	O'Reilly Automotive Inc	Citibank	1.650	(6.648)	ONEOK Inc	Deutsche Bank	(9.374)
(178.400)	Oasis Petroleum Inc	JP Morgan	(255.112)	(23.901)	ONEOK Inc	Bank of America	
(490.812)	Oasis Petroleum Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(34.710)
		Merrill Lynch	(505.536)	(224.127)	OPKO Health Inc	Credit Suisse	(132.235)
7.416	Occidental Petroleum Corp	Credit Suisse	42.939	(9.353)	OPKO Health Inc	Citibank	(561)
49.742	Occidental Petroleum Corp	Deutsche Bank	(13.928)	(1.869.104)	OPKO Health Inc	JP Morgan	(888.036)
(11.257)	Oceaneering International Inc	Citibank	4.053	(17.295)	OPKO Health Inc	Bank of America	
(54.358)	Oceaneering International Inc	Bank of America				Merrill Lynch	15.738
		Merrill Lynch	13.590	(54.459)	Oracle Corp	Bank of America	
(63.077)	Oceaneering International Inc	Credit Suisse	(43.094)			Merrill Lynch	(9.258)
(41.376)	Oceaneering International Inc	Deutsche Bank	13.291	(16.760)	Oracle Corp	JP Morgan	(17.430)
17.900	OGE Energy Corp	Credit Suisse	21.301	(12.162)	Oracle Corp	Citibank	(7.419)
3.905	OGE Energy Corp	Bank of America		(14.573)	Ormat Technologies Inc	Credit Suisse	41.533
		Merrill Lynch	5.350	(14.424)	Ormat Technologies Inc	Deutsche Bank	10.241
927	OGE Energy Corp	JP Morgan	1.103	(8.578)	Ormat Technologies Inc	JP Morgan	24.447

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(26.272)	Ormat Technologies Inc	Bank of America		(21.728)	Parsley Energy Inc 'A'	JP Morgan	52.799
		Merrill Lynch	7.611	(46.968)	Patterson Cos Inc	Bank of America	
(23.437)	Ormat Technologies Inc	Citibank	9.609			Merrill Lynch	69.513
596	Oshkosh Corp	Bank of America		(1.669)	Patterson Cos Inc	Credit Suisse	1.803
		Merrill Lynch	(7.808)	(14.586)	Patterson Cos Inc	Citibank	11.669
3.683	Oshkosh Corp	Citibank	(14.290)	(618)	Patterson Cos Inc	Deutsche Bank	915
5.119	Oshkosh Corp	JP Morgan	2.355	(67.725)	Patterson Cos Inc	JP Morgan	90.657
12.522	Oshkosh Corp	Deutsche Bank	(12.772)	(72.126)	Patterson-UTL Energy Inc	Citibank	95.928
(6.853)	Outfront Media Inc (Reit)	Bank of America		(53.168)	Patterson-UTL Energy Inc	Deutsche Bank	99.424
		Merrill Lynch	1.508	(132.782)	Patterson-UTL Energy Inc	Bank of America	
(30.199)	Outfront Media Inc (Reit)	Citibank	(2.114)			Merrill Lynch	248.302
(12.787)	Outfront Media Inc (Reit)	Credit Suisse	(1.120)	(66.330)	Patterson-UTL Energy Inc	Credit Suisse	88.882
(16.039)	Outfront Media Inc (Reit)	Deutsche Bank	3.529	(83.066)	Patterson-UTL Energy Inc	JP Morgan	111.308
21.106	Owens Corning	Credit Suisse	(32.503)	16.311	Paychex Inc	Bank of America	
30.105	Owens Corning	Bank of America				Merrill Lynch	22.509
		Merrill Lynch	(28.299)	(771)	Paycom Software Inc	Bank of America	
29.159	Owens Corning	Citibank	15.746			Merrill Lynch	(3.724)
21.184	Owens Corning	JP Morgan	(16.585)	(6.548)	Paycom Software Inc	Credit Suisse	16.828
5.905	Owens Corning	Deutsche Bank	(5.551)	(4.192)	Paycom Software Inc	Citibank	(22.930)
70.446	Owens-Illinois Inc	Bank of America		(5.855)	Paycom Software Inc	Deutsche Bank	(28.280)
		Merrill Lynch	42.972	(2.026)	PayPal Holdings Inc	Credit Suisse	(13.392)
61.896	Owens-Illinois Inc	JP Morgan	(25.672)	(25.948)	PayPal Holdings Inc	Bank of America	
77.369	Owens-Illinois Inc	Citibank	(18.569)			Merrill Lynch	(117.804)
5.903	Owens-Illinois Inc	Credit Suisse	(1.948)	(18.781)	PayPal Holdings Inc	Citibank	(32.116)
139.110	Owens-Illinois Inc	Deutsche Bank	43.137	(26.312)	PayPal Holdings Inc	Deutsche Bank	(111.421)
1.321	PACCAR Inc	Citibank	(3.593)	25.334	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America	
4.585	PACCAR Inc	JP Morgan	(4.363)			Merrill Lynch	172.018
10.199	PACCAR Inc	Bank of America		32.388	PBF Energy Inc 'A'	Citibank	120.159
		Merrill Lynch	(5.100)	10.029	PBF Energy Inc 'A'	Credit Suisse	90.662
2.961	PACCAR Inc	Credit Suisse	(3.642)	6.232	PBF Energy Inc 'A'	Deutsche Bank	42.315
12.158	PACCAR Inc	Deutsche Bank	(6.079)	(11.298)	PDC Energy Inc	Credit Suisse	(25.364)
10.680	Packaging Corp of America	JP Morgan	48.049	(22.658)	PDC Energy Inc	Citibank	43.390
6.742	Packaging Corp of America	Bank of America		61.210	Peabody Energy Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(904)			Merrill Lynch	206.890
8.946	Packaging Corp of America	Citibank	(39.094)	52.450	Peabody Energy Corp	Credit Suisse	275.083
6.627	Packaging Corp of America	Deutsche Bank	23.195	38.852	Peabody Energy Corp	Deutsche Bank	131.320
(13.115)	PacWest Bancorp	Citibank	11.541	28.891	Peabody Energy Corp	JP Morgan	67.458
(17.005)	PacWest Bancorp	Credit Suisse	(8.332)	82.597	Peabody Energy Corp	Citibank	207.318
(8.134)	PacWest Bancorp	JP Morgan	(3.986)	16.150	Pebblebrook Hotel		
(12.292)	PacWest Bancorp	Bank of America			Trust (Reit)	Deutsche Bank	55.071
		Merrill Lynch	3.319	9.269	Pebblebrook Hotel		
(4.531)	PacWest Bancorp	Deutsche Bank	1.223		Trust (Reit)	JP Morgan	13.456
(2.685)	Palo Alto Networks Inc	JP Morgan	(26.069)	(3.739)	Pegasystems Inc	Citibank	(10.656)
724	Papa John's International Inc	Bank of America		(363)	Pegasystems Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	167			Merrill Lynch	(490)
10.781	Papa John's International Inc	Citibank	9.919	(8.377)	Pegasystems Inc	JP Morgan	1.257
7.702	Papa John's International Inc	JP Morgan	(50.910)	(6.796)	Pegasystems Inc	Deutsche Bank	(9.175)
844	Papa John's International Inc	Credit Suisse	(5.579)	(12.713)	Penske Automotive		
37.124	Paramount Group Inc (Reit)	Bank of America			Group Inc	Credit Suisse	(11.107)
		Merrill Lynch	16.706	(13.098)	Penske Automotive		
16.402	Paramount Group Inc (Reit)	Credit Suisse	820		Group Inc	Deutsche Bank	(6.680)
1.036	Paramount Group Inc (Reit)	Citibank	383	(16.005)	Penske Automotive		
188	Paramount Group Inc (Reit)	Deutsche Bank	85		Group Inc	JP Morgan	(19.366)
17.897	Park Hotels &			(17.600)	Penske Automotive	Bank of America	
	Resorts Inc (Reit)	JP Morgan	40.628		Group Inc	Merrill Lynch	(3.676)
67.136	Park Hotels &	Bank of America		(7.504)	Penske Automotive		
	Resorts Inc (Reit)	Merrill Lynch	124.873		Group Inc	Citibank	(2.176)
36.281	Park Hotels &			17.568	Pentair Plc	Bank of America	
	Resorts Inc (Reit)	Deutsche Bank	67.483			Merrill Lynch	(23.149)
23.852	Park Hotels &			10.482	Pentair Plc	Citibank	(16.666)
	Resorts Inc (Reit)	Credit Suisse	60.823	4.446	Pentair Plc	JP Morgan	(472)
7.355	Parker-Hannifin Corp	Bank of America		(12.468)	Penumbra Inc	Citibank	(62.340)
		Merrill Lynch	(23.462)	(28.702)	Penumbra Inc	Credit Suisse	(718.985)
5.120	Parker-Hannifin Corp	Citibank	(24.320)	(3.880)	Penumbra Inc	Deutsche Bank	(43.068)
2.894	Parker-Hannifin Corp	JP Morgan	6.830	(5.073)	Penumbra Inc	JP Morgan	(127.079)
2.984	Parker-Hannifin Corp	Deutsche Bank	(9.519)	15.219	People's United Financial Inc	Citibank	(8.523)
(116.167)	Parsley Energy Inc 'A'	Bank of America		31.440	People's United Financial Inc	JP Morgan	(314)
		Merrill Lynch	217.232	79.986	People's United Financial Inc	Bank of America	
(109.884)	Parsley Energy Inc 'A'	Citibank	103.291			Merrill Lynch	(34.947)
(156.114)	Parsley Energy Inc 'A'	Deutsche Bank	276.400	143.067	People's United Financial Inc	Deutsche Bank	(44.351)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
5.773	PepsiCo Inc	Citibank	(924)	(28.791)	Plains GP Holdings LP 'A'	Credit Suisse	18.115
30.300	PepsiCo Inc	Credit Suisse	90.294	7.047	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America	
8.597	PepsiCo Inc	JP Morgan	23.419			Merrill Lynch	(3.030)
24.140	PepsiCo Inc	Bank of America		15.913	Planet Fitness Inc 'A'	Credit Suisse	(15.595)
		Merrill Lynch	58.845	4.083	Plantronics Inc	Credit Suisse	30.092
864	PepsiCo Inc	Deutsche Bank	2.566	1.062	Plantronics Inc	Bank of America	
8.028	Performance Food Group Co	Credit Suisse	26.091			Merrill Lynch	7.838
41.222	Performance Food Group Co	Citibank	30.917	9.097	Plantronics Inc	Citibank	27.473
9.528	PerkinElmer Inc	Citibank	(15.054)	16.544	Plantronics Inc	JP Morgan	109.483
10.911	PerkinElmer Inc	Bank of America		8.528	Plantronics Inc	Deutsche Bank	62.937
		Merrill Lynch	8.292	(27.720)	Platform Specialty Products Corp	Bank of America	
530	PerkinElmer Inc	Credit Suisse	551			Merrill Lynch	(25.502)
3.107	PerkinElmer Inc	Deutsche Bank	2.361	(132.767)	Platform Specialty Products Corp		
38.968	Pfizer Inc	Credit Suisse	42.865			Citibank	(71.694)
41.775	Pfizer Inc	Citibank	15.039	(452.104)	Platform Specialty Products Corp	JP Morgan	(596.215)
84.872	Pfizer Inc	JP Morgan	75.165				
91.044	Pfizer Inc	Bank of America		(79.679)	Platform Specialty Products Corp	Credit Suisse	(67.598)
		Merrill Lynch	35.507	(204.986)	Platform Specialty Products Corp	Deutsche Bank	(188.587)
46.122	Pfizer Inc	Deutsche Bank	17.988			Credit Suisse	19.018
(5.386)	PG&E Corp	Bank of America		11.886	PNM Resources Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	539	32.549	PNM Resources Inc	Merrill Lynch	58.061
(12.675)	PG&E Corp	Deutsche Bank	1.268			Citibank	23.970
7.591	Philip Morris International Inc	Citibank	(4.555)	14.981	PNM Resources Inc	JP Morgan	10.704
31.448	Phillips 66	Credit Suisse	117.930	6.690	PNM Resources Inc	Deutsche Bank	76.070
29.655	Phillips 66	Bank of America		41.119	PNM Resources Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	49.820	6.135	Polaris Industries Inc	Merrill Lynch	29.387
36.440	Phillips 66	JP Morgan	136.650			Citibank	(7.704)
38.642	Phillips 66	Citibank	48.302	4.233	Polaris Industries Inc		
9.277	Phillips 66	Deutsche Bank	15.585	7.059	PolyOne Corp	Bank of America	
(79.275)	Physicians Realty Trust (Reit)	Citibank	(49.151)			Merrill Lynch	(918)
(22.661)	Physicians Realty Trust (Reit)	JP Morgan	(2.719)	3.888	PolyOne Corp	JP Morgan	272
(85.614)	Physicians Realty Trust (Reit)	Credit Suisse	(10.274)	787	PolyOne Corp	Citibank	(354)
(82.085)	Physicians Realty Trust (Reit)	Bank of America		5.905	PolyOne Corp	Credit Suisse	413
		Merrill Lynch	(41.007)	10.878	PolyOne Corp	Deutsche Bank	(1.414)
(51.915)	Physicians Realty Trust (Reit)	Deutsche Bank	(22.323)	530	Pool Corp	Credit Suisse	154
7.704	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America		1.931	Popular Inc	Deutsche Bank	(6.778)
		Merrill Lynch	6.702	849		Bank of America	
67.337	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	JP Morgan	61.544			Merrill Lynch	(900)
104.240	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	53.001	3.990	Popular Inc	Citibank	(6.344)
				3.638	Popular Inc	JP Morgan	(4.548)
57.547	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Citibank	42.585	5.862	Popular Inc	Credit Suisse	(7.328)
112.754	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	98.096	9.900	Popular Inc	Deutsche Bank	(10.494)
				10.198	Portland General Electric Co	Credit Suisse	10.402
(24.439)	Pinnacle Financial Partners Inc			18.796	Portland General Electric Co	Bank of America	
		Citibank	10.998			Merrill Lynch	33.833
(6.411)	Pinnacle Financial Partners Inc	JP Morgan	(8.065)	17.762	Portland General Electric Co	Citibank	33.570
(19.000)	Pinnacle Financial Partners Inc	Bank of America	(33.250)	13.417	Portland General Electric Co	Deutsche Bank	24.151
		Merrill Lynch		8.056	Portland General Electric Co	JP Morgan	8.217
(22.965)	Pinnacle Financial Partners Inc	Deutsche Bank	(40.189)	(61.020)	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America	
14.859	Pinnacle West Capital Corp	Deutsche Bank	31.947			Merrill Lynch	16.842
17.668	Pinnacle West Capital Corp	Citibank	47.527	(7.784)	Portola Pharmaceuticals Inc	Citibank	(623)
16.209	Pinnacle West Capital Corp	JP Morgan	27.629	(65.082)	Portola Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	108.539
8.642	Pinnacle West Capital Corp	Credit Suisse	18.237	(1.600)	Portola Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	3.312
3.550	Pinnacle West Capital Corp	Bank of America		(9.951)	Portola Pharmaceuticals Inc	Deutsche Bank	3.184
		Merrill Lynch	7.633	(29.287)	Post Holdings Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(43.931)
(5.211)	Pioneer Natural Resources Co	JP Morgan	47.348	8.586	Potlatch Corp (Reit)	Bank of America	
(2.067)	Pioneer Natural Resources Co	Citibank	13.415			Merrill Lynch	32.198
(4.302)	Pioneer Natural Resources Co	Credit Suisse	27.677	17.485	Potlatch Corp (Reit)	JP Morgan	32.347
15.771	Pitney Bowes Inc	Bank of America		15.598	Potlatch Corp (Reit)	Credit Suisse	28.076
		Merrill Lynch	(2.129)	969	Potlatch Corp (Reit)	Citibank	291
40.467	Pitney Bowes Inc	Citibank	(14.770)	19.606	Potlatch Corp (Reit)	Deutsche Bank	73.522
156.588	Pitney Bowes Inc	JP Morgan	(20.379)	(3.309)	PPG Industries Inc	JP Morgan	6.775
69.310	Pitney Bowes Inc	Credit Suisse	1.040	(10.629)	PPG Industries Inc	Citibank	17.219
48.623	Pitney Bowes Inc	Deutsche Bank	(16.565)	(38.003)	PPL Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	1.900
				(23.585)	PPL Corp	Deutsche Bank	1.179
				(38.355)	PPL Corp	JP Morgan	10.356
				(24.400)	PPL Corp	Credit Suisse	(3.694)
				91	PRA Health Sciences Inc	Credit Suisse	547

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
4.560	PRA Health Sciences Inc	Citibank	29.366	12.334	PS Business Parks Inc (Reit)	JP Morgan	51.803
13.636	PRA Health Sciences Inc	JP Morgan	81.952	29.252	PS Business Parks Inc (Reit)	Credit Suisse	122.858
2.087	PRA Health Sciences Inc	Bank of America		3.849	PS Business Parks Inc (Reit)	Citibank	21.593
		Merrill Lynch	14.797	7.748	PS Business Parks Inc (Reit)	Deutsche Bank	40.677
(2.794)	Praxair Inc	Citibank	6.957	(6.693)	PTC Inc	Bank of America	
(6.433)	Praxair Inc	Deutsche Bank	14.338			Merrill Lynch	(11.177)
(30.248)	Prestige Brands Holdings Inc	Citibank	(32.063)	(11.115)	PTC Inc	Citibank	(17.006)
(29.171)	Prestige Brands Holdings Inc	Bank of America		(24.466)	PTC Inc	Credit Suisse	5.672
		Merrill Lynch	10.502	(8.954)	PTC Inc	JP Morgan	4.208
(5.716)	Prestige Brands Holdings Inc	Deutsche Bank	2.058	(13.752)	PTC Inc	Deutsche Bank	(22.541)
(39.792)	Prestige Brands Holdings Inc	JP Morgan	(204.133)	3.923	Public Service Enterprise Group Inc	Bank of America	
(47.980)	PriceSmart Inc	Credit Suisse	(226.766)			Merrill Lynch	9.141
(4.060)	PriceSmart Inc	Deutsche Bank	(20.097)	39.328	Public Service Enterprise Group Inc	JP Morgan	58.599
(14.138)	PriceSmart Inc	Bank of America		13.608	Public Service Enterprise Group Inc	Citibank	27.624
		Merrill Lynch	(69.983)	2.234	Public Service Enterprise Group Inc		
(8.801)	PriceSmart Inc	Citibank	(29.923)	(1.916)	Public Storage (Reit)	Credit Suisse	3.329
(11.845)	PriceSmart Inc	JP Morgan	(45.696)			Bank of America	
1.528	Primerica Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(11.707)
		Merrill Lynch	5.730	(3.541)	Public Storage (Reit)	JP Morgan	(7.047)
3.484	Primerica Inc	Citibank	(523)	(2.897)	Public Storage (Reit)	Deutsche Bank	(17.701)
2.204	Primerica Inc	JP Morgan	7.053	23.253	PulteGroup Inc	Citibank	16.742
12.595	Primerica Inc	Deutsche Bank	47.231	7.206	PulteGroup Inc	Deutsche Bank	6.485
13.423	Principal Financial Group Inc	Bank of America		19.699	PulteGroup Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(46.712)			Merrill Lynch	17.729
48.433	Principal Financial Group Inc	JP Morgan	(84.758)	7.171	PulteGroup Inc	JP Morgan	(6.956)
12.650	Principal Financial Group Inc	Deutsche Bank	(44.022)	(1.621)	Puma Biotechnology Inc	Bank of America	
1.586	Principal Financial Group Inc	Credit Suisse	(2.776)			Merrill Lynch	3.323
(28.335)	ProAssurance Corp	Bank of America		(5.409)	Puma Biotechnology Inc	Credit Suisse	62.203
		Merrill Lynch	36.432	(27.857)	Puma Biotechnology Inc	Citibank	(27.857)
(4.079)	ProAssurance Corp	Citibank	5.303	(1.977)	Puma Biotechnology Inc	JP Morgan	22.736
(12.632)	ProAssurance Corp	JP Morgan	22.765	(15.079)	Puma Biotechnology Inc	Deutsche Bank	30.912
(5.542)	ProAssurance Corp	Credit Suisse	6.928	24.573	Pure Storage Inc 'A'	Credit Suisse	(51.979)
(17.728)	ProAssurance Corp	Deutsche Bank	22.160	1.240	PVH Corp	Credit Suisse	4.757
(23.224)	Procter & Gamble Co/The	Bank of America		4.601	PVH Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(5.070)			Merrill Lynch	20.797
(4.297)	Procter & Gamble Co/The	JP Morgan	(9.969)	2.853	PVH Corp	Deutsche Bank	12.896
(12.234)	Procter & Gamble Co/The	Credit Suisse	(28.383)	(217.510)	QEP Resources Inc	Citibank	171.833
(25.146)	Procter & Gamble Co/The	Deutsche Bank	(20.368)	(38.133)	QEP Resources Inc	Bank of America	
28.211	Progressive Corp/The	Bank of America				Merrill Lynch	23.261
		Merrill Lynch	16.927	(21.676)	QEP Resources Inc	JP Morgan	19.660
32.464	Progressive Corp/The	Citibank	16.881	(23.615)	QEP Resources Inc	Deutsche Bank	14.405
35.301	Progressive Corp/The	JP Morgan	47.656	2.231	Qorvo Inc	Bank of America	
43.587	Progressive Corp/The	Credit Suisse	32.745			Merrill Lynch	1.829
10.424	Progressive Corp/The	Deutsche Bank	6.254	86	Qorvo Inc	Citibank	12
4.566	Prologis Inc (Reit)	Credit Suisse	(2.922)	6.076	Qorvo Inc	JP Morgan	3.226
5.975	Prologis Inc (Reit)	JP Morgan	4.572	2.955	Qorvo Inc	Credit Suisse	3.044
19.997	Prologis Inc (Reit)	Bank of America		(11.624)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	JP Morgan	(37.546)
		Merrill Lynch	15.418	(27.037)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America	
11.249	Prologis Inc (Reit)	Citibank	8.774			Merrill Lynch	(75.433)
(2.781)	Proofpoint Inc	Bank of America		(65.042)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	(195.150)
		Merrill Lynch	13.099	(21.826)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Citibank	(63.732)
(6.295)	Proofpoint Inc	Citibank	2.329	(184)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	(513)
(4.187)	Proofpoint Inc	Deutsche Bank	19.721	(22.257)	Qualcomm Inc	Citibank	(13.354)
(4.671)	Proofpoint Inc	Credit Suisse	14.528	(39.831)	Qualcomm Inc	JP Morgan	(204.333)
(13.684)	Proofpoint Inc	JP Morgan	85.936	(81.303)	Qualcomm Inc	Credit Suisse	(104.462)
(553)	Prosperity Bancshares Inc	Credit Suisse	702	(752)	Qualcomm Inc	Deutsche Bank	(1.767)
(6.891)	Prosperity Bancshares Inc	Deutsche Bank	9.923	(6.946)	Quanta Services Inc	Deutsche Bank	3.820
(18.669)	Prosperity Bancshares Inc	Citibank	49.286	(9.959)	Quanta Services Inc	Bank of America	
(10.560)	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America				Merrill Lynch	5.477
		Merrill Lynch	15.206	(4.626)	Quanta Services Inc	Citibank	1.110
(20.198)	Prosperity Bancshares Inc	JP Morgan	28.577	19.598	Quest Diagnostics Inc	Credit Suisse	156.980
(13.934)	Proto Labs Inc	Deutsche Bank	(76.637)	9.270	Quest Diagnostics Inc	Bank of America	
(5.503)	Proto Labs Inc	JP Morgan	(13.618)			Merrill Lynch	53.484
2.340	Prudential Financial Inc	Credit Suisse	(7.933)	23.203	Quest Diagnostics Inc	Citibank	140.146
1.472	Prudential Financial Inc	Bank of America		8.336	Quest Diagnostics Inc	JP Morgan	66.771
		Merrill Lynch	(5.638)	3.867	Quest Diagnostics Inc	Deutsche Bank	22.235
9.894	Prudential Financial Inc	Citibank	(51.944)	(2.857)	Qurate Retail Inc	Bank of America	
15.985	Prudential Financial Inc	JP Morgan	(54.189)			Merrill Lynch	3.743
5.968	Prudential Financial Inc	Deutsche Bank	(22.857)	(19.576)	Qurate Retail Inc	JP Morgan	30.997
7.728	PS Business Parks Inc (Reit)	Bank of America					
		Merrill Lynch	41.140				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(43.205)	Qurate Retail Inc QVC Group 'A'	Credit Suisse	155.323	(865)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Bank of America	(3.287)
(7.139)	Qurate Retail Inc QVC Group 'A'	Citibank	10.066	21.542	Regions Financial Corp	Credit Suisse	(15.726)
(13.347)	Qurate Retail Inc QVC Group 'A'	Deutsche Bank	17.485	48.924	Regions Financial Corp	Bank of America	
67.441	Radian Group Inc	Merrill Lynch	7.419	47.871	Regions Financial Corp	JP Morgan	(56.263)
23.047	Radian Group Inc	Citibank	(9.449)	73.786	Regions Financial Corp	Citibank	(34.946)
30.636	Radian Group Inc	Deutsche Bank	3.370	29.133	Regions Financial Corp	Deutsche Bank	(89.281)
4.503	Radian Group Inc	JP Morgan	(675)	1.675	Reinsurance Group of America Inc	Bank of America	(36.404)
2.444	Ralph Lauren Corp	Citibank	48.538	1.993	Reinsurance Group of America Inc	Citibank	(1.407)
17.699	Ralph Lauren Corp	JP Morgan	529.023	705	Reinsurance Group of America Inc	JP Morgan	(2.855)
27.037	Ralph Lauren Corp	Bank of America		9.430	Reliance Steel & Aluminum Co	Credit Suisse	36.305
23.543	Ralph Lauren Corp	Deutsche Bank	676.195	2.138	Reliance Steel & Aluminum Co	Bank of America	
15.971	Ralph Lauren Corp	Credit Suisse	443.980			Merrill Lynch	6.286
(55.718)	Range Resources Corp	Citibank	(18.944)	12.816	Reliance Steel & Aluminum Co	Citibank	10.381
(57.839)	Range Resources Corp	JP Morgan	(82.710)	20.827	Reliance Steel & Aluminum Co	JP Morgan	80.184
(62.476)	Range Resources Corp	Credit Suisse	(89.341)	10.136	Reliance Steel & Aluminum Co	Deutsche Bank	29.800
(68.578)	Range Resources Corp	Bank of America		2.042	RenaissanceRe Holdings Ltd	Credit Suisse	(8.781)
(25.684)	Range Resources Corp	Merrill Lynch	(68.578)	2.989	RenaissanceRe Holdings Ltd	Citibank	(11.657)
10.555	Raymond James Financial Inc	Deutsche Bank	(25.684)	1.719	RenaissanceRe Holdings Ltd	Deutsche Bank	(8.526)
		Bank of America		8.913	RenaissanceRe Holdings Ltd	JP Morgan	(38.326)
		Merrill Lynch	28.604	(24.280)	Republic Services Inc	Citibank	(30.836)
8.304	Raymond James Financial Inc	Citibank	(42.101)	(10.834)	Republic Services Inc	JP Morgan	(13.198)
7.254	Raymond James Financial Inc	JP Morgan	39.244	5.103	ResMed Inc	Citibank	5.613
10.859	Raymond James Financial Inc	Credit Suisse	58.747	4.111	ResMed Inc	JP Morgan	4.244
5.852	Raymond James Financial Inc	Deutsche Bank	15.859	35.234	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Bank of America	
56.895	Rayonier Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	31.358
		Merrill Lynch	102.980	41.323	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Citibank	21.075
49.479	Rayonier Inc (Reit)	Deutsche Bank	71.463	76.463	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	JP Morgan	39.200
2.390	Rayonier Inc (Reit)	Credit Suisse	3.250				
20.842	Rayonier Inc (Reit)	Citibank	12.088	70.109	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	59.503
30.433	Rayonier Inc (Reit)	JP Morgan	40.483	96.199	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	70.856
3.540	Raytheon Co	Credit Suisse	5.468	(26.299)	Rexnord Corp	Citibank	(5.523)
14.793	Raytheon Co	Bank of America		(8.968)	Rexnord Corp	Credit Suisse	(3.946)
		Merrill Lynch	34.911	(51.012)	Rexnord Corp	Bank of America	
2.217	Raytheon Co	JP Morgan	3.711			Merrill Lynch	(25.506)
275	Raytheon Co	Citibank	1.108	(9.744)	Rexnord Corp	Deutsche Bank	(4.872)
(13.819)	RBC Bearings Inc	Credit Suisse	(72.273)	(3.633)	RingCentral Inc 'A'	JP Morgan	(1.923)
(4.728)	RBC Bearings Inc	Deutsche Bank	(26.335)	(11.090)	RLI Corp/DE	Credit Suisse	(1.109)
(9.079)	RBC Bearings Inc	JP Morgan	(47.483)	(9.045)	RLI Corp/DE	JP Morgan	(905)
(14.618)	Realogy Holdings Corp	Deutsche Bank	4.824	(8.122)	RLI Corp/DE	Bank of America	
(49.545)	RealPage Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(2.518)
		Merrill Lynch	(11.063)	(6.305)	RLI Corp/DE	Citibank	8.323
(23.002)	RealPage Inc	Citibank	(16.101)	(4.486)	RLI Corp/DE	Deutsche Bank	(1.391)
(12.794)	RealPage Inc	JP Morgan	(8.282)	(51.716)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Bank of America	
(12.582)	RealPage Inc	Credit Suisse	27.112			Merrill Lynch	(115.844)
(19.806)	RealPage Inc	Deutsche Bank	(4.952)	(18.595)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Citibank	(21.384)
(6.408)	Realty Income Corp (Reit)	Credit Suisse	(4.614)	(2.528)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Credit Suisse	(5.814)
(17.855)	Realty Income Corp (Reit)	Bank of America		(50.871)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Deutsche Bank	(113.951)
		Merrill Lynch	(26.068)	(91.262)	RLJ Lodging Trust (Reit)	JP Morgan	(209.903)
(384)	Realty Income Corp (Reit)	Deutsche Bank	(561)	13.756	Robert Half International Inc	Credit Suisse	16.031
21.508	Red Hat Inc	Citibank	76.784	21.701	Robert Half International Inc	Bank of America	
3.171	Red Hat Inc	Bank of America				Merrill Lynch	17.241
		Merrill Lynch	4.503	53.499	Robert Half International Inc	Citibank	(24.610)
14.738	Regal Beloit Corp	Citibank	5.895	4.706	Robert Half International Inc	JP Morgan	5.694
6.488	Regal Beloit Corp	JP Morgan	23.357	14.953	Robert Half International Inc	Deutsche Bank	18.093
2.545	Regal Beloit Corp	Bank of America		13.125	Rockwell Automation Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	3.054			Merrill Lynch	(11.393)
1.805	Regal Beloit Corp	Deutsche Bank	2.166	5.761	Rockwell Automation Inc	Citibank	(19.127)
17	Regal Beloit Corp	Credit Suisse	61	10.350	Rockwell Automation Inc	JP Morgan	3.628
(14.076)	Regency Centers Corp (Reit)	Bank of America		8.394	Rockwell Automation Inc	Credit Suisse	22.748
		Merrill Lynch	(24.211)	2.324	Rockwell Automation Inc	Deutsche Bank	(883)
(9.914)	Regency Centers Corp (Reit)	Credit Suisse	(297)	(551)	Rockwell Collins Inc	Credit Suisse	(2.573)
(13.029)	Regency Centers Corp (Reit)	Citibank	(11.987)	(878)	Rockwell Collins Inc	Bank of America	
(1.748)	Regency Centers Corp (Reit)	Deutsche Bank	(3.007)			Merrill Lynch	(2.432)
(17.652)	Regency Centers Corp (Reit)	JP Morgan	(530)				
(1.580)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	(29.056)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(3.300)	Rockwell Collins Inc	JP Morgan	(15.411)	(17.894)	Sabre Corp	Deutsche Bank	(8.947)
(4.435)	Rockwell Collins Inc	Citibank	1.242	(24.298)	Sabre Corp	JP Morgan	(44.222)
14.675	Rollins Inc	Bank of America		(3.565)	Sage Therapeutics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	8.805			Merrill Lynch	46.235
1.188	Rollins Inc	Deutsche Bank	713	(4.727)	Sage Therapeutics Inc	JP Morgan	(520)
19	Rollins Inc	JP Morgan	16	(3.802)	Sage Therapeutics Inc	Deutsche Bank	62.315
(4.819)	Roper Technologies Inc	Credit Suisse	(22.890)	(1.283)	Sage Therapeutics Inc	Citibank	9.045
(8.585)	Roper Technologies Inc	Bank of America		14.636	salesforce.com Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	22.186			Merrill Lynch	26.850
(9.428)	Roper Technologies Inc	Citibank	31.395	141.539	Sally Beauty Holdings Inc	Credit Suisse	42.462
(8.369)	Roper Technologies Inc	JP Morgan	(20.017)	61.103	Sally Beauty Holdings Inc	Citibank	10.388
10.105	Ross Stores Inc	JP Morgan	(13.945)	156.998	Sally Beauty Holdings Inc	Bank of America	
21.389	Ross Stores Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(18.559)
		Merrill Lynch	(74.491)	41.707	Sally Beauty Holdings Inc	Deutsche Bank	(8.341)
5.397	Ross Stores Inc	Deutsche Bank	(17.864)	5.060	Sally Beauty Holdings Inc	JP Morgan	1.518
8.752	Royal Caribbean Cruises Ltd	JP Morgan	5.964	11.974	Sanderson Farms Inc	Bank of America	
2.597	Royal Caribbean Cruises Ltd	Credit Suisse	1.774			Merrill Lynch	(147.041)
1.619	Royal Caribbean Cruises Ltd	Deutsche Bank	(1.846)	13.301	Sanderson Farms Inc	Citibank	(101.487)
5.306	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America		18.381	Sanderson Farms Inc	Deutsche Bank	(211.498)
		Merrill Lynch	(13.838)	742	Sanderson Farms Inc	JP Morgan	(11.479)
(16.198)	Royal Gold Inc	Credit Suisse	(22.353)	(27.106)	Sanmina Corp	Bank of America	
(15.702)	Royal Gold Inc	Citibank	(29.834)			Merrill Lynch	8.104
(10.928)	Royal Gold Inc	JP Morgan	(15.081)	(47.923)	Sanmina Corp	Deutsche Bank	4.792
(8.722)	Royal Gold Inc	Deutsche Bank	(10.728)	(10.920)	Sanmina Corp	Citibank	(1.092)
24.506	RPC Inc	Citibank	(45.826)	(21.521)	Sarepta Therapeutics Inc	Credit Suisse	(227.830)
26.512	RPC Inc	Bank of America		(16.562)	Sarepta Therapeutics Inc	JP Morgan	(190.297)
		Merrill Lynch	(63.629)	(3.775)	Sarepta Therapeutics Inc	Deutsche Bank	(16.912)
55.789	RPC Inc	JP Morgan	(112.136)	(26.055)	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America	
9.376	RPC Inc	Credit Suisse	(18.846)			Merrill Lynch	(110.956)
79.275	RPC Inc	Deutsche Bank	(190.260)	(14.324)	Sarepta Therapeutics Inc	Citibank	(113.589)
2.691	RPM International Inc	Bank of America		(5.381)	SBA Communications Corp (Reit)	Credit Suisse	(5.084)
		Merrill Lynch	565	(1.582)	SBA Communications Corp (Reit)	Citibank	(2.246)
33.302	RPM International Inc	JP Morgan	11.254	(8.500)	SCANA Corp	Bank of America	
4.538	RPM International Inc	Citibank	(6.444)			Merrill Lynch	(11.475)
2.033	RPM International Inc	Credit Suisse	1.504	(11.648)	SCANA Corp	Deutsche Bank	(15.725)
266	RPM International Inc	Deutsche Bank	56	(6.463)	Schlumberger Ltd	JP Morgan	5.817
(57.786)	RSP Permian Inc	JP Morgan	339.782	(2.563)	Schlumberger Ltd	Deutsche Bank	7.586
(74.083)	RSP Permian Inc	Deutsche Bank	220.027	(2.234)	Science Applications International Corp	Citibank	(6.590)
(61.996)	RSP Permian Inc	Credit Suisse	364.536	(5.940)	Science Applications International Corp	Bank of America	
2.990	Ryder System Inc	Bank of America		(3.914)	Science Applications International Corp	Merrill Lynch	7.781
		Merrill Lynch	718	(9.658)	Scientific Games Corp/DE 'A'	JP Morgan	665
3.802	Ryder System Inc	Citibank	2.585			Bank of America	
18.190	Ryder System Inc	JP Morgan	7.458	(2.719)	Scientific Games Corp/DE 'A'	Merrill Lynch	(5.795)
7.610	Ryder System Inc	Credit Suisse	2.120	(7.266)	Scientific Games Corp/DE 'A'	Credit Suisse	(22.432)
13.460	Ryder System Inc	Deutsche Bank	3.230	(117)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Deutsche Bank	(4.360)
11.116	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Bank of America				Merrill Lynch	(260)
		Merrill Lynch	32.125	(17.316)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Citibank	8.831
4.068	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Citibank	7.038	(5.712)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Credit Suisse	(32.673)
11.926	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	JP Morgan	36.851	(4.063)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Deutsche Bank	2.959
16.715	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Credit Suisse	51.649	(4.712)	Scotts Miracle-Gro Co/The	JP Morgan	(26.953)
413	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	1.194	7.292	Seagate Technology Plc	Credit Suisse	12.688
12.986	S&P Global Inc	Bank of America		4.220	Seagate Technology Plc	Bank of America	
		Merrill Lynch	7.012			Merrill Lynch	1.941
5.033	S&P Global Inc	JP Morgan	20.635	39.596	Seagate Technology Plc	Citibank	8.711
10.343	S&P Global Inc	Citibank	(11.377)	35.633	Seagate Technology Plc	JP Morgan	40.245
2.305	S&P Global Inc	Credit Suisse	(2.711)	7.381	Seagate Technology Plc	Deutsche Bank	3.395
7.131	S&P Global Inc	Deutsche Bank	3.851	18.181	Sealed Air Corp	Deutsche Bank	18.545
(30.898)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Bank of America		22.952	Sealed Air Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(26.263)			Merrill Lynch	23.411
(82.997)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Credit Suisse	(98.781)	4.672	Sealed Air Corp	JP Morgan	1.729
(4.189)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Citibank	(4.692)	4.219	Sealed Air Corp	Credit Suisse	1.561
(21.452)	Sabra Health Care Inc (Reit)	JP Morgan	(28.102)	(18.027)	Seattle Genetics Inc	Bank of America	
(100.155)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Deutsche Bank	(91.300)			Merrill Lynch	(26.993)
(32.473)	Sabre Corp	Citibank	(20.458)	(30.059)	Seattle Genetics Inc	Citibank	(125.346)
(18.034)	Sabre Corp	Bank of America		(17.504)	Seattle Genetics Inc	Credit Suisse	(93.121)
		Merrill Lynch	(9.017)	(889)	Seattle Genetics Inc	Deutsche Bank	(1.867)
(20.845)	Sabre Corp	Credit Suisse	(37.938)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes USD				Plus-values/ (moins-values) latentes USD			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(8.387)	Seattle Genetics Inc	JP Morgan	(44.619)	443	Silgan Holdings Inc	Credit Suisse	173
12.777	SEI Investments Co	JP Morgan	17.760	7.721	Silgan Holdings Inc	Deutsche Bank	3.243
9.242	SEI Investments Co	Bank of America		7.066	Silgan Holdings Inc	Citibank	(636)
		Merrill Lynch	6.100	(3.178)	Silicon Laboratories Inc	Bank of America	
13.502	Selective Insurance Group Inc	Credit Suisse	6.751			Merrill Lynch	(13.665)
8.327	Selective Insurance Group Inc	JP Morgan	4.164	(50)	Silicon Laboratories Inc	Citibank	(123)
6.074	Selective Insurance Group Inc	Citibank	2.733	(5.148)	Silicon Laboratories Inc	Credit Suisse	(28.571)
3.630	Selective Insurance Group Inc	Bank of America		(87)	Silicon Laboratories Inc	Deutsche Bank	(374)
		Merrill Lynch	5.808	7.142	Simon Property	Bank of America	
3.475	Selective Insurance Group Inc	Deutsche Bank	1.078		Group Inc (Reit)	Merrill Lynch	43.423
(147.303)	SemGroup Corp 'A'	JP Morgan	(198.859)	197	Simon Property		
(71.105)	SemGroup Corp 'A'	Bank of America			Group Inc (Reit)	Citibank	494
		Merrill Lynch	(16.802)	7.562	Simon Property		
(35.259)	SemGroup Corp 'A'	Citibank	(3.526)		Group Inc (Reit)	Credit Suisse	41.088
(89.406)	SemGroup Corp 'A'	Deutsche Bank	(22.352)	1.750	Simon Property		
(20.032)	SemGroup Corp 'A'	Credit Suisse	1.563		Group Inc (Reit)	Deutsche Bank	4.202
(5.879)	Semptra Energy	JP Morgan	3.763	1.171	Simon Property		
(10.410)	Semptra Energy	Credit Suisse	6.662		Group Inc (Reit)	JP Morgan	2.319
(35.572)	Semptra Energy	Bank of America		13.653	Simpson Manufacturing	Bank of America	
		Merrill Lynch	(57.921)		Co Inc	Merrill Lynch	48.059
(4.984)	Senior Housing Properties	Bank of America		5.131	Simpson Manufacturing		
	Trust (Reit)	Merrill Lynch	(7.675)		Co Inc	JP Morgan	16.778
(10.150)	Senior Housing Properties			8.924	Simpson Manufacturing		
	Trust (Reit)	Citibank	(10.759)		Co Inc	Citibank	13.208
(6.004)	Senior Housing Properties			7.523	Simpson Manufacturing		
	Trust (Reit)	JP Morgan	(9.366)		Co Inc	Credit Suisse	21.896
(3.379)	Senior Housing Properties			7.923	Simpson Manufacturing		
	Trust (Reit)	Credit Suisse	(5.271)		Co Inc	Deutsche Bank	27.889
(3.475)	Senior Housing Properties			(2.270)	SINA Corp/China	Bank of America	
	Trust (Reit)	Deutsche Bank	(5.352)			Merrill Lynch	(83)
(12.799)	Sensata Technologies			(4.309)	SINA Corp/China	Deutsche Bank	3.663
	Holding Plc	Citibank	15.359	(2.847)	Sinclair Broadcast		
(1.142)	Sensata Technologies				Group Inc 'A'	Citibank	6.975
	Holding Plc	Credit Suisse	11	(6.494)	Sinclair Broadcast		
4.550	Sensient Technologies Corp	Bank of America			Group Inc 'A'	Deutsche Bank	19.157
		Merrill Lynch	273	23.505	Sirius XM Holdings Inc	Bank of America	
13.777	Sensient Technologies Corp	Citibank	—			Merrill Lynch	6.111
6.324	Sensient Technologies Corp	JP Morgan	(6.514)	30.347	Sirius XM Holdings Inc	JP Morgan	15.174
16.177	Sensient Technologies Corp	Credit Suisse	(11.220)	111.988	Sirius XM Holdings Inc	Citibank	21.278
1.964	Sensient Technologies Corp	Deutsche Bank	118	87.411	Sirius XM Holdings Inc	Credit Suisse	33.382
(14.527)	Service Corp International/US	Bank of America		89.510	Sirius XM Holdings Inc	Deutsche Bank	23.273
		Merrill Lynch	3.013	(9.205)	SiteOne Landscape	Bank of America	
(844)	Service Corp International/US	JP Morgan	(633)		Supply Inc	Merrill Lynch	22.184
(1.401)	Service Corp International/US	Citibank	532	(17.662)	SiteOne Landscape		
(8.502)	Service Corp International/US	Deutsche Bank	680		Supply Inc	Deutsche Bank	42.565
(30.467)	ServiceMaster Global	Bank of America		(22.447)	SiteOne Landscape		
	Holdings Inc	Merrill Lynch	24.983		Supply Inc	JP Morgan	76.326
(18.275)	ServiceMaster Global			16.690	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America	
	Holdings Inc	Citibank	1.828			Merrill Lynch	23.901
(26.731)	ServiceMaster Global			3.277	Six Flags Entertainment Corp	Citibank	3.703
	Holdings Inc	Credit Suisse	(66.828)	4.135	Six Flags Entertainment Corp	JP Morgan	13.232
(16.935)	ServiceMaster Global			20.895	Six Flags Entertainment Corp	Credit Suisse	66.864
	Holdings Inc	JP Morgan	(20.673)	1.913	Six Flags Entertainment Corp	Deutsche Bank	3.673
(30.367)	ServiceMaster Global			4.360	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Bank of America	
	Holdings Inc	Deutsche Bank	24.901			Merrill Lynch	1.003
(5.169)	ServiceNow Inc	Bank of America		14.682	Skechers U.S.A. Inc 'A'	JP Morgan	(1.468)
		Merrill Lynch	(31.686)	12.475	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Deutsche Bank	2.869
(7.130)	ServiceNow Inc	Credit Suisse	(25.098)	20.199	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Citibank	(9.494)
(2.210)	Sherwin-Williams Co/The	Citibank	(22.277)	6.308	Skyworks Solutions Inc	JP Morgan	13.038
(565)	Sherwin-Williams Co/The	JP Morgan	(4.435)	2.348	Skyworks Solutions Inc	Citibank	(1.949)
(6.677)	Signature Bank/New York NY	Bank of America		2.493	Skyworks Solutions Inc	Deutsche Bank	3.291
		Merrill Lynch	27.764	11.440	SL Green Realty Corp (Reit)	Bank of America	
(3.099)	Signature Bank/New York NY	Citibank	13.791			Merrill Lynch	16.317
(7.724)	Signature Bank/New York NY	JP Morgan	11.277	11.087	SL Green Realty Corp (Reit)	JP Morgan	(6.366)
7.235	Signet Jewelers Ltd	Citibank	24.237	9.742	SL Green Realty Corp (Reit)	Deutsche Bank	4.384
2.284	Signet Jewelers Ltd	Credit Suisse	13.681	(42.258)	SLM Corp	Bank of America	
512	Signet Jewelers Ltd	Deutsche Bank	2.570			Merrill Lynch	5.650
27.631	Signet Jewelers Ltd	JP Morgan	165.510	(26.597)	SLM Corp	Citibank	9.974
22.623	Silgan Holdings Inc	Bank of America		(88.412)	SLM Corp	JP Morgan	11.930
		Merrill Lynch	7.660	(28.734)	SM Energy Co	Credit Suisse	(46.466)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(5.179)	SM Energy Co	Bank of America		(17.337)	Spirit Airlines Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.111)			Merrill Lynch	(7.282)
(22.850)	SM Energy Co	JP Morgan	(48.442)	(41.941)	Spirit Airlines Inc	Citibank	(5.033)
(24.955)	SM Energy Co	Citibank	6.239	(27.245)	Spirit Airlines Inc	JP Morgan	11.484
1.403	Snap-on Inc	Credit Suisse	744	(54.308)	Spirit Airlines Inc	Credit Suisse	14.120
20.920	Snap-on Inc	Bank of America		(7.354)	Spirit Airlines Inc	Deutsche Bank	(3.089)
		Merrill Lynch	(23.221)	(122.528)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Citibank	(18.992)
2.086	Snap-on Inc	Deutsche Bank	(2.315)	(53.613)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	JP Morgan	(15.816)
7.799	Snap-on Inc	Citibank	(34.394)	(97.572)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Bank of America	
3.940	Snap-on Inc	JP Morgan	(15.437)			Merrill Lynch	(44.395)
4.324	Sonoco Products Co	Citibank	—	(62.459)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Deutsche Bank	(28.419)
21.013	Sonoco Products Co	JP Morgan	(10.296)	(40.674)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Credit Suisse	(11.999)
4.161	Sonoco Products Co	Bank of America		(7.033)	Splunk Inc	Citibank	14.629
		Merrill Lynch	2.871	(3.999)	Splunk Inc	JP Morgan	3.439
30.162	Sonoco Products Co	Deutsche Bank	20.812	(13.152)	Sprint Corp	Citibank	395
20.189	Sonoco Products Co	Credit Suisse	(7.179)	(15.709)	Sprint Corp	JP Morgan	—
(911)	Sotheby's	Credit Suisse	146	(403.612)	Sprint Corp	Deutsche Bank	(8.072)
(6.997)	Sotheby's	Citibank	980	18.792	Sprouts Farmers Market Inc	Bank of America	
(5.706)	Sotheby's	JP Morgan	913			Merrill Lynch	(564)
(47.377)	South Jersey Industries Inc	Citibank	(37.428)	29.999	Sprouts Farmers Market Inc	Credit Suisse	9.300
(25.478)	South Jersey Industries Inc	JP Morgan	(39.746)	50.447	Sprouts Farmers Market Inc	JP Morgan	15.639
(32.146)	South Jersey Industries Inc	Bank of America		18.271	Sprouts Farmers Market Inc	Citibank	1.644
		Merrill Lynch	(22.502)	10.971	Sprouts Farmers Market Inc	Deutsche Bank	388
(19.113)	South Jersey Industries Inc	Deutsche Bank	(13.379)	(11.396)	Square Inc 'A'	Credit Suisse	(61.994)
(27.929)	South Jersey Industries Inc	Credit Suisse	(43.569)	(59.701)	Square Inc 'A'	Deutsche Bank	(244.751)
(10.187)	South State Corp	Citibank	3.565	(9.191)	Square Inc 'A'	JP Morgan	(255.519)
(8.782)	South State Corp	Credit Suisse	(14.490)	(17.223)	Square Inc 'A'	Bank of America	
(5.914)	South State Corp	Deutsche Bank	(9.758)			Merrill Lynch	(70.787)
(4.947)	South State Corp	JP Morgan	3.141	(69.236)	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America	
(42.771)	Southern Co/The	Credit Suisse	(27.087)	(21.800)	SS&C Technologies Holdings Inc	Merrill Lynch	(101.140)
(52.678)	Southern Co/The	Citibank	(56.365)			Citibank	(17.222)
(17.844)	Southern Co/The	Bank of America		(23.125)	SS&C Technologies Holdings Inc	JP Morgan	(25.900)
		Merrill Lynch	(7.316)	(11.012)	SS&C Technologies Holdings Inc	Credit Suisse	(12.333)
7.747	Southwest Airlines Co	Bank of America		2.822	Stanley Black & Decker Inc	Credit Suisse	4.233
		Merrill Lynch	(4.803)	4.616	Stanley Black & Decker Inc	Bank of America	
22.992	Southwest Airlines Co	Citibank	5.288			Merrill Lynch	785
3.835	Southwest Airlines Co	Deutsche Bank	(2.378)	3.262	Stanley Black & Decker Inc	Citibank	(16.930)
34.331	Southwest Airlines Co	Credit Suisse	(42.914)	10.718	Stanley Black & Decker Inc	JP Morgan	16.077
1.145	Southwest Gas Holdings Inc	Bank of America		17.796	Starbucks Corp	Credit Suisse	(9.254)
		Merrill Lynch	3.824	9.236	Starbucks Corp	Citibank	1.755
4.525	Southwest Gas Holdings Inc	Credit Suisse	13.439	39.847	Starwood Property Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	17.416
(4.683)	Southwest Gas Holdings Inc	Citibank	(23.087)	70.137	Starwood Property Trust Inc (Reit)	Bank of America	
69.942	Southwestern Energy Co	JP Morgan	35.670			Merrill Lynch	13.060
135.472	Southwestern Energy Co	Credit Suisse	69.091	1.744	Starwood Property Trust Inc (Reit)	JP Morgan	748
100.582	Southwestern Energy Co	Citibank	1.006	12.006	State Street Corp	Deutsche Bank	35.373
(62.287)	Spark Therapeutics Inc	Credit Suisse	(682.253)			Bank of America	
(4.719)	Spectrum Brands Holdings Inc	Citibank	(12.505)	7.488	State Street Corp	Merrill Lynch	(58.589)
(6.025)	Spectrum Brands Holdings Inc	JP Morgan	(60.732)	23.769	State Street Corp	Citibank	(29.952)
(3.511)	Spectrum Brands Holdings Inc	Credit Suisse	(35.391)	6.859	State Street Corp	JP Morgan	(75.504)
(47.997)	Spectrum Brands Holdings Inc	Deutsche Bank	(373.417)	18.121	Steel Dynamics Inc	Credit Suisse	(32.891)
(7.032)	Spire Inc	Credit Suisse	(12.550)	29.990	Steel Dynamics Inc	Credit Suisse	75.383
(15.195)	Spire Inc	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(15.195)	48.850	Steel Dynamics Inc	Merrill Lynch	36.288
(6.331)	Spire Inc	Citibank	(8.863)	34.811	Steel Dynamics Inc	Citibank	11.724
(74)	Spire Inc	Deutsche Bank	(74)	15.774	Steel Dynamics Inc	JP Morgan	106.912
(1.871)	Spire Inc	JP Morgan	(3.648)	(20.760)	Stericycle Inc	Deutsche Bank	19.087
15.645	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	20.495	(11.736)	Stericycle Inc	Merrill Lynch	(13.079)
16.691	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Citibank	(29.877)	(26.345)	Stericycle Inc	Citibank	(10.680)
20.580	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	JP Morgan	7.615	(13.324)	Stericycle Inc	JP Morgan	(20.553)
529	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Deutsche Bank	693	(29.209)	Stericycle Inc	Credit Suisse	(10.393)
4.157	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Credit Suisse	1.538	(7.950)	Steris Plc	Deutsche Bank	(19.834)
				(6.907)	Steris Plc	Citibank	(6.599)
						JP Morgan	(47.037)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(19.272)	Sterling Bancorp/DE	Bank of America		52.164	Synopsys Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.672)			Merrill Lynch	(29.583)
(36.519)	Sterling Bancorp/DE	Citibank	—	32.736	Synopsys Inc	Credit Suisse	(53.507)
(51.915)	Sterling Bancorp/DE	Deutsche Bank	(23.362)	2.549	Synopsys Inc	Deutsche Bank	(714)
(32.418)	Sterling Bancorp/DE	JP Morgan	(25.934)	28.866	Synovus Financial Corp	Credit Suisse	22.227
(342)	Steven Madden Ltd	Bank of America		29.113	Synovus Financial Corp	Citibank	(21.835)
		Merrill Lynch	(1.197)	21.554	Synovus Financial Corp	JP Morgan	16.597
(3.719)	Steven Madden Ltd	JP Morgan	(18.037)	37.894	Synovus Financial Corp	Bank of America	
(5.343)	Stifel Financial Corp	Citibank	7.747			Merrill Lynch	56
(6.634)	Stifel Financial Corp	Bank of America		9.848	Synovus Financial Corp	Deutsche Bank	2.068
		Merrill Lynch	(4.312)	13.858	Syntel Inc	Deutsche Bank	1.181
(1.003)	Stifel Financial Corp	Deutsche Bank	(652)	11.023	Syntel Inc	Bank of America	
(19.211)	STORE Capital Corp (Reit)	Citibank	(20.364)			Merrill Lynch	14.991
(42.599)	STORE Capital Corp (Reit)	Bank of America		36.540	Syntel Inc	Credit Suisse	56.971
		Merrill Lynch	(58.361)	90.745	Syntel Inc	JP Morgan	189.657
(17.563)	STORE Capital Corp (Reit)	JP Morgan	(17.387)	24.381	Sysco Corp	Bank of America	
(3.580)	STORE Capital Corp (Reit)	Credit Suisse	(3.544)			Merrill Lynch	64.610
(43.432)	STORE Capital Corp (Reit)	Deutsche Bank	(59.502)	21.479	Sysco Corp	Citibank	41.025
(12.719)	Stryker Corp	Bank of America		16.483	Sysco Corp	Credit Suisse	38.067
		Merrill Lynch	(75.894)	19.472	Sysco Corp	JP Morgan	55.690
(4.344)	Stryker Corp	Credit Suisse	(40.225)	24.591	T Rowe Price Group Inc	Bank of America	
(1.752)	Stryker Corp	Deutsche Bank	(5.069)			Merrill Lynch	107.217
(1.250)	Stryker Corp	JP Morgan	(11.621)	3.492	T Rowe Price Group Inc	Citibank	(4.051)
(100.848)	Summit Materials Inc 'A'	Citibank	59.500	3.510	T Rowe Price Group Inc	JP Morgan	25.728
(106.751)	Summit Materials Inc 'A'	Bank of America		16.643	T Rowe Price Group Inc	Credit Suisse	121.993
		Merrill Lynch	149.451	15.097	T Rowe Price Group Inc	Deutsche Bank	65.823
(11.233)	Summit Materials Inc 'A'	JP Morgan	18.310	(2.052)	T-Mobile US Inc	Bank of America	
(26.084)	Summit Materials Inc 'A'	Credit Suisse	42.517			Merrill Lynch	1.149
(65.958)	Summit Materials Inc 'A'	Deutsche Bank	92.341	(16.685)	T-Mobile US Inc	JP Morgan	10.513
(1.968)	Sun Communities Inc (Reit)	Bank of America		(9.243)	T-Mobile US Inc	Deutsche Bank	5.176
		Merrill Lynch	(8.154)	(7.587)	Tableau Software Inc 'A'	Citibank	(37.707)
(11.865)	Sun Communities Inc (Reit)	JP Morgan	(23.730)	(2.052)	Tableau Software Inc 'A'	Deutsche Bank	(13.851)
(12.613)	Sun Communities Inc (Reit)	Deutsche Bank	(46.164)	(6.798)	Take-Two Interactive		
(4.616)	Sunstone Hotel				Software Inc	Citibank	8.701
	Investors Inc (Reit)	JP Morgan	(4.801)	(15.834)	Tanger Factory Outlet		
(8.483)	Sunstone Hotel	Bank of America			Centers Inc (Reit)	Citibank	(13.301)
	Investors Inc (Reit)	Merrill Lynch	(10.434)	(6.990)	Tanger Factory Outlet		
31.530	SunTrust Banks Inc	Credit Suisse	(24.147)		Centers Inc (Reit)	Deutsche Bank	(10.904)
24.762	SunTrust Banks Inc	Bank of America		7.364	Tapestry Inc	Deutsche Bank	(10.015)
		Merrill Lynch	(50.019)	(125.543)	Targa Resources Corp	Bank of America	
5.084	SunTrust Banks Inc	Citibank	(11.846)			Merrill Lynch	75.814
7.953	SunTrust Banks Inc	JP Morgan	(15.996)	(7.242)	Targa Resources Corp	Citibank	3.331
8.185	SunTrust Banks Inc	Deutsche Bank	(16.534)	(37.146)	Targa Resources Corp	Credit Suisse	(24.888)
(722)	SVB Financial Group	Bank of America		(70.518)	Targa Resources Corp	JP Morgan	(16.610)
		Merrill Lynch	7.181	(43.717)	Targa Resources Corp	Deutsche Bank	27.979
(1.580)	SVB Financial Group	Credit Suisse	1.715	16.542	Target Corp	Credit Suisse	62.627
(123.342)	Symantec Corp	Citibank	46.870	19.181	Target Corp	Deutsche Bank	3.644
(49.125)	Symantec Corp	Deutsche Bank	65.827	6.201	Target Corp	Bank of America	
(33.569)	Symantec Corp	Bank of America				Merrill Lynch	1.178
		Merrill Lynch	13.871	948	Target Corp	JP Morgan	3.650
(67.082)	Symantec Corp	JP Morgan	510.494	47.845	Target Corp	Citibank	(105.259)
(42.143)	Symantec Corp	Credit Suisse	320.708	(7.179)	Taubman Centers Inc (Reit)	Citibank	(11.845)
(1.872)	Synchrony Financial	Credit Suisse	(2.920)	(4.469)	Taubman Centers Inc (Reit)	Bank of America	
(26.493)	Synchrony Financial	JP Morgan	(41.329)			Merrill Lynch	(6.748)
(26.564)	Synchrony Financial	Citibank	39.049	(14.286)	Taubman Centers Inc (Reit)	Credit Suisse	26.286
(30.231)	Synchrony Financial	Deutsche Bank	(12.999)	(1.947)	Taubman Centers Inc (Reit)	Deutsche Bank	(2.940)
(1.919)	Syneos Health Inc	Bank of America		(15.813)	Taubman Centers Inc (Reit)	JP Morgan	29.096
		Merrill Lynch	(5.277)	28.925	TCF Financial Corp	Bank of America	
(46.349)	Syneos Health Inc	Credit Suisse	(128.436)			Merrill Lynch	18.801
(26.634)	Syneos Health Inc	Deutsche Bank	(73.244)	40.963	TCF Financial Corp	Citibank	3.687
(85.163)	Syneos Health Inc	JP Morgan	(336.394)	14.503	TCF Financial Corp	JP Morgan	9.744
(5.678)	SYNNEX Corp	Credit Suisse	(7.949)	6.742	TCF Financial Corp	Credit Suisse	7.012
(17.776)	SYNNEX Corp	Deutsche Bank	(2.844)	10.688	TCF Financial Corp	Deutsche Bank	6.947
(9.718)	SYNNEX Corp	Bank of America		18.183	TD Ameritrade Holding Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.555)			Merrill Lynch	(26.729)
(3.092)	SYNNEX Corp	Citibank	(2.659)	30.971	TD Ameritrade Holding Corp	Citibank	(64.729)
(4.120)	SYNNEX Corp	JP Morgan	(5.768)	12.271	TD Ameritrade Holding Corp	JP Morgan	(24.378)
15.980	Synopsys Inc	Citibank	(14.222)	19.518	TD Ameritrade Holding Corp	Deutsche Bank	(28.691)
14.836	Synopsys Inc	JP Morgan	(9.940)	8.108	TD Ameritrade Holding Corp	Credit Suisse	(11.189)
				2.078	TE Connectivity Ltd	Citibank	(1.808)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
10.650	TE Connectivity Ltd	JP Morgan	10.774	(20.141)	Tesla Inc	Deutsche Bank	(82.175)
7.169	TE Connectivity Ltd	Credit Suisse	8.029	11.484	Tetra Tech Inc	Citibank	17.226
3.115	TE Connectivity Ltd	Bank of America		(2.816)	Texas Capital Bancshares Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.617)			Merrill Lynch	10.842
9.789	TE Connectivity Ltd	Deutsche Bank	(8.223)	(1.386)	Texas Capital Bancshares Inc	Citibank	3.812
868	Tech Data Corp	Credit Suisse	10.546	(5.068)	Texas Capital Bancshares Inc	JP Morgan	14.190
30.325	Tech Data Corp	Bank of America		(7.947)	Texas Capital Bancshares Inc	Credit Suisse	22.252
		Merrill Lynch	320.996	(5.088)	Texas Capital Bancshares Inc	Deutsche Bank	19.589
23.709	Tech Data Corp	Citibank	226.421	13.127	Texas Instruments Inc	Bank of America	
3.448	Tech Data Corp	JP Morgan	41.893			Merrill Lynch	44.107
21.924	Tech Data Corp	Deutsche Bank	238.972	11.963	Texas Instruments Inc	JP Morgan	85.057
6.275	TechnipFMC Plc	Bank of America		16.149	Texas Instruments Inc	Citibank	27.615
		Merrill Lynch	(4.330)	3.529	Texas Instruments Inc	Credit Suisse	12.062
12.708	TechnipFMC Plc	Deutsche Bank	(8.769)	18.530	Texas Instruments Inc	Deutsche Bank	62.261
62.600	Tegna Inc	Credit Suisse	(9.390)	1.089	Texas Roadhouse Inc	Credit Suisse	(1.372)
18.212	Tegna Inc	Bank of America		28.694	Texas Roadhouse Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(6.192)			Merrill Lynch	88.091
25.792	Tegna Inc	Citibank	(13.412)	5.702	Texas Roadhouse Inc	Deutsche Bank	17.505
43.847	Tegna Inc	JP Morgan	(6.577)	(11.625)	TFS Financial Corp	Bank of America	
6.731	Tegna Inc	Deutsche Bank	(2.289)			Merrill Lynch	(9.009)
(1.210)	Teledyne Technologies Inc	Bank of America		(504)	TFS Financial Corp	Citibank	(234)
		Merrill Lynch	(9.728)	(5.518)	TFS Financial Corp	JP Morgan	(3.890)
(2.518)	Teledyne Technologies Inc	Citibank	(17.802)	(17.603)	TFS Financial Corp	Credit Suisse	(12.410)
(3.744)	Teledyne Technologies Inc	Credit Suisse	(24.898)	(15.106)	TFS Financial Corp	Deutsche Bank	(11.707)
(1.020)	Teledyne Technologies Inc	JP Morgan	(6.783)	844	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America	
(1.496)	Teleflex Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(554)
		Merrill Lynch	(13.703)	5.201	Thermo Fisher Scientific Inc	JP Morgan	11.702
(2.087)	Teleflex Inc	Credit Suisse	(18.175)	1.383	Thermo Fisher Scientific Inc	Citibank	(10.428)
(1.223)	Teleflex Inc	Deutsche Bank	(7.164)	1.592	Thor Industries Inc	Citibank	(15.331)
(1.562)	Teleflex Inc	Citibank	(9.872)	1.757	Thor Industries Inc	JP Morgan	(11.789)
31.099	Telephone & Data Systems Inc	Bank of America		443	Thor Industries Inc	Credit Suisse	(2.973)
		Merrill Lynch	(12.129)	6.980	Thor Industries Inc	Bank of America	
10.005	Telephone & Data Systems Inc	Citibank	(8.804)			Merrill Lynch	(53.683)
81.799	Telephone & Data Systems Inc	JP Morgan	(35.572)	21.194	Tiffany & Co	Deutsche Bank	625.905
44.514	Telephone & Data Systems Inc	Credit Suisse	(29.766)	194	Time Warner Inc	JP Morgan	188
17.129	Telephone & Data Systems Inc	Deutsche Bank	(6.680)	28.213	Timken Co/The	Bank of America	
(5.542)	Tempur Sealy International Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(35.898)
		Merrill Lynch	15.241	22.866	Timken Co/The	Citibank	(41.159)
(14.360)	Tempur Sealy International Inc	Deutsche Bank	39.490	14.080	Timken Co/The	JP Morgan	(7.744)
20.670	Tenet Healthcare Corp	Credit Suisse	89.030	1.084	Timken Co/The	Credit Suisse	(596)
9.186	Tenet Healthcare Corp	JP Morgan	22.993	5.328	Timken Co/The	Deutsche Bank	(5.062)
10.229	Tenet Healthcare Corp	Deutsche Bank	28.743	4.462	TJX Cos Inc/The	Credit Suisse	34.045
54.049	Tenneco Inc	Bank of America		2.626	TJX Cos Inc/The	JP Morgan	20.036
		Merrill Lynch	(164.945)	22.193	TJX Cos Inc/The	Bank of America	
11.302	Tenneco Inc	Citibank	(36.958)			Merrill Lynch	103.076
7.804	Tenneco Inc	JP Morgan	(12.252)	8.377	TJX Cos Inc/The	Citibank	23.121
50.175	Tenneco Inc	Credit Suisse	(106.353)	16.024	Toll Brothers Inc	Bank of America	
47.745	Tenneco Inc	Deutsche Bank	(122.705)			Merrill Lynch	(20.030)
37.225	Teradata Corp	Bank of America		8.991	Toll Brothers Inc	Credit Suisse	(35.694)
		Merrill Lynch	63.282	9.438	Toll Brothers Inc	Citibank	1.699
22.777	Teradata Corp	Citibank	31.888	14.574	Toll Brothers Inc	Deutsche Bank	(18.218)
27.905	Teradata Corp	JP Morgan	12.557	22.914	Toll Brothers Inc	JP Morgan	(90.969)
19.241	Teradata Corp	Credit Suisse	16.920	15.397	Torchmark Corp	Bank of America	
8.975	Teradata Corp	Deutsche Bank	15.258			Merrill Lynch	(8.930)
7.872	Teradyne Inc	Bank of America		7.679	Torchmark Corp	Citibank	(20.580)
		Merrill Lynch	23.380	14.398	Torchmark Corp	JP Morgan	(12.284)
17.613	Teradyne Inc	Citibank	9.159	11.774	Torchmark Corp	Credit Suisse	(8.595)
27.271	Teradyne Inc	JP Morgan	60.661	33.993	Torchmark Corp	Deutsche Bank	(32.823)
69.637	Teradyne Inc	Credit Suisse	161.975	16.839	Toro Co/The	Bank of America	
34.568	Teradyne Inc	Deutsche Bank	102.667			Merrill Lynch	25.427
(12.621)	TESARO Inc	Citibank	53.513	26.419	Toro Co/The	Citibank	(17.701)
(1.270)	TESARO Inc	JP Morgan	1.486	111.717	Toro Co/The	JP Morgan	20.284
(24.171)	TESARO Inc	Bank of America		77.579	Toro Co/The	Credit Suisse	(11.281)
		Merrill Lynch	84.446	22.417	Toro Co/The	Deutsche Bank	33.850
(113.231)	TESARO Inc	Deutsche Bank	267.225	12.623	Total System Services Inc	JP Morgan	(9.972)
(7.749)	Tesla Inc	Citibank	(102.674)	4.222	Total System Services Inc	Credit Suisse	(3.335)
(25.042)	Tesla Inc	JP Morgan	(49.457)	36.412	Tractor Supply Co	Credit Suisse	289.279
(10.334)	Tesla Inc	Bank of America		14.921	Tractor Supply Co	Deutsche Bank	62.967
		Merrill Lynch	(42.163)	(2.369)	TransDigm Group Inc	Bank of America	
(3.269)	Tesla Inc	Credit Suisse	44.818			Merrill Lynch	(26.130)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(4.966)	TransDigm Group Inc	Citibank	(43.006)	3.461	Trustmark Corp	Bank of America	
(1.807)	TransDigm Group Inc	JP Morgan	(8.186)			Merrill Lynch	173
(1.976)	TransDigm Group Inc	Credit Suisse	(12.285)	3.246	Trustmark Corp	Citibank	(1.818)
(2.729)	TransDigm Group Inc	Deutsche Bank	(30.101)	5.932	Trustmark Corp	Deutsche Bank	297
47.782	Transocean Ltd	Bank of America		3.897	TTEC Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(47.782)			Merrill Lynch	13.640
97.983	Transocean Ltd	Citibank	(113.660)	3.797	TTEC Holdings Inc	Credit Suisse	14.808
30.123	Transocean Ltd	JP Morgan	(602)	21.396	TTEC Holdings Inc	Citibank	28.885
12.782	Transocean Ltd	Credit Suisse	(256)	3.792	TTEC Holdings Inc	Deutsche Bank	13.272
32.332	Transocean Ltd	Deutsche Bank	(32.332)	10.478	TTEC Holdings Inc	JP Morgan	40.864
(10.822)	TransUnion	Bank of America		18.095	Tupperware Brands Corp	Citibank	(28.047)
		Merrill Lynch	3.679	12.230	Tupperware Brands Corp	JP Morgan	489
(8.148)	TransUnion	Citibank	(5.704)	44.519	Tupperware Brands Corp	Bank of America	
(13.042)	TransUnion	Deutsche Bank	329			Merrill Lynch	(21.369)
1.786	Travelers Cos Inc/The	Bank of America		19.324	Tupperware Brands Corp	Credit Suisse	773
		Merrill Lynch	(5.720)	12.542	Tupperware Brands Corp	Deutsche Bank	(6.020)
9.468	Travelers Cos Inc/The	Citibank	(30.771)	(68.233)	Twitter Inc	Bank of America	
8.170	Travelers Cos Inc/The	Deutsche Bank	(13.807)			Merrill Lynch	(127.596)
(11.310)	TreeHouse Foods Inc	Citibank	(7.804)	(60.824)	Twitter Inc	Citibank	(107.050)
(31.201)	TreeHouse Foods Inc	JP Morgan	(72.386)	(15.579)	Twitter Inc	Deutsche Bank	(24.657)
(16.634)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America		5.219	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	(8.675)			Merrill Lynch	574
(11.138)	TreeHouse Foods Inc	Deutsche Bank	(7.685)	3.544	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Credit Suisse	1.311
(38.531)	TreeHouse Foods Inc	Credit Suisse	(77.850)				
13.131	Trex Co Inc	Bank of America		1.836	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Deutsche Bank	202
		Merrill Lynch	105.048	8.900	Two Harbors Investment Corp (Reit)	JP Morgan	3.293
2.244	Trex Co Inc	Citibank	9.784	38.508	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Citibank	2.310
(235.928)	TRI Pointe Group Inc	Bank of America		(12.840)	Tyler Technologies Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(374.189)			Merrill Lynch	(316.763)
(60.383)	TRI Pointe Group Inc	Citibank	(56.156)	(2.664)	Tyler Technologies Inc	Citibank	(17.103)
(33.671)	TRI Pointe Group Inc	Credit Suisse	3.367	(400)	Tyler Technologies Inc	Deutsche Bank	(1.564)
(59.038)	TRI Pointe Group Inc	Deutsche Bank	(79.166)	(9.923)	Tyler Technologies Inc	Credit Suisse	(66.087)
(61.034)	TRI Pointe Group Inc	JP Morgan	6.103	5.654	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America	
(8.128)	Tribune Media Co 'A'	Bank of America				Merrill Lynch	8.311
		Merrill Lynch	12.436	27.003	Tyson Foods Inc 'A'	JP Morgan	29.139
(4.958)	Tribune Media Co 'A'	Citibank	5.355	31.365	Tyson Foods Inc 'A'	Credit Suisse	65.553
(24.813)	Trimble Inc	Bank of America		19.148	Tyson Foods Inc 'A'	Citibank	16.659
		Merrill Lynch	15.880	12.033	Tyson Foods Inc 'A'	Deutsche Bank	17.689
(14.568)	Trimble Inc	Citibank	10.052	6.370	Ubiquiti Networks Inc	JP Morgan	67.203
(11.981)	Trimble Inc	JP Morgan	10.911	4.313	Ubiquiti Networks Inc	Citibank	17.425
(20.759)	Trimble Inc	Credit Suisse	23.354	26.258	UDR Inc (Reit)	JP Morgan	3.414
(9.890)	Trimble Inc	Deutsche Bank	7.108	31.036	UDR Inc (Reit)	Bank of America	
7.400	TriNet Group Inc	Bank of America				Merrill Lynch	33.209
		Merrill Lynch	10.804	11.219	UDR Inc (Reit)	Citibank	13.463
14.748	TriNet Group Inc	Citibank	25.514	9.845	UDR Inc (Reit)	Deutsche Bank	10.534
26.481	TriNet Group Inc	Deutsche Bank	38.662	47.988	UGI Corp	Bank of America	
18.889	TriNet Group Inc	JP Morgan	33.056			Merrill Lynch	54.989
11.287	TriNet Group Inc	Credit Suisse	10.991	4.410	UGI Corp	Citibank	5.865
(19.637)	Trinity Industries Inc	Citibank	4.124	17.521	UGI Corp	JP Morgan	27.943
(18.298)	Trinity Industries Inc	JP Morgan	19.884	958	UGI Corp	Credit Suisse	2.079
(8.132)	Trinity Industries Inc	Credit Suisse	(11.134)	23.569	UGI Corp	Deutsche Bank	26.162
(24.574)	Trinity Industries Inc	Deutsche Bank	13.270	(6.745)	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Bank of America	
31.851	Trinseo SA	Credit Suisse	(66.978)			Merrill Lynch	(135)
25.111	Trinseo SA	Bank of America		(1.328)	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	JP Morgan	(1.567)
		Merrill Lynch	(71.290)	(2.200)	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Citibank	5.016
32.560	Trinseo SA	Deutsche Bank	(78.144)	(5.749)	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Deutsche Bank	(115)
3.444	Trinseo SA	Citibank	(11.537)	(2.181)	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Credit Suisse	113
38.270	Trinseo SA	JP Morgan	(104.448)	(3.831)	Ultimate Software Group Inc/The	Credit Suisse	(32.985)
(4.774)	TripAdvisor Inc	Bank of America		(1.895)	Ultimate Software Group Inc/The	Deutsche Bank	(10.214)
		Merrill Lynch	(12.938)	(3.965)	Ultimate Software Group Inc/The	Bank of America	
(41.260)	TripAdvisor Inc	Citibank	(118.004)			Merrill Lynch	(19.119)
(5.279)	Triton International Ltd/Bermuda						
(7.614)	Triton International Ltd/Bermuda	Deutsche Bank	2.933				
(34.298)	Triton International Ltd/Bermuda	Credit Suisse	(4.873)				
(17.500)	Triton International Ltd/Bermuda	Citibank	14.405				
1.950	Trustmark Corp	JP Morgan	(11.200)				
		JP Morgan	429				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(2.455)	Ultimate Software Group Inc/The	Citibank	(18.044)	5.409	United Therapeutics Corp	Deutsche Bank	595
(5.446)	Ultimate Software Group Inc/The	JP Morgan	(46.890)	9.845	UnitedHealth Group Inc	JP Morgan	112.331
(25.698)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	JP Morgan	(360.286)	1.531	UnitedHealth Group Inc	Citibank	(2.664)
(16.377)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Credit Suisse	(229.606)	4.298	UnitedHealth Group Inc	Bank of America	
(19.052)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Citibank	(145.557)			Merrill Lynch	16.934
(60.828)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Deutsche Bank	(546.309)	2.842	UnitedHealth Group Inc	Credit Suisse	32.427
(339)	UMB Financial Corp	JP Morgan	251	4.061	UnitedHealth Group Inc	Deutsche Bank	16.000
(6.115)	UMB Financial Corp	Deutsche Bank	11.190	(12.162)	Uniti Group Inc (Reit)	Credit Suisse	(21.648)
(22.340)	Umpqua Holdings Corp	Citibank	4.915	(58.078)	Uniti Group Inc (Reit)	Citibank	(41.235)
(22.809)	Umpqua Holdings Corp	Credit Suisse	(1.597)	(70.419)	Uniti Group Inc (Reit)	Bank of America	
(6.500)	Umpqua Holdings Corp	Deutsche Bank	325			Merrill Lynch	(59.152)
(17.321)	Umpqua Holdings Corp	JP Morgan	(1.212)	(12.065)	Uniti Group Inc (Reit)	JP Morgan	(21.476)
(216.537)	Under Armour Inc 'A'	JP Morgan	(684.257)	(120.497)	Uniti Group Inc (Reit)	Deutsche Bank	(101.217)
(21.630)	Under Armour Inc 'A'	Credit Suisse	(68.351)	(16.007)	Univar Inc	Deutsche Bank	(6.403)
(1.166)	Under Armour Inc 'A'	Bank of America		(39.098)	Univar Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(3.032)			Merrill Lynch	(15.639)
(103.189)	Under Armour Inc 'A'	Deutsche Bank	(268.291)	(16.917)	Univar Inc	Citibank	5.583
(6.196)	Under Armour Inc 'C'	Bank of America		(7.739)	Universal Display Corp	Credit Suisse	15.091
		Merrill Lynch	(13.136)	(10.160)	Universal Display Corp	Deutsche Bank	17.780
(16.611)	Under Armour Inc 'C'	Citibank	(23.920)	(6.107)	Universal Display Corp	Bank of America	
(125.186)	Under Armour Inc 'C'	JP Morgan	(343.010)			Merrill Lynch	19.312
(77.915)	Under Armour Inc 'C'	Credit Suisse	(173.294)	(14.866)	Universal Display Corp	Citibank	8.920
(97.848)	Under Armour Inc 'C'	Deutsche Bank	(207.438)	(8.565)	Universal Display Corp	JP Morgan	11.296
(5.960)	Union Pacific Corp	Bank of America		1.162	Universal Health Services Inc 'B'		
		Merrill Lynch	(28.906)	8.094	Universal Health Services Inc 'B'	Credit Suisse	395
(20.167)	Union Pacific Corp	Citibank	(44.771)				
(10.831)	Union Pacific Corp	Credit Suisse	(87.190)	3.736	Universal Health Services Inc 'B'	Citibank	(19.426)
(4.256)	Union Pacific Corp	JP Morgan	(21.853)			JP Morgan	(7.769)
(32.725)	United Bankshares Inc/WV	Citibank	9.818	4.235	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America	
(71.628)	United Bankshares Inc/WV	Bank of America		93.563	Unum Group	Merrill Lynch	(4.743)
		Merrill Lynch	(88.986)			Bank of America	
(1.448)	United Bankshares Inc/WV	JP Morgan	(2.896)	41.827	Unum Group	Merrill Lynch	(43.047)
(66.431)	United Bankshares Inc/WV	Credit Suisse	(96.901)	6.551	Unum Group	Citibank	(44.337)
(44.434)	United Bankshares Inc/WV	Deutsche Bank	(57.764)	7.051	Unum Group	JP Morgan	(1.572)
2.344	United Continental Holdings Inc	Bank of America		19.093	Unum Group	Credit Suisse	(1.692)
		Merrill Lynch	2.977	25.041	Urban Edge Properties (Reit)	Deutsche Bank	(1.909)
3.405	United Continental Holdings Inc	JP Morgan	5.380	8.013	Urban Edge Properties (Reit)	Citibank	27.295
14.806	United Continental Holdings Inc	Credit Suisse	23.998	20.428	Urban Outfitters Inc	Credit Suisse	7.051
8.387	United Natural Foods Inc	Bank of America		4.631	Urban Outfitters Inc	Citibank	8.580
		Merrill Lynch	5.619			Bank of America	
5.348	United Natural Foods Inc	Deutsche Bank	3.583	32.402	Urban Outfitters Inc	Merrill Lynch	1.216
10.824	United Natural Foods Inc	JP Morgan	21.215	19.797	Urban Outfitters Inc	JP Morgan	77.131
(8.937)	United Parcel Service Inc 'B'	Credit Suisse	(49.666)	20.832	Urban Outfitters Inc	Credit Suisse	51.868
(5.450)	United Parcel Service Inc 'B'	JP Morgan	(2.268)	16.893	US Bancorp	Deutsche Bank	17.291
4.582	United Rentals Inc	Credit Suisse	(34.946)	28.749	US Bancorp	Credit Suisse	(16.217)
6.262	United Rentals Inc	Bank of America		36.019	US Foods Holding Corp	Deutsche Bank	(50.311)
		Merrill Lynch	(29.619)			Bank of America	
4.989	United Rentals Inc	Citibank	(29.734)	8.670	US Foods Holding Corp	Merrill Lynch	35.299
4.295	United Rentals Inc	JP Morgan	6.400	47.740	US Foods Holding Corp	Credit Suisse	23.322
448	United Rentals Inc	Deutsche Bank	(2.119)	17.563	US Foods Holding Corp	JP Morgan	68.508
18.374	United States Cellular Corp	Bank of America		17.332	US Foods Holding Corp	Citibank	8.957
		Merrill Lynch	(24.621)	(30.722)	US Silica Holdings Inc	Deutsche Bank	16.985
8.158	United States Cellular Corp	Citibank	(9.871)	(57.554)	US Silica Holdings Inc	JP Morgan	(307)
12.254	United States Cellular Corp	JP Morgan	(15.195)	(58.714)	US Silica Holdings Inc	Citibank	65.612
21.851	United States Cellular Corp	Credit Suisse	(27.095)	(18.855)	US Silica Holdings Inc	Deutsche Bank	34.641
19.934	United States Cellular Corp	Deutsche Bank	(26.712)			Bank of America	
20.096	United States Steel Corp	Bank of America		(52.021)	US Silica Holdings Inc	Merrill Lynch	11.124
		Merrill Lynch	29.736	(41.004)	USG Corp	Credit Suisse	15.557
(22.146)	United Technologies Corp	Bank of America				Bank of America	
		Merrill Lynch	(18.160)	(5.169)	USG Corp	Merrill Lynch	(4.477)
(16.235)	United Technologies Corp	Citibank	40.587	(6.634)	USG Corp	Citibank	(310)
(46.608)	United Technologies Corp	Deutsche Bank	(38.219)	(25.413)	USG Corp	Credit Suisse	(495)
20.161	United Therapeutics Corp	Bank of America		(14.092)	USG Corp	Deutsche Bank	(3.304)
		Merrill Lynch	(13.050)	(2.997)	Vail Resorts Inc	JP Morgan	6.060
7.712	United Therapeutics Corp	Citibank	16.041			Bank of America	
7.811	United Therapeutics Corp	JP Morgan	40.852	(7.397)	Vail Resorts Inc	Merrill Lynch	(19.660)
30.924	United Therapeutics Corp	Credit Suisse	139.130	(3.494)	Vail Resorts Inc	Citibank	(41.867)
				(1.427)	Vail Resorts Inc	Credit Suisse	(42.180)
				(5.091)	Vail Resorts Inc	Deutsche Bank	(9.361)
						JP Morgan	(71.987)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
33.147	Valero Energy Corp	Deutsche Bank	268.491	54.580	VeriSign Inc	Citibank	175.748
2.906	Valero Energy Corp	Credit Suisse	10.134	27.897	VeriSign Inc	JP Morgan	205.728
97.730	Valero Energy Corp	Bank of America		(11.197)	Verisk Analytics Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	794.150			Merrill Lynch	(20.602)
37.735	Valero Energy Corp	JP Morgan	407.915	(23.899)	Verisk Analytics Inc	JP Morgan	(77.911)
(52.088)	Valley National Bancorp	Bank of America		(19.777)	Verisk Analytics Inc	Citibank	(24.326)
		Merrill Lynch	1.668	(16.698)	Verisk Analytics Inc	Credit Suisse	(43.770)
(8.197)	Valley National Bancorp	Citibank	1.721	(11.268)	Verisk Analytics Inc	Deutsche Bank	(20.733)
(34.163)	Valley National Bancorp	Credit Suisse	5.087	6.732	Verizon Communications Inc	Citibank	(4.847)
(1.505)	Valley National Bancorp	JP Morgan	—	66.078	Verizon Communications Inc	Bank of America	
(86.748)	Valley National Bancorp	Deutsche Bank	7.807			Merrill Lynch	17.397
(1.915)	Valmont Industries Inc	Credit Suisse	(634)	883	Versum Materials Inc	Citibank	1.174
(3.140)	Valmont Industries Inc	JP Morgan	(7.335)	38.163	Versum Materials Inc	JP Morgan	120.213
(1.612)	Valmont Industries Inc	Bank of America		11.008	Vertex Pharmaceuticals Inc	Citibank	6.495
		Merrill Lynch	(4.997)	2.851	Vertex Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	5.389
(1.659)	Valmont Industries Inc	Citibank	(1.078)	2.994	Vertex Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	25.297
(34.650)	Valvoline Inc	JP Morgan	22.869	17.514	VF Corp	Credit Suisse	62.263
(54.019)	Valvoline Inc	Bank of America		3.236	VF Corp	Deutsche Bank	9.967
		Merrill Lynch	14.094	17.272	Viacom Inc 'B'	Credit Suisse	(19.206)
(62.624)	Valvoline Inc	Credit Suisse	36.206	8.035	Viacom Inc 'B'	Deutsche Bank	(10.204)
(58.119)	Valvoline Inc	Citibank	31.965	(1.750)	ViaSat Inc	Bank of America	
(63.169)	Valvoline Inc	Deutsche Bank	6.949			Merrill Lynch	(2.083)
4.507	Varian Medical Systems Inc	Bank of America		(8.105)	ViaSat Inc	JP Morgan	1.459
		Merrill Lynch	6.175	(28.538)	ViaSat Inc	Citibank	(50.798)
1.858	Varian Medical Systems Inc	Citibank	(409)	(51.526)	ViaSat Inc	Credit Suisse	(15.997)
10.605	Varian Medical Systems Inc	JP Morgan	17.180	(87.072)	ViaSat Inc	Deutsche Bank	(103.616)
1.659	Varian Medical Systems Inc	Deutsche Bank	2.273	(175.622)	Viavi Solutions Inc	Bank of America	
1.548	Varian Medical Systems Inc	Credit Suisse	2.508			Merrill Lynch	43.905
13.098	Vector Group Ltd	Bank of America		(21.099)	Viavi Solutions Inc	Citibank	9.495
		Merrill Lynch	(131)	(15.072)	Viavi Solutions Inc	Deutsche Bank	3.768
12.887	Vector Group Ltd	JP Morgan	(5.541)	30.504	Visa Inc 'A'	Credit Suisse	26.233
37.557	Vector Group Ltd	Credit Suisse	(16.150)	10.876	Visa Inc 'A'	Deutsche Bank	(3.698)
19.341	Vector Group Ltd	Citibank	7.156	14.268	Visa Inc 'A'	Citibank	713
10.880	Vector Group Ltd	Deutsche Bank	(109)	125.738	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America	
6.398	Vectren Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(25.148)
		Merrill Lynch	7.230	117.037	Vishay Intertechnology Inc	Citibank	35.111
6.750	Vectren Corp	Citibank	7.425	74.969	Vishay Intertechnology Inc	JP Morgan	89.963
2.027	Vectren Corp	JP Morgan	1.074	69.261	Vishay Intertechnology Inc	Credit Suisse	35.642
24.475	Vectren Corp	Credit Suisse	12.972	39.673	Vishay Intertechnology Inc	Deutsche Bank	(7.935)
(8.470)	Veeva Systems Inc 'A'	Deutsche Bank	(15.415)	7.867	Visteon Corp	Bank of America	
(2.988)	Veeva Systems Inc 'A'	Citibank	(6.245)			Merrill Lynch	(37.880)
(14.876)	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America		19.090	Visteon Corp	Citibank	(126.471)
		Merrill Lynch	(27.074)	5.711	Visteon Corp	JP Morgan	1.913
(6.679)	Ventas Inc (Reit)	Citibank	(12.156)	3.935	Visteon Corp	Credit Suisse	1.318
(14.575)	Ventas Inc (Reit)	Credit Suisse	(32.754)	5.182	Visteon Corp	Deutsche Bank	(24.951)
(19.602)	Ventas Inc (Reit)	Bank of America		42.841	Vistra Energy Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(43.908)			Merrill Lynch	56.122
(7.643)	Ventas Inc (Reit)	Deutsche Bank	(15.563)	22.484	Vistra Energy Corp	Deutsche Bank	29.454
(7.784)	Ventas Inc (Reit)	JP Morgan	(12.921)	22.952	Vistra Energy Corp	Credit Suisse	27.926
(15.312)	VEREIT Inc (Reit)	Citibank	(2.603)	18.012	VMware Inc 'A'	Credit Suisse	41.604
(122.064)	VEREIT Inc (Reit)	JP Morgan	(26.854)	27.102	VMware Inc 'A'	Citibank	59.624
(66.779)	VEREIT Inc (Reit)	Bank of America		5.287	VMware Inc 'A'	JP Morgan	13.218
		Merrill Lynch	(9.349)	3.305	VMware Inc 'A'	Bank of America	
(52.215)	VEREIT Inc (Reit)	Credit Suisse	(11.487)			Merrill Lynch	(6.941)
(168.256)	VEREIT Inc (Reit)	Deutsche Bank	(23.556)	16.581	VMware Inc 'A'	Deutsche Bank	(34.820)
(10.161)	VeriFone Systems Inc	Citibank	1.016	(2.152)	Vornado Realty Trust (Reit)	Citibank	(4.347)
(54.433)	VeriFone Systems Inc	Bank of America		(37.095)	Vornado Realty Trust (Reit)	Deutsche Bank	(74.362)
		Merrill Lynch	3.810	(4.906)	Vornado Realty Trust (Reit)	Bank of America	
(12.977)	VeriFone Systems Inc	JP Morgan	2.855			Merrill Lynch	(9.812)
(18.021)	VeriFone Systems Inc	Credit Suisse	3.965	(33.883)	Vornado Realty Trust (Reit)	JP Morgan	(24.506)
(8.701)	VeriFone Systems Inc	Deutsche Bank	609	(24.087)	Voya Financial Inc	Deutsche Bank	32.517
(4.620)	Verint Systems Inc	Bank of America		(6.911)	Voya Financial Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.158)			Merrill Lynch	9.330
(5.156)	Verint Systems Inc	Citibank	(2.836)	(18.342)	Vulcan Materials Co	Bank of America	
(13.043)	Verint Systems Inc	Credit Suisse	(12.095)			Merrill Lynch	(6.467)
(883)	Verint Systems Inc	Deutsche Bank	(795)	(13.493)	Vulcan Materials Co	Citibank	(3.103)
(5.632)	Verint Systems Inc	JP Morgan	(2.869)	(16.298)	Vulcan Materials Co	JP Morgan	(19.227)
31	VeriSign Inc	Credit Suisse	260	(33.637)	Vulcan Materials Co	Credit Suisse	(57.183)
6.322	VeriSign Inc	Deutsche Bank	27.817	(4.799)	Vulcan Materials Co	Deutsche Bank	(5.231)
11.249	VeriSign Inc	Bank of America		5.595	WABCO Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	49.496			Merrill Lynch	(35.920)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
5.841	WABCO Holdings Inc	JP Morgan	(48.162)	(4.898)	Webster Financial Corp	Citibank	7.690
1.892	WABCO Holdings Inc	Deutsche Bank	(12.147)	(4.085)	Webster Financial Corp	Bank of America	
4.907	WABCO Holdings Inc	Citibank	(35.968)			Merrill Lynch	(123)
(34.847)	Wabtec Corp/DE	Credit Suisse	(125.944)	(525)	Webster Financial Corp	Deutsche Bank	(16)
(6.627)	Wabtec Corp/DE	Bank of America		(6.634)	WEC Energy Group Inc	Citibank	(18.044)
		Merrill Lynch	(30.683)	(4.280)	WEC Energy Group Inc	Bank of America	
(81.819)	Wabtec Corp/DE	Deutsche Bank	(378.822)			Merrill Lynch	(7.790)
(15.513)	Wabtec Corp/DE	Citibank	(5.430)	(18.936)	WEC Energy Group Inc	JP Morgan	(19.125)
(2.473)	Wabtec Corp/DE	JP Morgan	(14.195)	(4.613)	WEC Energy Group Inc	Deutsche Bank	(8.396)
9.761	Waddell & Reed Financial Inc 'A'			(8.465)	Weight Watchers International Inc		
		Citibank	(3.124)			Deutsche Bank	30.728
18.537	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Deutsche Bank	9.639	17.776	Weingarten Realty Investors (Reit)	Bank of America	
15.639	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Bank of America		34.838	Weingarten Realty Investors (Reit)	Merrill Lynch	36.796
(22.024)	WageWorks Inc	Merrill Lynch	8.132			Citibank	35.535
		Bank of America		2.231	Weingarten Realty Investors (Reit)	JP Morgan	3.904
10.646	Walgreens Boots Alliance Inc	Merrill Lynch	(62.768)				
16.087	Walgreens Boots Alliance Inc	Citibank	(15.437)	30.582	Weingarten Realty Investors (Reit)	Deutsche Bank	63.305
19.553	Walgreens Boots Alliance Inc	Credit Suisse	(9.454)				
11.752	Walgreens Boots Alliance Inc	Deutsche Bank	(35.782)	10.776	Weingarten Realty Investors (Reit)	Credit Suisse	18.858
		Bank of America		(107.089)	Welbilt Inc	Deutsche Bank	(39.781)
34.049	Walgreens Boots Alliance Inc	Merrill Lynch	(21.506)	(103.810)	Welbilt Inc	Bank of America	
9.497	Walmart Inc	JP Morgan	(49.028)			Merrill Lynch	(51.905)
25.029	Walmart Inc	Credit Suisse	(21.273)	(10.276)	Welbilt Inc	Citibank	411
25.782	Walmart Inc	JP Morgan	(56.008)	(58.321)	Welbilt Inc	JP Morgan	(35.576)
5.053	Walmart Inc	Citibank	3.352	(33.837)	Welbilt Inc	Credit Suisse	(20.641)
(11.846)	Walt Disney Co/The	Deutsche Bank	(597)	13.782	WellCare Health Plans Inc	Bank of America	
(3.073)	Walt Disney Co/The	Deutsche Bank	36.960			Merrill Lynch	117.974
(15.447)	Walt Disney Co/The	Citibank	13.122	10.813	WellCare Health Plans Inc	Citibank	80.449
(9.147)	Walt Disney Co/The	JP Morgan	30.740	14.511	WellCare Health Plans Inc	JP Morgan	137.274
16.170	Washington Federal Inc	Credit Suisse	42.933	2.335	WellCare Health Plans Inc	Credit Suisse	22.089
47.759	Washington Federal Inc	Credit Suisse	4.754	1.574	WellCare Health Plans Inc	Deutsche Bank	13.473
		Bank of America		(58.474)	Wells Fargo & Co	Bank of America	
28.246	Washington Federal Inc	Merrill Lynch	7.164			Merrill Lynch	46.779
38.586	Washington Federal Inc	Citibank	(9.886)	(20.047)	Wells Fargo & Co	Citibank	26.262
57.858	Washington Federal Inc	JP Morgan	21.222	(31.277)	Wells Fargo & Co	JP Morgan	32.294
4.785	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Deutsche Bank	8.679	(49.203)	Wells Fargo & Co	Credit Suisse	(7.538)
7.766	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America		(47.756)	Wells Fargo & Co	Deutsche Bank	38.205
18.546	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Merrill Lynch	4.067	(18.646)	Welltower Inc (Reit)	Citibank	(31.512)
26.950	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Citibank	4.815	(37.304)	Welltower Inc (Reit)	Credit Suisse	(76.300)
6.860	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	JP Morgan	(6.120)	(28.900)	Welltower Inc (Reit)	JP Morgan	(72.256)
(42.433)	Waste Connections Inc			(17.638)	Welltower Inc (Reit)	Bank of America	
		Credit Suisse	(8.894)			Merrill Lynch	(44.624)
(28.546)	Waste Connections Inc	Deutsche Bank	5.831	(32.598)	Welltower Inc (Reit)	Deutsche Bank	(82.473)
(71.305)	Waste Connections Inc	Bank of America		(77.419)	Wendy's Co/The	Bank of America	
10.121	Waste Management Inc	Merrill Lynch	(94.085)	(22.235)	Wendy's Co/The	Merrill Lynch	11.613
7.606	Waste Management Inc	Deutsche Bank	(64.799)	(33.357)	Wendy's Co/The	Citibank	(3.335)
7.726	Waste Management Inc	JP Morgan	(164.034)	(57.202)	Wendy's Co/The	Deutsche Bank	5.004
23.591	Waste Management Inc	Credit Suisse	12.145	14.311	Werner Enterprises Inc	Credit Suisse	(3.836)
8.479	Waste Management Inc	Citibank	18.863			Bank of America	
8.187	Waters Corp	Bank of America		32.181	Werner Enterprises Inc	Merrill Lynch	46.511
		Merrill Lynch	16.147	34.142	Werner Enterprises Inc	JP Morgan	135.160
6.327	Waters Corp	JP Morgan	28.309	25.825	Werner Enterprises Inc	Credit Suisse	143.396
8.003	Waters Corp	Deutsche Bank	17.721	(17.913)	WESCO International Inc	Deutsche Bank	83.931
10.261	Waters Corp	Bank of America		(5.092)	WESCO International Inc	Credit Suisse	13.435
1.464	Waters Corp	Merrill Lynch	30.374	(4.139)	WESCO International Inc	Deutsche Bank	764
4.173	Watsco Inc	JP Morgan	9.111	(7.848)	WESCO International Inc	JP Morgan	2.416
		Citibank	(18.167)			Bank of America	
5.051	Watsco Inc	Credit Suisse	21.937	(497)	West Pharmaceutical Services Inc	Merrill Lynch	1.177
(17.237)	Wayfair Inc 'A'	Deutsche Bank	5.431	(9.343)	West Pharmaceutical Services Inc	JP Morgan	(3.156)
(17.823)	Wayfair Inc 'A'	Merrill Lynch	25.497			Bank of America	
(177.901)	Weatherford International Plc	Credit Suisse	45.863	(10.463)	Westar Energy Inc	Merrill Lynch	(44.566)
(218.837)	Weatherford International Plc	Deutsche Bank	(181.678)	(8.549)	Westar Energy Inc	Credit Suisse	(38.295)
(2.355.566)	Weatherford International Plc	JP Morgan	(188.924)	4.317	Western Alliance Bancorp	Deutsche Bank	(25.220)
		Citibank	9.785	8.985	Western Alliance Bancorp	Credit Suisse	863
		Credit Suisse	(33.920)	1.571	Western Alliance Bancorp	Citibank	(12.040)
		Deutsche Bank	61.743	12.131	Western Alliance Bancorp	JP Morgan	314
						Bank of America	
						Merrill Lynch	(10.918)

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
1.030	Western Alliance Bancorp	Deutsche Bank	(927)	(3.155)	World Fuel Services Corp	Deutsche Bank	4.543
21.156	Western Digital Corp	Credit Suisse	168.402	(71.334)	World Fuel Services Corp	Bank of America	
599	Western Digital Corp	Bank of America				Merrill Lynch	97.485
		Merrill Lynch	1.623	(10.973)	World Fuel Services Corp	Credit Suisse	14.594
28.290	Western Digital Corp	Citibank	(61.672)	(10.119)	World Fuel Services Corp	Citibank	4.857
18.362	Western Digital Corp	JP Morgan	146.162	(28.482)	Worldpay Inc 'A'	Citibank	35.602
36.659	Western Union Co/The	Bank of America		(56.641)	Worldpay Inc 'A'	JP Morgan	231.662
		Merrill Lynch	(4.399)	(2.131)	Worldpay Inc 'A'	Bank of America	
93.699	Western Union Co/The	Citibank	(27.173)			Merrill Lynch	4.326
94.060	Western Union Co/The	JP Morgan	17.871	4.169	Worthington Industries Inc	Bank of America	
137.030	Western Union Co/The	Deutsche Bank	(16.444)			Merrill Lynch	11.673
71.256	Western Union Co/The	Credit Suisse	(3.723)	9.570	Worthington Industries Inc	JP Morgan	34.069
(35.214)	WestRock Co	Bank of America		1.120	Worthington Industries Inc	Citibank	549
		Merrill Lynch	46.130	11.539	Worthington Industries Inc	Credit Suisse	41.079
(21.311)	WestRock Co	Citibank	38.573	22.005	Worthington Industries Inc	Deutsche Bank	61.614
(6.851)	WestRock Co	JP Morgan	3.837	23.537	WP Carey Inc (Reit)	Bank of America	
(55.567)	WestRock Co	Credit Suisse	31.118			Merrill Lynch	46.746
(8.351)	WestRock Co	Deutsche Bank	14.917	4.146	WP Carey Inc (Reit)	Credit Suisse	5.514
(12.405)	WEX Inc	Bank of America		2.489	WP Carey Inc (Reit)	Deutsche Bank	5.277
		Merrill Lynch	33.618	27.473	WP Carey Inc (Reit)	JP Morgan	48.228
(20.952)	WEX Inc	Citibank	27.657	14.802	WP Carey Inc (Reit)	Citibank	27.088
(12.508)	WEX Inc	Credit Suisse	(79.926)	(54.718)	WPX Energy Inc	Bank of America	
(5.440)	WEX Inc	Deutsche Bank	14.742			Merrill Lynch	(14.774)
(6.711)	WEX Inc	JP Morgan	(42.883)	(94.574)	WPX Energy Inc	Citibank	(24.589)
(2.869)	Weyerhaeuser Co (Reit)	Bank of America		(36.813)	WPX Energy Inc	Deutsche Bank	(9.940)
		Merrill Lynch	(3.730)	(93.792)	WPX Energy Inc	JP Morgan	10.676
(23.114)	Weyerhaeuser Co (Reit)	Citibank	(3.467)	(41.284)	WPX Energy Inc	Credit Suisse	2.722
(15.783)	Weyerhaeuser Co (Reit)	Deutsche Bank	(20.518)	(13.988)	WR Berkley Corp	Credit Suisse	856
(22.917)	Weyerhaeuser Co (Reit)	JP Morgan	(19.938)	(25.606)	WR Berkley Corp	Deutsche Bank	4.353
(2.593)	Whirlpool Corp	Bank of America		(10.176)	WR Berkley Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	29.586			Merrill Lynch	1.730
(2.932)	Whirlpool Corp	Deutsche Bank	33.454	(5.845)	WR Berkley Corp	Citibank	5.611
(4.338)	Whirlpool Corp	Credit Suisse	35.268	(16.776)	WR Berkley Corp	JP Morgan	(11.743)
(440)	Whirlpool Corp	Citibank	8.118	13.265	WR Grace & Co	Bank of America	
(11.445)	Whirlpool Corp	JP Morgan	141.004			Merrill Lynch	(1.194)
3.026	White Mountains Insurance Group Ltd	Citibank	42.001	(135.743)	Wright Medical Group NV	Citibank	(78.731)
(1.128)	White Mountains Insurance Group Ltd	Credit Suisse	(39.333)	(11.604)	Wright Medical Group NV	JP Morgan	(50.477)
(20.081)	Whiting Petroleum Corp	Deutsche Bank	(77.111)	(210.254)	Wright Medical Group NV	Credit Suisse	(909.904)
(22.311)	Whiting Petroleum Corp	JP Morgan	(145.022)	(154.402)	Wright Medical Group NV	Deutsche Bank	(194.547)
(37.419)	Whiting Petroleum Corp	Citibank	(88.309)	6.163	WW Grainger Inc	Credit Suisse	34.396
21.052	Williams-Sonoma Inc	JP Morgan	163.809	976	WW Grainger Inc	Citibank	(1.737)
30.025	Williams-Sonoma Inc	Credit Suisse	220.667	2.722	WW Grainger Inc	Deutsche Bank	8.874
7.817	Williams-Sonoma Inc	Bank of America		5.847	WW Grainger Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	62.692			Merrill Lynch	15.256
4.205	Williams-Sonoma Inc	Citibank	37.298	110	WW Grainger Inc	JP Morgan	1.544
25.578	Williams-Sonoma Inc	Deutsche Bank	205.136	(7.310)	Wyndham Worldwide Corp	Bank of America	
(3.576)	Willis Towers Watson Plc	JP Morgan	5.858			Merrill Lynch	19.700
(2.819)	Willis Towers Watson Plc	Citibank	10.120	(3.977)	Wyndham Worldwide Corp	Credit Suisse	4.004
(995)	Willis Towers Watson Plc	Deutsche Bank	1.652	(3.746)	Wyndham Worldwide Corp	Deutsche Bank	(2.864)
5.684	Wintrust Financial Corp	Credit Suisse	796	(9.451)	Wynn Resorts Ltd	Citibank	(32.039)
7.441	Wintrust Financial Corp	JP Morgan	1.042	(1.094)	Wynn Resorts Ltd	Bank of America	
7.960	Wintrust Financial Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(6.947)
		Merrill Lynch	(15.272)	(3.123)	Wynn Resorts Ltd	Credit Suisse	(14.463)
451	Wintrust Financial Corp	Citibank	(1.772)	(3.726)	Wynn Resorts Ltd	Deutsche Bank	(23.660)
7.882	Wintrust Financial Corp	Deutsche Bank	(1.498)	19.478	Xcel Energy Inc	Citibank	34.087
18.839	Wolverine World Wide Inc	Citibank	15.636	2.185	Xcel Energy Inc	Credit Suisse	1.005
17.828	Wolverine World Wide Inc	Credit Suisse	70.064	6.150	Xcel Energy Inc	Deutsche Bank	5.597
6.253	Wolverine World Wide Inc	Deutsche Bank	11.255	10.001	Xcel Energy Inc	JP Morgan	4.600
12.291	Wolverine World Wide Inc	JP Morgan	48.304	15.263	Xcel Energy Inc	Bank of America	
(13.526)	Woodward Inc	Bank of America				Merrill Lynch	13.889
		Merrill Lynch	(29.219)	(23.189)	Xerox Corp	Bank of America	
(4.502)	Woodward Inc	Credit Suisse	(11.300)	(29.332)	Xerox Corp	Merrill Lynch	21.765
(10.416)	Woodward Inc	Deutsche Bank	(19.415)	3.969	Xilinx Inc	Credit Suisse	25.894
(4.297)	Woodward Inc	JP Morgan	(10.785)			Bank of America	
(11.776)	Workday Inc 'A'	Credit Suisse	13.660	4.067	Xilinx Inc	Merrill Lynch	(11.847)
(11.116)	Workday Inc 'A'	Citibank	(36.460)	781	Xilinx Inc	Citibank	(15.739)
(5.074)	Workday Inc 'A'	Deutsche Bank	(1.015)	(10.633)	XL Group Ltd	JP Morgan	(4.785)
(15.880)	Workday Inc 'A'	Bank of America		(911)	XPO Logistics Inc	Citibank	(228)
		Merrill Lynch	879	(36.676)	XPO Logistics Inc	JP Morgan	(127.135)
				(1.317)	XPO Logistics Inc	Credit Suisse	(4.675)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(4.076)	XPO Logistics Inc	Bank of America		(6.269)	Zendesk Inc	Credit Suisse	(16.049)
		Merrill Lynch	234	(9.925)	Zillow Group Inc 'C'	Citibank	(67.986)
(27.329)	XPO Logistics Inc	Deutsche Bank	(63.950)	(12.826)	Zillow Group Inc 'C'	Credit Suisse	(46.302)
13.382	Xylem Inc/NY	Bank of America		(32.236)	Zillow Group Inc 'C'	JP Morgan	(135.555)
		Merrill Lynch	(12.044)	(1.060)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America	
7.638	Xylem Inc/NY	Citibank	(7.103)			Merrill Lynch	(7.007)
8.117	Xylem Inc/NY	Credit Suisse	2.597	(28.697)	Zillow Group Inc 'C'	Deutsche Bank	(192.189)
(47.535)	Yelp Inc	Citibank	18.063	(4.527)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America	
(9.151)	Yelp Inc	JP Morgan	34.865			Merrill Lynch	6.719
(13.827)	Yelp Inc	Bank of America		(4.923)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Citibank	7.040
		Merrill Lynch	(811)	(11.111)	Zimmer Biomet Holdings Inc	JP Morgan	49.666
116.885	Yum China Holdings Inc	Bank of America		(16.438)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Credit Suisse	73.478
		Merrill Lynch	315.589	(28.946)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Deutsche Bank	48.340
117.199	Yum China Holdings Inc	JP Morgan	236.323	4.638	Zions Bancorporation	Bank of America	
23.192	Yum China Holdings Inc	Credit Suisse	49.399			Merrill Lynch	(13.728)
25.574	Yum China Holdings Inc	Citibank	32.223	248	Zions Bancorporation	Citibank	(910)
31.846	Yum China Holdings Inc	Deutsche Bank	85.984	24.499	Zions Bancorporation	Credit Suisse	(51.427)
5.760	Yum! Brands Inc	Deutsche Bank	(7.085)	18.739	Zions Bancorporation	JP Morgan	(20.238)
42.105	Yum! Brands Inc	Credit Suisse	(59.521)	12.618	Zions Bancorporation	Deutsche Bank	(42.327)
17.208	Yum! Brands Inc	Bank of America		11.896	Zoetis Inc	Credit Suisse	28.431
		Merrill Lynch	(21.166)	16.723	Zoetis Inc	Bank of America	
8.378	Yum! Brands Inc	Citibank	(2.262)			Merrill Lynch	25.201
7.993	Yum! Brands Inc	JP Morgan	(11.190)	11.458	Zoetis Inc	JP Morgan	20.102
(3.835)	Zayo Group Holdings Inc	Credit Suisse	(690)	3.893	Zoetis Inc	Citibank	39
(52.566)	Zayo Group Holdings Inc	Bank of America		4.046	Zoetis Inc	Deutsche Bank	5.543
		Merrill Lynch	(62.238)	(106.816)	Zynga Inc 'A'	JP Morgan	(59.283)
(20.041)	Zayo Group Holdings Inc	Citibank	(13.227)	(24.453)	Zynga Inc 'A'	Deutsche Bank	(8.681)
(20.875)	Zayo Group Holdings Inc	JP Morgan	(3.758)	(51.130)	Zynga Inc 'A'	Bank of America	
(6.725)	Zayo Group Holdings Inc	Deutsche Bank	(4.443)			Merrill Lynch	(18.151)
2.101	Zebra Technologies Corp	Citibank	4.927	(91.029)	Zynga Inc 'A'	Citibank	(31.405)
(29.578)	Zendesk Inc	JP Morgan	(75.720)				5.802.097
(22.952)	Zendesk Inc	Bank of America		Total (exposition brute sous-jacente – 13.208.098.328 USD)			(14.759.625)
(35.876)	Zendesk Inc	Merrill Lynch	(42.461)				
		Citibank	(64.577)				

BlackRock Style Advantage Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
CCCDs	EUR 217.840.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(1.713.495)	3.992.772
CCCDs	EUR 57.624.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Crossover Series 29 Version 1	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(1.107.106)	5.959.360
CCCDs	USD 47.777.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(93.853)	761.651
CCCDs	USD 26.786.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.30	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2023	(93.603)	1.690.726
CCIRS	MXN 695.520.000	Fund receives Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate and pays Fixed 7,520%	Bank of America Merrill Lynch	13/9/2023	676.320	676.854
CCIRS	MXN 1.973.089.000	Fund receives Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate and pays Fixed 7,925%	Bank of America Merrill Lynch	13/9/2023	303.365	304.805
CCIRS	AUD 66.382.000	Fund receives Fixed 2,787% and pays Floating AUD 6 Month BBSW	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	490.730	491.453
CCIRS	CAD 421.410.000	Fund receives Fixed 2,475% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(878.286)	(873.559)
CCIRS	CAD 50.325.000	Fund receives Fixed 2,551% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	34.171	34.746
CCIRS	CAD 240.862.000	Fund receives Fixed 2,552% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	176.677	179.434
CCIRS	CAD 199.584.000	Fund receives Fixed 2,638% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	763.278	765.519
CCIRS	CAD 216.088.000	Fund receives Fixed 2,802% and pays Floating CAD 3 Month CDOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	2.122.795	2.125.222
CCIRS	EUR 66.256.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,499%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(509.788)	(508.618)
CCIRS	EUR 208.141.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,550%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(2.226.878)	(2.223.345)
CCIRS	EUR 57.956.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,552%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(626.866)	(625.845)
CCIRS	EUR 92.580.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,582%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(1.160.764)	(1.159.115)
CCIRS	EUR 911.570.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,607%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(12.853.694)	(12.742.887)
CCIRS	GBP 455.921.000	Fund receives Fixed 1,415% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	4.632.423	4.031.487
CCIRS	GBP 33.829.000	Fund receives Fixed 1,494% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	465.393	472.207
CCIRS	HKD 20.340.808	Fund receives Fixed 2,575% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(15.065)	(15.027)
CCIRS	HKD 471.685.842	Fund receives Fixed 2,610% and pays Floating HKD 3 Month HIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(251.488)	(250.622)
CCIRS	PLN 92.904.418	Fund receives Floating PLN 6 Month LIBOR and pays Fixed 2,472%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(20.246)	(19.854)
CCIRS	PLN 113.549.844	Fund receives Floating PLN 6 Month LIBOR and pays Fixed 2,490%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(50.099)	(49.621)
CCIRS	PLN 123.872.558	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 2,475%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(30.551)	(30.029)
CCIRS	PLN 114.265.841	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 2,500%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(64.084)	(63.601)
CCIRS	PLN 385.228.000	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 2,528%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(354.266)	(352.669)
CCIRS	PLN 239.202.180	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 2,542%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(261.911)	(260.903)
CCIRS	PLN 285.970.159	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 2,596%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(505.401)	(504.188)
CCIRS	PLN 599.875.000	Fund receives Floating PLN 6 Month WIBOR and pays Fixed 2,705%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(1.881.929)	(1.879.368)
CCIRS	SEK 1.320.871.000	Fund receives Fixed 0,767% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	1.841.055	1.734.888
CCIRS	SGD 96.173.700	Fund receives Fixed 2,240% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(378.196)	(377.142)
CCIRS	SGD 37.028.122	Fund receives Fixed 2,248% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(135.727)	(135.323)
CCIRS	SGD 41.217.300	Fund receives Fixed 2,258% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(135.686)	(135.234)
CCIRS	SGD 55.081.635	Fund receives Fixed 2,270% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(157.805)	(157.205)
CCIRS	SGD 28.807.990	Fund receives Fixed 2,272% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(79.970)	(79.657)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
CCIRS	SGD 30.703.253	Fund receives Fixed 2,282% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(74.307)	(73.973)
CCIRS	SGD 68.820.000	Fund receives Fixed 2,295% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(135.954)	(135.198)
CCIRS	SGD 105.672.091	Fund receives Fixed 2,314% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(137.318)	(136.156)
CCIRS	SGD 76.729.000	Fund receives Fixed 2,315% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(96.977)	(96.134)
CCIRS	SGD 29.417.616	Fund receives Fixed 2,460% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	114.596	114.915
CCIRS	SGD 31.346.640	Fund receives Fixed 2,475% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	138.841	139.181
CCIRS	SGD 19.611.744	Fund receives Fixed 2,490% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	97.332	97.544
CCIRS	USD 11.593.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,787%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	38.738	27.145
CCIRS	USD 110.536.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,992%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(794.904)	(793.312)
CCIRS	ZAR 1.294.098.346	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,255%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	1.316.039	1.317.623
CCIRS	ZAR 1.130.798.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,260%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	1.131.774	1.133.159
CCIRS	ZAR 1.250.692.616	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,280%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	1.171.284	1.172.802
CCIRS	ZAR 1.088.196.692	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,308%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	921.047	922.368
CCIRS	ZAR 1.392.962.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,315%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	1.147.618	1.149.309
CCIRS	ZAR 1.260.222.346	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,367%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	827.364	828.890
CCIRS	ZAR 1.837.124.000	Fund receives Floating ZAR 3 Month JIBAR and pays Fixed 7,500%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	419.892	421.995
CCIRS	MXN 322.821.000	Fund receives Fixed 7,835% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2028	(363.636)	(363.290)
CCIRS	MXN 772.287.000	Fund receives Fixed 7,930% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2028	(623.095)	(622.275)
CCIRS	MXN 396.096.000	Fund receives Fixed 8,135% and pays Floating MXN 1 Month Mexican Interbank Rate	Bank of America Merrill Lynch	6/9/2028	(46.382)	(45.979)
CCIRS	AUD 24.340.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,011%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(201.615)	(201.229)
CCIRS	AUD 56.763.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,050%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(618.618)	(617.726)
CCIRS	AUD 124.481.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,072%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(1.541.446)	(1.539.489)
CCIRS	AUD 21.578.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,106%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(316.701)	(316.373)
CCIRS	AUD 27.664.000	Fund receives Floating AUD 6 Month BBSW and pays Fixed 3,131%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(452.696)	(452.279)
CCIRS	CAD 161.941.000	Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,595%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	471.773	474.282
CCIRS	CAD 48.509.000	Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,602%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	116.266	117.019
CCIRS	CAD 61.624.000	Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,776%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(589.568)	(588.602)
CCIRS	CAD 87.029.000	Fund receives Floating CAD 3 Month CDOR and pays Fixed 2,922%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(1.706.032)	(1.704.668)
CCIRS	EUR 36.247.000	Fund receives Fixed 1,138% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	696.304	697.195
CCIRS	EUR 13.869.000	Fund receives Fixed 1,146% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	280.654	280.999
CCIRS	EUR 25.355.000	Fund receives Fixed 1,158% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	543.809	546.969
CCIRS	EUR 84.060.000	Fund receives Fixed 1,186% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	2.082.284	2.081.795
CCIRS	GBP 1.058.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,604%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(14.646)	(14.617)
CCIRS	GBP 232.557.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,605%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(3.938.201)	(3.256.758)
CCIRS	HKD 117.787.000	Fund receives Floating HKD 3 Month HIBOR and pays Fixed 2,787%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	50.513	50.815

BlackRock Style Advantage Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
CCIRS	HKD 103.206.000	Fund receives Floating HKD 3 Month HIBOR and pays Fixed 2,788%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	43.689	43.953
CCIRS	PLN 54.862.000	Fund receives Fixed 2,940% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	6.007	6.331
CCIRS	PLN 61.287.000	Fund receives Fixed 3,155% and pays Floating PLN 6 Month WIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	316.693	317.058
CCIRS	SEK 296.580.000	Fund receives Fixed 1,308% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	244.197	244.907
CCIRS	SEK 1.089.185.000	Fund receives Fixed 1,400% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	2.012.310	2.014.814
CCIRS	SEK 239.534.000	Fund receives Fixed 1,439% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	534.830	547.084
CCIRS	SEK 157.843.000	Fund receives Fixed 1,448% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	375.052	375.440
CCIRS	SEK 4.916.085.000	Fund receives Fixed 1,460% and pays Floating SEK 3 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	14.381.817	12.377.257
CCIRS	SGD 38.849.000	Fund receives Fixed 2,655% and pays Floating SGD 6 Month STIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	37.444	38.037
CCIRS	USD 159.997.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,905%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(66.546)	(63.330)
CCIRS	USD 60.237.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,171%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(1.428.039)	(1.426.828)
CCIRS	ZAR 50.628.000	Fund receives Fixed 7,800% and pays Floating ZAR 3 Month JIBAR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	(63.347)	(63.262)
CDS	USD 43.053.000	Fund receives Fixed 5,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.HY.30	Deutsche Bank	20/6/2023	48.208	2.717.495
CDS	USD 82.516.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	Goldman Sachs	20/6/2023	(193.846)	1.315.453
CDS	USD 125.947.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit CDX.NA.IG.30	JP Morgan	20/6/2023	(305.189)	2.007.820
IRS	CNY 230.521.050	Fund receives Floating CNY 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,692%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(88.936)	(88.936)
IRS	CNY 230.521.050	Fund receives Floating CNY 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,710%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(117.435)	(117.435)
IRS	CNY 51.226.900	Fund receives Floating CNY 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,725%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(31.525)	(31.525)
IRS	INR 1.635.212.007	Fund receives Fixed 6,678% and pays Floating INR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(396.169)	(396.169)
IRS	INR 539.619.962	Fund receives Fixed 6,690% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(126.657)	(126.657)
IRS	INR 539.619.962	Fund receives Fixed 6,690% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(126.657)	(126.657)
IRS	INR 1.756.438.685	Fund receives Fixed 6,700% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(401.644)	(401.644)
IRS	INR 555.972.082	Fund receives Fixed 6,700% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(127.134)	(127.134)
IRS	INR 854.780.274	Fund receives Fixed 6,710% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(190.294)	(190.294)
IRS	INR 1.587.449.081	Fund receives Fixed 6,711% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(352.443)	(352.443)
IRS	INR 8.664.512.626	Fund receives Fixed 6,718% and pays Floating INR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(1.884.391)	(1.884.391)
IRS	INR 3.671.030.390	Fund receives Fixed 6,758% and pays Floating INR 6 Month LIBOR	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(710.715)	(710.715)
IRS	KRW 56.221.752.300	Fund receives Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate and pays Fixed 2,328%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(166.116)	(166.116)
IRS	KRW 63.072.421.500	Fund receives Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate and pays Fixed 2,345%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(234.499)	(234.499)
IRS	THB 583.413.500	Fund receives Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate and pays Fixed 2,260%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2023	(83.458)	(83.458)
IRS	KRW 16.366.763.000	Fund receives Floating KRW 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,344%	Bank of America Merrill Lynch	19/9/2028	27.006	27.006
IRS	INR 1.627.908.693	Fund receives Fixed 6,682% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	BNP Paribas	19/9/2023	(389.970)	(389.970)
IRS	KRW 13.875.932.730	Fund receives Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate and pays Fixed 2,360%	BNP Paribas	19/9/2023	(60.668)	(60.668)
IRS	KRW 19.073.192.000	Fund receives Floating KRW 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,198%	BNP Paribas	19/9/2023	51.791	51.791
IRS	THB 1.592.635.760	Fund receives Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate and pays Fixed 2,030%	BNP Paribas	19/9/2023	313.181	313.181

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Style Advantage Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
IRS	61.456.042.000	KRW Fund receives Floating KRW 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,428%	BNP Paribas	19/9/2028	(326.055)	(326.055)
IRS	353.050.310	THB Fund receives Fixed 2,450% and pays Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate	BNP Paribas	19/9/2028	(105.006)	(105.006)
IRS	2.470.614.630	INR Fund receives Fixed 6,685% and pays Floating INR 6 Month LIBOR	Citibank	19/9/2023	(340.883)	(340.883)
IRS	1.634.966.737	INR Fund receives Fixed 6,685% and pays Floating INR 6 Month LIBOR	Citibank	19/9/2023	(388.695)	(388.695)
IRS	INR 814.076.452	Fund receives Fixed 6,690% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Citibank	19/9/2023	(191.077)	(191.077)
IRS	2.706.345.500	INR Fund receives Fixed 6,716% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Citibank	19/9/2023	(592.677)	(592.677)
IRS	5.223.056.200	INR Fund receives Fixed 6,930% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Citibank	19/9/2023	(468.009)	(468.009)
IRS	5.848.255.500	INR Fund receives Fixed 7,120% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Citibank	19/9/2023	147.818	147.818
IRS	THB 583.413.500	Fund receives Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate and pays Fixed 2,300%	Citibank	19/9/2023	(117.925)	(117.925)
IRS	5.254.821.209	INR Fund receives Fixed 6,766% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	(990.331)	(990.331)
IRS	4.055.549.520	INR Fund receives Fixed 6,910% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Deutsche Bank	19/9/2023	(412.437)	(412.437)
IRS	24.095.036.700	KRW Fund receives Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate and pays Fixed 2,342%	Deutsche Bank	19/9/2023	(86.956)	(86.956)
IRS	49.196.488.770	KRW Fund receives Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate and pays Fixed 2,350%	Deutsche Bank	19/9/2023	(193.638)	(193.638)
IRS	8.295.500.600	KRW Fund receives Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate and pays Fixed 2,351%	Deutsche Bank	19/9/2023	(33.013)	(33.013)
IRS	19.073.192.000	KRW Fund receives Floating KRW 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,188%	Deutsche Bank	19/9/2023	60.110	60.110
IRS	29.749.558.000	KRW Fund receives Floating KRW 3 Month LIBOR and pays Fixed 2,428%	Deutsche Bank	19/9/2028	(156.612)	(156.612)
IRS	2.436.354.482	INR Fund receives Fixed 6,685% and pays Floating INR 6 Month LIBOR	Goldman Sachs	19/9/2023	(579.216)	(579.216)
IRS	902.471.517	INR Fund receives Fixed 6,750% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	Goldman Sachs	19/9/2023	(179.085)	(179.085)
IRS	5.848.255.500	INR Fund receives Fixed 7,148% and pays Floating INR 6 Month MIBOR	Goldman Sachs	19/9/2023	245.059	245.059
IRS	165.607.639.996	KRW Fund receives Floating KRW 3 Month Certificate of Deposit Rate and pays Fixed 2,347%	Goldman Sachs	19/9/2023	(630.163)	(630.163)
IRS	THB 854.327.467	Fund receives Floating THB 6 Month LIBOR and pays Fixed 2,041%	Goldman Sachs	19/9/2023	153.803	153.803
IRS	2.503.551.014	INR Fund receives Fixed 6,690% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	HSBC	19/9/2023	(587.623)	(587.623)
IRS	2.626.236.642	INR Fund receives Fixed 6,762% and pays Floating INR 6 Month LIBOR	HSBC	19/9/2023	(501.296)	(501.296)
IRS	1.001.555.680	THB Fund receives Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate and pays Fixed 2,030%	HSBC	19/9/2023	196.949	196.949
IRS	THB 225.720.690	Fund receives Fixed 2,445% and pays Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate	HSBC	19/9/2028	(70.258)	(70.258)
IRS	THB 494.196.000	Fund receives Fixed 2,445% and pays Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate	HSBC	19/9/2028	(153.824)	(153.824)
IRS	1.628.071.500	INR Fund receives Fixed 6,690% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	JP Morgan	19/9/2023	(382.134)	(382.134)
IRS	1.635.130.250	INR Fund receives Fixed 6,690% and pays Floating INR 6 Month LIBOR	JP Morgan	19/9/2023	(383.791)	(383.791)
IRS	6.083.324.280	INR Fund receives Fixed 6,945% and pays Floating INR 1 Month MIBOR	JP Morgan	19/9/2023	(489.920)	(489.920)
IRS	2.018.063.713	THB Fund receives Floating THB 6 Month Thailand Fixing Rate and pays Fixed 2,050%	JP Morgan	19/9/2023	337.228	337.228
TRS	BRL 110.843.502	Fund receives Ibovespa Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	13/6/2018	2.914.178	2.914.178
TRS	BRL 82.839.982	Fund receives Ibovespa Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	13/6/2018	1.812.960	1.812.960
TRS	46.088.783.600	KRW Fund receives Fixed 0,000% and pays KOSPI 200 Index	Bank of America Merrill Lynch	14/6/2018	(734.991)	(734.991)
TRS	3.925.447.500	KRW Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	14/6/2018	(43.900)	(43.900)
TRS	344.123.524	TWD Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(128.222)	(128.222)

BlackRock Style Advantage Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes USD	Valeur de marché USD
TRS	TWD 422.427.580	Fund receives Taiwan Stock Exchange Capitalization Weighted Stock Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	7.190	7.190
TRS	TWD 4.147.514.573	Fund receives Taiwan Stock Exchange Capitalization Weighted Stock Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(1.127.760)	(1.127.760)
TRS	THB 985.458.849	Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Index	Bank of America Merrill Lynch	28/6/2018	(1.091.076)	(1.091.076)
TRS	THB 271.165.824	Fund receives SET50 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	28/6/2018	(178.806)	(178.806)
TRS	THB 227.173.425	Fund receives SET50 Index and pays Fixed 0,000%	Credit Suisse	28/6/2018	(119.028)	(119.028)
TRS	PLN 7.498.921	Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index	JP Morgan	15/6/2018	(65.156)	(65.156)
TRS	TRY 79.849.645	Fund receives BIST 30 Index and pays Fixed 0,000%	JP Morgan	29/6/2018	(123.371)	(123.371)
Total (exposition brute sous-jacente – 10.278.338.227 USD)					(9.417.610)	10.651.116

CCCDs : *Centrally Cleared Credit Default Swaps* ou swaps sur défaut faisant l'objet d'une compensation centrale

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

CDS (*credit default swaps*) : swaps sur défaillance

IRS (*interest rate swaps*) : swaps sur taux d'intérêt

TRS (*total return swaps*) : swaps sur rendement total

BlackRock Style Advantage Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
AUD	2.422.000	USD	1.825.314	JP Morgan	20/6/2018	9.517
AUD	2.421.000	USD	1.824.884	JP Morgan	18/7/2018	9.524
AUD	2.420.000	USD	1.824.472	JP Morgan	15/8/2018	9.532
CAD	15.930.197	USD	12.641.686	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(338.004)
CAD	2.006.962	USD	1.553.003	Citibank	20/6/2018	(2.927)
CAD	11.906.038	USD	9.221.967	Credit Suisse	20/6/2018	(26.342)
CAD	8.068.306	USD	6.280.133	Deutsche Bank	20/6/2018	(48.579)
CAD	50.326.497	USD	39.321.986	JP Morgan	20/6/2018	(452.335)
CAD	15.913.356	USD	12.637.904	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	(338.751)
CAD	8.060.078	USD	6.279.129	Deutsche Bank	18/7/2018	(49.636)
CAD	51.371.366	USD	40.799.836	JP Morgan	18/7/2018	(1.095.813)
CAD	64.304.000	USD	50.062.672	Barclays Bank	15/8/2018	(336.488)
CHF	2.149.000	USD	2.279.501	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(96.329)
CHF	3.506.000	USD	3.550.610	Credit Suisse	20/6/2018	11.140
CHF	3.496.000	USD	3.550.158	Credit Suisse	18/7/2018	10.420
CHF	3.487.000	USD	3.549.507	Credit Suisse	15/8/2018	10.463
CLP	1.915.501.000	USD	3.052.088	BNP Paribas	20/6/2018	(17.887)
CLP	5.529.949.000	USD	8.966.351	Credit Suisse	20/6/2018	(206.773)
CLP	1.682.629.000	USD	2.829.374	Deutsche Bank	20/6/2018	(164.048)
CLP	1.437.231.000	USD	2.389.411	Goldman Sachs	20/6/2018	(112.801)
CLP	1.619.886.000	USD	2.682.819	JP Morgan	20/6/2018	(116.879)
CLP	1.915.108.000	USD	3.051.370	BNP Paribas	18/7/2018	(17.051)
CLP	5.528.174.000	USD	8.964.760	Credit Suisse	18/7/2018	(205.860)
CLP	1.682.203.000	USD	2.828.420	Deutsche Bank	18/7/2018	(163.119)
CLP	1.619.511.000	USD	2.681.976	JP Morgan	18/7/2018	(116.005)
CLP	1.224.527.000	USD	1.934.840	BNP Paribas	16/8/2018	5.162
CLP	3.846.250.000	USD	6.133.392	Credit Suisse	16/8/2018	(39.828)
EUR	497.141	PLN	2.152.768	BNP Paribas	16/8/2018	371
EUR	501.147	PLN	2.172.653	Citibank	16/8/2018	(312)
EUR	815.962	PLN	3.531.505	Credit Suisse	16/8/2018	1.111
EUR	501.110	PLN	2.170.074	UBS	16/8/2018	342
EUR	85.366.012	USD	106.039.611	Barclays Bank	20/6/2018	(6.457.522)
EUR	25.331.000	USD	30.562.176	Citibank	20/6/2018	(1.012.782)
EUR	3.368.000	USD	4.045.035	Goldman Sachs	20/6/2018	(116.159)
EUR	2.044.000	USD	2.408.517	Societe Generale	20/6/2018	(24.127)
EUR	87.700.000	USD	108.429.619	Citibank	18/7/2018	(5.899.792)
EUR	3.360.000	USD	4.045.245	Goldman Sachs	18/7/2018	(117.078)
EUR	2.039.000	USD	2.408.302	Societe Generale	18/7/2018	(24.513)
EUR	4.792.000	USD	5.715.078	Citibank	15/8/2018	(101.016)
EUR	89.621.000	USD	107.194.782	Deutsche Bank	15/8/2018	(2.199.396)
EUR	2.035.000	USD	2.408.720	Societe Generale	15/8/2018	(24.618)
GBP	5.192.038	USD	7.221.255	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(314.176)
GBP	1.116.000	USD	1.565.110	Citibank	20/6/2018	(80.471)
GBP	652.171	USD	889.311	Credit Suisse	20/6/2018	(21.714)
GBP	49.832.591	USD	69.484.967	JP Morgan	20/6/2018	(3.191.610)
GBP	2.885.933	USD	3.941.567	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	(96.913)
GBP	651.067	USD	889.224	Credit Suisse	18/7/2018	(21.870)
GBP	49.495.200	USD	70.499.033	Goldman Sachs	18/7/2018	(4.561.284)
GBP	32.046.600	USD	43.724.541	BNP Paribas	15/8/2018	(977.397)
HKD	92.239.000	USD	11.772.551	Deutsche Bank	18/7/2018	(7.523)
HKD	121.125.000	USD	15.461.400	HSBC	18/7/2018	(11.980)
HUF	3.125.034.408	USD	12.485.963	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(1.067.392)
HUF	837.253.899	USD	3.348.627	Barclays Bank	20/6/2018	(289.383)
HUF	1.648.628.000	USD	6.571.017	Citibank	20/6/2018	(547.091)
HUF	672.773.208	USD	2.680.597	Credit Suisse	20/6/2018	(222.349)
HUF	1.007.445.838	USD	4.012.451	Deutsche Bank	20/6/2018	(331.342)
HUF	167.676.147	USD	668.148	JP Morgan	20/6/2018	(55.476)
HUF	271.330.501	USD	1.085.140	Societe Generale	20/6/2018	(93.724)
HUF	1.307.589.000	USD	5.246.571	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	(459.454)
INR	1.201.752.000	USD	17.851.068	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(74.082)
INR	113.741.000	USD	1.678.661	Barclays Bank	20/6/2018	3.860
INR	4.856.230.000	USD	73.945.046	BNP Paribas	20/6/2018	(2.108.985)
INR	3.468.735.000	USD	52.747.601	Citibank	20/6/2018	(1.436.139)
INR	5.774.821.600	USD	88.015.415	HSBC	20/6/2018	(2.591.035)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
INR	788.617.000	USD	11.509.200	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	120.778
INR	114.125.000	USD	1.677.939	Barclays Bank	18/7/2018	5.098
INR	13.198.828.000	USD	200.144.481	Citibank	18/7/2018	(5.497.295)
INR	225.620.000	USD	3.294.685	HSBC	18/7/2018	32.603
INR	791.633.000	USD	11.507.761	Bank of America		
				Merrill Lynch	16/8/2018	129.770
INR	12.099.849.200	USD	177.358.596	HSBC	16/8/2018	517.222
JPY	745.626.888	USD	7.013.077	Citibank	20/6/2018	(133.328)
JPY	1.498.419.112	USD	14.201.649	Credit Suisse	20/6/2018	(376.039)
JPY	322.075.576	USD	3.020.978	Deutsche Bank	20/6/2018	(49.252)
JPY	516.709.424	USD	4.846.598	JP Morgan	20/6/2018	(79.025)
JPY	175.378.000	USD	1.613.597	Citibank	18/7/2018	7.784
JPY	1.373.654.200	USD	12.926.795	HSBC	18/7/2018	(227.269)
KRW	11.783.296.000	USD	10.939.094	Barclays Bank	20/6/2018	(2.433)
KRW	6.063.113.000	USD	5.645.677	Citibank	20/6/2018	(18.201)
KRW	2.770.401.000	USD	2.575.919	Deutsche Bank	20/6/2018	(4.572)
KRW	4.475.260.000	USD	4.210.424	HSBC	20/6/2018	(56.713)
KRW	11.769.292.000	USD	10.936.422	Barclays Bank	18/7/2018	(1.277)
KRW	3.428.043.000	USD	3.176.467	Citibank	18/7/2018	8.614
KRW	2.767.121.000	USD	2.575.623	Deutsche Bank	18/7/2018	(4.622)
KRW	11.758.614.000	USD	10.937.030	Barclays Bank	16/8/2018	1.023
KRW	3.424.176.000	USD	3.176.416	Citibank	16/8/2018	8.808
MXN	124.695.900	USD	6.752.519	Citibank	20/6/2018	(534.017)
MXN	43.154.612	USD	2.327.122	Credit Suisse	20/6/2018	(175.030)
MXN	72.812.000	USD	3.823.457	Deutsche Bank	20/6/2018	(192.370)
MXN	25.840.000	USD	1.411.745	Goldman Sachs	20/6/2018	(123.121)
MXN	1.033.229.488	USD	54.887.593	JP Morgan	20/6/2018	(3.361.118)
MXN	741.566.000	USD	39.980.483	Barclays Bank	18/7/2018	(3.177.941)
MXN	73.099.000	USD	3.821.770	Deutsche Bank	18/7/2018	(194.003)
MXN	25.944.000	USD	1.411.293	Goldman Sachs	18/7/2018	(123.740)
MXN	747.273.000	USD	37.634.430	Citibank	15/8/2018	(722.961)
NOK	79.313.000	USD	10.253.368	Credit Suisse	20/6/2018	(561.704)
NOK	505.887.383	USD	63.823.017	Deutsche Bank	20/6/2018	(2.006.035)
NOK	27.053.617	USD	3.340.980	UBS	20/6/2018	(35.159)
NOK	229.605.200	USD	29.657.091	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	(1.568.602)
NOK	232.976.576	USD	28.565.331	Deutsche Bank	18/7/2018	(64.409)
NOK	27.014.424	USD	3.340.108	UBS	18/7/2018	(35.329)
NOK	232.713.241	USD	28.564.206	Deutsche Bank	15/8/2018	(64.528)
NOK	26.986.759	USD	3.340.346	UBS	15/8/2018	(35.361)
NZD	49.015.010	USD	35.192.644	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(838.833)
NZD	19.771.309	USD	14.128.418	Credit Suisse	20/6/2018	(271.033)
NZD	92.352.600	USD	67.592.868	Deutsche Bank	20/6/2018	(2.864.454)
NZD	19.565.681	USD	13.528.215	JP Morgan	20/6/2018	185.049
NZD	132.488.534	USD	96.721.910	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	(3.859.865)
NZD	13.775.000	USD	9.735.675	Credit Suisse	18/7/2018	(80.692)
NZD	19.558.866	USD	13.524.450	JP Morgan	18/7/2018	184.482
NZD	14.764.982	USD	10.159.326	Bank of America		
				Merrill Lynch	15/8/2018	190.070
NZD	140.188.000	USD	97.954.346	Citibank	15/8/2018	309.314
NZD	10.866.018	USD	7.479.873	JP Morgan	15/8/2018	136.575
PLN	4.774.000	EUR	1.102.628	Bank of America		
				Merrill Lynch	16/8/2018	(1.015)
PLN	4.782.000	USD	1.289.088	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	2.365
PLN	43.742.000	USD	12.646.221	BNP Paribas	20/6/2018	(833.022)
PLN	229.079.400	USD	67.253.497	Societe Generale	20/6/2018	(5.387.089)
PLN	4.777.000	USD	1.288.742	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	2.158
PLN	17.944.000	USD	5.031.616	BNP Paribas	18/7/2018	(182.567)
PLN	248.448.200	USD	73.526.050	Citibank	18/7/2018	(6.387.312)
PLN	163.811.800	USD	45.645.794	UBS	16/8/2018	(1.351.888)
RUB	4.306.904.800	USD	74.879.903	Citibank	20/6/2018	(5.816.520)
RUB	1.302.710.600	USD	20.067.944	Goldman Sachs	18/7/2018	759.271
RUB	29.086.400	USD	454.810	Goldman Sachs	15/8/2018	8.834
SEK	55.243.000	USD	6.222.404	Deutsche Bank	20/6/2018	48.374
SEK	55.106.000	USD	6.222.041	Deutsche Bank	18/7/2018	47.243
SGD	15.047.301	USD	11.228.424	BNP Paribas	20/6/2018	8.893
SGD	12.234.320	USD	9.165.850	Citibank	20/6/2018	(29.266)

BlackRock Style Advantage Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
SGD	54.271.967	USD	41.497.460	Credit Suisse	20/6/2018	(967.182)
SGD	8.132.423	USD	6.222.784	Deutsche Bank	20/6/2018	(149.494)
SGD	136.611.988	USD	103.089.926	JP Morgan	20/6/2018	(1.068.162)
SGD	15.034.242	USD	11.225.314	BNP Paribas	18/7/2018	8.774
SGD	12.222.565	USD	9.163.552	Citibank	18/7/2018	(30.444)
SGD	54.216.417	USD	41.486.185	Credit Suisse	18/7/2018	(973.869)
SGD	4.181.997	USD	3.199.643	Deutsche Bank	18/7/2018	(74.715)
SGD	120.446.779	USD	90.775.546	JP Morgan	18/7/2018	(773.693)
SGD	15.024.811	USD	11.225.463	BNP Paribas	15/8/2018	8.941
SGD	864.014	USD	645.173	Citibank	15/8/2018	871
SGD	48.413.175	USD	36.115.096	JP Morgan	15/8/2018	84.572
THB	561.342.000	USD	17.936.912	ANZ	20/6/2018	(380.984)
THB	278.062.000	USD	8.659.886	BNP Paribas	20/6/2018	36.482
THB	148.577.000	USD	4.722.531	Citibank	20/6/2018	(75.796)
THB	263.065.000	USD	8.445.104	Deutsche Bank	20/6/2018	(217.767)
THB	1.143.985.000	USD	36.781.718	HSBC	20/6/2018	(1.003.676)
THB	1.143.987.600	USD	36.766.434	Morgan Stanley	20/6/2018	(988.311)
THB	144.257.000	USD	4.642.220	Nomura		
				International Standard	20/6/2018	(130.594)
THB	150.858.000	USD	4.699.626	Chartered Bank	20/6/2018	18.446
THB	348.442.000	USD	10.875.218	UBS	20/6/2018	22.278
THB	429.753.000	USD	13.721.219	ANZ	18/7/2018	(267.466)
THB	2.920.807.400	USD	93.780.462	BNP Paribas	18/7/2018	(2.342.312)
THB	69.204.000	USD	2.161.612	Citibank	18/7/2018	4.873
THB	262.690.000	USD	8.442.552	Deutsche Bank	18/7/2018	(218.837)
THB	150.694.000	USD	4.698.469	Standard		
				Chartered Bank	18/7/2018	19.124
THB	347.878.000	USD	10.871.188	UBS	18/7/2018	19.404
THB	3.384.969.800	USD	105.836.532	Barclays Bank	15/8/2018	235.644
THB	277.435.000	USD	8.655.157	BNP Paribas	15/8/2018	38.609
THB	69.142.000	USD	2.161.363	Citibank	15/8/2018	5.286
THB	347.547.000	USD	10.871.886	UBS	15/8/2018	18.926
TRY	33.539.000	USD	8.397.661	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(1.050.810)
TRY	188.004.800	USD	47.227.301	Barclays Bank	20/6/2018	(6.044.103)
TRY	213.617.000	USD	50.096.621	HSBC	18/7/2018	(3.819.569)
TRY	142.341.400	USD	32.260.868	UBS	15/8/2018	(1.763.224)
TWD	210.565.000	USD	7.214.836	Barclays Bank	20/6/2018	(179.529)
TWD	164.243.000	USD	5.618.987	BNP Paribas	20/6/2018	(131.371)
TWD	421.135.000	USD	14.432.317	Citibank	20/6/2018	(361.534)
TWD	229.981.000	USD	7.953.692	Credit Suisse	20/6/2018	(269.665)
TWD	315.850.000	USD	10.811.227	Deutsche Bank	20/6/2018	(258.182)
TWD	151.610.000	USD	5.190.346	JP Morgan	20/6/2018	(124.817)
TWD	210.025.000	USD	7.213.636	Barclays Bank	18/7/2018	(180.310)
TWD	163.820.000	USD	5.617.392	BNP Paribas	18/7/2018	(131.381)
TWD	420.050.000	USD	14.427.271	Citibank	18/7/2018	(360.620)
TWD	135.040.000	USD	10.807.547	Deutsche Bank	18/7/2018	(257.475)
TWD	151.220.000	USD	5.188.540	JP Morgan	18/7/2018	(124.478)
USD	17.348.755	AUD	22.369.615	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	402.245
USD	1.581.268	AUD	2.100.000	BNP Paribas	20/6/2018	(9.626)
USD	23.664.940	AUD	30.547.899	Citibank	20/6/2018	522.821
USD	45.830.337	AUD	58.599.000	Credit Suisse	20/6/2018	1.437.594
USD	1.867.286	AUD	2.371.244	Deutsche Bank	20/6/2018	70.907
USD	33.486.057	AUD	43.912.243	JP Morgan	20/6/2018	219.536
USD	13.018.876	AUD	16.873.289	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	233.868
USD	12.176.258	AUD	15.934.880	Citibank	18/7/2018	102.289
USD	7.187.378	AUD	9.507.000	Credit Suisse	18/7/2018	(16.143)
USD	2.103.864	AUD	2.800.000	HSBC	18/7/2018	(17.716)
USD	88.851.586	AUD	115.452.831	JP Morgan	18/7/2018	1.372.171
USD	107.886.263	AUD	144.525.253	Bank of America		
				Merrill Lynch	15/8/2018	(1.642.614)
USD	1.757.505	AUD	2.329.000	Citibank	15/8/2018	(7.534)
USD	8.164.223	AUD	10.908.947	JP Morgan	15/8/2018	(103.153)
USD	15.604.563	BRL	57.456.000	Barclays Bank	20/6/2018	199.906
USD	27.026.501	BRL	90.751.000	Citibank	20/6/2018	2.695.047
USD	8.805.341	BRL	30.997.000	Credit Suisse	20/6/2018	494.665
USD	18.645.247	BRL	68.150.000	Deutsche Bank	20/6/2018	373.398
USD	2.467.920	BRL	8.270.000	HSBC	20/6/2018	250.632

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	19.961.065	BRL	70.048.000	JP Morgan	20/6/2018	1.180.339
USD	15.596.392	BRL	57.585.000	Barclays Bank	18/7/2018	198.652
USD	10.138.717	BRL	35.249.000	Citibank	18/7/2018	713.433
USD	8.799.547	BRL	31.058.000	Credit Suisse	18/7/2018	494.901
USD	18.636.802	BRL	68.301.000	Deutsche Bank	18/7/2018	373.694
USD	43.001.663	BRL	149.556.000	JP Morgan	18/7/2018	3.011.657
USD	15.601.340	BRL	57.739.000	Barclays Bank	15/8/2018	204.160
USD	11.020.785	BRL	41.132.000	Deutsche Bank	15/8/2018	52.171
USD	59.897.816	BRL	217.471.000	Goldman Sachs	15/8/2018	1.905.123
USD	4.603.012	BRL	17.085.000	JP Morgan	15/8/2018	46.979
USD	2.475.545	CAD	3.187.495	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	13.684
USD	3.921.256	CAD	5.000.000	BNP Paribas	20/6/2018	59.508
USD	421.596	CAD	530.937	Citibank	20/6/2018	11.527
USD	4.691.820	CAD	6.040.000	Credit Suisse	20/6/2018	26.828
USD	6.463.634	CAD	8.395.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(20.241)
USD	17.254.434	CAD	22.022.568	JP Morgan	20/6/2018	245.312
USD	5.005.590	CAD	6.434.000	UBS	20/6/2018	36.292
USD	2.475.262	CAD	3.184.677	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	13.881
USD	6.463.073	CAD	8.387.000	Deutsche Bank	18/7/2018	(19.092)
USD	3.924.359	CAD	5.000.000	Goldman Sachs	18/7/2018	59.947
USD	11.631.869	CAD	14.935.323	JP Morgan	18/7/2018	88.621
USD	5.004.423	CAD	6.427.000	UBS	18/7/2018	37.108
USD	6.461.910	CAD	8.381.000	Deutsche Bank	15/8/2018	(19.105)
USD	8.283.532	CAD	10.591.000	JP Morgan	15/8/2018	93.528
USD	5.596.783	CAD	7.200.000	Societe Generale	15/8/2018	29.035
USD	5.004.698	CAD	6.424.000	UBS	15/8/2018	37.028
USD	3.429.332	CHF	3.222.000	Barclays Bank	20/6/2018	156.098
USD	2.177.327	CHF	2.074.000	Credit Suisse	20/6/2018	70.348
USD	2.768.488	CHF	2.770.000	JP Morgan	20/6/2018	(45.558)
USD	5.477.607	CHF	5.400.000	HSBC	18/7/2018	(22.142)
USD	2.767.868	CHF	2.762.000	JP Morgan	18/7/2018	(45.152)
USD	3.187.986	CHF	3.029.000	Societe Generale	18/7/2018	103.034
USD	7.384.117	CHF	7.346.000	HSBC	15/8/2018	(115.607)
USD	3.135.105	CLP	1.922.453.000	Citibank	20/6/2018	89.892
USD	8.012.375	CLP	4.845.083.000	Credit Suisse	20/6/2018	337.642
USD	36.450.960	CLP	21.994.509.000	Deutsche Bank	20/6/2018	1.611.105
USD	45.436.502	CLP	27.329.943.000	Citibank	18/7/2018	2.134.640
USD	34.269.564	CLP	21.649.797.000	Credit Suisse	16/8/2018	(29.927)
USD	3.242.666	EUR	2.604.722	Citibank	20/6/2018	204.177
USD	9.228.897	EUR	7.493.278	Credit Suisse	20/6/2018	487.757
USD	20.711.868	EUR	16.630.562	HSBC	20/6/2018	1.311.804
USD	896.038	EUR	719.438	Societe Generale	20/6/2018	56.791
USD	4.345.364	EUR	3.565.000	Credit Suisse	18/7/2018	177.533
USD	4.689.352	EUR	4.000.000	HSBC	15/8/2018	3.156
USD	18.101.310	GBP	13.362.496	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	324.897
USD	5.222.464	GBP	3.713.616	Citibank	20/6/2018	282.160
USD	4.469.396	GBP	3.305.472	Credit Suisse	20/6/2018	72.056
USD	3.845.131	GBP	2.704.934	Deutsche Bank	20/6/2018	246.700
USD	30.223.854	GBP	22.105.482	JP Morgan	20/6/2018	816.460
USD	18.098.925	GBP	13.340.061	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	327.230
USD	2.786.227	GBP	1.992.127	Citibank	18/7/2018	132.305
USD	4.468.486	GBP	3.299.661	Credit Suisse	18/7/2018	72.661
USD	30.216.338	GBP	22.066.150	JP Morgan	18/7/2018	819.704
USD	9.049.470	GBP	6.765.976	Bank of America		
				Merrill Lynch	15/8/2018	24.296
USD	4.468.176	GBP	3.295.218	Credit Suisse	15/8/2018	72.666
USD	13.651.213	GBP	10.109.806	JP Morgan	15/8/2018	165.684
USD	3.334.993	GBP	2.500.000	Societe Generale	15/8/2018	229
USD	22.621.439	HKD	176.825.000	Citibank	20/6/2018	81.396
USD	8.490.748	HKD	66.366.659	Deutsche Bank	20/6/2018	30.930
USD	2.510.283	HKD	19.622.341	JP Morgan	20/6/2018	9.005
USD	7.527.664	HKD	59.015.000	BNP Paribas	18/7/2018	336
USD	148.837.479	HUF	38.468.958.869	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	8.275.653
USD	3.344.868	HUF	908.372.625	Barclays Bank	20/6/2018	25.763
USD	34.095.195	HUF	9.040.963.000	BNP Paribas	20/6/2018	1.060.398
USD	8.303.629	HUF	2.210.475.000	Citibank	20/6/2018	226.769

BlackRock Style Advantage Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	6.024.950	HUF	1.635.853.095	Credit Suisse	20/6/2018	47.702
USD	1.672.375	HUF	454.804.271	JP Morgan	20/6/2018	10.564
USD	5.337.326	HUF	1.416.532.739	Societe Generale	20/6/2018	161.453
USD	52.164.055	HUF	14.160.207.876	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	323.180
USD	3.344.267	HUF	906.303.107	Barclays Bank	18/7/2018	26.269
USD	34.087.731	HUF	9.020.458.000	BNP Paribas	18/7/2018	1.063.609
USD	79.599.648	HUF	20.041.560.800	Citibank	18/7/2018	6.226.993
USD	6.023.950	HUF	1.632.126.180	Credit Suisse	18/7/2018	48.695
USD	1.672.116	HUF	453.768.105	JP Morgan	18/7/2018	10.859
USD	5.336.554	HUF	1.413.309.732	Societe Generale	18/7/2018	162.392
USD	141.091.898	HUF	37.593.834.749	Bank of America		
				Merrill Lynch	15/8/2018	3.218.852
USD	3.344.192	HUF	904.744.267	Barclays Bank	15/8/2018	26.098
USD	21.113.603	HUF	5.618.114.000	BNP Paribas	15/8/2018	509.520
USD	6.024.139	HUF	1.629.318.925	Credit Suisse	15/8/2018	48.713
USD	1.671.953	HUF	452.987.624	JP Morgan	15/8/2018	10.649
USD	334.419	HUF	90.505.035	Societe Generale	15/8/2018	2.497
USD	5.688.886	INR	382.350.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	32.951
USD	11.276.351	INR	740.518.000	Citibank	20/6/2018	322.196
USD	5.681.745	INR	382.353.000	Deutsche Bank	20/6/2018	25.766
USD	2.718.972	INR	178.283.000	Goldman Sachs	20/6/2018	81.711
USD	12.547.679	INR	843.204.000	HSBC	20/6/2018	74.535
USD	5.687.945	INR	383.595.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	30.951
USD	5.680.711	INR	383.590.000	Deutsche Bank	18/7/2018	23.791
USD	12.547.849	INR	845.725.000	HSBC	18/7/2018	75.681
USD	27.523.366	JPY	2.996.865.510	Citibank	20/6/2018	(128.106)
USD	23.140.560	JPY	2.492.889.228	Credit Suisse	20/6/2018	139.175
USD	3.827.883	JPY	400.000.000	HSBC	20/6/2018	137.164
USD	7.925.315	JPY	868.921.262	JP Morgan	20/6/2018	(92.046)
USD	27.517.171	JPY	2.989.581.121	Citibank	18/7/2018	(121.708)
USD	13.380.322	JPY	1.451.023.871	Credit Suisse	18/7/2018	(34.491)
USD	7.923.856	JPY	866.812.017	JP Morgan	18/7/2018	(89.879)
USD	14.975.805	JPY	1.633.541.142	Citibank	15/8/2018	(154.532)
USD	13.105.680	JPY	1.419.019.858	Credit Suisse	15/8/2018	(37.698)
USD	6.343.200	JPY	691.696.200	HSBC	15/8/2018	(63.493)
USD	3.705.897	KRW	3.987.545.000	Barclays Bank	20/6/2018	4.858
USD	5.718.172	KRW	6.110.439.000	Citibank	20/6/2018	46.771
USD	95.151.284	KRW	101.233.445.000	HSBC	20/6/2018	1.191.501
USD	3.704.611	KRW	3.981.864.000	Barclays Bank	18/7/2018	4.961
USD	77.406.364	KRW	82.485.770.000	Citibank	18/7/2018	766.759
USD	12.184.531	KRW	12.980.759.000	HSBC	18/7/2018	123.781
USD	94.279.531	KRW	101.486.258.600	UBS	16/8/2018	(124.625)
USD	3.883.317	MXN	72.478.949	Citibank	20/6/2018	268.839
USD	5.871.856	MXN	110.701.465	Credit Suisse	20/6/2018	351.247
USD	5.438.749	MXN	103.826.895	Deutsche Bank	20/6/2018	260.970
USD	3.676.889	MXN	73.449.000	Goldman Sachs	20/6/2018	14.035
USD	15.574.188	MXN	299.483.641	JP Morgan	20/6/2018	639.136
USD	985.702	MXN	19.593.050	UBS	20/6/2018	8.609
USD	1.971.333	MXN	39.382.993	Deutsche Bank	18/7/2018	16.828
USD	3.675.791	MXN	73.762.000	Goldman Sachs	18/7/2018	15.120
USD	9.485.712	MXN	185.862.000	JP Morgan	18/7/2018	261.726
USD	985.425	MXN	19.676.007	UBS	18/7/2018	8.942
USD	1.971.196	MXN	39.559.040	Deutsche Bank	15/8/2018	17.181
USD	3.675.940	MXN	74.096.000	Goldman Sachs	15/8/2018	15.976
USD	4.486.776	MXN	89.674.000	JP Morgan	15/8/2018	57.339
USD	985.343	MXN	19.763.960	UBS	15/8/2018	9.104
USD	23.376.892	NOK	182.593.833	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	1.064.812
USD	7.062.017	NOK	57.521.402	Barclays Bank	20/6/2018	33.181
USD	3.474.036	NOK	28.175.598	Credit Suisse	20/6/2018	31.115
USD	14.004.640	NOK	113.572.000	Deutsche Bank	20/6/2018	126.693
USD	15.799.307	NOK	122.087.600	HSBC	20/6/2018	880.795
USD	21.488.271	NOK	166.129.167	JP Morgan	20/6/2018	1.188.093
USD	23.370.987	NOK	182.333.154	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	1.065.470
USD	7.060.863	NOK	57.444.212	Barclays Bank	18/7/2018	33.491

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	3.473.328	NOK	28.137.788	Credit Suisse	18/7/2018	31.124
USD	14.002.053	NOK	113.418.000	Deutsche Bank	18/7/2018	127.192
USD	21.481.991	NOK	165.886.846	JP Morgan	18/7/2018	1.188.414
USD	39.667.185	NOK	318.729.800	Citibank	15/8/2018	633.322
USD	9.110.456	NZD	13.021.186	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(15.879)
USD	4.882.872	NZD	6.732.368	Citibank	20/6/2018	164.266
USD	4.405.713	NZD	5.989.000	Credit Suisse	20/6/2018	208.121
USD	2.551.785	NZD	3.683.814	JP Morgan	20/6/2018	(30.140)
USD	2.314.511	NZD	3.354.631	UBS	20/6/2018	(36.695)
USD	7.779.699	NZD	11.188.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	(62.041)
USD	2.343.562	NZD	3.396.363	JP Morgan	18/7/2018	(36.970)
USD	2.313.983	NZD	3.353.637	UBS	18/7/2018	(36.603)
USD	7.779.283	NZD	11.187.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	15/8/2018	(62.155)
USD	2.343.374	NZD	3.395.860	JP Morgan	15/8/2018	(36.927)
USD	2.313.768	NZD	3.353.140	UBS	15/8/2018	(36.590)
USD	11.300.319	PLN	38.859.676	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	805.667
USD	2.385.118	PLN	8.652.000	Deutsche Bank	20/6/2018	48.513
USD	6.518.559	PLN	22.769.000	Goldman Sachs	20/6/2018	369.441
USD	14.455.150	PLN	48.651.324	Societe Generale	20/6/2018	1.316.114
USD	9.420.392	PLN	32.447.951	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	651.906
USD	2.384.387	PLN	8.644.000	Deutsche Bank	18/7/2018	48.499
USD	6.516.918	PLN	22.746.000	Goldman Sachs	18/7/2018	370.214
USD	15.927.264	PLN	53.602.049	Societe Generale	18/7/2018	1.442.257
USD	16.387.459	RUB	1.038.143.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(259.685)
USD	13.406.924	RUB	829.772.000	Citibank	20/6/2018	101.112
USD	7.585.397	RUB	440.787.000	Credit Suisse	20/6/2018	517.156
USD	2.169.011	RUB	139.988.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(75.766)
USD	20.002.766	RUB	1.268.805.000	HSBC	20/6/2018	(343.160)
USD	17.082.127	RUB	1.085.566.000	JP Morgan	20/6/2018	(325.469)
USD	4.552.958	RUB	286.438.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	(26.498)
USD	8.639.471	RUB	540.653.000	Citibank	18/7/2018	(4.272)
USD	14.902.738	RUB	948.342.000	JP Morgan	18/7/2018	(258.974)
USD	4.551.971	RUB	287.350.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	15/8/2018	(28.455)
USD	3.453.826	RUB	214.866.000	Citibank	15/8/2018	28.812
USD	83.223.729	SEK	684.388.148	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	5.537.032
USD	89.444.699	SEK	745.886.110	Barclays Bank	20/6/2018	4.777.207
USD	10.887.605	SEK	94.359.181	Credit Suisse	20/6/2018	176.646
USD	130.906.118	SEK	1.117.624.929	Deutsche Bank	20/6/2018	4.041.574
USD	9.301.929	SEK	78.375.033	JP Morgan	20/6/2018	405.374
USD	5.022.542	SEK	43.758.965	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	44.185
USD	26.743.094	SEK	232.900.779	Barclays Bank	18/7/2018	246.506
USD	10.885.119	SEK	94.108.559	Credit Suisse	18/7/2018	178.604
USD	265.842.943	SEK	2.232.578.457	Deutsche Bank	18/7/2018	11.847.606
USD	9.299.678	SEK	78.161.839	JP Morgan	18/7/2018	407.385
USD	5.022.497	SEK	43.662.786	Bank of America		
				Merrill Lynch	15/8/2018	44.450
USD	20.278.825	SEK	175.879.518	Barclays Bank	15/8/2018	226.586
USD	202.074.275	SEK	1.743.375.600	Citibank	15/8/2018	3.309.896
USD	10.885.314	SEK	93.903.714	Credit Suisse	15/8/2018	179.237
USD	63.410.654	SEK	553.563.904	Deutsche Bank	15/8/2018	298.158
USD	1.673.560	SEK	14.591.078	JP Morgan	15/8/2018	10.013
USD	70.020.977	SGD	91.796.800	Barclays Bank	20/6/2018	1.467.172
USD	70.008.389	SGD	91.795.000	Citibank	20/6/2018	1.455.929
USD	126.257.553	SGD	164.779.600	HSBC	18/7/2018	3.128.737
USD	18.691.621	SGD	25.017.800	Deutsche Bank	15/8/2018	(14.776)
USD	3.369.888	THB	106.539.000	Citibank	20/6/2018	37.889
USD	3.367.690	THB	106.419.000	Citibank	18/7/2018	36.160
USD	7.666.307	TRY	31.701.495	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	721.968

BlackRock Style Advantage Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
USD	1.605.899	TRY	6.797.449	BNP Paribas	20/6/2018	116.891
USD	4.720.831	TRY	19.988.000	Citibank	20/6/2018	342.381
USD	1.196.324	TRY	4.919.925	Deutsche Bank	20/6/2018	118.595
USD	7.902.375	TRY	33.851.131	JP Morgan	20/6/2018	487.150
USD	7.663.603	TRY	31.963.363	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	739.200
USD	4.718.301	TRY	20.152.000	Citibank	18/7/2018	352.660
USD	1.127.303	TRY	4.667.205	Deutsche Bank	18/7/2018	116.220
USD	7.899.856	TRY	34.170.432	JP Morgan	18/7/2018	497.324
USD	3.390.520	TRY	15.676.000	JP Morgan	15/8/2018	31.827
USD	5.936.075	TWD	174.466.000	BNP Paribas	20/6/2018	106.892
USD	101.981.166	TWD	2.970.590.000	Citibank	20/6/2018	2.729.084
USD	91.466.454	TWD	2.682.510.000	Credit Suisse	20/6/2018	1.839.577
USD	132.278.792	TWD	3.871.331.400	HSBC	20/6/2018	2.931.524
USD	24.863.877	TWD	743.307.000	JP Morgan	20/6/2018	28.821
USD	8.236.869	TWD	246.200.000	UBS	20/6/2018	10.939
USD	5.933.826	TWD	174.017.000	BNP Paribas	18/7/2018	106.338
USD	16.265.802	TWD	483.013.000	Citibank	18/7/2018	90.643
USD	33.830.832	TWD	1.008.137.000	Credit Suisse	18/7/2018	70.298
USD	228.434.122	TWD	6.606.314.800	Goldman Sachs	18/7/2018	7.201.580
USD	40.000.294	TWD	1.193.067.000	HSBC	18/7/2018	46.817
USD	24.848.125	TWD	741.353.000	JP Morgan	18/7/2018	21.665
USD	8.231.195	TWD	245.660.000	UBS	18/7/2018	4.522
USD	228.482.836	TWD	6.800.791.600	ANZ	15/8/2018	208.259
USD	23.342.502	TWD	695.905.000	Credit Suisse	15/8/2018	(16.164)
USD	39.994.452	TWD	1.190.579.000	HSBC	15/8/2018	31.616
USD	16.608.125	TWD	494.673.000	JP Morgan	15/8/2018	3.989
USD	10.578.506	ZAR	128.169.883	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	453.932
USD	4.146.537	ZAR	49.646.357	Deutsche Bank	20/6/2018	224.803
USD	13.272.152	ZAR	162.286.760	JP Morgan	20/6/2018	452.571
USD	10.575.457	ZAR	128.586.752	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	455.332
USD	744.167	ZAR	9.523.625	Deutsche Bank	18/7/2018	(5.368)
USD	13.268.973	ZAR	162.822.623	JP Morgan	18/7/2018	454.392
ZAR	722.972.282	USD	60.277.930	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(3.167.901)
ZAR	141.321.962	USD	11.697.828	Citibank	20/6/2018	(534.328)
ZAR	68.567.000	USD	5.623.242	Deutsche Bank	20/6/2018	(206.902)
ZAR	81.424.604	USD	6.492.485	JP Morgan	20/6/2018	(60.480)
ZAR	113.766.951	USD	8.970.341	Societe Generale	20/6/2018	16.495
ZAR	7.979.573	USD	631.540	Bank of America		
				Merrill Lynch	18/7/2018	(3.526)
ZAR	902.193.200	USD	73.799.035	Citibank	18/7/2018	(2.793.990)
ZAR	68.759.000	USD	5.430.477	JP Morgan	18/7/2018	(18.958)
ZAR	114.157.427	USD	8.967.650	Societe Generale	18/7/2018	16.848
ZAR	8.008.378	USD	631.536	Bank of America		
				Merrill Lynch	15/8/2018	(3.562)
ZAR	595.857.000	USD	46.798.115	Citibank	15/8/2018	(74.216)
ZAR	69.012.000	USD	5.430.434	JP Morgan	15/8/2018	(18.884)
ZAR	114.570.622	USD	8.967.533	Societe Generale	15/8/2018	16.479
						6.644.107
Catégorie d'Actions couverte en dollars australiens						
AUD	1.541.882.320	USD	1.151.963.155	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	16.066.343
USD	72.426.991	AUD	96.533.978	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(700.856)
						15.365.487

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Catégorie d'Actions couverte en BRL						
BRL	52.622.390	USD	14.100.130	State Street Bank & Trust Company	3/7/2018	(8.511)
BRL	110.831.350	USD	29.888.507	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(127.535)
USD	158.424	BRL	591.768	State Street Bank & Trust Company	3/7/2018	(44)
USD	29.729.584	BRL	110.831.350	State Street Bank & Trust Company	4/6/2018	(31.389)
						(167.479)
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	50.625.101	USD	50.578.021	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	818.281
USD	4.362.007	CHF	4.360.817	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(65.241)
						753.040
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	742.067.173	USD	880.676.114	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(15.529.108)
USD	65.425.586	EUR	55.217.755	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	1.049.371
						(14.479.737)
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
GBP	469.704.369	USD	636.458.624	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(11.839.094)
USD	50.960.201	GBP	37.708.569	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	814.811
						(11.024.283)
Catégorie d'Actions couverte en yens japonais						
JPY	66.442.782.459	USD	607.028.283	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	5.706.433
USD	43.528.669	JPY	4.774.480.415	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(501.545)
						5.204.888
Catégorie d'Actions couverte en dollars néo-zélandais						
NZD	108.950.865	USD	76.014.928	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	346.604
USD	6.819.369	NZD	9.813.082	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(58.428)
						288.176
Catégorie d'Actions couverte en couronnes suédoises						
SEK	152.596	USD	17.494	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(182)
USD	694	SEK	6.052	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	8
						(174)
Total (exposition brute sous-jacente – 12.396.903.824 USD)						2.584.025

BlackRock Style Advantage Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
1.234	EUR	Amsterdam Index	Juin 2018	159.753.338	(2.052.105)
5.839	AUD	Australian 10 Year Bond	Juin 2018	569.314.278	5.273.813
3.330	EUR	CAC 40 Index	Juin 2018	209.245.577	(2.925.847)
6.798	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	471.359.842	13.480.018
(736)	EUR	DAX Index	Juin 2018	271.511.047	(4.948.681)
(1.872)	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	254.311.200	(680.187)
1.419	EUR	Euro Bund	Juin 2018	166.693.567	4.757.158
(75)	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	7.662.746	(50.774)
2.431	EUR	FTSE MIB Index	Juin 2018	307.748.768	(23.184.174)
(2.521)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index	Juin 2018	99.875.708	2.460.443
1.786	HKD	Hang Seng China Enterprises Index	Juin 2018	135.735.727	(578.261)
688	HKD	Hang Seng Index	Juin 2018	133.665.040	(26.641)
(856)	EUR	IBEX 35 Index	Juin 2018	94.470.690	5.744.047
99	JPY	Japan 10 Year Bond	Juin 2018	93.962.208	152.798
(2.934)	SGD	MSCI Singapore Index	Juin 2018	85.759.370	2.274.471
2.961	SEK	OMX Stockholm 30 Index	Juin 2018	52.142.161	(1.478.799)
(1.890)	CAD	S&P/TSX 60 Index	Juin 2018	276.277.906	(8.657.721)
(2.193)	USD	SGX NIFTY 50 Index	Juin 2018	47.000.376	(275.790)
(1.499)	AUD	SPI 200 Index	Juin 2018	170.778.074	(822.451)
3.853	CHF	Swiss Market Index	Juin 2018	333.898.001	(8.909.374)
49	JPY	Topix Index	Juin 2018	7.878.750	(269.608)
(3.407)	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	577.056.965	(8.551.073)
(12.644)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	1.272.858.962	(14.278.254)
Total				5.798.960.301	(43.546.992)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	68,23
Finance	15,87
Portefeuille de titres à la valeur de marché	84,10
Autres éléments de l'actif net	15,90
	100,00

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS				Chypre			
Australie				EUR 12.000	Cyprus Government International Bond 3,875% 6/5/2022	12.895	0,04
EUR 100.000	Westpac Banking Corp RegS 0,50% 17/5/2024	100.163	0,32	EUR 25.000	Cyprus Government International Bond RegS 3,75% 26/7/2023	26.694	0,09
EUR 100.000	Westpac Banking Corp RegS 0,75% 22/7/2021	102.283	0,32	EUR 45.000	Cyprus Government International Bond RegS 2,75% 27/6/2024	45.275	0,14
		202.446	0,64	EUR 20.000	Cyprus Government International Bond RegS 4,25% 4/11/2025	21.613	0,07
Autriche						106.477	0,34
EUR 100.000	Erste Group Bank AG RegS 0,625% 19/1/2023	102.183	0,32	Danemark			
EUR 380.000	Republic of Austria Government Bond RegS '144A' 0,50% 20/4/2027	379.096	1,20	DKK 755.000	Denmark Government Bond 4,00% 15/11/2019	108.349	0,34
EUR 18.000	Republic of Austria Government Bond RegS '144A' 3,80% 26/1/2062	31.071	0,10	DKK 1.200.000	Nordea Kredit Realkreditatieselskab 1,00% 1/4/2022	167.438	0,53
EUR 60.000	Republic of Austria Government Bond RegS '144A' 2,10% 20/9/2117	67.897	0,22	DKK 2.269.301	Nordea Kredit Realkreditatieselskab 2,00% 1/10/2047	304.497	0,97
		580.247	1,84	DKK 396.998	Nykredit Realkredit 1,50% 1/10/2047	52.664	0,17
Belgique				DKK 2.446.000	Nykredit Realkredit A/S 1,00% 1/10/2020	338.430	1,07
GBP 100.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV RegS 1,75% 7/3/2025	112.161	0,36	DKK 1.100.000	Nykredit Realkredit A/S 1,00% 1/1/2021	152.497	0,48
GBP 20.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV RegS 2,25% 24/5/2029	21.965	0,07	DKK 1.726.000	Nykredit Realkredit A/S 1,00% 1/1/2022	240.639	0,76
EUR 100.000	BNP Paribas Fortis SA 0,875% 22/3/2028	99.908	0,32	DKK 1.480.639	Nykredit Realkredit A/S 2,00% 1/10/2047	200.325	0,64
EUR 100.000	BNP Paribas Fortis SA RegS 24/10/2023 (Zero Coupon)	98.498	0,31			1.564.839	4,96
EUR 100.000	KBC Group NV RegS 0,75% 18/10/2023	98.588	0,31	Finlande			
EUR 100.000	KBC Group NV RegS (Contingent Convertible Bond) FRN (Perpetual)	102.455	0,32	EUR 70.000	Finland Government Bond RegS '144A' 15/4/2022 (Zero Coupon)	70.671	0,22
EUR 260.000	Kingdom of Belgium Government Bond 1,25% 22/4/2033	264.048	0,84	EUR 110.000	Finland Government Bond RegS '144A' 0,50% 15/9/2027	109.638	0,35
EUR 86.029	Kingdom of Belgium Government Bond RegS '144A' 0,50% 22/10/2024	87.561	0,28	EUR 25.000	Finland Government Bond RegS '144A' 1,375% 15/4/2047	25.963	0,08
EUR 182.657	Kingdom of Belgium Government Bond RegS '144A' 0,80% 22/6/2025	188.833	0,60			206.272	0,65
EUR 402.828	Kingdom of Belgium Government Bond RegS '144A' 0,80% 22/6/2027	409.495	1,30	France			
EUR 59.397	Kingdom of Belgium Government Bond RegS '144A' 1,90% 22/6/2038	64.718	0,20	EUR 100.000	Agence Francaise de Developpement 1,00% 31/1/2028	101.609	0,32
EUR 193.771	Kingdom of Belgium Government Bond RegS '144A' 1,60% 22/6/2047	192.597	0,61	EUR 200.000	Agence Francaise de Developpement RegS 1,375% 5/7/2032	203.874	0,65
		1.740.827	5,52	EUR 200.000	AXA Bank Europe SCF RegS 0,125% 14/3/2022	200.690	0,64
Canada				EUR 100.000	AXA SA RegS FRN 16/4/2040	108.268	0,34
EUR 125.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 0,25% 24/1/2023	125.085	0,40	EUR 100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 2,50% 25/5/2028	99.787	0,32
EUR 250.000	CPPIB Capital Inc RegS 0,375% 20/6/2024	249.630	0,79	EUR 200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 1,25% 26/5/2027	199.802	0,63
EUR 125.000	National Bank of Canada 0,75% 13/3/2025	126.445	0,40	EUR 100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS FRN 3/6/2020	100.679	0,32
		501.160	1,59	EUR 100.000	BNP Paribas SA 1,125% 22/11/2023	100.036	0,32
				GBP 100.000	BNP Paribas SA RegS 1,125% 16/8/2022	112.007	0,36
				EUR 100.000	BNP Paribas SA RegS 1,625% 23/2/2026	104.491	0,33
				EUR 100.000	BPCE SA 1,375% 23/3/2026	97.620	0,31
				EUR 100.000	BPCE SA RegS 0,375% 5/10/2023	98.630	0,31
				EUR 200.000	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA RegS 0,375% 31/7/2020	202.595	0,64

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
France suite				Allemagne suite			
EUR 100.000	Caisse Francaise de Financement Local 1,00% 25/4/2028	100.844	0,32	EUR 17.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50% 15/2/2028	17.261	0,05
EUR 200.000	Caisse Francaise de Financement Local RegS 0,375% 11/5/2024	200.165	0,64	EUR 70.919	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,00% 4/1/2037	110.673	0,35
EUR 100.000	Caisse Francaise de Financement Local RegS 0,625% 26/1/2023	102.230	0,32	EUR 68.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe RegS 1,25% 15/8/2048	71.707	0,23
EUR 300.000	Cie de Financement Foncier SA 0,25% 11/4/2023	300.357	0,95	EUR 58.000	Bundesrepublik Deutschland RegS 3,25% 4/7/2042	87.506	0,28
EUR 100.000	Cie de Financement Foncier SA 0,75% 29/5/2026	100.093	0,32	EUR 155.731	Bundesrepublik Deutschland RegS 2,50% 4/7/2044*	210.872	0,67
EUR 100.000	Cie de Financement Foncier SA RegS 0,125% 18/2/2020	100.716	0,32	EUR 239.000	Bundesrepublik Deutschland RegS 2,50% 15/8/2046	327.621	1,04
EUR 100.000	Cie de Saint-Gobain RegS 27/3/2020 (Zero Coupon)	100.017	0,32	EUR 46.000	Commerzbank AG RegS 0,125% 23/2/2023	46.015	0,15
EUR 100.000	Credit Agricole SA/London RegS 0,875% 19/1/2022	102.133	0,32	EUR 45.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1,00% 17/12/2027	45.509	0,14
EUR 100.000	Credit Agricole SA/London RegS 1,375% 3/5/2027	100.895	0,32	EUR 38.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1,625% 16/8/2033	39.274	0,12
EUR 200.000	Engie SA FRN (Perpetual)	191.766	0,61	EUR 100.000	Deutsche Bank AG 1,75% 17/1/2028	91.512	0,29
EUR 85.000	France Government Bond OAT RegS 0,50% 25/5/2025	86.540	0,27	EUR 100.000	Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG RegS 0,50% 30/9/2026	99.117	0,31
EUR 87.000	France Government Bond OAT RegS '144A' 1,75% 25/5/2066	86.679	0,28	EUR 100.000	Erste Abwicklungsanstalt 7/6/2019 (Zero Coupon)	100.421	0,32
EUR 344.808	French Republic Government Bond OAT RegS 0,25% 25/11/2020	350.963	1,11	EUR 100.000	Erste Abwicklungsanstalt RegS 12/6/2020 (Zero Coupon)	100.660	0,32
EUR 174.286	French Republic Government Bond OAT RegS 3,00% 25/4/2022	196.743	0,62	EUR 20.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,875% 21/1/2019	20.559	0,06
EUR 50.877	French Republic Government Bond OAT RegS 2,25% 25/10/2022	56.379	0,18	EUR 160.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/12/2022 (Zero Coupon)	160.442	0,51
EUR 32.554	French Republic Government Bond OAT RegS 2,50% 25/5/2030	38.737	0,12	EUR 331.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125% 24/2/2023	333.469	1,06
EUR 56.196	French Republic Government Bond OAT RegS 5,75% 25/10/2032	92.559	0,29	EUR 6.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,25% 30/6/2025	5.983	0,02
EUR 322.156	French Republic Government Bond OAT RegS '144A' 2,00% 25/5/2048	352.381	1,12	EUR 100.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,50% 15/9/2027	98.969	0,31
EUR 23.727	French Republic Government Bond OAT RegS 4,00% 25/4/2060	39.975	0,13	EUR 175.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,125% 9/5/2033	176.664	0,56
EUR 81.000	French Republic Government Bond OAT RegS 25/5/2022 (Zero Coupon)	81.780	0,26	EUR 89.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg RegS 0,05% 11/11/2021	89.508	0,28
EUR 322.826	French Republic Government Bond OAT RegS 25/3/2023 (Zero Coupon)	324.400	1,03	EUR 100.000	SAP SE RegS 2,125% 13/11/2019	103.359	0,33
EUR 80.114	French Republic Government Bond OAT RegS '144A' 1,75% 25/6/2039	86.293	0,27	EUR 193.000	State of Lower Saxony RegS 1/3/2021 (Zero Coupon)	194.574	0,62
EUR 50.000	French Republic Government Bond OAT RegS 4,00% 25/4/2055	82.040	0,26	EUR 163.000	State of North Rhine-Westphalia Germany RegS 0,50% 16/2/2027	161.400	0,51
EUR 100.000	La Poste Variable SA 3,125% (Perpetual)	97.815	0,31			2.807.608	8,90
EUR 200.000	Orange SA 1,375% 20/3/2028	198.686	0,63	Irlande			
EUR 100.000	RCI Banque SA 0,25% 12/7/2021	99.900	0,32	EUR 284.000	Ireland Government Bond 0,90% 15/5/2028	282.748	0,90
EUR 100.000	RCI Banque Variable SA 0,253% 12/3/2025	98.855	0,31	EUR 260.000	Ireland Government Bond 1,30% 15/5/2033	255.421	0,81
EUR 100.000	Societe Generale SFH SA FRN 23/2/2028	96.976	0,31	EUR 50.000	Ireland Government Bond RegS 1,00% 15/5/2026	51.372	0,16
EUR 100.000	Societe Generale SFH SA RegS 0,50% 2/6/2025	100.132	0,32	EUR 97.373	Ireland Government Bond RegS 2,40% 15/5/2030	110.832	0,35
EUR 100.000	TOTAL SA FRN (Perpetual)	104.920	0,33	EUR 175.336	Ireland Government Bond RegS 1,70% 15/5/2037	178.901	0,57
EUR 100.000	Total SA RegS FRN (Perpetual)	102.915	0,33	EUR 31.836	Ireland Government Bond RegS 2,00% 18/2/2045	33.474	0,11
		5.904.972	18,73			912.748	2,90
Allemagne				Italie			
EUR 25.000	BASF SE RegS 0,875% 15/11/2027	24.245	0,08	EUR 200.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA RegS 0,75% 21/11/2022	188.032	0,60
EUR 90.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,25% 15/2/2027	90.288	0,29	EUR 100.000	Enel SpA Variable FRN 24/11/2081	95.831	0,30

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

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Italie suite				Luxembourg suite			
EUR 100.000	Intesa Sanpaolo SpA RegS 1,125% 14/1/2020	100.698	0,32	EUR 100.000	Richemont International Holding SA 1,50% 26/3/2030	100.961	0,32
EUR 86.091	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,70% 15/9/2018	87.031	0,28			1.061.733	3,37
EUR 70.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,50% 1/5/2019	71.015	0,23	Mexique			
EUR 199.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,75% 1/5/2021	211.473	0,67	EUR 100.000	Mexico Government International Bond 1,75% 17/4/2028	95.725	0,30
EUR 60.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,35% 1/11/2021	57.624	0,18			95.725	0,30
EUR 266.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,45% 15/9/2022	260.135	0,83	Pays-Bas			
EUR 161.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50% 1/5/2023	178.280	0,57	EUR 100.000	ABN AMRO Bank NV 0,875% 22/4/2025	100.131	0,32
EUR 152.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,65% 15/10/2023	140.598	0,45	EUR 100.000	ABN AMRO Bank NV 1,45% 12/4/2038	99.556	0,32
EUR 40.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,05% 1/8/2027	37.703	0,12	EUR 100.000	Aegon Bank NV RegS 0,375% 21/11/2024	99.241	0,31
EUR 27.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,95% 1/9/2038	25.908	0,08	EUR 100.000	Airbus Group Finance BV RegS 0,875% 13/5/2026	99.004	0,31
EUR 255.487	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,65% 23/4/2020	259.064	0,82	EUR 100.000	ASML Holding NV RegS 1,375% 7/7/2026	101.767	0,32
EUR 34.065	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS 1,25% 27/10/2020	34.350	0,11	EUR 100.000	Cooperatieve Rabobank UA RegS 1,25% 23/3/2026	102.507	0,32
EUR 650.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 4,75% 1/9/2028	751.413	2,38	EUR 52.000	Daimler International Finance BV 1,00% 11/11/2025	51.666	0,16
EUR 221.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 1,65% 1/3/2032	189.289	0,60	EUR 100.000	de Volksbank NV 1,00% 8/3/2028	100.838	0,32
EUR 71.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 2,25% 1/9/2036	63.013	0,20	EUR 100.000	de Volksbank NV RegS 0,75% 18/5/2027	99.562	0,32
EUR 64.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 4,75% 1/9/2044	79.067	0,25	GBP 100.000	Deutsche Telekom International Finance BV RegS 2,25% 13/4/2029	109.660	0,35
EUR 187.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 3,25% 1/9/2046	187.563	0,59	EUR 100.000	Enexis Holding NV RegS 1,50% 20/10/2023	105.034	0,33
EUR 84.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 2,70% 1/3/2047	75.926	0,24	EUR 200.000	Gas Natural Fenosa Finance BV RegS 0,875% 15/5/2025	192.762	0,61
EUR 88.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 3,45% 1/3/2048	89.526	0,28	EUR 100.000	Nederlandse Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV RegS 0,125% 20/4/2022	101.033	0,32
EUR 18.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro RegS '144A' 2,80% 1/3/2067	15.814	0,05	EUR 23.509	Netherlands Government Bond 5,50% 15/1/2028	34.837	0,11
		3.199.353	10,15	EUR 203.000	Netherlands Government Bond RegS '144A' 15/1/2022 (Zero Coupon)	205.850	0,65
Japon				EUR 103.422	Netherlands Government Bond RegS '144A' 0,25% 15/7/2025	104.044	0,33
EUR 100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc RegS 0,934% 11/10/2024	100.006	0,32	EUR 116.423	Netherlands Government Bond RegS '144A' 0,50% 15/7/2026	118.413	0,38
		100.006	0,32	EUR 33.000	Netherlands Government Bond RegS '144A' 2,75% 15/1/2047	47.035	0,15
Luxembourg				EUR 200.000	NN Group NV RegS FRN 8/4/2044	220.155	0,70
EUR 100.000	CNH Industrial Finance Europe SA RegS 1,75% 12/9/2025	99.734	0,32	EUR 100.000	Vonovia Finance BV 1,50% 22/3/2026	99.731	0,32
EUR 105.000	European Financial Stability Facility 0,40% 17/2/2025	105.105	0,33	EUR 100.000	Vonovia Finance BV 1,50% 14/1/2028	96.721	0,31
EUR 135.000	European Financial Stability Facility 1,45% 5/9/2040	135.246	0,43			2.289.547	7,26
EUR 26.000	European Financial Stability Facility RegS 1,50% 22/1/2020	26.809	0,08	Nouvelle-Zélande			
EUR 10.000	European Financial Stability Facility RegS 1,75% 29/10/2020	10.497	0,03	EUR 125.000	ANZ New Zealand International Ltd/ London RegS 0,125% 22/9/2023	123.256	0,39
EUR 50.000	European Financial Stability Facility RegS 0,20% 28/4/2025	49.326	0,16	EUR 100.000	Chorus Ltd 1,125% 18/10/2023	101.357	0,32
EUR 248.000	European Financial Stability Facility RegS 0,40% 31/5/2026	245.160	0,78			224.613	0,71
EUR 209.000	European Financial Stability Facility RegS 0,75% 3/5/2027	210.051	0,67	Norvège			
EUR 5.000	European Financial Stability Facility RegS 1,20% 17/2/2045	4.631	0,01	EUR 125.000	DNB Bank ASA Variable FRN 20/3/2028	123.127	0,39
EUR 75.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1,75% 24/4/2028	74.213	0,24	NOK 695.000	Norway Government Bond '144A' 2,00% 26/4/2028	74.572	0,24

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Norvège suite				Espagne suite			
EUR 225.000	SpareBank 1 Boligkreditt 0,50% 30/1/2025	224.738	0,71	EUR 89.000	Spain Government Bond '144A' 5,50% 30/4/2021	103.016	0,33
		422.437	1,34	EUR 245.000	Spain Government Bond 0,75% 30/7/2021	250.007	0,79
Pologne				EUR 37.000	Spain Government Bond 0,40% 30/4/2022	37.105	0,12
EUR 100.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 1,375% 1/6/2025	100.664	0,32	EUR 217.000	Spain Government Bond '144A' 1,40% 30/4/2028	215.404	0,68
EUR 100.000	mBank Hipoteczny SA 1,073% 5/3/2025	101.027	0,32	EUR 32.000	Spain Government Bond '144A' 2,70% 31/10/2048	32.712	0,10
EUR 75.000	Republic of Poland Government International Bond RegS 0,50% 20/12/2021	76.285	0,24	EUR 51.000	Spain Government Bond RegS '144A' 4,30% 31/10/2019	54.211	0,17
EUR 30.000	Republic of Poland Government International Bond RegS 1,00% 25/10/2028	29.157	0,09	EUR 257.000	Spain Government Bond RegS '144A' 4,40% 31/10/2023	307.786	0,98
		307.133	0,97	EUR 219.000	Spain Government Bond RegS '144A' 4,80% 31/1/2024	268.057	0,85
Portugal				EUR 41.000	Spain Government Bond RegS '144A' 1,95% 30/4/2026	43.303	0,14
EUR 100.000	Banco Santander Totta SA RegS 1,25% 26/9/2027	101.301	0,32	EUR 2.000	Spain Government Bond RegS '144A' 1,95% 30/7/2030	2.054	0,01
EUR 51.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 2,125% 17/10/2028	51.795	0,17	EUR 222.000	Spain Government Bond RegS '144A' 2,35% 30/7/2033	232.496	0,74
EUR 170.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 2,25% 18/4/2034	164.550	0,52	EUR 62.000	Spain Government Bond RegS '144A' 4,70% 30/7/2041	87.615	0,28
EUR 25.737	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 4,125% 14/4/2027	30.621	0,10	EUR 119.000	Spain Government Bond RegS '144A' 2,90% 31/10/2046	127.487	0,40
EUR 15.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 4,80% 15/6/2020	16.476	0,05	EUR 37.000	Spain Government Bond RegS '144A' 3,45% 30/7/2066	42.583	0,13
EUR 3	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 2,875% 21/7/2026	3	0,00	EUR 133.559	Spain Government Inflation Linked Bond RegS '144A' 0,55% 30/11/2019	137.709	0,44
EUR 7.400	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT RegS '144A' 4,10% 15/2/2045*	8.893	0,03			3.923.235	12,44
		373.639	1,19	Supranational			
Singapour				EUR 235.000	European Investment Bank 0,875% 14/1/2028	238.620	0,76
EUR 135.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 0,625% 18/4/2025	132.179	0,42	EUR 210.000	European Investment Bank 1,125% 13/4/2033	210.052	0,67
		132.179	0,42	EUR 84.000	European Investment Bank 1,50% 15/11/2047	84.451	0,27
Espagne				EUR 25.000	European Stability Mechanism RegS 1,80% 2/11/2046	26.809	0,08
EUR 100.000	Adif - Alta Velocidad 1,25% 4/5/2026	98.612	0,31	EUR 160.000	European Union 0,50% 4/4/2025	162.089	0,51
EUR 155.000	Autonomous Community of Madrid Spain RegS 0,747% 30/4/2022	156.796	0,50	EUR 40.000	European Union 1,25% 4/4/2033	41.112	0,13
EUR 235.000	Autonomous Community of Madrid Spain RegS 1,773% 30/4/2028	237.710	0,75	EUR 7.000	European Union RegS 1,375% 4/10/2029	7.424	0,02
EUR 100.000	Banco de Sabadell SA 0,875% 5/3/2023	97.758	0,31	EUR 9.000	European Union RegS 0,75% 4/4/2031	8.795	0,03
EUR 100.000	CaixaBank SA RegS 1,125% 17/5/2024	97.905	0,31			779.352	2,47
EUR 100.000	FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico RegS 3,375% 17/3/2019	102.707	0,33	Suède			
EUR 100.000	FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico RegS 0,031% 17/6/2020	99.982	0,32	SEK 2.000.000	Landshypotek Bank AB 0,75% 25/5/2023	194.655	0,62
EUR 100.000	Iberdrola Finanzas SA 1,621% 29/11/2029	98.584	0,31	SEK 500.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 1,50% 21/12/2022	50.764	0,16
EUR 100.000	Santander Consumer Finance SA RegS 0,50% 4/10/2021	100.111	0,32	SEK 2.000.000	Stadshypotek AB 4,50% 21/9/2022	228.015	0,72
EUR 521.000	Spain Government Bond 1,40% 31/1/2020	533.983	1,69	EUR 100.000	Swedbank AB 0,30% 6/9/2022	99.854	0,32
EUR 241.000	Spain Government Bond 1,15% 30/7/2020	247.596	0,78	EUR 100.000	Swedbank AB RegS FRN 22/11/2027	98.413	0,31
EUR 110.000	Spain Government Bond 0,05% 31/1/2021	109.946	0,35	SEK 800.000	Swedbank Hypotek AB RegS 1,00% 15/6/2022	79.798	0,25
						751.499	2,38
				Suisse			
				EUR 200.000	UBS AG RegS (Contingent Convertible Bond) FRN 12/2/2026	218.106	0,69
				EUR 200.000	UBS AG/London 0,25% 10/1/2022	199.140	0,63

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

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Suisse suite				OBLIGATIONS			
EUR 200.000	UBS Group Funding Switzerland AG RegS 1,50% 30/11/2024	202.510	0,65	Nouvelle-Zélande			
		619.756	1,97	NZD 170.000	New Zealand Government Bond 2,50% 20/9/2040	113.939	0,36
Royaume-Uni						113.939	0,36
EUR 100.000	Barclays Plc RegS FRN 14/11/2023	96.865	0,31	Total des obligations		113.939	0,36
EUR 125.000	British Telecommunications Plc RegS 1,00% 21/11/2024	123.114	0,39	Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		113.939	0,36
EUR 100.000	Centrica Plc RegS FRN 10/4/2076	102.572	0,33	Organismes de placement collectif			
EUR 100.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 1,25% 21/5/2026	101.420	0,32	Irlande			
EUR 100.000	Motability Operations Group Plc RegS 1,625% 9/6/2023	105.530	0,33	720.964	Institutional Cash Series Plc - Institutional Euro Assets Liquidity Fund Agency Dis ¹	720.964	2,29
EUR 100.000	Sky Plc 1,50% 15/9/2021	103.745	0,33			720.964	2,29
		633.246	2,01	Total des organismes de placement collectif		720.964	2,29
Etats-Unis				Portefeuille de titres à la valeur de marché		30.962.088	98,20
USD 25.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3,50% 12/1/2024	21.464	0,07	Autres éléments de l'actif net		568.743	1,80
USD 65.000	Goldman Sachs Group Inc /The Variable FRN 15/5/2026	55.433	0,18	Total de l'actif net (EUR)		31.530.831	100,00
EUR 100.000	Levi Strauss & Co 3,375% 15/3/2027	101.332	0,32				
EUR 100.000	Nestle Holdings Inc RegS 0,875% 18/7/2025	100.648	0,32				
EUR 150.000	PVH Corp 3,125% 15/12/2027	147.999	0,47				
USD 308.026	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2022	259.260	0,82				
		686.136	2,18				
Total des obligations		30.127.185	95,55				
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		30.127.185	95,55				

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
CCCDs	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	Credit Suisse	20/6/2022	(1.758)	3.142
CCCDs	EUR 200.000	Fund receives default protection on Markit iTraxx Europe Series 29 Version 1 and pays Fixed 1,000%	Credit Suisse	20/6/2023	1.504	(3.146)
CCILS	EUR 200.000	Fund receives Fixed 1,410% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Credit Suisse	15/2/2023	(860)	(856)
CCILS	EUR 145.000	Fund receives Fixed 1,588% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Credit Suisse	15/1/2028	(219)	(216)
CCILS	EUR 72.500	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Credit Suisse	15/5/2028	(507)	(506)
CCILS	EUR 72.500	Fund receives Fixed 1,548% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Credit Suisse	15/5/2028	(507)	(506)
CCILS	EUR 72.500	Fund receives Fixed 1,592% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Credit Suisse	15/5/2028	(157)	(156)
CCILS	EUR 72.500	Fund receives Fixed 1,598% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Credit Suisse	15/5/2028	(119)	(117)
CCIRS	USD 1.000.000	Fund receives Fixed 3,044% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Credit Suisse	27/4/2022	2.501	2.512
CCIRS	USD 1.090.000	Fund receives Fixed 3,063% and pays Floating USD 3 Month LIBOR	Credit Suisse	27/4/2022	3.063	3.075
CCIRS	EUR 662.988	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,430%	Credit Suisse	7/10/2022	(6.943)	(6.933)
CCIRS	USD 400.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,057%	Credit Suisse	27/4/2025	(2.477)	(2.472)
CCIRS	USD 470.000	Fund receives Floating USD 3 Month LIBOR and pays Fixed 3,078%	Credit Suisse	27/4/2025	(3.287)	(3.282)
CCIRS	CAD 145.000	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,817%	Credit Suisse	1/6/2026	(1.702)	(1.700)
CCIRS	CAD 145.000	Fund receives Floating CAD 6 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,821%	Credit Suisse	1/6/2026	(1.752)	(1.750)
CCIRS	CAD 240.000	Fund receives Floating CAD 6 Month LIBOR and pays Fixed 2,712%	Credit Suisse	1/6/2026	(1.634)	(1.631)
CCIRS	EUR 368.218	Fund receives Fixed 1,047% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Credit Suisse	15/2/2027	8.700	8.707
CCIRS	EUR 180.000	Fund receives Fixed 0,835% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Credit Suisse	15/8/2027	(398)	(395)
CCIRS	EUR 80.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,953%	Credit Suisse	15/1/2028	(647)	(645)
CCIRS	EUR 80.000	Fund receives Floating EUR 6 Month EURIBOR and pays Fixed 0,956%	Credit Suisse	15/1/2028	(669)	(668)
CCIRS	NZD 63.000	Fund receives Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate and pays Fixed 3,215%	Credit Suisse	18/5/2028	(381)	(380)
CCIRS	NZD 73.500	Fund receives Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate and pays Fixed 3,219%	Credit Suisse	24/5/2028	(458)	(458)
CCIRS	NZD 73.500	Fund receives Floating NZD 3 Month New Zealand Bank Bill Rate and pays Fixed 3,220%	Credit Suisse	24/5/2028	(462)	(462)
CCIRS	EUR 100.000	Fund receives Fixed 1,076% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Credit Suisse	3/6/2030	38	40
CCIRS	EUR 37.000	Fund receives Fixed 1,254% and pays Floating EUR 6 Month EURIBOR	Credit Suisse	1/6/2033	19	20
CCIRS	GBP 83.000	Fund receives Floating GBP 6 Month LIBOR and pays Fixed 1,827%	Credit Suisse	2/5/2038	(639)	(637)
CCIRS	GBP 220.000	Fund receives Fixed 1,376% and pays Floating GBP 6 Month LIBOR	Credit Suisse	15/5/2058	2.104	2.111
CDS	EUR 150.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	BNP Paribas	20/6/2022	(1.698)	2.356
CDS	EUR 165.847	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	Citibank	20/6/2022	(1.366)	2.605
CDS	EUR 170.000	Fund receives Fixed 1,000% and provides default protection on Markit iTraxx Europe Senior Financials Series 27 Version 1	JP Morgan	20/6/2022	(1.407)	2.671
ILS	EUR 161.000	Fund receives Fixed 1,362% and pays Floating EUR 12 Month CPTFEMU	Morgan Stanley	15/7/2027	(3.424)	(3.424)
IRS	CAD 140.000	Fund receives Floating CAD 3 Month Canadian Bankers Acceptances and pays Fixed 2,749%	Credit Suisse	1/6/2026	(1.204)	(1.203)
Total (exposition brute sous-jacente – 6.648.406 EUR)					(16.746)	(4.304)

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

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

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

CDS (credit default swaps) : swaps sur défaillance

ILS (inflation linked swaps) : swaps liés à l'inflation

IRS (interest rate swaps) : swaps sur taux d'intérêt

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
CAD	180.000	USD	139.594	Morgan Stanley	27/6/2018	(476)
CHF	1.496	EUR	1.278	Bank of America		
				Merrill Lynch	27/6/2018	25
CHF	68.504	EUR	58.517	Barclays Bank	27/6/2018	1.147
CHF	70.000	EUR	59.538	Credit Suisse	27/6/2018	1.429
EUR	6.292	AUD	10.000	UBS	20/6/2018	(202)
EUR	1.578.050	DKK	11.750.000	Citibank	20/6/2018	(563)
EUR	404.105	GBP	360.000	HSBC	20/6/2018	(6.438)
EUR	72.506	NOK	700.000	Standard		
				Chartered Bank	20/6/2018	(819)
EUR	93.902	NZD	160.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(2.235)
EUR	2.362	PLN	10.000	Morgan Stanley	20/6/2018	47
EUR	554.785	SEK	5.660.000	Morgan Stanley	20/6/2018	4.022
EUR	117.443	SEK	1.200.000	Dominion Bank		
				Toronto	29/6/2018	672
EUR	8.068	USD	10.000	Bank of America		
				Merrill Lynch	20/6/2018	(504)
EUR	16.092	USD	20.000	Barclays Bank	20/6/2018	(1.053)
EUR	752.088	USD	920.000	BNP Paribas	20/6/2018	(36.574)
EUR	8.021	USD	10.000	HSBC	20/6/2018	(551)
EUR	33.472	USD	40.000	JP Morgan	20/6/2018	(817)
EUR	580.786	USD	720.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(36.428)
EUR	8.083	USD	10.000	UBS	20/6/2018	(490)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	7.898	USD	9.268	Barclays Bank	27/6/2018	(42)
EUR	50.000	USD	59.618	HSBC	27/6/2018	(1.078)
EUR	42.102	USD	49.403	JP Morgan	27/6/2018	(225)
JPY	8.000.000	USD	73.740	UBS	29/6/2018	106
MXN	2.200.000	USD	113.730	Barclays Bank	29/6/2018	(3.608)
NZD	200.000	USD	139.364	HSBC	29/6/2018	696
SEK	1.200.000	EUR	117.003	Morgan Stanley	29/6/2018	(231)
USD	58.300	CAD	75.017	Bank of America		
				Merrill Lynch	27/6/2018	304
USD	11.644	CAD	14.983	Credit Suisse	27/6/2018	60
USD	70.049	CAD	90.000	HSBC	27/6/2018	454
USD	300.000	EUR	251.654	HSBC	20/6/2018	5.518
USD	890.000	EUR	725.566	JP Morgan	20/6/2018	37.379
USD	59.245	EUR	50.000	Citibank	27/6/2018	758
USD	131.504	EUR	110.000	Morgan Stanley	29/6/2018	2.648
USD	73.386	JPY	8.000.000	Morgan Stanley	29/6/2018	(409)
USD	55.428	MXN	1.100.000	Citibank	29/6/2018	573
USD	55.406	MXN	1.100.000	UBS	29/6/2018	554
USD	19.585	NZD	28.339	JP Morgan	27/6/2018	(238)
USD	49.514	NZD	71.661	Morgan Stanley	27/6/2018	(611)
Total (exposition brute sous-jacente – 7.310.616 EUR)						(37.200)

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
4	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	237.164	6.672
2	EUR	Euro BTP	Juin 2018	230.596	(9.700)
(12)	EUR	Euro Bund	Juin 2018	1.205.412	(41.490)
(1)	EUR	Euro Bund	Septembre 2018	102.158	620
12	EUR	Euro Schatz	Juin 2018	1.215.300	4.560
4	EUR	Euro-BOBL	Juin 2018	435.292	6.700
(4)	EUR	Euro-BUXL	Juin 2018	604.944	(21.380)
(5)	EUR	Euro-OAT	Juin 2018	601.190	(6.860)
(1)	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	144.831	(2.510)
(2)	USD	US Treasury 5 Year Note	Septembre 2018	166.399	(263)
Total				4.943.286	(63.651)

Options achetées au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
130.000	Call	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,17	29/10/2018	417	3.131
130.000	Put	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,17	29/10/2018	(470)	2.244
Total (exposition brute sous-jacente – 130.259 EUR)						(53)	5.375

BlackRock Sustainable Euro Bond Fund suite

Swaptions vendues au 31 mai 2018

Valeur nominale	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values latentes EUR	Valeur de marché EUR
(2.734.000)	Call	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 24/6/2020; and pays 2,4% Fixed semi-annually from 24/3/2020	J.P. Morgan Chase Bank NA	USD 2,40	20/3/2020	677	(7.718)
(2.734.000)	Put	Fund writes an option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,4% Fixed semi-annually from 24/3/2020; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 24/6/2020	J.P. Morgan Chase Bank NA	USD 3,40	20/3/2020	747	(7.648)
Total (exposition brute sous-jacente – 1.416.951 EUR)						1.424	(15.366)

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 mai 2018

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Etats-Unis			
USD 388.000	Fannie Mae Pool 3,00% TBA	331.339	1,05
USD (270.000)	Fannie Mae Pool 3,50% TBA	(231.151)	(0,73)
		100.188	0,32
Total (exposition brute sous-jacente – 562.490 EUR)		100.188	0,32

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	50,79
Finance	33,79
Services aux collectivités	2,49
Organismes de placement collectif	2,29
Communications	2,02
Biens de consommation cyclique	1,90
Valeurs industrielles	1,75
Biens de consommation non cyclique	1,45
Énergie	0,66
Technologie	0,65
Diversifiés	0,33
Matériaux de base	0,08
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,20
Autres éléments de l'actif net	1,80
	100,00

BlackRock Systematic European Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Autriche				Allemagne suite			
1.317	Erste Group Bank AG	46.991	0,29	285	Innogy SE	10.223	0,06
		46.991	0,29	173	Linde AG	33.718	0,21
Belgique				352	Linde AG	62.550	0,38
234	KBC Group NV	15.430	0,09	298	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	18.893	0,12
716	Solvay SA*	82.698	0,51	3.694	SAP SE	356.877	2,18
		98.128	0,60	106	Sartorius AG (Pref)	13.695	0,08
Danemark				81	Siemens AG Reg	9.095	0,06
1.891	Carlsberg A/S 'B'	180.829	1,11	4.905	Siemens Healthineers AG	164.268	1,00
7.152	Danske Bank A/S	203.312	1,24	201	Siltronic AG	29.034	0,18
1.387	H Lundbeck A/S	83.534	0,51	172	Software AG	7.064	0,04
		467.675	2,86	1.601	STADA Arzneimittel AG	129.841	0,79
Finlande				3.914	Telefonica Deutschland Holding AG	14.208	0,09
863	Neste OYJ	59.892	0,36	456	Uniper SE	12.139	0,07
13.865	Nokia OYJ	68.687	0,42	170	Volkswagen AG*	27.302	0,17
1.448	UPM-Kymmene OYJ	45.554	0,28	273	Vonovia SE	11.076	0,07
		174.133	1,06			3.001.078	18,33
France				Irlande			
457	Arkema SA	47.802	0,29	2.867	CRH Plc	91.193	0,56
1.642	Atos SE	190.554	1,16	98	DCC Plc	8.072	0,05
6.479	AXA SA	138.391	0,85	351	Smurfit Kappa Group Plc	12.306	0,07
1.607	BNP Paribas SA	85.733	0,52			111.571	0,68
4.637	Cie de Saint-Gobain	199.739	1,22	Italie			
11.289	Credit Agricole SA	132.476	0,81	38.566	A2A SpA	55.419	0,34
19	Dassault Aviation SA	31.483	0,19	17.600	Hera SpA	46.535	0,28
220	Edenred	6.063	0,04	58.669	Intesa Sanpaolo SpA	146.555	0,90
15.488	Engie SA	210.559	1,29	4.599	Intesa Sanpaolo SpA - RSP	11.916	0,07
2.144	Faurecia SA	157.198	0,96	8.267	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA*	66.186	0,40
201	Kering SA	98.470	0,60	2.892	Moncler SpA	113.453	0,69
289	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	86.556	0,53	1.482	Pirelli & Call SpA '144A'	10.854	0,07
1.350	Peugeot SA	27.135	0,17	14.134	Snam SpA	50.077	0,31
1.573	Renault SA	130.433	0,80			500.995	3,06
50	Safran SA	5.098	0,03	Jersey			
374	Sanofi	24.606	0,15	1.128	Ferguson Plc	75.568	0,46
3.271	Schneider Electric SE	241.858	1,48	14.794	Glencore Plc	63.184	0,39
1.651	Total SA	85.687	0,52	1.773	Petrofac Ltd	11.821	0,07
1.027	Unibail-Rodamco SE (Reit)	196.106	1,20	1.397	Shire Plc	65.585	0,40
2.951	Vinci SA	248.061	1,51			216.158	1,32
		2.344.008	14,32	Luxembourg			
Allemagne				1.995	ArcelorMittal	55.441	0,34
693	adidas AG	135.100	0,83			55.441	0,34
67	Allianz SE	11.926	0,07	Malte			
119	Aurubis AG	8.340	0,05	5.318	Kindred Group Plc SDR	57.826	0,35
3.737	BASF SE	316.673	1,93			57.826	0,35
513	Bayer AG Reg	52.275	0,32	Pays-Bas			
2.425	Bayerische Motoren Werke AG	207.531	1,27	1.459	ASML Holding NV	248.103	1,52
191	Continental AG	41.772	0,26	3.684	BE Semiconductor Industries NV	105.805	0,65
2.417	Covestro AG '144A'	187.849	1,15	6.282	CNH Industrial NV	62.820	0,38
3.137	Daimler AG Reg	194.588	1,19	3.918	ING Groep NV	48.912	0,30
270	Delivery Hero AG	10.600	0,06	2.230	Koninklijke DSM NV	191.914	1,17
1.478	Deutsche Bank AG Reg	13.704	0,08	4.443	STMicroelectronics NV	90.726	0,55
1.298	Deutsche Boerse AG	148.946	0,91	1.603	Unilever NV - CVA	77.192	0,47
6.154	Deutsche Lufthansa AG Reg	143.081	0,87	266	Wolters Kluwer NV	12.768	0,08
2.286	Deutsche Post AG Reg	74.706	0,46			838.240	5,12
2.990	Deutsche Telekom AG Reg	39.812	0,24	Norvège			
21.837	E.ON SE	197.931	1,21	534	Aker BP ASA	16.746	0,10
878	Hella KGaA Hueck & Co	47.632	0,29	8.407	Equinor ASA	188.917	1,15
624	Hochtief AG	96.221	0,59				
7.290	Infineon Technologies AG	172.408	1,05				

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic European Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Norvège suite				Royaume-Uni suite			
8.946	Norsk Hydro ASA	48.251	0,30	401	Dechra Pharmaceuticals Plc	12.737	0,08
2.311	Telenor ASA	40.450	0,25	4.849	Diageo Plc	152.742	0,93
		294.364	1,80	1.355	Dialog Semiconductor Plc	25.596	0,16
Espagne				20.855	DS Smith Plc	132.004	0,81
40.087	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	234.509	1,43	3.526	Electrocomponents Plc	29.012	0,18
4.336	EDP Renovaveis SA	34.536	0,21	3.795	G4S Plc	11.846	0,07
648	International Consolidated Airlines Group SA	5.046	0,03	6.981	GlaxoSmithKline Plc	121.809	0,74
18.417	International Consolidated Airlines Group SA	143.469	0,88	22.610	Hammerson Plc (Reit)	142.752	0,87
		417.560	2,55	28.354	HSBC Holdings Plc	233.298	1,43
Suède				3.539	Imperial Brands Plc	109.489	0,67
3.909	Assa Abloy AB	72.306	0,44	223	Indivior Plc	1.223	0,01
1.357	Atlas Copco AB 'A'	46.690	0,28	298	InterContinental Hotels Group Plc	16.408	0,10
2.007	Boliden AB	60.637	0,37	419	Intertek Group Plc	26.464	0,16
754	Boliden AB	421	0,00	21.155	JD Sports Fashion Plc	91.642	0,56
7.824	Electrolux AB 'B'	166.573	1,02	15.644	Legal & General Group Plc	48.279	0,30
13.450	Sandvik AB	201.283	1,23	227.403	Lloyds Banking Group Plc	164.874	1,01
5.481	Securitas AB 'B'	75.358	0,46	277	London Stock Exchange Group Plc	14.164	0,09
13.825	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	107.779	0,66	1.884	Meggitt Plc	10.605	0,06
13.908	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	133.272	0,81	3.176	Mondi Plc	76.092	0,47
1.821	Swedbank AB 'A'	32.567	0,20	12.711	National Grid Plc	121.670	0,74
1.025	Swedish Match AB	41.869	0,26	303	NMC Health Plc	12.334	0,08
14.101	Volvo AB 'B'	209.927	1,28	3.962	Rentokil Initial Plc	15.536	0,10
		1.148.682	7,01	2.706	Rio Tinto Plc	131.300	0,80
Suisse				1.215	Rolls Royce Holdings Plc 'C'	11.464	0,07
38	Barry Callebaut AG Reg	57.638	0,35	10.895	Royal Dutch Shell Plc 'A'	325.167	1,99
1.845	Cie Financiere Richemont SA Reg	146.638	0,90	7.274	Royal Dutch Shell Plc 'B'	223.071	1,36
1.534	Coca-Cola HBC AG	45.503	0,28	906	Royal Mail Plc	5.298	0,03
62	EMS-Chemie Holding AG Reg	33.551	0,20	4.224	Severn Trent Plc	95.587	0,58
78	Georg Fischer AG Reg	86.728	0,53	2.134	Sky Plc	32.746	0,20
7.985	Nestle SA Reg	522.281	3,19	364	Smiths Group Plc	7.307	0,04
6.980	Novartis AG Reg	451.563	2,76	590	Spirax-Sarco Engineering Plc	41.801	0,26
657	Roche Holding AG	124.136	0,76	1.932	Standard Life Aberdeen Plc	7.752	0,05
2.288	Roche Holding AG	425.132	2,60	8.538	Taylor Wimpey Plc	18.571	0,11
425	Schindler Holding AG	77.637	0,47	39.520	Thomas Cook Group Plc	51.941	0,32
64	SGS SA Reg	142.211	0,87	2.503	Unilever Plc	119.422	0,73
21	Sika AG	145.457	0,89	53.611	Vodafone Group Plc	117.643	0,72
105	Temenos AG	13.439	0,08			3.870.720	23,64
8.843	UBS Group AG Reg	115.187	0,70			16.030.671	97,91
		2.387.101	14,58				
Royaume-Uni				Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire			
4.656	Anglo American Plc	95.721	0,58	ACTIONS ORDINAIRES			
1.120	Associated British Foods Plc	34.181	0,21	Royaume-Uni			
1.313	AstraZeneca Plc	82.389	0,50	86.265	Rolls Royce Holdings Plc 'C'	98	0,00
14.395	Aviva Plc	84.086	0,51			98	0,00
5.024	BAE Systems Plc	37.027	0,23			98	0,00
13.191	Barclays Plc	29.717	0,18			98	0,00
2.621	Barratt Developments Plc	16.399	0,10			98	0,00
29.259	BP Plc	191.674	1,17			98	0,00
1.095	British American Tobacco Plc	48.116	0,29			98	0,00
7.037	Bunzl Plc*	185.697	1,13			98	0,00
3.382	Carnival Plc	187.251	1,14			98	0,00
4.438	Compass Group Plc	82.176	0,50			98	0,00
682	Croda International Plc	36.640	0,22			98	0,00

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

BlackRock Systematic European Equity Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-value non réalisée EUR
5	EUR	EURO STOXX 50 Index	Juin 2018	170.700	1.830
1	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	87.688	570
Total				258.388	2.400

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	21,70
Biens de consommation cyclique	18,23
Finance	15,23
Valeurs industrielles	11,60
Matériaux de base	9,66
Technologie	7,57
Énergie	6,77
Services aux collectivités	5,09
Communications	2,06
Portefeuille de titres à la valeur de marché	97,91
Autres éléments de l'actif net	2,09
	100,00

BlackRock Systematic Global Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Australie				Brésil suite			
117.849	Aristocrat Leisure Ltd	2.681.689	0,46	77.600	Metalurgica Gerdau SA (Pref)	141.904	0,02
73.264	BlueScope Steel Ltd	964.546	0,16	2.300	MRV Engenharia e Participacoes SA	8.319	0,00
11.047	Caltex Australia Ltd*	246.190	0,04	11.100	Petrobras Distribuidora SA	54.247	0,01
15.052	CIMIC Group Ltd	469.986	0,08	36.200	Petroleo Brasileiro SA	215.700	0,04
708	Cochlear Ltd*	105.197	0,02	30.200	Suzano Papel e Celulose SA	349.517	0,06
5.732	CSL Ltd	806.959	0,14	4.100	Telefonica Brasil SA (Pref)	50.093	0,01
848.468	Qantas Airways Ltd	4.081.237	0,70	27.700	Tim Participacoes SA	99.745	0,02
26.575	Santos Ltd	117.965	0,02	5.169	Ultrapar Participacoes SA	69.400	0,01
6.771	Sims Metal Management Ltd	81.808	0,01			5.923.583	1,01
58.595	Stockland (Reit)	184.201	0,03	Îles Vierges britanniques			
21.900	Whitehaven Coal Ltd	87.260	0,02	3.217	Michael Kors Holdings Ltd	190.672	0,04
		9.827.038	1,68	669	Nomad Foods Ltd	11.734	0,00
						202.406	0,04
Autriche				Canada			
18.936	OMV AG	1.085.513	0,19	80.111	Bank of Nova Scotia/The*	4.805.176	0,82
		1.085.513	0,19	7.480	Lundin Mining Corp	46.598	0,01
Belgique				3.733	Magna International Inc	239.126	0,04
3.623	KBC Group NV	278.355	0,05	35.810	Manulife Financial Corp	671.196	0,11
3.940	Solvay SA	530.225	0,09	15	Pan American Silver Corp*	268	0,00
10.178	UCB SA	792.411	0,13	1.370	Parex Resources Inc	23.870	0,00
		1.600.991	0,27	1.906	Quebecor Inc 'B'	36.858	0,01
Bermudes				18.801	Sun Life Financial Inc	775.900	0,13
1.635	Bunge Ltd	113.861	0,02	954	TFI International Inc	28.913	0,01
4.000	China Resources Gas Group Ltd	15.187	0,00	40.451	Toronto-Dominion Bank/The	2.360.735	0,40
1.745	Cosan Ltd 'A'	15.548	0,00	962	WSP Global Inc	49.845	0,01
3.500	Dairy Farm International Holdings Ltd	29.995	0,01			9.038.485	1,54
45.246	Genpact Ltd	1.378.646	0,23	Îles Caïmans			
704.000	HengTen Networks Group Ltd	28.254	0,00	12.500	3SBio Inc'144A'	35.754	0,01
1.719	Invesco Ltd	46.998	0,01	599	51job Inc ADR	64.650	0,01
3.000	Kerry Properties Ltd	16.035	0,00	37.925	Alibaba Group Holding Ltd ADR	7.531.905	1,29
30.500	Luye Pharma Group Ltd	33.458	0,01	1.660	Autohome Inc ADR	186.401	0,03
19.000	Shenzhen International Holdings Ltd	41.541	0,01	1.130	Baidu Inc ADR	275.912	0,05
		1.719.523	0,29	46.000	China First Capital Group Ltd	46.066	0,01
Brésil				24.000	China Lesso Group Holdings Ltd	16.910	0,00
78.500	Ambev SA	415.049	0,07	1.056	China Lodging Group Ltd ADR	45.746	0,01
2.000	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	11.692	0,00	60.000	China Resources Cement Holdings Ltd	70.636	0,01
1.210	Banco Bradesco SA	8.474	0,00	50.800	China Zhongwang Holdings Ltd	27.508	0,00
29.711	Banco Bradesco SA (Pref)	232.722	0,04	208.000	Chong Sing Holdings FinTech Gr	27.561	0,00
10.500	Banco do Brasil SA	85.629	0,01	9.000	Country Garden Holdings Co Ltd	17.636	0,00
3.800	Banco Santander Brasil SA (Unit)	34.469	0,01	3.000	ENN Energy Holdings Ltd	30.865	0,01
13.200	Braskem SA 'A' (Pref)	160.922	0,03	4.149	Fang Holdings Ltd ADR	22.239	0,00
12.100	CCR SA	33.466	0,01	54.000	Future Land Development Holdings Ltd	42.313	0,01
75.300	Cia Energetica de Minas Gerais (Pref)	155.087	0,03	1.143	GDS Holdings Ltd ADR	44.006	0,01
5.881	Cia Paranaense de Energia (Pref)	37.111	0,01	18.000	Genscript Biotech Corp	67.196	0,01
6.200	Cia Siderurgica Nacional SA	12.819	0,00	20.000	Greentown China Holdings Ltd	30.069	0,01
1.700	CPFL Energia SA	10.454	0,00	7.500	Hengan International Group Co Ltd	71.381	0,01
1.300	Energisa SA (Unit)	10.518	0,00	440	Hutchison China MediTech Ltd	24.624	0,00
4.500	Equatorial Energia SA	73.456	0,01	24.000	Jiayuan International Group Ltd	45.990	0,01
21.500	Fibria Celulose SA	408.633	0,07	45.000	Kaisa Group Holdings Ltd	24.424	0,00
55.800	Gerdau SA (Pref)	221.759	0,04	29.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	39.089	0,01
49.700	Hypera SA	376.348	0,06	28.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	30.716	0,01
1.600	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	13.499	0,00	29.500	KWG Property Holding Ltd	40.668	0,01
1.400	Iochpe Maxion SA	8.943	0,00	17.500	Li Ning Co Ltd	21.003	0,00
3.000	IRB Brasil Resseguros S/A	38.845	0,01	52.000	Logan Property Holdings Co Ltd	78.179	0,01
141.500	Itau Unibanco Holding SA (Pref)	1.633.080	0,28	9.893	Momo Inc ADR	448.450	0,08
156.980	Itausa - Investimentos Itau SA (Pref)	473.379	0,08	681	Noah Holdings Ltd ADR	41.228	0,01
159.931	JBS SA	383.503	0,06	819	Pagseguro Digital Ltd 'A'	28.427	0,00
1.500	Localiza Rent a Car SA	9.961	0,00	8.392	SINA Corp/China	760.315	0,13
1.900	Magazine Luiza SA	55.316	0,01	28.000	SSY Group Ltd	29.931	0,01
13.900	Marfrig Global Foods SA	29.524	0,01	92.100	Tencent Holdings Ltd	4.684.383	0,80
				27.000	Towngas China Co Ltd	26.488	0,00

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

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Îles Caïmans suite			
41.000	Uni-President China Holdings Ltd*	44.141	0,01
13.897	Weibo Corp ADR	1.437.228	0,25
160.000	WH Group Ltd '144A'	164.104	0,03
10.500	Wuxi Biologics Cayman Inc '144A'	117.660	0,02
70.000	Xinyi Solar Holdings Ltd	28.986	0,00
39.000	Yuzhou Properties Co Ltd	27.429	0,00
1.954	YY Inc ADR	231.158	0,04
21.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd	67.291	0,01
		17.096.666	2,92
Chine			
367.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H'	189.843	0,03
66.000	Angang Steel Co Ltd 'H'	65.422	0,01
3.000	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	18.385	0,00
80.500	BAIC Motor Corp Ltd 'H' '144A'	78.154	0,01
647.000	Bank of China Ltd 'H'	337.980	0,06
145.000	BBMG Corp 'H'	63.552	0,01
26.000	Beijing Capital International Airport Co Ltd 'H'	38.427	0,01
294.000	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	106.382	0,02
43.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H'	29.201	0,00
199.000	China Coal Energy Co Ltd 'H'	87.473	0,01
103.000	China Communications Construction Co Ltd 'H'	110.497	0,02
1.123.000	China Construction Bank Corp 'H'	1.133.202	0,19
150.500	China COSCO Holdings Co Ltd 'H'	84.562	0,01
178.000	China Eastern Airlines Corp Ltd	141.516	0,02
81.500	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	50.985	0,01
39.600	China International Capital Corp Ltd 'H' '144A'	83.451	0,01
152.000	China Life Insurance Co Ltd 'H'	424.121	0,07
90.600	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	391.318	0,07
810.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H'	791.558	0,13
82.000	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'H' '144A'	64.044	0,01
400.000	China Reinsurance Group Corp 'H'	89.696	0,02
13.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	33.955	0,01
400.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	186.528	0,03
106.000	CITIC Securities Co Ltd 'H'	267.137	0,05
240.000	Datang International Power Generation Co Ltd 'H'	77.363	0,01
46.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	52.455	0,01
33.200	GF Securities Co Ltd 'H'	56.005	0,01
22.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H'	114.924	0,02
93.400	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H' '144A'	217.057	0,04
54.000	Haitong Securities Co Ltd 'H'	67.563	0,01
825.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	683.234	0,12
31.000	Jiangxi Copper Co Ltd 'H'	45.027	0,01
21.500	Legend Holdings Corp 'H' '144A'	68.483	0,01
84.000	Maanshan Iron & Steel Co Ltd 'H'	40.669	0,01
341.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H'	102.100	0,02
23.500	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	106.591	0,02
115.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	54.359	0,01
554.000	PetroChina Co Ltd 'H'	458.096	0,08
29.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	289.035	0,05
55.000	Qingdao Port International Co Ltd 'H' '144A'	43.937	0,01
41.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd 'H'	44.037	0,01
108.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd 'H'	79.672	0,01

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Chine suite			
60.000	Sinotrans Ltd 'H'	34.018	0,01
44.000	Weichai Power Co Ltd 'H'	58.975	0,01
44.400	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H'	71.052	0,01
		7.632.041	1,30
République tchèque			
2.489	CEZ AS	62.355	0,01
814	Komerční banka AS	33.050	0,00
10.380	Moneta Money Bank AS '144A'	36.148	0,01
		131.553	0,02
Danemark			
31.923	Carlsberg A/S 'B'	3.556.827	0,61
84.901	Danske Bank A/S	2.812.092	0,48
715	Genmab A/S	108.809	0,02
1.109	H Lundbeck A/S	77.822	0,01
		6.555.550	1,12
Finlande			
7.960	Amer Sports OYJ	257.834	0,04
4	Metsä OYJ	138	0,00
42.544	Sampo OYJ 'A'	2.092.355	0,36
144.989	UPM-Kymmene OYJ	5.314.659	0,91
16.018	Valmet OYJ	295.628	0,05
		7.960.614	1,36
France			
502	Air Liquide SA	62.175	0,01
16.941	Arkema SA	2.064.678	0,35
16.413	Atos SE	2.219.294	0,38
99.446	AXA SA	2.474.972	0,42
14.270	BNP Paribas SA	887.034	0,15
6.606	Capgemini SE	872.837	0,15
1.102	Christian Dior SE	472.382	0,08
43.201	Cie de Saint-Gobain	2.168.207	0,37
25.876	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	3.343.569	0,57

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt

suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Allemagne suite			
19.243	Covestro AG '144A'	1.742.558	0,30
5	CTS Eventim AG & Co KGaA	241	0,00
1.652	Daimler AG	119.397	0,02
1.666	Delivery Hero AG	76.209	0,01
6.711	Deutsche Boerse AG	897.267	0,15
169.677	Deutsche Lufthansa AG Reg	4.596.503	0,78
40.041	Deutsche Post AG Reg	1.524.644	0,26
79.614	E.ON SE	840.797	0,14
5.584	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	560.964	0,10
490	Hella GmbH & Co KGaA	30.973	0,01
24.736	Hochtief AG*	4.444.219	0,76
1.655	Linde AG	342.663	0,06
98	Puma SE	58.120	0,01
48	Puma SE	28.467	0,00
5.657	Rheinmetall AG	715.810	0,12
8.924	SAP SE	1.004.531	0,17
661	Sartorius AG (Pref)	99.505	0,02
3.354	Software AG	160.498	0,03
40.384	Suedzucker AG*	726.975	0,12
3.527	Talanx AG	136.435	0,02
16.751	TUI AG	388.783	0,07
2.468	Wirecard AG	380.440	0,07
		26.184.316	4,47
Guernesey			
13.547	Amdocs Ltd	922.009	0,16
		922.009	0,16
Hong Kong			
63.200	AIA Group Ltd	579.765	0,10
17.000	Champion (Reit)	11.869	0,00
10.000	China Everbright Ltd	21.965	0,00
264.500	China Mobile Ltd*	2.358.989	0,40
16.000	China Overseas Land & Investment Ltd	53.512	0,01
82.000	China Power International Development Ltd	22.776	0,00
22.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	106.795	0,02
9.200	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	32.996	0,01
40.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	36.694	0,01
18.000	CLP Holdings Ltd	188.974	0,03
382.000	CNOOC Ltd	642.450	0,11
23.000	Hang Lung Properties Ltd	52.161	0,01
10.000	Hua Hong Semiconductor Ltd '144A'	24.208	0,00
831	I-CABLE Communications Ltd	18	0,00
110.000	Lenovo Group Ltd	58.303	0,01
76.000	MMG Ltd	55.194	0,01
76.000	Shenzhen Investment Ltd	32.245	0,01
16.000	Sinotruk Hong Kong Ltd	22.628	0,00
84.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	1.354.925	0,23
118.000	Yuexiu Property Co Ltd	26.611	0,01
		5.683.078	0,97
Hongrie			
37.724	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	351.947	0,06
3.326	OTP Bank Plc	119.580	0,02
9.423	Richter Gedeon Nyrt	183.322	0,03
		654.849	0,11
Indonésie			
21.700	Astra International Tbk PT	10.776	0,00
106.400	Bank Central Asia Tbk PT	173.824	0,03

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Indonésie suite			
104.500	Bank Mandiri Persero Tbk PT	53.021	0,01
76.700	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	46.782	0,01
438.100	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	97.110	0,02
52.000	Indah Kiat Pulp & Paper Corp Tbk PT	69.982	0,01
43.600	Matahari Department Store Tbk PT	28.711	0,00
1.304.200	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	330.391	0,06
		810.597	0,14
Irlande			
18.389	Accenture Plc 'A'	2.875.488	0,49
1.831	Alkermes Plc	86.936	0,01
2.116	Allegion Plc	166.106	0,03
939	DCC Plc	90.121	0,02
6.011	Eaton Corp Plc	466.153	0,08
219	ICON Plc	27.763	0,00
35.641	Ingersoll-Rand Plc	3.153.159	0,54
1.296	Perrigo Co Plc	97.044	0,02
2.161	Smurfit Kappa Group Plc	88.277	0,01
		7.051.047	1,20
Île de Man			
5.281	Playtech Plc	55.381	0,01
		55.381	0,01
Israël			
1.126	Wix.com Ltd	97.680	0,02
		97.680	0,02
Italie			
6.934	A2A SpA	11.610	0,00
988	Assicurazioni Generali SpA	16.537	0,00
9.412	Azimut Holding SpA	153.694	0,03
773	ERG SpA	15.870	0,00
6.335	Hera SpA	19.516	0,00
15.583	Intesa Sanpaolo SpA	45.355	0,01
183.311	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA*	1.709.959	0,29
56.913	Moncler SpA	2.601.426	0,45
9.282	Pirelli & Call SpA '144A'	79.208	0,01
24.951	Saipem SpA	106.111	0,02
		4.759.286	0,81</

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

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Japon suite				Malaisie suite			
2.600	Hakuhodo DY Holdings Inc	39.589	0,01	101.700	Petronas Chemicals Group Bhd	205.700	0,03
8.600	Haseko Corp	131.106	0,02	17.200	Public Bank Bhd	103.114	0,02
242.000	Hitachi Ltd	1.776.830	0,30	15.100	QL Resources Bhd	20.070	0,00
7.500	Iida Group Holdings Co Ltd	143.716	0,03	5.300	Tenaga Nasional Bhd	19.176	0,00
2.700	Itochu Techno-Solutions Corp	49.150	0,01	16.000	Top Glove Corp Bhd	41.246	0,01
600	Japan Tobacco Inc	16.237	0,00				
7.800	JTEKT Corp	114.094	0,02			643.825	0,11
305.550	JXTG Holdings Inc	1.979.548	0,34	Mexique			
27.100	Kirin Holdings Co Ltd	773.072	0,13	7.800	Alsea SAB de CV	25.164	0,00
800	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	70.860	0,01	1.294.100	America Movil SAB de CV 'L'	996.022	0,17
2.700	Konami Holdings Corp	127.167	0,02	122.700	Cemex SAB de CV 'CPO' (Unit)	72.470	0,01
6.900	Mazda Motor Corp	87.128	0,02	6.300	Fomento Economico Mexicano SAB de CV (Unit)	52.213	0,01
800	Miraca Holdings Inc	26.103	0,01	29.000	GMexico Transportes SAB de CV '144A'	39.956	0,01
195.900	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	1.820.058	0,31	11.657	Gruma SAB de CV 'B'	121.929	0,02
12.400	Mitsui & Co Ltd	219.096	0,04	29.900	Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	159.819	0,03
18.100	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	577.892	0,10	357.800	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	898.985	0,15
1.200	Nihon M&A Center Inc	39.596	0,01			2.366.558	0,40
11.000	Nippon Kayaku Co Ltd	121.259	0,02	Pays-Bas			
200	Nippon Shokubai Co Ltd	15.466	0,00	6.990	Aalberts Industries NV	343.286	0,06
69.200	Nippon Telegraph & Telephone Corp	3.256.696	0,56	1.291	AerCap Holdings NV	71.199	0,01
1.200	Nitori Holdings Co Ltd	206.996	0,04	44.534	BE Semiconductor Industries NV	1.490.245	0,26
134.600	NTT DOCOMO Inc	3.496.039	0,60	18.381	Ferrari NV	2.387.952	0,41
400	Otsuka Corp	16.572	0,00	7.286	Fiat Chrysler Automobiles NV	164.896	0,03
382.000	Resona Holdings Inc	2.136.834	0,37	187.449	ING Groep NV	2.726.582	0,47
8.000	Secom Co Ltd	598.663	0,10	59.739	Koninklijke Ahold Delhaize NV	1.373.165	0,23
25.000	Seven & i Holdings Co Ltd	1.110.881	0,19	52.101	Koninklijke DSM NV*	5.224.311	0,89
3.100	SG Holdings Co Ltd	70.518	0,01	549.684	Koninklijke KPN NV	1.495.483	0,26
96.100	Sojitz Corp	343.673	0,06	61.143	Steinhoff International Holdings NV	5.518	0,00
79.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	479.847	0,08	147.844	STMicroelectronics NV	3.517.556	0,60
138.200	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	5.735.883	0,98	11.953	Wolters Kluwer NV	668.498	0,11
15.400	Suzuki Motor Corp	888.841	0,15			19.468.691	3,33
2.700	TIS Inc	127.416	0,02	Nouvelle-Zélande			
300	Tokio Marine Holdings Inc	14.489	0,00	6.752	a2 Milk Co Ltd	51.442	0,01
1.100	Tokyo Century Corp	66.409	0,01			51.442	0,01
5.900	Tokyo Electron Ltd	1.109.360	0,19	Norvège			
5.000	Toppan Printing Co Ltd	40.924	0,01	6.559	Aker BP ASA	239.655	0,04
1.300	Toyobo Co Ltd	21.676	0,00	180.064	Equinor ASA	4.714.541	0,81
800	Toyota Boshoku Corp	15.249	0,00	98.645	Orkla ASA	892.650	0,15
5.700	Ulvac Inc	254.542	0,04	960	Salmar ASA	42.017	0,01
13.100	West Japan Railway Co	945.175	0,16	190.542	Telenor ASA	3.885.929	0,66
20.000	Yahoo Japan Corp	72.999	0,01	3.815	TGS NOPEC Geophysical Co ASA	128.352	0,02
5.000	Zeon Corp	63.690	0,01			9.903.144	1,69
		37.416.595	6,39	Panama			
Jersey				43.575	Carnival Corp	2.743.482	0,47
11.385	boohoo.com Plc	31.176	0,01			2.743.482	0,47
14.016	Centamin Plc	24.109	0,00	Papouasie-Nouvelle-Guinée			
2.284	Experian Plc	56.229	0,01	10.511	Oil Search Ltd	65.846	0,01
25.112	Glencore Plc	124.963	0,02			65.846	0,01
7.937	IWG Plc	32.749	0,01	Pologne			
29.975	Petrofac Ltd	232.859	0,04	3.572	Bank Polska Kasa Opieki SA	107.823	0,02
		502.085	0,09	2.857	Energia SA	7.274	0,00
Liberia				10.071	Eurocash SA	64.471	0,01
7.227	Royal Caribbean Cruises Ltd	762.304	0,13	21.235	PGE Polska Grupa Energetyczna SA	56.416	0,01
		762.304	0,13	28.509	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA*	627.333	0,11
Luxembourg				56.145	Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA	86.709	0,01
1.366	Reinet Investments SCA	25.395	0,00				
1.458	Trinseo SA	106.288	0,02				
		131.683	0,02				
Malaisie							
3.400	Fraser & Neave Holdings Bhd	32.308	0,01				
145.600	MISC Bhd	214.742	0,04				
33.400	My EG Services Bhd	7.469	0,00				

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

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Pologne suite				Espagne suite			
8.862	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	89.822	0,02	32.816	Amadeus IT Group SA	2.597.723	0,44
6.411	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	62.851	0,01	701.612	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4.782.275	0,82
		1.102.699	0,19	7.914	EDP Renovaveis SA	73.445	0,01
				3.452	Grifols SA	102.563	0,02
				25.078	International Consolidated Airlines Group SA	227.621	0,04
Portugal				138.275	Mediaset Espana Comunicacion SA	1.243.133	0,21
9.774	Galp Energia SGPS SA	181.186	0,03	949	Merlin Properties Socimi SA (Reit)	13.070	0,00
19.371	Jerónimo Martins SGPS SA	303.906	0,05	193.545	Repsol SA	3.663.391	0,62
		485.092	0,08	29.238	Telefonica SA	256.181	0,04
						13.202.628	2,25
Russie				Suède			
296.000	Inter RAO UES PJSC	19.130	0,00	36.430	Electrolux AB 'B'	903.682	0,15
5.262	Lukoil PJSC	356.520	0,06	10.450	Fabege AB	122.906	0,02
1.296	Magnit PJSC GDR	25.920	0,01	42.117	Sandvik AB*	734.384	0,13
20.600	Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC	16.125	0,00	49.471	SSAB AB 'A'	267.814	0,05
2.076	Mobile TeleSystems PJSC ADR	20.366	0,00	148.527	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	1.658.298	0,28
1.155	Novatek PJSC GDR Reg	167.359	0,03	105.087	Swedish Match AB	5.001.505	0,85
8.450	Novolipetsk Steel PJSC	22.305	0,00	258.549	Volvo AB 'B'	4.484.805	0,77
2.110	Severstal PJSC	34.063	0,01			13.173.394	2,25
90.700	Surgutneftgas OJSC	41.658	0,01				
78.200	Surgutneftgas OJSC (Pref)	38.769	0,01	Suisse			
15.590	Tatneft PJSC	167.001	0,03	50	Barry Callebaut AG Reg	88.364	0,01
		909.216	0,16	692	Coca-Cola HBC AG	23.917	0,00
Singapour				824	Georg Fischer AG Reg	1.067.513	0,18
6.600	BOC Aviation Ltd '144A'	40.952	0,01	1.946	OC Oerlikon Corp Reg	31.370	0,01
22.854	Flex Ltd	322.013	0,05	14.836	Roche Holding AG	3.211.933	0,55
21.700	Venture Corp Ltd	341.847	0,06	3	Sika AG	24.211	0,00
		704.812	0,12	14.571	Swiss Re AG	1.273.946	0,22
				42.323	TE Connectivity Ltd	3.980.055	0,68
Afrique du Sud				662	Temenos Group AG	98.726	0,02
761	Barloworld Ltd	8.042	0,00			9.800.035	1,67
2.937	Bid Corp Ltd	59.174	0,01	Taiwan			
9.891	Bidvest Group Ltd/The	160.479	0,03	143.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	255.822	0,04
2.313	Clicks Group Ltd	37.552	0,01	21.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	15.139	0,00
5.350	FirstRand Ltd	25.618	0,00	244.000	Fubon Financial Holding Co Ltd	424.291	0,07
851	Kumba Iron Ore Ltd	19.365	0,00	2.000	Hiwin Technologies Corp	28.370	0,01
437	Mr Price Group Ltd	8.706	0,00	5.000	Powertech Technology Inc	14.919	0,00
469	Naspers Ltd 'N'	112.951	0,02	10.000	Realtek Semiconductor Corp	38.216	0,01
11.111	Netcare Ltd	26.184	0,01	2.000	TaiMed Biologics Inc	21.027	0,00
4.137	Pick n Pay Stores Ltd	24.722	0,00	82.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	613.053	0,11
27.145	Standard Bank Group Ltd*	445.793	0,08	116.000	Uni-President Enterprises Corp	283.017	0,05
903	Tiger Brands Ltd*	24.144	0,00	5.000	Walsin Technology Corp	64.666	0,01
		952.730	0,16			1.758.520	0,30
Corée du Sud				Thaïlande			
1.042	Celltrion Inc	256.646	0,04	20.000	Gulf Energy Development PCL	42.513	0,01
360	HLB Inc	46.087	0,01	84.400	PTT Exploration & Production PCL NVDR*	354.855	0,06
1.097	KB Financial Group Inc	52.715	0,01	49.100	PTT Global Chemical PCL NVDR	136.986	0,02
1.870	KT Corp	46.839	0,01	104.200	PTT PCL NVDR*	170.192	0,03
994	LG Electronics Inc	85.388	0,01	54.600	Thai Oil PCL NVDR	157.024	0,03
46	Medy-Tox Inc	32.159	0,01	78.900	Total Access Communication PCL NVDR*	110.371	0,02
114	NongShim Co Ltd	34.477	0,01	50.200	True Corp PCL NVDR*	11.220	0,00
64	POSCO	20.157	0,00			983.161	0,17
12.100	Samsung Electronics Co Ltd	569.108	0,10	Turquie			
663	SillaJen Inc	49.512	0,01	43.999	Akbank Turk AS	78.268	0,01
4.215	SK Hynix Inc	365.213	0,06	20.891	Arcelik AS	76.353	0,01
890	SK Innovation Co Ltd	170.082	0,03	21.742	BIM Birlesik Magazalar AS	332.536	0,06
		1.728.383	0,30	22.642	Enerjisa Enerji AS '144A'	32.681	0,01
Espagne				158.263	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	390.855	0,06
721	ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	30.293	0,01				
1.114	Aena SME SA '144A'	212.933	0,04				

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

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Turquie suite				Royaume-Uni suite			
46.334	Haci Omer Sabanci Holding AS	95.715	0,01	14.011	Royal Dutch Shell Plc 'B'	500.635	0,09
92.018	KOC Holding AS	287.569	0,05	37.288	Royal Mail Plc	254.080	0,04
15.381	Tupras Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	357.453	0,06	1.049	Schroders Plc	45.528	0,01
8.192	Turk Hava Yollari AO	29.868	0,01	2.215	Severn Trent Plc	58.402	0,01
232.146	Turkiye Garanti Bankasi AS	458.554	0,08	4.390	Spirax-Sarco Engineering Plc	362.392	0,06
9.216	Turkiye Halk Bankasi AS*	15.479	0,00	4.746	SSP Group Plc	41.165	0,01
309.217	Turkiye Is Bankasi AS 'C'	407.421	0,07	2.897	Tate & Lyle Plc	26.587	0,00
94.628	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO 'D'	114.030	0,02	38.246	Taylor Wimpey Plc	96.927	0,02
47.262	Yapi ve Kredi Bankasi AS*	42.453	0,01	648	TechnipFMC Plc	20.269	0,00
		2.719.235	0,46	324.478	Thomas Cook Group Plc	496.890	0,09
Royaume-Uni				515	Victrex Plc	19.456	0,00
44.325	Anglo American Plc	1.061.760	0,18	93.312	Vodafone Group Plc	238.578	0,04
31.230	Anglo American Plc	748.306	0,13	1.833	WH Smith Plc	47.636	0,01
6.761	Ashmore Group Plc	33.128	0,01	8.806	William Hill Plc	37.330	0,01
4.959	Ashtead Group Plc	154.055	0,03	59.016	Wm Morrison Supermarkets Plc	194.791	0,03
2.985	ASOS Plc	262.441	0,05			25.928.071	4,43
86.828	Associated British Foods Plc	3.087.496	0,53	Etats-Unis			
53.096	Auto Trader Group Plc '144A'	251.055	0,04	13.030	Abbott Laboratories	808.642	0,14
45.732	Aviva Plc	311.253	0,05	20.380	AbbVie Inc	2.055.731	0,35
6.520	Barratt Developments Plc	47.530	0,01	407	ABIOMED Inc	157.920	0,03
851	Bodycote Plc	11.256	0,00	26.104	Adobe Systems Inc	6.488.149	1,11
80.467	BP Plc	614.191	0,11	4.133	Aetna Inc	732.037	0,13
7.493	British Land Co Plc/The (Reit)	67.333	0,01	346	Affiliated Managers Group Inc	55.194	0,01
1.293	Bunzl Plc	39.755	0,01	79.509	Agilent Technologies Inc	4.983.624	0,85
6.632	Burberry Group Plc	182.754	0,03	16.847	Air Products & Chemicals Inc	2.742.186	0,47
41.251	Carnival Plc	2.661.139	0,45	553	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	69.164	0,01
16.180	Centrica Plc	31.090	0,01	2.832	Alexion Pharmaceuticals Inc	329.985	0,06
6.918	Close Brothers Group Plc	134.355	0,02	16.714	Allstate Corp/The	1.561.756	0,27
40.544	Coca-Cola European Partners Plc	1.539.050	0,26	6.651	Ally Financial Inc	172.660	0,03
962	Croda International Plc	60.218	0,01	1.065	Alnylam Pharmaceuticals Inc	108.523	0,02
58.024	Diageo Plc	2.129.594	0,36	1.939	Alphabet Inc 'A'	2.123.030	0,36
22.901	Dialog Semiconductor Plc	504.043	0,09	4.237	Alphabet Inc 'C'	4.591.637	0,78
48.075	Direct Line Insurance Group Plc	228.848	0,04	4.094	Amazon.com Inc	6.662.780	1,14
17.394	DS Smith Plc	128.280	0,02	6.144	American Eagle Outfitters Inc	138.547	0,02
436	easyJet Plc	9.899	0,00	10.565	American Express Co	1.042.026	0,18
9.101	Electrocomponents Plc	87.250	0,02	3.046	American Financial Group Inc/OH	336.309	0,06
27.339	Evrax Plc	183.308	0,03	16.534	Ameriprise Financial Inc	2.291.282	0,39
11.646	Ferrexpo Plc	33.625	0,01	16.554	AmerisourceBergen Corp	1.379.941	0,24
7.881	Fevertree Drinks Plc	315.124	0,05	21.682	AMETEK Inc	1.614.442	0,28
7.011	G4S Plc	25.499	0,00	8.567	Amgen Inc	1.543.174	0,26
8.925	GlaxoSmithKline Plc	181.448	0,03	2.059	Anadarko Petroleum Corp	144.912	0,03
15.879	Hammerson Plc (Reit)	116.811	0,02	771	Anthem Inc	177.114	0,03
17.919	Hays Plc	43.947	0,01	44.909	Apple Inc	8.419.090	1,44
80.815	HSBC Holdings Plc	774.766	0,13	39.318	Applied Materials Inc	2.023.894	0,35
2.343	IG Group Holdings Plc	27.019	0,00	66.488	Archer-Daniels-Midland Co	2.928.132	0,50
33.109	Imperial Brands Plc	1.193.489	0,20	6.111	Arthur J Gallagher & Co	404.487	0,07
20.716	Inchcape Plc	202.403	0,03	305	ASGN Inc	23.659	0,00
8.413	Indivior Plc	53.759	0,01	919	Automatic Data Processing Inc	119.929	0,02
7.904	InterContinental Hotels Group Plc	507.057	0,09	579	Avery Dennison Corp	61.878	0,01
2.930	International Game Technology PLC	76.195	0,01	58.222	Bank of America Corp	1.684.071	0,29
27.221	Intertek Group Plc	2.003.194	0,34	56.416	Baxter International Inc	4.067.594	0,70
74.584	ITV Plc	162.547	0,03	1.453	Bemis Co Inc	62.217	0,01
26.352	JD Sports Fashion Plc	133.008	0,02	1	Berkshire Hathaway Inc 'A'	290.700	0,05
4.338	Jupiter Fund Management Plc	26.243	0,00	2.681	Biogen Inc	800.895	0,14
135.976	Legal & General Group Plc	488.936	0,08	2.120	BioMarin Pharmaceutical Inc	193.196	0,03
42.405	Man Group Plc	102.140	0,02	3.496	Boeing Co/The	1.240.171	0,21
1.563	Mondi Plc	43.632	0,01	3.026	Booz Allen Hamilton Holding Corp	136.563	0,02
25.522	Moneysupermarket.com Group Plc	108.055	0,02	22.477	BorgWarner Inc	1.099.800	0,19
1.827	NMC Health Plc	86.653	0,01	1.110	Boston Properties Inc (Reit)	135.020	0,02
30.862	Old Mutual Plc*	98.431	0,02	1.146	Brandywine Realty Trust (Reit)	18.600	0,00
2.023	Pagegroup Plc	14.253	0,00	44.683	Bristol-Myers Squibb Co	2.367.752	0,40
3.965	Persimmon Plc	149.898	0,03	939	Broadridge Financial Solutions Inc ADR	109.609	0,02
111.749	Rentokil Initial Plc	510.559	0,09	10.937	Brown-Forman Corp 'B'	622.534	0,11
641	Rightmove Plc	42.187	0,01	5.570	Bruker Corp	171.166	0,03
10.517	Rio Tinto Plc	594.580	0,10				
23.079	Royal Dutch Shell Plc 'A'	802.560	0,14				

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

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
2.421	Burlington Stores Inc	358.986	0,06	12.501	Hershey Co/The	1.136.341	0,19
7.472	Cabot Corp	451.458	0,08	13.705	Hewlett Packard Enterprise Co	212.565	0,04
4.190	Cadence Design Systems Inc	178.620	0,03	310	Highwoods Properties Inc (Reit)	14.672	0,00
4.910	Capital One Financial Corp	457.023	0,08	2.709	Hill-Rom Holdings Inc	250.935	0,04
2.232	CBRE Group Inc 'A'	104.815	0,02	23.942	Honeywell International Inc	3.579.568	0,61
7.795	CDK Global Inc	504.804	0,09	2.604	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	56.585	0,01
1.446	CDW Corp/DE	117.227	0,02	147.207	HP Inc	3.277.564	0,56
7.611	Celanese Corp 'A'	875.189	0,15	19.114	Humana Inc	5.631.749	0,96
9.979	Celgene Corp	779.260	0,13	180	Hyatt Hotels Corp 'A'	14.751	0,00
35.854	CenterPoint Energy Inc	934.355	0,16	1.787	IDACORP Inc	165.155	0,03
274	Charles Schwab Corp/The	15.237	0,00	7.372	IDEXX Laboratories Inc	1.553.649	0,27
405	Chemours Co/The	20.222	0,00	31.928	Illinois Tool Works Inc	4.648.398	0,79
478	Chevron Corp	59.248	0,01	2.207	Incyte Corp	151.202	0,03
14.279	Cigna Corp	2.460.843	0,42	6.415	Ingredion Inc	727.333	0,12
71.790	Citigroup Inc	4.738.140	0,81	1.687	Insperty Inc	154.023	0,03
66.652	Citizens Financial Group Inc	2.698.739	0,46	21.356	Intercontinental Exchange Inc	1.527.808	0,26
24.948	CME Group Inc	4.106.191	0,70	3.501	InterDigital Inc/PA	281.305	0,05
20.246	CMS Energy Corp	931.923	0,16	29.786	International Business Machines Corp	4.235.271	0,72
69.230	Comcast Corp 'A'	2.148.207	0,37	57.639	Interpublic Group of Cos Inc/The	1.296.877	0,22
55.914	Conagra Brands Inc	2.091.184	0,36	6.195	Intuit Inc	1.248.974	0,21
57.984	ConocoPhillips	3.912.180	0,67	4.319	Jabil Inc	124.171	0,02
1.274	Constellation Brands Inc 'A'	283.911	0,05	69.156	Johnson & Johnson	8.367.876	1,43
323	Continental Resources Inc/OK	21.838	0,00	3.720	Jones Lang LaSalle Inc	614.507	0,11
2.139	Copart Inc	119.656	0,02	9.360	JPMorgan Chase & Co	1.001.614	0,17
378	Cornerstone OnDemand Inc	19.010	0,00	2.739	KAR Auction Services Inc	146.235	0,03
332	Costco Wholesale Corp	66.012	0,01	13.269	Kellogg Co	855.452	0,15
126	Crane Co	10.681	0,00	1.728	Keysight Technologies Inc	103.576	0,02
10.439	Cummins Inc	1.510.628	0,26	27.396	Kohl's Corp	1.849.778	0,32
2.859	Dana Inc	63.956	0,01	3.804	Lamb Weston Holdings Inc	246.043	0,04
45.970	Danaher Corp	4.637.913	0,79	4.677	Landstar System Inc	534.815	0,09
1.355	Darden Restaurants Inc	119.809	0,02	16.974	Las Vegas Sands Corp	1.366.068	0,23
360	Discover Financial Services	26.611	0,00	17.767	Lear Corp	3.514.313	0,60
520	Dollar General Corp	46.218	0,01	1.616	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	74.239	0,01
1.445	Domino's Pizza Inc	361.525	0,06	6.368	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	292.482	0,05
7.003	DR Horton Inc	297.067	0,05	20.829	Lincoln National Corp	1.383.254	0,24
14.400	DTE Energy Co	1.469.520	0,25	351	Lithia Motors Inc 'A'	33.889	0,01
4.424	Duke Realty Corp (Reit)	124.757	0,02	1.193	Lululemon Athletica Inc	124.573	0,02
1.514	Dun & Bradstreet Corp/The	187.569	0,03	19.879	ManpowerGroup Inc*	1.824.693	0,31
266	EastGroup Properties Inc (Reit)	24.844	0,00	28.394	Marathon Petroleum Corp	2.307.012	0,39
14.998	Eastman Chemical Co	1.571.940	0,27	10.888	Masco Corp	415.377	0,07
64.801	eBay Inc	2.431.982	0,42	298	Masimo Corp	29.869	0,01
2.422	Eli Lilly & Co	204.393	0,04	40.485	Mastercard Inc 'A'	7.780.812	1,33
1.764	Entergy Corp	141.314	0,02	61.868	Maxim Integrated Products Inc	3.655.161	0,62
1.606	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	144.861	0,03	37.200	McDonald's Corp	5.989.200	1,02
27.594	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	4.149.862	0,71	6.644	McKesson Corp	948.165	0,16
195	Expeditors International of Washington Inc	14.722	0,00	16.811	Merck & Co Inc	1.004.625	0,17
2.719	Express Scripts Holding Co	206.821	0,04	60.579	Microsoft Corp	6.022.764	1,03
2.728	Extended Stay America Inc (Unit)	56.742	0,01	36.305	Morgan Stanley	1.830.498	0,31
5.050	Exxon Mobil Corp	407.787	0,07	17.167	Motorola Solutions Inc	1.875.838	0,32
9.419	Facebook Inc 'A'	1.781.792	0,30	497	National Instruments Corp	20.770	0,00
10.291	Fidelity National Information Services Inc	1.059.253	0,18	1.520	National Retail Properties Inc (Reit)	62.852	0,01
5.297	First American Financial Corp	281.589	0,05	1.495	Nektar Therapeutics	124.175	0,02
2.778	Flowers Foods Inc	56.588	0,01	21.569	NetApp Inc	1.482.006	0,25
10.771	Fortune Brands Home & Security Inc	614.701	0,11	6.266	Newmont Mining Corp	244.687	0,04
516	Franklin Resources Inc	17.260	0,00	19.386	Norfolk Southern Corp	2.975.557	0,51
16.744	Gilead Sciences Inc	1.135.578	0,19	133	Northern Trust Corp	13.644	0,00
1.897	GoDaddy Inc 'A'	137.722	0,02	3.941	ON Semiconductor Corp	101.441	0,02
3.894	Goldman Sachs Group Inc/The	881.095	0,15	43.250	Oracle Corp	2.031.885	0,35
853	Graco Inc	39.306	0,01	3.067	Oshkosh Corp	226.774	0,04
6.813	H&R Block Inc	190.355	0,03	2.558	Outfront Media Inc (Reit)	50.546	0,01
1.851	Halliburton Co	92.569	0,02	17.315	Owens Corning	1.119.761	0,19
305	Hanover Insurance Group Inc/The	37.039	0,01	58.940	PACCAR Inc	3.714.399	0,63
11.527	Hartford Financial Services Group Inc/The	606.666	0,10	923	Packaging Corp of America	109.311	0,02
23.131	HD Supply Holdings Inc	928.016	0,16	1.890	Penske Automotive Group Inc*	90.890	0,02
284	Helmerich & Payne Inc	18.957	0,00	20.628	PepsiCo Inc	2.058.056	0,35

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

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
374	Phillips 66	44.880	0,01	9.522	UGI Corp	481.051	0,08
6.923	Pilgrim's Pride Corp	137.422	0,02	17.380	Union Pacific Corp	2.522.533	0,43
10.409	Pinnacle West Capital Corp	826.370	0,14	548	United Therapeutics Corp	58.724	0,01
3.966	Portland General Electric Co	168.000	0,03	3.058	UnitedHealth Group Inc	744.440	0,13
400	PotlatchDeltic Corp (Reit)	20.080	0,00	23.731	Unum Group	902.015	0,15
23.832	PPL Corp	647.754	0,11	4.849	Urban Outfitters Inc	201.864	0,04
4.013	Praxair Inc	628.917	0,11	1.079	Valero Energy Corp	133.796	0,02
17.773	Principal Financial Group Inc	989.601	0,17	1.880	Varian Medical Systems Inc	222.949	0,04
5.996	Progressive Corp/The	374.810	0,06	186	Veeva Systems Inc 'A'	14.415	0,00
61.771	Prologis Inc (Reit)	3.987.318	0,68	5.090	Ventas Inc (Reit)	277.405	0,05
26.605	Prudential Financial Inc	2.572.970	0,44	25.376	VeriSign Inc	3.325.779	0,57
2.037	PVH Corp	324.148	0,06	3.206	Vertex Pharmaceuticals Inc	502.925	0,09
18.125	Quest Diagnostics Inc	1.955.325	0,33	16.842	VF Corp	1.375.318	0,24
13.469	Ralph Lauren Corp	1.838.114	0,31	5.280	Visa Inc 'A'	690.413	0,12
6.455	Raytheon Co	1.366.911	0,23	1.142	Vishay Intertechnology Inc	24.496	0,00
1.010	Regeneron Pharmaceuticals Inc	307.292	0,05	2.748	VMware Inc 'A'	381.972	0,07
302	Reliance Steel & Aluminum Co	28.868	0,01	20.583	Walmart Inc	1.718.680	0,29
23.387	Republic Services Inc	1.598.969	0,27	2.991	Waste Management Inc	252.052	0,04
1.206	Robert Half International Inc	77.148	0,01	8.310	Weingarten Realty Investors (Reit)	242.320	0,04
899	Rockwell Automation Inc	159.842	0,03	5.549	WellCare Health Plans Inc	1.245.196	0,21
16.431	Ryder System Inc	1.126.674	0,19	30.191	Westar Energy Inc	1.716.358	0,29
1.598	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	133.705	0,02	8.615	Western Union Co/The	171.525	0,03
15.991	S&P Global Inc	3.181.090	0,54	1.209	Westlake Chemical Corp	142.602	0,02
1.327	Seattle Genetics Inc	78.824	0,01	1.273	Wolverine World Wide Inc	42.938	0,01
6.722	Simon Property Group Inc (Reit)	1.080.427	0,19	1.136	XPO Logistics Inc	123.835	0,02
217	SL Green Realty Corp (Reit)	21.034	0,00	4	Xylem Inc/NY	285	0,00
2.970	Sohu.com Inc	107.722	0,02	1.474	Yelp Inc*	64.532	0,01
523	Sotheby's	28.901	0,01	3.017	Yum! Brands Inc	247.726	0,04
742	SS&C Technologies Holdings Inc	37.345	0,01	707	Zendesk Inc	40.115	0,01
1.305	Stryker Corp	229.523	0,04	51.640	Zoetis Inc	4.357.900	0,74
870	Sun Communities Inc (Reit)	83.633	0,01			286.498.291	48,92
14.663	SunTrust Banks Inc	986.233	0,17	Total des actions ordinaires et privilégiées		574.157.671	98,04
129	SYNNEX Corp	14.159	0,00				
23.140	Synopsys Inc	2.045.113	0,35	EXCHANGE TRADED FUNDS			
1.270	Synovus Financial Corp	68.758	0,01				
52.135	Target Corp	3.819.931	0,65		France		
3.645	Taylor Morrison Home Corp 'A'	79.497	0,01	233.825	Lyxor MSCI India UCITS ETF	4.299.574	0,74
4.058	Telephone & Data Systems Inc	103.682	0,02			4.299.574	0,74
4.779	Tenneco Inc	211.805	0,04	Total des <i>Exchange Traded Funds</i>		4.299.574	0,74
747	Teradata Corp	29.656	0,01	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		578.457.245	98,78
3.231	Terex Corp	128.594	0,02	Portefeuille de titres à la valeur de marché		578.457.245	98,78
42.066	Texas Instruments Inc	4.735.370	0,81				
1.968	Thermo Fisher Scientific Inc	413.910	0,07	Autres éléments de l'actif net		7.157.857	1,22
13.832	Tiffany & Co	1.818.078	0,31	Total de l'actif net (USD)		585.615.102	100,00
9.868	Time Warner Inc	921.869	0,16				
6.969	Total System Services Inc	602.958	0,10				
619	Twilio Inc 'A'	33.748	0,01				
38.597	Twitter Inc	1.336.228	0,23				
400	UDR Inc (Reit)	14.540	0,00				

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

BlackRock Systematic Global Equity Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
21	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	2.852.850	34.600
17	EUR	EURO STOXX 50 Index	Juin 2018	676.229	(13.993)
3	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	306.510	18.544
8	USD	Mini MSCI Emerging Markets Index	Juin 2018	447.280	(11.618)
7	JPY	Nikkei 225 Index	Juin 2018	712.614	(17.812)
1	CAD	S&P/TSX 60 Index	Juin 2018	146.179	3.906
1	AUD	SPI 200 Index	Juin 2018	113.928	1.004
1	CHF	Swiss Market Index	Juin 2018	86.659	(2.242)
Total				5.342.249	12.389

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	315.623	USD	375.472	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(7.500)
USD	25.236	EUR	21.358	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	336
						(7.164)
Total (exposition brute sous-jacente – 392.873 USD)						(7.164)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	20,62
Finance	18,06
Biens de consommation cyclique	13,82
Technologie	12,29
Communications	11,14
Valeurs industrielles	9,53
Matériaux de base	5,98
Énergie	4,72
Services aux collectivités	1,72
Exchange Traded Funds	0,74
Diversifiés	0,15
Titres adossés à des actifs	0,01
Portefeuille de titres à la valeur de marché	98,78
Autres éléments de l'actif net	1,22
	100,00

BlackRock Total Advantage Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
OBLIGATIONS				France suite			
AUD 300.000	Australie Australia Government Bond RegS 4,00% 20/8/2020	357.832	1,06	EUR 81.920	France Government Bond OAT RegS '144A' 0,10% 25/7/2047	88.977	0,26
AUD 420.000	Australia Government Bond RegS 1,25% 21/2/2022	316.362	0,93	EUR 3.500.000	France Treasury Bill BTF RegS 20/6/2018 (Zero Coupon)	3.500.875	10,35
AUD 385.000	Australia Government Bond RegS 3,00% 20/9/2025	352.961	1,04	EUR 5.000.000	France Treasury Bill BTF RegS 15/8/2018 (Zero Coupon)	5.006.150	14,81
AUD 220.000	Australia Government Bond RegS 0,75% 21/11/2027	145.176	0,43	EUR 4.600.000	France Treasury Bill BTF RegS 12/9/2018 (Zero Coupon)	4.608.050	13,63
AUD 265.000	Australia Government Bond RegS 2,50% 20/9/2030	243.295	0,72	EUR 5.000.000	France Treasury Bill BTF RegS 10/10/2018 (Zero Coupon)	5.010.700	14,82
AUD 235.000	Australia Government Bond RegS 2,00% 21/8/2035	195.085	0,58			20.801.632	61,52
AUD 180.000	Australia Government Bond RegS 1,25% 21/8/2040	128.224	0,38	Allemagne			
		1.738.935	5,14	EUR 202.322	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond RegS 1,75% 15/4/2020	215.452	0,64
Canada				EUR 201.848	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond RegS 0,10% 15/4/2023	219.056	0,65
CAD 207.943	Canadian Government Real Return Bond 4,25% 1/12/2021	156.838	0,47	EUR 129.249	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond RegS 0,10% 15/4/2026	143.757	0,42
CAD 181.570	Canadian Government Real Return Bond 4,25% 1/12/2026	158.589	0,47	EUR 119.224	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond RegS 0,50% 15/4/2030	140.529	0,41
CAD 210.857	Canadian Government Real Return Bond 4,00% 1/12/2031	203.739	0,60	EUR 72.923	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond RegS 0,10% 15/4/2046	89.335	0,26
CAD 180.638	Canadian Government Real Return Bond 3,00% 1/12/2036	172.351	0,51	EUR 2.400.000	German Treasury Bill RegS 15/8/2018 (Zero Coupon)	2.403.096	7,11
CAD 197.147	Canadian Government Real Return Bond 2,00% 1/12/2041	173.281	0,51	EUR 1.200.000	German Treasury Bill RegS 10/10/2018 (Zero Coupon)	1.202.688	3,56
CAD 206.917	Canadian Government Real Return Bond 1,50% 1/12/2044	170.055	0,50			4.413.913	13,05
CAD 210.179	Canadian Government Real Return Bond 1,25% 1/12/2047	167.444	0,50	Royaume-Uni			
CAD 35.786	Canadian Government Real Return Bond 0,50% 1/12/2050	23.649	0,07	GBP 16.711	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/11/2019	19.856	0,06
		1.225.946	3,63	GBP 10.000	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 2,50% 16/4/2020	41.326	0,12
France				GBP 33.830	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 1,875% 22/11/2022	45.963	0,14
EUR 125.568	France Government Bond OAT RegS 1,30% 25/7/2019	130.133	0,38	GBP 17.220	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/3/2024	22.187	0,07
EUR 281.695	France Government Bond OAT RegS 2,25% 25/7/2020	308.062	0,91	GBP 10.000	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 2,50% 17/7/2024	41.376	0,12
EUR 76.976	France Government Bond OAT RegS 0,10% 1/3/2021	81.109	0,24	GBP 21.553	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/3/2026	28.606	0,08
EUR 103.408	France Government Bond OAT RegS 0,10% 25/7/2021	109.303	0,32	GBP 35.850	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 1,25% 22/11/2027	53.797	0,16
EUR 228.159	France Government Bond OAT RegS 1,10% 25/7/2022	255.483	0,76	GBP 23.443	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/3/2029	32.517	0,10
EUR 202.464	France Government Bond OAT RegS 2,10% 25/7/2023	240.587	0,71	GBP 5.000	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 4,125% 22/7/2030	20.744	0,06
EUR 198.027	France Government Bond OAT RegS 0,25% 25/7/2024	218.246	0,65	GBP 25.633	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 1,25% 22/11/2032	43.432	0,13
EUR 92.273	France Government Bond OAT RegS 0,10% 1/3/2025	100.221	0,30	GBP 23.967	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,75% 22/3/2034	39.334	0,12
EUR 219.358	France Government Bond OAT RegS 1,85% 25/7/2027	278.672	0,82	GBP 15.000	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 2,00% 26/1/2035	45.862	0,13
EUR 51.177	France Government Bond OAT RegS 0,10% 1/3/2028	55.857	0,17	GBP 10.703	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/11/2036	16.903	0,05
EUR 128.227	France Government Bond OAT RegS 3,40% 25/7/2029	191.493	0,57	GBP 27.521	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 1,125% 22/11/2037	51.505	0,15
EUR 113.175	France Government Bond OAT RegS '144A' 0,70% 25/7/2030	132.846	0,39	GBP 32.132	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,625% 22/3/2040	58.682	0,17
EUR 158.564	France Government Bond OAT RegS 3,15% 25/7/2032	247.451	0,73	GBP 26.197	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,625% 22/11/2042	50.411	0,15
EUR 158.630	France Government Bond OAT RegS 1,80% 25/7/2040	237.417	0,70				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
Royaume-Uni suite				Etats-Unis suite			
GBP 28.699	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/3/2044	51.005	0,15	USD 31.528	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/7/2024	26.284	0,08
GBP 21.591	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/3/2046	39.513	0,12	USD 36.874	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,25% 15/1/2025	30.770	0,09
GBP 26.789	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,75% 22/11/2047	57.486	0,17	USD 39.715	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,375% 15/1/2025	37.834	0,11
GBP 5.064	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 10/8/2048	9.609	0,03	USD 47.352	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/7/2025	39.884	0,12
GBP 26.082	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,50% 22/3/2050	55.571	0,16	USD 47.258	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/1/2026	40.298	0,12
GBP 22.995	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,25% 22/3/2052	47.935	0,14	USD 18.859	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,00% 15/1/2026	17.739	0,05
GBP 28.959	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 1,25% 22/11/2055	81.154	0,24	USD 26.026	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/7/2026	21.355	0,06
GBP 5.253	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/11/2056	11.397	0,03	USD 41.321	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/1/2027	34.379	0,10
GBP 16.313	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/3/2058	36.194	0,11	USD 18.561	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,375% 15/1/2027	18.115	0,05
GBP 23.601	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,375% 22/3/2062	60.550	0,18	USD 40.804	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/7/2027	33.984	0,10
GBP 10.686	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/11/2065	27.285	0,08	USD 17.867	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,75% 15/1/2028	16.736	0,05
GBP 22.290	United Kingdom Gilt Inflation Linked RegS 0,125% 22/3/2068	59.831	0,18	USD 15.428	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3,625% 15/4/2028	16.828	0,05
		1.150.031	3,40	USD 17.434	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,50% 15/1/2029	17.575	0,05
Etats-Unis				USD 30.358	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3,875% 15/4/2029	34.363	0,10
USD 11.623	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,125% 15/1/2019	10.092	0,03	USD 7.029	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3,375% 15/4/2032	8.052	0,02
USD 42.597	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2019	36.419	0,11	USD 17.318	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,125% 15/2/2040	18.603	0,06
USD 17.530	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,875% 15/7/2019	15.352	0,05	USD 28.487	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,125% 15/2/2041	30.803	0,09
USD 34.618	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,375% 15/1/2020	30.170	0,09	USD 16.565	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,75% 15/2/2042	13.784	0,04
USD 47.951	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2020	40.811	0,12	USD 21.707	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/2/2043	17.481	0,05
USD 22.884	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,25% 15/7/2020	20.039	0,06	USD 26.767	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,375% 15/2/2044	25.437	0,08
USD 28.518	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,125% 15/1/2021	24.874	0,07	USD 21.194	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,75% 15/2/2045	17.472	0,05
USD 31.586	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2021	26.736	0,08	USD 21.063	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,00% 15/2/2046	18.441	0,05
USD 88.573	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/7/2021	76.458	0,23	USD 15.506	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,875% 15/2/2047	13.164	0,04
USD 49.613	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/1/2022	41.903	0,12			1.035.485	3,06
USD 25.652	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2022	21.591	0,06	Total des obligations		30.365.942	89,80
USD 32.553	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/7/2022	27.521	0,08	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		30.365.942	89,80
USD 43.243	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/1/2023	36.324	0,11	Portefeuille de titres à la valeur de marché		30.365.942	89,80
USD 37.529	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/7/2023	31.954	0,10	Autres éléments de l'actif net		3.447.328	10,20
USD 53.472	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/1/2024	45.860	0,14	Total de l'actif net (EUR)		33.813.270	100,00

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

[illegible]

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Finlande suite				France suite			
(203)	Metso OYJ	Bank of America		56	BioMerieux	Citibank	246
		Merrill Lynch	114	142	BNP Paribas SA	Deutsche Bank	(1.397)
(652)	Metso OYJ	Deutsche Bank	365	(20.758)	Bollere SA	Deutsche Bank	4.152
178	Neste OYJ	Bank of America		(351)	Bollere SA	JP Morgan	31
		Merrill Lynch	214	439	Bouygues SA	Deutsche Bank	(1.027)
21	Neste OYJ	Credit Suisse	80	(3.065)	Bureau Veritas SA	JP Morgan	1.103
190	Neste OYJ	Citibank	(175)	83	Cap Gemini SA	Citibank	(100)
28	Neste OYJ	JP Morgan	106	(387)	Carrefour SA	Bank of America	
(689)	Nokia OYJ	Bank of America				Merrill Lynch	288
		Merrill Lynch	214	(555)	Carrefour SA	Credit Suisse	627
(736)	Nokia OYJ	Citibank	234	(209)	Carrefour SA	Citibank	208
(6.031)	Nokia OYJ	Deutsche Bank	1.870	68	Casino Guichard		
(354)	Nokian Renkaat OYJ	Credit Suisse	170		Perrachon SA	Credit Suisse	(403)
(647)	Nokian Renkaat OYJ	Deutsche Bank	(317)	9	Casino Guichard		
(103)	Orion OYJ 'B'	Bank of America			Perrachon SA	Deutsche Bank	(35)
		Merrill Lynch	32	49	Casino Guichard		
(164)	Orion OYJ 'B'	Deutsche Bank	51		Perrachon SA	JP Morgan	(290)
(3.293)	Outokumpu OYJ	Bank of America		1.066	Cie de Saint-Gobain	Bank of America	
		Merrill Lynch	810			Merrill Lynch	(1.988)
(431)	Outokumpu OYJ	Credit Suisse	116	83	Cie de Saint-Gobain	Deutsche Bank	(155)
(1.856)	Outokumpu OYJ	Deutsche Bank	457	97	Cie Generale des		
458	Sampo OYJ 'A'	Citibank	(605)		Etablissements		
13	Sampo OYJ 'A'	JP Morgan	(26)		Michelin SCA	Credit Suisse	(833)
548	Stora Enso OYJ 'R'	Bank of America		704	Cie Generale des	Bank of America	
		Merrill Lynch	77		Etablissements Michelin SCA	Merrill Lynch	(5.843)
3.153	Stora Enso OYJ 'R'	Deutsche Bank	441	22	Cie Generale des		
186	Tieto OYJ	Credit Suisse	(48)		Etablissements		
1.468	Tieto OYJ	JP Morgan	(382)		Michelin SCA	Citibank	(130)
1.504	UPM-Kymmene OYJ	Bank of America		47	Cie Generale des		
		Merrill Lynch	(60)		Etablissements		
544	UPM-Kymmene OYJ	Deutsche Bank	(22)		Michelin SCA	JP Morgan	(301)
604	UPM-Kymmene OYJ	JP Morgan	471	1.546	Cie Plastic Omnium SA	Credit Suisse	(386)
2.708	Valmet OYJ	Bank of America		78	Cie Plastic Omnium SA	JP Morgan	(19)
		Merrill Lynch	27	588	CNP Assurances	Bank of America	
235	Valmet OYJ	JP Morgan	(12)			Merrill Lynch	(517)
(210)	Wartsila OYJ Abp	Bank of America		(227)	Danone SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	(76)			Merrill Lynch	(256)
(1.596)	Wartsila OYJ Abp	Citibank	1.109	(97)	Danone SA	Deutsche Bank	(110)
			3.691	5	Dassault Aviation SA	Bank of America	
France						Merrill Lynch	(175)
(229)	Accor SA	Bank of America		23	Dassault Aviation SA	Deutsche Bank	(805)
		Merrill Lynch	(82)	4	Dassault Aviation SA	JP Morgan	(100)
(1.715)	Accor SA	Credit Suisse	892	289	Eiffage SA	Citibank	(688)
(540)	Accor SA	Deutsche Bank	(194)	162	Eiffage SA	JP Morgan	(645)
(280)	Aeroports de Paris	JP Morgan	1.540	(1.875)	Electricite de France SA	Bank of America	
691	Air France-KLM	Citibank	(355)			Merrill Lynch	1.753
318	Air France-KLM	Bank of America		(1.579)	Elior Group SA '144A'	Deutsche Bank	3.947
		Merrill Lynch	(125)	(245)	Elis SA	Bank of America	
3.061	Air France-KLM	Credit Suisse	(1.322)			Merrill Lynch	233
660	Air France-KLM	JP Morgan	(285)	(3.730)	Elis SA	Credit Suisse	7.496
(710)	Air Liquide SA	Citibank	4.615	(431)	Elis SA	Deutsche Bank	409
(37)	Air Liquide SA	Deutsche Bank	74	3.067	Engie SA	Citibank	(2.101)
(323)	Airbus SE	JP Morgan	756	1.130	Engie SA	JP Morgan	(1.271)
(5.983)	ALD SA '144A'	Deutsche Bank	3.769	69	Eramet	Bank of America	
(1.371)	ALD SA '144A'	JP Morgan	768			Merrill Lynch	(407)
(206)	Alstom SA	Bank of America		70	Eramet	Credit Suisse	(203)
		Merrill Lynch	(367)	124	Eramet	Citibank	(905)
(92)	Alstom SA	Deutsche Bank	(164)	(377)	Essilor International		
(126)	Alstom SA	JP Morgan	(244)		Cie Generale d'Optique SA	Credit Suisse	(697)
(46)	Alten SA	Bank of America		504	Eurazeo SA	Deutsche Bank	(680)
		Merrill Lynch	(48)	(10)	Eurofins Scientific SE	Citibank	86
(319)	Alten SA	Deutsche Bank	(335)	(161)	Eurofins Scientific SE	JP Morgan	225
(2.802)	Altran Technologies SA	Citibank	1.205	503	Euronext NV '144A'	Credit Suisse	(1.836)
166	Amundi SA '144A'	Deutsche Bank	(1.408)	5	Euronext NV '144A'	Deutsche Bank	(8)
597	Arkema SA	Credit Suisse	(1.313)	(134)	Eutelsat Communications SA	Credit Suisse	253
832	Atos SE	Citibank	998	(667)	Eutelsat Communications SA	JP Morgan	1.257
1.078	AXA SA	JP Morgan	(1.256)	252	Faurecia SA	Deutsche Bank	625
108	BioMerieux	Credit Suisse	670	161	Faurecia SA	Credit Suisse	370
				1.344	Faurecia SA	Citibank	(2.876)
				113	Fonciere Des Regions (Reit)	JP Morgan	(718)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
France suite				France suite			
(94)	Gecina SA (Reit)	Citibank	–	(188)	Societe Generale SA	Citibank	873
(7.344)	Getlink	JP Morgan	1.138	(215)	Sodexo SA	Citibank	426
(14)	Hermes International	Credit Suisse	(675)	28	Sopra Steria Group	Credit Suisse	(118)
(146)	Hermes International	Deutsche Bank	(4.117)	96	Sopra Steria Group	JP Morgan	(403)
50	ICADE (Reit)	Bank of America		(230)	SPIE SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	(47)			Merrill Lynch	377
512	ICADE (Reit)	Deutsche Bank	(486)	(1.064)	SPIE SA	JP Morgan	1.692
(486)	Iliad SA	Credit Suisse	10.400	286	STMicroelectronics NV	Bank of America	
(30)	Iliad SA	JP Morgan	642			Merrill Lynch	3
(38)	Iliad SA	Bank of America		(2.095)	Suez	Bank of America	
		Merrill Lynch	(431)			Merrill Lynch	241
(198)	Ingenico Group SA	Bank of America		(297)	Suez	Credit Suisse	407
		Merrill Lynch	63	(899)	Suez	Deutsche Bank	103
(460)	Ingenico Group SA	Citibank	570	(260)	Tarkett SA	Credit Suisse	473
44	Ipsen SA	Bank of America		(149)	Tarkett SA	Citibank	253
		Merrill Lynch	246	(175)	Teleperformance	JP Morgan	543
167	Ipsen SA	Citibank	518	1.508	Television Francaise 1	Citibank	(1.033)
(22)	JCDecaux SA	Citibank	6	209	Thales SA	Bank of America	
(888)	JCDecaux SA	JP Morgan	2.344			Merrill Lynch	(345)
(2.069)	Korian SA	Deutsche Bank	1.655	241	Thales SA	Credit Suisse	(265)
42	L'Oreal SA	JP Morgan	196	241	Thales SA	JP Morgan	(265)
73	L'Oreal SA	Credit Suisse	526	1.310	Total SA	JP Morgan	118
(4)	Legrand SA	Deutsche Bank	4	10	Trigano SA	Bank of America	
(106)	LVMH Moet Hennessy	Bank of America				Merrill Lynch	21
	Louis Vuitton SE	Merrill Lynch	(111)	128	Trigano SA	Credit Suisse	1.997
1.959	Mercialys SA (Reit)	Credit Suisse	(686)	13	Trigano SA	Deutsche Bank	27
1.399	Metropole Television SA	Citibank	(1.539)	319	Ubisoft Entertainment SA	Citibank	1.678
(10)	Nexans SA	Bank of America		184	Ubisoft Entertainment SA	Bank of America	
		Merrill Lynch	16			Merrill Lynch	1.336
(118)	Nexans SA	Credit Suisse	221	78	Ubisoft Entertainment SA	JP Morgan	537
(404)	Nexans SA	Deutsche Bank	663	(3.518)	Vallourec SA	Bank of America	
27	Nexity SA	Bank of America				Merrill Lynch	(1.207)
		Merrill Lynch	(71)	(12.038)	Vallourec SA	JP Morgan	(4.118)
870	Nexity SA	JP Morgan	(2.279)	(2.287)	Vallourec SA	Citibank	1.656
165	Orange SA	Credit Suisse	(78)	1.272	Veolia Environnement SA	Bank of America	
6.150	Orange SA	Deutsche Bank	892			Merrill Lynch	(210)
(113)	Orpea	Deutsche Bank	(525)	(191)	Vicat SA	Bank of America	
(25)	Orpea	Bank of America				Merrill Lynch	602
		Merrill Lynch	(85)	404	Vinci SA	JP Morgan	(283)
(50)	Orpea	Citibank	(187)	(1.247)	Vivendi SA	Citibank	1.970
(701)	Orpea	JP Morgan	(2.383)	(220)	Wendel SA	Citibank	1.474
(45)	Pernod Ricard SA	Credit Suisse	(297)	1.144	Worldline SA/France '144A'	Bank of America	
(191)	Pernod Ricard SA	Deutsche Bank	(1.079)			Merrill Lynch	5.743
283	Peugeot SA	Citibank	(241)				27.606
4.765	Peugeot SA	Bank of America					
		Merrill Lynch	(334)		Allemagne		
(315)	Remy Cointreau SA	Deutsche Bank	(2.740)	(2.055)	1&1 Drillisch AG	Citibank	2.774
(334)	Renault SA	Citibank	2.989	(10)	1&1 Drillisch AG	Bank of America	
(964)	Rexel SA	Deutsche Bank	164			Merrill Lynch	20
(1.418)	Rubis SCA	Deutsche Bank	2.623	(62)	Aareal Bank AG	Credit Suisse	335
52	Safran SA	Citibank	–	75	adidas AG	Deutsche Bank	112
239	Safran SA	JP Morgan	896	100	adidas AG	Credit Suisse	135
183	Sanofi	Deutsche Bank	105	36	Allianz SE Reg	Bank of America	
1.068	Sanofi	Bank of America				Merrill Lynch	(513)
		Merrill Lynch	1.228	401	Allianz SE Reg	Deutsche Bank	(5.718)
89	Sanofi	Citibank	(52)	329	Aurubis AG	Credit Suisse	(1.961)
322	Sanofi	JP Morgan	(39)	83	Aurubis AG	JP Morgan	(495)
(384)	Sartorius Stedim Biotech	Citibank	(19)	(74)	Axel Springer SE	JP Morgan	278
112	Schneider Electric SE	Bank of America		1.124	BASF SE	Bank of America	
		Merrill Lynch	(247)			Merrill Lynch	(3.248)
118	Schneider Electric SE	JP Morgan	(136)	226	BASF SE	Deutsche Bank	(653)
248	Schneider Electric SE	Credit Suisse	(362)	94	BASF SE	JP Morgan	(108)
59	Schneider Electric SE	Deutsche Bank	(98)	452	Bayer AG Reg	JP Morgan	72
632	SCOR SE	Citibank	(1.138)	(61)	Bayerische Motoren		
(24)	Societe BIC SA	Deutsche Bank	65		Werke AG	JP Morgan	388
(111)	Societe BIC SA	JP Morgan	344	(76)	Bayerische Motoren		
(63)	Societe Generale SA	Bank of America			Werke AG	Deutsche Bank	501
		Merrill Lynch	352	238	Beiersdorf AG	Credit Suisse	362
(338)	Societe Generale SA	Credit Suisse	1.726	(2.425)	Bilfinger SE	Deutsche Bank	2.619

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Allemagne suite				Allemagne suite			
(22)	Bilfinger SE	JP Morgan	(1)	230	LEG Immobilien AG	Citibank	432
(86)	Brenntag AG	Credit Suisse	(60)	48	LEG Immobilien AG	Credit Suisse	(31)
(176)	Brenntag AG	Citibank	252	(52)	MAN SE	Citibank	78
(542)	Carl Zeiss Meditec AG	Bank of America		(978)	MAN SE	JP Morgan	3.179
		Merrill Lynch	(1.192)	(253)	MAN SE	Bank of America	
(3.608)	Commerzbank AG	Bank of America				Merrill Lynch	974
		Merrill Lynch	7.948	856	Merck KGaA	Bank of America	
(101)	CompuGroup Medical SE	Credit Suisse	465			Merrill Lynch	7.173
106	Continental AG	Bank of America		120	MTU Aero Engines AG	Citibank	624
		Merrill Lynch	(307)	8	MTU Aero Engines AG	Deutsche Bank	90
15	Continental AG	Deutsche Bank	(44)	385	Muenchener		
58	Continental AG	JP Morgan	(539)		Rueckversicherungs-		
182	Covestro AG '144A'	Credit Suisse	218		Gesellschaft AG in		
429	Covestro AG '144A'	Citibank	(549)		Muenchen Reg	Credit Suisse	(4.870)
396	Covestro AG '144A'	Deutsche Bank	(301)	41	NEMETSCHEK SE	Bank of America	
977	Covestro AG '144A'	JP Morgan	1.172			Merrill Lynch	(283)
(957)	CTS Eventim AG & Co KGaA	Bank of America		152	Nemetschek SE	Deutsche Bank	(1.262)
		Merrill Lynch	(2.526)	46	Nemetschek SE	Credit Suisse	(281)
(223)	Daimler AG Reg	Credit Suisse	1.085	(196)	OSRAM Licht AG	Credit Suisse	280
(273)	Daimler AG Reg	Deutsche Bank	1.330	(367)	OSRAM Licht AG	Citibank	1.145
(319)	Daimler AG Reg	JP Morgan	1.592	(125)	OSRAM Licht AG	Deutsche Bank	30
(6.312)	Deutsche Bank AG Reg	Credit Suisse	13.773	(599)	Porsche Automobil		
(189)	Deutsche Boerse AG	Bank of America			Holding SE (Pref)	Citibank	3.750
		Merrill Lynch	331	668	ProSiebenSat.1 Media SE	Bank of America	
293	Deutsche EuroShop AG	Bank of America				Merrill Lynch	(3.073)
		Merrill Lynch	176	193	ProSiebenSat.1 Media SE	Credit Suisse	(1.135)
149	Deutsche EuroShop AG	Citibank	(279)	1	PUMA SE	Deutsche Bank	92
4.972	Deutsche Lufthansa AG Reg	Bank of America		(204)	Qiagen NV	Bank of America	
		Merrill Lynch	(9.347)			Merrill Lynch	(322)
214	Deutsche Lufthansa AG Reg	JP Morgan	(428)	595	Rheinmetall AG	Bank of America	
2.719	Deutsche Post AG Reg	Credit Suisse	(5.057)			Merrill Lynch	(1.458)
394	Deutsche Post AG Reg	Deutsche Bank	(516)	29	Rheinmetall AG	Credit Suisse	(247)
2.038	Deutsche Telekom AG Reg	Credit Suisse	(2.425)	80	Rheinmetall AG	Deutsche Bank	(196)
447	Deutsche Telekom AG Reg	Deutsche Bank	(375)	125	Rhoen-Klinikum AG	Bank of America	
175	Deutsche Telekom AG Reg	JP Morgan	(208)			Merrill Lynch	(50)
(1.760)	Deutsche Wohnen SE	Citibank	(1.514)	2.643	Rhoen-Klinikum AG	Deutsche Bank	(1.057)
(1.089)	DMG Mori AG	Bank of America		192	RTL Group SA	JP Morgan	(1.296)
		Merrill Lynch	(381)	(2.089)	RWE AG	Credit Suisse	764
(7.545)	E.ON SE	Bank of America		(930)	RWE AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.750			Merrill Lynch	656
(2.023)	E.ON SE	Deutsche Bank	444	139	Salzgitter AG	Bank of America	
(1.860)	E.ON SE	JP Morgan	878			Merrill Lynch	(506)
67	Evonik Industries AG	Deutsche Bank	(85)	479	Salzgitter AG	Deutsche Bank	(1.744)
1.761	Evonik Industries AG	JP Morgan	(1.391)	505	Schaeffler AG (Pref)	Deutsche Bank	(323)
(1.721)	Evotec AG	Citibank	(1.687)	2.863	Schaeffler AG (Pref)	JP Morgan	(1.174)
(243)	Fraport AG Frankfurt Airport			110	Scout24 AG '144A'	Citibank	(2)
	Services Worldwide	Deutsche Bank	471	(33)	Siemens AG Reg	Bank of America	
61	Fresenius Medical Care AG	Bank of America				Merrill Lynch	129
	& Co KGaA	Merrill Lynch	49	(74)	Siemens AG Reg	Credit Suisse	(147)
216	Fresenius Medical Care AG			(118)	Siemens AG Reg	Deutsche Bank	460
	& Co KGaA	Deutsche Bank	173	(126)	Siemens Healthineers AG	Credit Suisse	(28)
468	Fuchs Petrolub SE (Pref)	Citibank	(215)	291	Siltronic AG	JP Morgan	(553)
(514)	GEA Group AG	Deutsche Bank	200	1.174	Software AG	Credit Suisse	(2.407)
(199)	Grand City Properties SA	Bank of America		25	Software AG	Bank of America	
		Merrill Lynch	(84)			Merrill Lynch	(42)
(2.859)	Grand City Properties SA	Citibank	(229)	290	Suedzucker AG	Credit Suisse	326
(89)	Grenke AG	Deutsche Bank	289	(816)	Symrise AG	Credit Suisse	816
292	Hannover Rueck SE	Deutsche Bank	(1.256)	(111)	Symrise AG	Deutsche Bank	140
(2.050)	Hapag-Lloyd AG '144A'	Deutsche Bank	(3.936)	(818)	Telefonica Deutschland		
(79)	HeidelbergCement AG	JP Morgan	559		Holding AG	Credit Suisse	397
(62)	HeidelbergCement AG	Bank of America		(10.738)	Telefonica Deutschland		
		Merrill Lynch	217		Holding AG	Deutsche Bank	3.361
(77)	HeidelbergCement AG	Deutsche Bank	270	(1.063)	Telefonica Deutschland		
45	Hochtief AG	Credit Suisse	95		Holding AG	JP Morgan	516
453	Hochtief AG	Deutsche Bank	1.721	(963)	thyssenkrupp AG	Bank of America	
(220)	Infineon Technologies AG	Credit Suisse	(18)			Merrill Lynch	(1.079)
(589)	Infineon Technologies AG	JP Morgan	(47)	(2.214)	thyssenkrupp AG	Credit Suisse	(708)
(572)	Innogy SE	Deutsche Bank	257	(277)	thyssenkrupp AG	JP Morgan	(89)
(85)	Innogy SE	JP Morgan	71	7	Uniper SE	Bank of America	
(677)	KION Group AG	JP Morgan	2.843			Merrill Lynch	(2)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Allemagne suite				Hong Kong suite			
195	Uniper SE	Credit Suisse	(92)	1.000	China Construction Bank Corp 'H'	Deutsche Bank	(38)
2.562	Uniper SE	Citibank	(1.383)	(74.000)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	Citibank	243
(561)	United Internet AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	482	(65.000)	China Everbright International Ltd	Citibank	(1.564)
(92)	Volkswagen AG (Pref)	Deutsche Bank	1.055	22.000	China Everbright Ltd	Citibank	433
(203)	Volkswagen AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	2.452	2.000	China Everbright Ltd	JP Morgan	92
(182)	Volkswagen AG (Pref)	Credit Suisse	2.231	(73.000)	China Galaxy Securities Co Ltd 'H'	Citibank	319
(1.222)	Vonovia SE	Bank of America Merrill Lynch	(1.540)	(7.800)	China Gas Holdings Ltd	Citibank	(896)
70	Wacker Chemie AG	Bank of America Merrill Lynch	(812)	(45.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	Bank of America Merrill Lynch	590
18	Wacker Chemie AG	Credit Suisse	(283)	(20.000)	China Huarong Asset Management Co Ltd 'H' '144A'	JP Morgan	306
54	Wacker Chemie AG	Deutsche Bank	(626)	(48.000)	China Jinmao Holdings Group Ltd	Citibank	892
(69)	Wirecard AG	Deutsche Bank	(509)	(10.000)	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	711
(958)	Zalando SE '144A'	Deutsche Bank	(2.261)	(4.000)	China Life Insurance Co Ltd 'H'	Citibank	44
(180)	Zalando SE '144A'	JP Morgan	(95)	(48.000)	China Longyuan Power Group Corp Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	315
			(1.802)	1.000	China Medical System Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	39
Hong Kong				8.000	China Medical System Holdings Ltd	Citibank	1.120
(3.000)	AAC Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2.624)	4.000	China Medical System Holdings Ltd	Deutsche Bank	157
(500)	AAC Technologies Holdings Inc	Citibank	(180)	5.000	China Medical System Holdings Ltd	JP Morgan	(262)
18.000	Agile Group Holdings Ltd	Deutsche Bank	(3.071)	(3.000)	China Mengniu Dairy Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(476)
49.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H'	Credit Suisse	(1.661)	4.000	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Credit Suisse	(569)
1.800	AIA Group Ltd	JP Morgan	512	1.000	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Citibank	(131)
(46.000)	Alibaba Health Information Technology Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14.336)	3.000	China Merchants Bank Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(869)
(570.000)	Alibaba Pictures Group Ltd	Citibank	(6.233)	(28.000)	China Merchants Port Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	735
(15.586)	Alibaba Pictures Group Ltd	JP Morgan	(153)	(18.000)	China Merchants Port Holdings Co Ltd	Citibank	827
6.500	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	Citibank	355	(16.500)	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H'	Citibank	(271)
500	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H'	JP Morgan	(16)	3.000	China Mobile Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.329)
1.000	ANTA Sports Products Ltd	JP Morgan	(284)	500	China Mobile Ltd	Credit Suisse	(208)
41.000	Bank of China Ltd 'H'	Citibank	(179)	1.000	China Mobile Ltd	Deutsche Bank	(443)
8.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(131)	(26.000)	China National Building Material Co Ltd 'H'	JP Morgan	(416)
4.000	Bank of Communications Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(66)	(2.000)	China Overseas Land & Investment Ltd	Citibank	796
(9.373)	Bank of East Asia Ltd/The	Bank of America Merrill Lynch	1.742	(1.800)	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	262
(400)	Bank of East Asia Ltd/The	Citibank	—	(54.000)	China Power International Development Ltd	Credit Suisse	—
500	Beijing Enterprises Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	107	(18.000)	China Power International Development Ltd	JP Morgan	—
4.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd	Credit Suisse	2.067	12.000	China Railway Construction Corp Ltd 'H'	Deutsche Bank	(315)
(130.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.701)	24.000	China Railway Group Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(26)
(34.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Citibank	1.004	12.000	China Railway Group Ltd 'H'	Deutsche Bank	(13)
(58.000)	Beijing Enterprises Water Group Ltd	Deutsche Bank	(1.237)	4.000	China Railway Group Ltd 'H'	JP Morgan	22
(18.070)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Citibank	632				
(18.000)	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	157				
(2.000)	BYD Co Ltd 'H'	Citibank	623				
(200.000)	CGN Power Co Ltd 'H' '144A'	Citibank	(219)				
(3.000)	Champion (Reit)	Citibank	7				
(171.000)	China Cinda Asset Management Co Ltd 'H'	Citibank	—				
(3.000)	China Conch Venture Holdings Ltd	Citibank	(886)				
26.000	China Construction Bank Corp 'H'	Credit Suisse	(427)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
4.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	Credit Suisse	1.183	1.400	GF Securities Co Ltd 'H'	JP Morgan	(80)
(6.000)	China Resources Gas Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.148)	(36.000)	GOME Retail Holdings Ltd	Citibank	(118)
8.500	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	Credit Suisse	576	(1.000)	GOME Retail Holdings Ltd	JP Morgan	(6)
500	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(16)	(6.500)	Great Wall Motor Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	320
(8.000)	China State Construction International Holdings Ltd	Deutsche Bank	70	12.000	Guangdong Investment Ltd	Deutsche Bank	577
(94.000)	China State Construction International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	822	8.000	Guangdong Investment Ltd	Citibank	(175)
(14.600)	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	Citibank	(479)	22.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	Credit Suisse	(1.251)
78.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	Deutsche Bank	(853)	(175.000)	Guotai Junan International Holdings Ltd	Citibank	2.488
(28.000)	China Unicom Hong Kong Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.286	2.000	Haier Electronics Group Co Ltd	Deutsche Bank	208
(22.000)	China Unicom Hong Kong Ltd	Citibank	674	14.000	Haier Electronics Group Co Ltd	JP Morgan	2.526
1.700	China Vanke Co Ltd 'H'	Credit Suisse	(586)	24.000	Haitian International Holdings Ltd	Deutsche Bank	3.412
3.800	China Vanke Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(1.392)	(138.718)	Haitong International Securities Group Ltd	Citibank	(1.606)
2.000	China Vanke Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(733)	(39.200)	Haitong Securities Co Ltd 'H'	Citibank	1.200
14.000	CIFI Holdings Group Co Ltd	JP Morgan	(77)	(8.000)	Hang Lung Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.006
17.000	CITIC Ltd	Citibank	186	(9.000)	Hang Lung Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1.319
7.000	CITIC Ltd	JP Morgan	(123)	200	Hang Seng Bank Ltd	Credit Suisse	(26)
(24.000)	CITIC Securities Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(210)	1.800	Hang Seng Bank Ltd	Citibank	(98)
5.500	CK Asset Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1.474)	2.000	Henderson Land Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22
1.000	CK Asset Holdings Ltd	Citibank	(170)	126.000	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd '144A' (Unit)	Credit Suisse	4.409
500	CK Hutchison Holdings Ltd	Deutsche Bank	(79)	4.500	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd '144A' (Unit)	Citibank	79
(4.500)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	836	(14.000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	184
19.500	CLP Holdings Ltd	Deutsche Bank	1.386	(2.000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Citibank	39
(40.000)	CMBC CAPITAL Holdings Ltd	Citibank	-	41.000	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(359)
(30.000)	CMBC Capital Holdings Ltd	JP Morgan	180	(42.000)	Huaneng Power International Inc 'H'	Bank of America Merrill Lynch	(2.802)
20.000	CNOOC Ltd	JP Morgan	(44)	(15.200)	Huatai Securities Co Ltd 'H' '144A'	Citibank	(332)
(10.000)	COSCO SHIPPING Ports Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(481)	1.000	Hysan Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(12.000)	COSCO SHIPPING Ports Ltd	Citibank	(328)	4.000	Hysan Development Co Ltd	Deutsche Bank	(109)
15.000	Country Garden Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.083)	30.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H'	Credit Suisse	(919)
(38.000)	CRRC Corp Ltd 'H'	Citibank	83	500	Kerry Properties Ltd	Credit Suisse	208
28.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	JP Morgan	9.645	6.500	Kerry Properties Ltd	Citibank	1.955
(2.000)	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	405	12.500	Kingboard Chemical Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2.665)
12.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	131	41.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3.721)
34.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Credit Suisse	1.561	5.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	Credit Suisse	(48)
54.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Bank of America Merrill Lynch	590	6.000	Kingsoft Corp Ltd	Deutsche Bank	230
2.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	Citibank	(37)	(6.000)	Kunlun Energy Co Ltd	Bank of America	
(1.000)	ENN Energy Holdings Ltd	Citibank	(82)	(8.000)	Kunlun Energy Co Ltd	Merrill Lynch	(98)
(28.000)	Far East Horizon Ltd	Citibank	(704)	4.500	KWG Property Holding Ltd	Citibank	376
4.500	Fosun International Ltd	JP Morgan	354	22.000	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	Citibank	(374)
(30.000)	Fullshare Holdings Ltd	Citibank	(66)	(50.000)	Lenovo Group Ltd	Credit Suisse	722
(47.500)	Fullshare Holdings Ltd	JP Morgan	52	(38.000)	Li & Fung Ltd	Citibank	(1.804)
3.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Credit Suisse	197	500	Link (Reit)	Citibank	1.454
1.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	Deutsche Bank	87	3.500	Link (Reit)	Deutsche Bank	3
(79.000)	GCL-Poly Energy Holdings Ltd	Citibank	777	5.000	Longfor Properties Co Ltd	Deutsche Bank	421
8.000	Geely Automobile Holdings Ltd	JP Morgan	(612)	(5.000)	Luk Fook Holdings International Ltd	Citibank	55
2.000	GF Securities Co Ltd 'H'	Deutsche Bank	(192)			Bank of America Merrill Lynch	(1.394)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Hong Kong suite				Hong Kong suite			
(4.400)	Man Wah Holdings Ltd	Citibank	5	(10.000)	Sunac China Holdings Ltd	Citibank	3.390
(27.200)	Man Wah Holdings Ltd	Bank of America		(6.500)	Swire Pacific Ltd 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(1.279)			Merrill Lynch	(533)
8.000	Melco International Development Ltd	Deutsche Bank	744	(2.400)	Swire Properties Ltd	Bank of America	
(24.400)	MGM China Holdings Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(249)
		Merrill Lynch	534	(3.000)	Swire Properties Ltd	Citibank	(607)
(2.014)	MGM China Holdings Ltd	Citibank	(176)	2.000	Techtronic Industries Co Ltd	Citibank	(416)
(2.000)	Minth Group Ltd	Citibank	219	4.500	Techtronic Industries Co Ltd	JP Morgan	836
(2.000)	Minth Group Ltd	Bank of America		500	Tencent Holdings Ltd	Credit Suisse	470
		Merrill Lynch	525	2.000	Tencent Holdings Ltd	Deutsche Bank	262
(1.183)	Minth Group Ltd	JP Morgan	139	12.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	Bank of America	
(28.000)	MMG Ltd	Citibank	1.010			Merrill Lynch	2.099
(16.000)	MMG Ltd	Deutsche Bank	1.015	4.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	Citibank	647
6.000	MTR Corp Ltd	Deutsche Bank	(1.443)	(28.000)	Value Partners Group Ltd	Citibank	245
(3.200)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	Citibank	210	100	VTech Holdings Ltd	Bank of America	
(1.500)	New China Life Insurance Co Ltd 'H'	JP Morgan	435			Merrill Lynch	(13)
(54.000)	New World Development Co Ltd	Bank of America		2.700	VTech Holdings Ltd	Deutsche Bank	(340)
		Merrill Lynch	(472)	16.000	Want Want China Holdings Ltd	Credit Suisse	1.487
3.000	Nexteer Automotive Group Ltd	Credit Suisse	551	3.000	WH Group Ltd '144A'	Citibank	(210)
3.000	Nexteer Automotive Group Ltd	Deutsche Bank	269	10.500	WH Group Ltd '144A'	JP Morgan	46
1.000	Nexteer Automotive Group Ltd	Citibank	85	(5.000)	Wharf Holdings Ltd/The	Citibank	55
8.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	Credit Suisse	9	(3.000)	Wharf Holdings Ltd/The	Bank of America	
16.000	People's Insurance Co Group of China Ltd/The 'H'	JP Morgan	17			Merrill Lynch	246
(130.000)	PetroChina Co Ltd 'H'	Citibank	(4.833)	(2.000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Bank of America	
(10.000)	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	Bank of America				Merrill Lynch	580
		Merrill Lynch	656	(2.000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	JP Morgan	(601)
5.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	Citibank	(492)	(4.000)	Wheelock & Co Ltd	Citibank	175
500	Power Assets Holdings Ltd	Credit Suisse	(213)	6.400	Wynn Macau Ltd	Credit Suisse	(350)
3.000	Power Assets Holdings Ltd	Citibank	(49)	24.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	Bank of America	
1.500	Power Assets Holdings Ltd	Deutsche Bank	(221)			Merrill Lynch	210
2.000	Power Assets Holdings Ltd	JP Morgan	(853)	1.000	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Credit Suisse	137
400	Sands China Ltd	Citibank	(4)	10.000	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	JP Morgan	1.367
3.200	Sands China Ltd	JP Morgan	359	(3.500)	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Citibank	(38)
(22.500)	Semiconductor Manufacturing International Corp	Citibank	(148)	(1.500)	Zhongsheng Group Holdings Ltd	Deutsche Bank	(230)
(21.000)	Semiconductor Manufacturing International Corp	Deutsche Bank	919	(13.900)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	Bank of America	
(13.000)	Semiconductor Manufacturing International Corp	JP Morgan	114			Merrill Lynch	2.432
9.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Credit Suisse	—	(900)	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H'	Citibank	(103)
5.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Citibank	—				3.142
3.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	Deutsche Bank	(131)	Italie			
37.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	JP Morgan	—	2.886	A2A SpA	Bank of America	
(6.000)	Shangri-La Asia Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(531)
		Merrill Lynch	(564)	26.789	A2A SpA	Credit Suisse	(5.880)
6.500	Shimao Property Holdings Ltd	Deutsche Bank	746	1.817	ACEA SpA	Credit Suisse	(2.053)
36.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	Bank of America		43	ACEA SpA	Citibank	(31)
		Merrill Lynch	1.890	196	ACEA SpA	JP Morgan	(221)
4.000	Sino Land Co Ltd	Deutsche Bank	(61)	1.162	Anima Holding SpA '144A'	Deutsche Bank	(1.466)
(21.500)	Sino-Ocean Group Holding Ltd	Citibank	(47)	1.857	Assicurazioni Generali SpA	Citibank	(1.662)
(2.800)	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Bank of America		(817)	Atlantia SpA	Credit Suisse	2.680
		Merrill Lynch	(123)	4.378	Autogrill SpA	JP Morgan	(2.846)
(4.000)	Sinopharm Group Co Ltd 'H'	Citibank	(175)	1.181	Azimut Holding SpA	Deutsche Bank	(1.632)
4.000	SJM Holdings Ltd	Deutsche Bank	840	633	Banca Generali SpA	Citibank	(1.886)
18.000	SJM Holdings Ltd	JP Morgan	4.448	20	Banca Generali SpA	Deutsche Bank	(110)
(67.500)	SOHO China Ltd	Bank of America		198	Banca Mediolanum SpA	Citibank	(17)
		Merrill Lynch	(812)	(290)	Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	Bank of America	
1.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	JP Morgan	175			Merrill Lynch	317
				(2.462)	Banca Popolare di Sondrio SCPA	Bank of America	
						Merrill Lynch	1.187
				(18.572)	Banco BPM SpA	Deutsche Bank	15.508
				(5.447)	BPER Banca	Citibank	3.366
				(1.929)	BPER Banca	JP Morgan	918

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Italie suite				Italie suite			
2.250	Brembo SpA	Citibank	427	(12.645)	Unipol Gruppo SpA	Credit Suisse	9.066
(326)	Brunello Cucinelli SpA	Deutsche Bank	(1.174)	(18.702)	Unipolsai Assicurazioni Spa	JP Morgan	5.106
538	Buzzi Unicem SpA	Deutsche Bank	(898)	(490)	Yoox Net-A-Porter Group SpA	JP Morgan	(69)
(1.882)	CNH Industrial NV	Citibank	1.835				2.103
(3.910)	Davide Campari-Milano SpA	Credit Suisse	(645)				
225	De' Longhi SpA	Deutsche Bank	(207)				
(126)	DiaSorin SpA	Bank of America					
		Merrill Lynch	(195)	100	77 Bank Ltd/The	Deutsche Bank	(177)
(185)	DiaSorin SpA	Citibank	(120)	(600)	ABC-Mart Inc	Deutsche Bank	2.848
11.813	Enel SpA	Deutsche Bank	(5.434)	(100)	Acom Co Ltd	Citibank	17
2.886	Enel SpA	JP Morgan	(1.662)	200	Advantest Corp	Deutsche Bank	(396)
1.401	ENI SpA	Bank of America		(3.200)	AEON Financial Service		
		Merrill Lynch	(1.447)		Co Ltd	JP Morgan	2.202
1.572	ERG SpA	JP Morgan	(3.836)	(1.000)	Aiful Corp	Citibank	119
226	Fiat Chrysler Automobiles NV	Citibank	17	(7.100)	Aiful Corp	Deutsche Bank	1.516
600	Fiat Chrysler Automobiles NV	Credit Suisse	185	(100)	Ain Holdings Inc	Citibank	(8)
142	FinecoBank Banca			(700)	Ain Holdings Inc	JP Morgan	(1.772)
	Fineco SpA	Citibank	(94)	(600)	Air Water Inc	Credit Suisse	81
3.126	FinecoBank Banca			(100)	Aisin Seiki Co Ltd	JP Morgan	388
	Fineco SpA	Credit Suisse	(4.001)	400	Alfresa Holdings Corp	Bank of America	
24	IMA Industria Macchine					Merrill Lynch	139
	Automatiche SpA	Credit Suisse	(28)	200	Alfresa Holdings Corp	Citibank	(84)
(399)	Infrastrutture Wireless	Bank of America		100	Alfresa Holdings Corp	JP Morgan	227
	Italiane SpA '144A'	Merrill Lynch	241	(1.400)	Alps Electric Co Ltd	Citibank	1.218
(2.573)	Infrastrutture Wireless			(400)	Alps Electric Co Ltd	Deutsche Bank	494
	Italiane SpA '144A'	Deutsche Bank	1.557	(200)	Alps Electric Co Ltd	JP Morgan	(66)
58	Interpump Group SpA	Bank of America		2.500	Amada Holdings Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(73)			Merrill Lynch	(2.828)
27	Interpump Group SpA	Deutsche Bank	(34)	400	Amada Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(383)
(4.917)	Intesa Sanpaolo SpA	Bank of America		600	Amada Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(679)
		Merrill Lynch	3.344	(300)	ANA Holdings Inc	JP Morgan	(361)
20.308	Iren SpA	Bank of America		100	Aoyama Trading Co Ltd	Credit Suisse	(245)
		Merrill Lynch	(6.336)	1.600	Aoyama Trading Co Ltd	Citibank	(3.164)
1.774	Iren SpA	Deutsche Bank	(553)	3.200	Aozora Bank Ltd	JP Morgan	(1.772)
(1.016)	Leonardo SpA	Credit Suisse	1.024	100	Asahi Glass Co Ltd	Citibank	(257)
(902)	Luxottica Group SpA	Bank of America		600	Asahi Glass Co Ltd	JP Morgan	(285)
		Merrill Lynch	(271)	(600)	Asahi Group Holdings Ltd	JP Morgan	(883)
10.361	Mediaset SpA	Bank of America		(1.200)	Asahi Intecc Co Ltd	Citibank	(1.661)
		Merrill Lynch	(5.025)	(500)	Asahi Kasei Corp	Citibank	73
1.495	Mediaset SpA	Citibank	(333)	300	Asics Corp	Credit Suisse	(610)
352	Mediobanca Banca	Bank of America		10.000	Astellas Pharma Inc	Credit Suisse	(158)
	di Credito Finanziario SpA	Merrill Lynch	(687)	2.100	Autobacs Seven Co Ltd	Credit Suisse	(2.774)
1.118	Moncler SpA	Credit Suisse	3.074	200	Autobacs Seven Co Ltd	JP Morgan	(264)
(2.584)	Poste Italiane SpA '144A'	Bank of America		1.200	Azbil Corp	Citibank	(570)
		Merrill Lynch	2.047	(500)	Bank of Kyoto Ltd/The	Credit Suisse	2.571
1.107	Prysmian SpA	Bank of America		(300)	Benesse Holdings Inc	Citibank	190
		Merrill Lynch	(2.679)	1.400	Bridgestone Corp	Credit Suisse	(1.650)
1.163	Recordati SpA	Citibank	(198)	1.000	Bridgestone Corp	Deutsche Bank	(854)
1.822	Societa Iniziative			100	Bridgestone Corp	Citibank	(182)
	Autostradali e Servizi SpA	Credit Suisse	(7.470)	1.700	Brother Industries Ltd	Bank of America	
895	Societa Iniziative					Merrill Lynch	(3.254)
	Autostradali e Servizi SpA	JP Morgan	(3.670)	(300)	Calbee Inc	Citibank	(36)
42.186	Telecom Italia SpA/Milano	JP Morgan	(6.353)	(800)	Calbee Inc	Credit Suisse	(981)
(319)	Tenaris SA	Bank of America		1.000	Canon Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	172			Merrill Lynch	(664)
(3.488)	Tenaris SA	JP Morgan	1.221	700	Canon Inc	Deutsche Bank	(465)
3.270	Terna Rete Elettrica			3.000	Canon Inc	JP Morgan	(1.661)
	Nazionale SpA	Credit Suisse	(1.449)	100	Canon Marketing Japan Inc	Bank of America	
3.136	Terna Rete Elettrica					Merrill Lynch	(105)
	Nazionale SpA	JP Morgan	(1.389)	1.700	Canon Marketing Japan Inc	Deutsche Bank	(1.789)
(26)	Tod's SpA	Credit Suisse	177	1.400	Casio Computer Co Ltd	Citibank	(377)
(520)	Tod's SpA	JP Morgan	3.536	300	Casio Computer Co Ltd	Deutsche Bank	(95)
(98)	UniCredit SpA	Credit Suisse	316	1.000	Central Japan Railway Co	Bank of America	
(3.504)	UniCredit SpA	JP Morgan	11.311			Merrill Lynch	5.300
(5.931)	Unione di Banche	Bank of America		(500)	Chiyoda Corp	Citibank	506
	Italiane SpA	Merrill Lynch	7.182	(4.600)	Chiyoda Corp	JP Morgan	5.822
(650)	Unione di Banche			(400)	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(1.044)
	Italiane SpA	Deutsche Bank	787	6.200	Citizen Watch Co Ltd	Citibank	(3.041)
(193)	Unione di Banche			(400)	Coca-Cola Bottlers Japan		
	Italiane SpA	JP Morgan	167		Holdings Inc	Credit Suisse	190

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Japon suite				Japon suite			
(1.000)	Coca-Cola Bottlers Japan Inc	Deutsche Bank	(1.345)	(300)	H2O Retailing Corp	Deutsche Bank	852
400	COMSYS Holdings Corp	Citibank	(28)	(500)	Hachijuni Bank Ltd/The	Citibank	186
100	COMSYS Holdings Corp	JP Morgan	(17)	200	Hakuhodo DY Holdings Inc	Bank of America	
(600)	Concordia Financial Group Ltd	Credit Suisse	47			Merrill Lynch	22
1.100	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(305)	(800)	Hamamatsu Photonics KK	Citibank	(570)
(200)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Deutsche Bank	2.310	100	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Citibank	79
1.000	Credit Saison Co Ltd	Bank of America		(400)	Harmonic Drive Systems Inc	Citibank	1.899
		Merrill Lynch	(1.139)	(1.000)	Harmonic Drive Systems Inc	Deutsche Bank	1.187
100	Credit Saison Co Ltd	Credit Suisse	(119)	500	Haseko Corp	Bank of America	
1.100	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	(166)
		Merrill Lynch	(557)	100	Haseko Corp	Citibank	(6)
(1.700)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Deutsche Bank	2.246	3.000	Haseko Corp	Deutsche Bank	(997)
2.000	Daicel Corp	Citibank	(1.028)	(700)	Heiwa Corp	Deutsche Bank	(399)
(200)	Daido Steel Co Ltd	Credit Suisse	1.282	(300)	Heiwa Corp	JP Morgan	(465)
(800)	Daifuku Co Ltd	JP Morgan	2.152	100	Hikari Tsushin Inc	JP Morgan	1.456
800	Daiichi Sankyo Co Ltd	JP Morgan	(3.183)	(200)	Hiroshima Bank Ltd/The	Deutsche Bank	98
900	Daiichikoshu Co Ltd	Citibank	(1.210)	(800)	Hiroshima Bank Ltd/The	JP Morgan	342
100	Daishi Bank Ltd/The	JP Morgan	(233)	200	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Credit Suisse	253
3.000	Daiwa Securities Group Inc	Bank of America		100	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	JP Morgan	127
		Merrill Lynch	(845)	(200)	Hitachi Capital Corp	Deutsche Bank	261
(2.900)	DeNA Co Ltd	Deutsche Bank	1.698	(200)	Hitachi Chemical Co Ltd	Credit Suisse	21
300	Denka Co Ltd	Bank of America		(100)	Hitachi Chemical Co Ltd	JP Morgan	10
		Merrill Lynch	(878)	(100)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Deutsche Bank	87
900	Denka Co Ltd	Deutsche Bank	(2.634)	6.000	Hitachi Ltd	JP Morgan	(2.914)
100	Denso Corp	JP Morgan	(243)	(1.900)	Hitachi Metals Ltd	Deutsche Bank	2.495
200	Denso Corp	Bank of America		(600)	Hitachi Metals Ltd	JP Morgan	441
(900)	Dentsu Inc	Merrill Lynch	(688)	(100)	Hitachi Transport System Ltd	JP Morgan	190
200	DIC Corp	Credit Suisse	427	(100)	Hokuhoku Financial Group Inc	JP Morgan	45
		Bank of America	(324)	(400)	Honda Motor Co Ltd	Citibank	778
300	DMG Mori Co Ltd	Bank of America		200	Hoshizaki Corp	JP Morgan	1.187
		Merrill Lynch	(740)	(100)	House Foods Group Inc	JP Morgan	(127)
1.500	DMG Mori Co Ltd	Deutsche Bank	(3.702)	1.800	Hoya Corp	JP Morgan	9.241
100	DMG Mori Co Ltd	JP Morgan	(218)	(300)	Ibiden Co Ltd	Credit Suisse	(64)
(1.100)	Don Quijote Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(783)	(200)	Ibiden Co Ltd	JP Morgan	(43)
100	Dowa Holdings Co Ltd	Bank of America		(700)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Citibank	2.298
		Merrill Lynch	(316)	(500)	IHI Corp	Deutsche Bank	(574)
600	East Japan Railway Co	Citibank	261	(6.400)	Iida Group Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	608
(800)	Ebara Corp	Citibank	2.278	(600)	Inpex Corp	Citibank	712
(100)	Eisai Co Ltd	Credit Suisse	(373)	(3.300)	Inpex Corp	JP Morgan	4.542
600	Ezaki Glico Co Ltd	JP Morgan	(712)	(2.500)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Deutsche Bank	356
(700)	FamilyMart UNY Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(277)	300	Ito En Ltd	Bank of America	
(100)	FANUC Corp	Deutsche Bank	435			Merrill Lynch	166
100	Fast Retailing Co Ltd	Deutsche Bank	(1.012)	1.200	Ito En Ltd	Citibank	807
(500)	FP Corp	Citibank	198	3.200	ITOCHU Corp	Citibank	(2.493)
(700)	Fuji Oil Holdings Inc	Credit Suisse	(2.824)	600	Itochu Techno-Solutions Corp	Credit Suisse	(294)
1.200	FUJIFILM Holdings Corp	Bank of America		400	Itochu Techno-Solutions Corp	Citibank	(203)
		Merrill Lynch	(664)	(800)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Credit Suisse	(190)
100	FUJIFILM Holdings Corp	Credit Suisse	(32)	(2.900)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	JP Morgan	(688)
700	Fujikura Ltd	Bank of America		(200)	Iyo Bank Ltd/The	Deutsche Bank	142
		Merrill Lynch	(266)	(1.000)	Iyo Bank Ltd/The	JP Morgan	815
4.800	Fujikura Ltd	Deutsche Bank	(1.823)	600	Izumi Co Ltd	Credit Suisse	(1.471)
9.000	Fujitsu Ltd	Credit Suisse	(1.346)	(800)	J Front Retailing Co Ltd	JP Morgan	386
1.000	Fujitsu Ltd	Citibank	(239)	200	Jafco Co Ltd	Credit Suisse	(348)
(4.000)	Fukuoka Financial Group Inc	Citibank	728	1.200	Jafco Co Ltd	JP Morgan	(2.088)
(300)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Bank of America		400	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(71)			Merrill Lynch	506
(100)	Furukawa Electric Co Ltd	Credit Suisse	910	1.800	Japan Airlines Co Ltd	Credit Suisse	1.253
(100)	Furukawa Electric Co Ltd	Deutsche Bank	601	(1.700)	Japan Exchange Group Inc	JP Morgan	(377)
900	Glory Ltd	Citibank	(1.246)	(1.400)	Japan Post Bank Co Ltd	JP Morgan	1.816
(693)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America		(700)	Japan Post Holdings Co Ltd	Citibank	166
		Merrill Lynch	(3.015)	(400)	Japan Post Holdings Co Ltd	JP Morgan	294
4.000	GS Yuasa Corp	Citibank	(1.582)	(3.600)	JGC Corp	Deutsche Bank	7.205
24.200	GungHo Online Entertainment Inc	Deutsche Bank	(957)	200	JTEKT Corp	Bank of America	
2.000	Gunma Bank Ltd/The	Credit Suisse	(316)			Merrill Lynch	(256)
				400	JTEKT Corp	Citibank	(658)
				(700)	JXTG Holdings Inc	Deutsche Bank	94

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Japon suite				Japon suite			
(5.600)	JXTG Holdings Inc	JP Morgan	195	2.300	Kyushu Railway Co	Bank of America	
3.000	K's Holdings Corp	Deutsche Bank	(1.258)		Merrill Lynch		637
300	Kagome Co Ltd	Citibank	71	600	Lawson Inc	Bank of America	
600	Kagome Co Ltd	Credit Suisse	–		Merrill Lynch		(427)
100	Kagome Co Ltd	JP Morgan	–	200	Lawson Inc	Citibank	(111)
1.000	Kajima Corp	Credit Suisse	(1.107)	(1.100)	LINE Corp	Bank of America	
8.000	Kajima Corp	JP Morgan	(8.860)		Merrill Lynch		1.044
2.900	Kakaku.com Inc	Bank of America		(2.600)	LINE Corp	Credit Suisse	1.543
		Merrill Lynch	4.221	800	Lintec Corp	Citibank	(791)
800	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America		100	Lintec Corp	Deutsche Bank	(138)
		Merrill Lynch	(2.215)	100	Lixil Group Corp	Bank of America	
100	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(309)		Merrill Lynch		(138)
1.000	Kamigumi Co Ltd	Bank of America		900	Lixil Group Corp	Credit Suisse	(876)
		Merrill Lynch	(752)	(1.800)	M3 Inc	Credit Suisse	(4.912)
1.000	Kaneka Corp	Citibank	(182)	(100)	M3 Inc	Citibank	(12)
(500)	Kansai Paint Co Ltd	Credit Suisse	344	400	Mabuchi Motor Co Ltd	Bank of America	
(3.300)	Kansai Paint Co Ltd	Citibank	2.402		Merrill Lynch		(1.139)
300	Kao Corp	Citibank	883	(400)	Makita Corp	Credit Suisse	237
900	Kao Corp	Deutsche Bank	4.713	11.400	Marubeni Corp	JP Morgan	(1.028)
(100)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Bank of America		(100)	Marui Group Co Ltd	Credit Suisse	25
		Merrill Lynch	194	(300)	Marui Group Co Ltd	JP Morgan	76
(3.500)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Credit Suisse	5.399	(500)	Marui Group Co Ltd	Deutsche Bank	340
300	KDDI Corp	JP Morgan	95	500	Maruichi Steel Tube Ltd	JP Morgan	(376)
(900)	Keihan Holdings Co Ltd	Citibank	392	4.400	Matsui Securities Co Ltd	Bank of America	
(100)	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America			Merrill Lynch		(731)
		Merrill Lynch	4	800	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Bank of America	
(400)	Keikyu Corp	Credit Suisse	443		Merrill Lynch		(2.215)
(1.100)	Keikyu Corp	Deutsche Bank	400	(26.100)	Mebuki Financial Group Inc	Credit Suisse	5.368
(300)	Keikyu Corp	JP Morgan	332	(2.000)	Mebuki Financial Group Inc	Citibank	427
(500)	Keio Corp	Credit Suisse	(692)	300	Medipal Holdings Corp	Credit Suisse	396
(1.000)	Keisei Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	(1.107)	200	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Credit Suisse	(229)
(400)	Kewpie Corp	JP Morgan	6	400	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Citibank	(79)
(200)	Keyence Corp	Credit Suisse	285	200	MEIJI Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	206
300	Kikkoman Corp	Credit Suisse	654	1.200	Miraca Holdings Inc	Citibank	(997)
400	Kikkoman Corp	Deutsche Bank	222	100	Miraca Holdings Inc	Credit Suisse	(566)
500	Kinden Corp	Bank of America		(1.100)	MISUMI Group Inc	JP Morgan	(348)
		Merrill Lynch	(305)	1.500	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Bank of America	
300	Kinden Corp	Citibank	(107)		Merrill Lynch		(42)
4.000	Kinden Corp	JP Morgan	(3.006)	7.200	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Credit Suisse	(1.025)
(500)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(455)	300	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JP Morgan	(43)
1.300	Kirin Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	1.831	400	Mitsubishi Corp	Citibank	(585)
300	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America		200	Mitsubishi Corp	Deutsche Bank	(247)
		Merrill Lynch	(408)	1.800	Mitsubishi Electric Corp	Credit Suisse	(1.225)
100	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(116)	300	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America	
100	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(73)		Merrill Lynch		(168)
(300)	Kobe Steel Ltd	JP Morgan	183	500	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Citibank	(609)
(900)	Kobe Steel Ltd	Bank of America		(900)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	(71)
		Merrill Lynch	648	(200)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Deutsche Bank	115
100	Koito Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	372	(500)	Mitsubishi Logistics Corp	Credit Suisse	712
(100)	Komatsu Ltd	Citibank	166	(1.800)	Mitsubishi Logistics Corp	Deutsche Bank	3.175
(700)	Komatsu Ltd	Deutsche Bank	598	1.000	Mitsubishi Materials Corp	Deutsche Bank	(1.147)
500	Komeri Co Ltd	Credit Suisse	(819)	(1.200)	Mitsubishi Motors Corp	Credit Suisse	(294)
100	Komeri Co Ltd	Citibank	(112)	(13.700)	Mitsubishi Motors Corp	JP Morgan	(3.360)
100	Konami Holdings Corp	Citibank	(269)	1.300	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	Citibank	(216)
400	Konami Holdings Corp	Credit Suisse	(1.139)	(500)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Credit Suisse	234
4.000	Konica Minolta Inc	JP Morgan	1.487	(3.300)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Citibank	1.639
(2.600)	Kubota Corp	Deutsche Bank	1.933	(1.400)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Credit Suisse	853
2.700	Kuraray Co Ltd	Credit Suisse	(2.478)	2.200	Mitsui & Co Ltd	Citibank	(1.558)
100	Kuraray Co Ltd	JP Morgan	(92)	800	Mitsui Chemicals Inc	Credit Suisse	–
100	Kurita Water Industries Ltd	Credit Suisse	(198)	(100)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Citibank	435
1.500	Kurita Water Industries Ltd	JP Morgan	(2.966)				
(200)	Kyocera Corp	Citibank	505				
(600)	Kyocera Corp	JP Morgan	1.134				
200	Kyowa Exeo Corp	Citibank	(112)				
(800)	Kyowa Hakko Kirin Co Ltd	Deutsche Bank	(108)				
(800)	Kyudenko Corp	JP Morgan	(506)				
(3.200)	Kyushu Financial Group Inc	Credit Suisse	532				

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Japon suite				Japon suite			
(1.000)	Mitsui OSK Lines Ltd	Credit Suisse	3.417	7.300	Nissan Motor Co Ltd	Bank of America	
(300)	Miura Co Ltd	JP Morgan	767			Merrill Lynch	(2.599)
1.800	Mixi Inc	Citibank	(6.479)	(100)	Nissan Shatai Co Ltd	Citibank	45
100	Mixi Inc	Deutsche Bank	(194)	(100)	Nissan Shatai Co Ltd	Bank of America	
300	Mixi Inc	JP Morgan	(795)			Merrill Lynch	84
(35.400)	Mizuho Financial Group Inc	Credit Suisse	2.380	(1.700)	Nissan Shatai Co Ltd	Deutsche Bank	1.425
200	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(63)	(200)	Nisshin Seifun Group Inc	JP Morgan	187
(1.800)	MonotaRO Co Ltd	Deutsche Bank	(570)	400	Nisshinbo Holdings Inc	Bank of America	
(100)	MonotaRO Co Ltd	Credit Suisse	(174)			Merrill Lynch	(490)
(100)	MonotaRO Co Ltd	JP Morgan	(174)	100	Nisshinbo Holdings Inc	Credit Suisse	(211)
200	Morinaga & Co Ltd/Japan	Credit Suisse	237	200	Nisshinbo Holdings Inc	Deutsche Bank	(245)
1.800	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America		(200)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	222
		Merrill Lynch	(4.129)	(400)	Nitori Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(380)
(900)	Murata Manufacturing Co Ltd	Citibank	249	(100)	Nitto Denko Corp	Deutsche Bank	(22)
(100)	Murata Manufacturing Co Ltd	Deutsche Bank	(277)	(500)	NOK Corp	Citibank	906
200	Nagase & Co Ltd	Bank of America		(1.700)	Nomura Holdings Inc	Citibank	596
		Merrill Lynch	(250)	(600)	Nomura Holdings Inc	Credit Suisse	201
300	Nagoya Railroad Co Ltd	Deutsche Bank	45	400	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America	
(400)	Nankai Electric Railway Co Ltd	Citibank	95			Merrill Lynch	(570)
(100)	Nankai Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	(8)	(600)	NS Solutions Corp	Citibank	271
(3.600)	Nexon Co Ltd	Credit Suisse	(4.784)	(400)	NSK Ltd	Citibank	627
(300)	NGK Insulators Ltd	Deutsche Bank	206	2.200	NTN Corp	Citibank	(1.131)
(500)	NH Foods Ltd	Credit Suisse	1.167	800	NTN Corp	Deutsche Bank	(171)
200	NHK Spring Co Ltd	Citibank	(188)	900	NTT DOCOMO Inc	JP Morgan	117
4.300	NHK Spring Co Ltd	Deutsche Bank	(2.959)	300	Obayashi Corp	Credit Suisse	(325)
100	Nichirei Corp	Citibank	28	4.000	Obayashi Corp	Deutsche Bank	(4.177)
700	Nichirei Corp	Deutsche Bank	(548)	(100)	Obic Co Ltd	Deutsche Bank	(269)
(600)	Nidec Corp	JP Morgan	(664)	(100)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Credit Suisse	2
(200)	Nifco Inc/Japan	JP Morgan	206	(2.000)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	47
900	Nihon Kohden Corp	Bank of America				Credit Suisse	(3.876)
		Merrill Lynch	484	10.000	Oji Holdings Corp	Deutsche Bank	(498)
(1.000)	Nihon M&A Center Inc	Credit Suisse	(2.136)	100	OKUMA Corp	Credit Suisse	138
300	Nikon Corp	Credit Suisse	(356)	(100)	Olympus Corp	Deutsche Bank	24
300	Nikon Corp	Citibank	(216)	(100)	Olympus Corp	JP Morgan	(229)
1.900	Nikon Corp	Deutsche Bank	(1.202)	600	Omron Corp	Citibank	(2.231)
(100)	Nintendo Co Ltd	Deutsche Bank	791	(700)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	426
(100)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Deutsche Bank	169	(100)	Open House Co Ltd	JP Morgan	(625)
(700)	Nippon Electric Glass Co Ltd	JP Morgan	1.124	200	Oracle Corp Japan	Bank of America	
600	Nippon Express Co Ltd	Citibank	142			Merrill Lynch	(1.139)
400	Nippon Kayaku Co Ltd	Credit Suisse	(516)	(5.500)	Orient Corp	Citibank	348
600	Nippon Kayaku Co Ltd	JP Morgan	(774)	(200)	Oriental Land Co Ltd/Japan	JP Morgan	522
(200)	Nippon Kayaku Co Ltd	Bank of America		1.600	ORIX Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	168			Merrill Lynch	(1.823)
(2.000)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(949)	100	ORIX Corp	Deutsche Bank	(114)
2.000	Nippon Paper Industries Co Ltd	Deutsche Bank	(3.069)	(100)	OSG Corp	Citibank	228
(300)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Credit Suisse	(356)	1.600	Otsuka Corp	Bank of America	
(200)	Nippon Shokubai Co Ltd	Deutsche Bank	(1.187)			Merrill Lynch	1.076
(200)	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	Deutsche Bank	355	(600)	Otsuka Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(712)
(500)	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	Credit Suisse	625	3.000	Panasonic Corp	Citibank	(1.804)
700	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Credit Suisse	(986)	(1.300)	Park24 Co Ltd	Credit Suisse	2.386
(1.900)	Nippon Yusen KK	Credit Suisse	3.081	(600)	Park24 Co Ltd	Citibank	460
(300)	Nippon Yusen KK	Deutsche Bank	598	(1.700)	PeptiDream Inc	Citibank	67
(200)	Nippon Yusen KK	JP Morgan	324	(300)	Persol Holdings Co Ltd	Citibank	301
(1.600)	Nipro Corp	Credit Suisse	2.772	(200)	Persol Holdings Co Ltd	JP Morgan	528
600	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Bank of America		(300)	Pigeon Corp	Deutsche Bank	(427)
		Merrill Lynch	(608)	900	Pola Orbis Holdings Inc	Credit Suisse	2.563
300	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Credit Suisse	(104)	(700)	Rakuten Inc	Credit Suisse	455
6.200	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	JP Morgan	(2.158)	(9.700)	Rakuten Inc	Deutsche Bank	3.829
(500)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Deutsche Bank	633	500	Recruit Holdings Co Ltd	Bank of America	
400	Nissan Chemical Industries Ltd	Bank of America				Merrill Lynch	1.127
		Merrill Lynch	601	2.300	Recruit Holdings Co Ltd	Credit Suisse	7.141
				(600)	Renesas Electronics Corp	Credit Suisse	(52)
				(7.600)	Renesas Electronics Corp	Deutsche Bank	(1.924)
				(3.200)	Resona Holdings Inc	JP Morgan	114
				(2.300)	Resorttrust Inc	Citibank	2.238
				(800)	Ricoh Co Ltd	Credit Suisse	367

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Japon suite				Japon suite			
(1.400)	Ricoh Co Ltd	Citibank	565	400	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Credit Suisse	946
(100)	Rinnai Corp	Credit Suisse	411	1.700	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	JP Morgan	4.021
100	Rohm Co Ltd	Deutsche Bank	(451)	(1.000)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Citibank	1.345
600	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(356)	(300)	Sumitomo Forestry Co Ltd	Credit Suisse	434
300	Sankyo Co Ltd	Deutsche Bank	36	500	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Bank of America	(1.503)
400	Sankyu Inc	Bank of America		200	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	(309)
		Merrill Lynch	443	200	Sumitomo Heavy Industries Ltd	JP Morgan	(309)
500	Sanwa Holdings Corp	Bank of America		(1.200)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Deutsche Bank	4.006
		Merrill Lynch	(570)	(700)	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Deutsche Bank	803
100	Sanwa Holdings Corp	Citibank	(66)	(1.100)	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Credit Suisse	879
4.100	Sanwa Holdings Corp	JP Morgan	(6.908)	1.200	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Bank of America	(1.139)
400	Sapporo Holdings Ltd	Bank of America		100	Sundrug Co Ltd	Citibank	(324)
		Merrill Lynch	(576)	700	Sundrug Co Ltd	Deutsche Bank	(3.433)
(1.400)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	(388)	(200)	Suntory Beverage & Food Ltd	JP Morgan	854
(1.700)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	3.429	300	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Bank of America	(285)
(300)	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Deutsche Bank	(356)	200	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Credit Suisse	285
(200)	SBI Holdings Inc/Japan	Deutsche Bank	(24)	800	Suzuken Co Ltd/Aichi Japan	Citibank	(1.329)
100	SCREEN Holdings Co Ltd	Citibank	(150)	1.500	Suzuki Motor Corp	Credit Suisse	5.138
(1.000)	SCSK Corp	Credit Suisse	(514)	(600)	Sysmex Corp	Citibank	1.282
600	Secom Co Ltd	Credit Suisse	(973)	700	T&D Holdings Inc	Citibank	(861)
1.000	Sega Sammy Holdings Inc	Deutsche Bank	222	(200)	Taiheiyo Cement Corp	JP Morgan	63
(900)	Seibu Holdings Inc	Citibank	135	200	Taisei Corp	Bank of America	(253)
2.300	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America		100	Taisei Corp	Citibank	(119)
		Merrill Lynch	2.656	1.200	Taisei Corp	Deutsche Bank	(1.519)
600	Seino Holdings Co Ltd	Citibank	95	400	Taisei Corp	JP Morgan	285
3.000	Sekisui Chemical Co Ltd	Deutsche Bank	(1.282)	500	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Credit Suisse	3.481
600	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	(285)	(2.800)	Taiyo Nippon Sanso Corp	Credit Suisse	1.462
(500)	Sekisui House Ltd	Credit Suisse	269	(1.800)	Takara Bio Inc	Credit Suisse	(4.557)
100	Seria Co Ltd	Deutsche Bank	(71)	(800)	Takara Holdings Inc	JP Morgan	165
1.100	Seven & i Holdings Co Ltd	Credit Suisse	183	(100)	TDK Corp	Deutsche Bank	309
(2.300)	Seven Bank Ltd	Credit Suisse	528	(200)	TDK Corp	Credit Suisse	(63)
200	Shimamura Co Ltd	Credit Suisse	(2.373)	(300)	TDK Corp	JP Morgan	(95)
(300)	Shimano Inc	JP Morgan	(1.471)	3.500	Teijin Ltd	Citibank	(2.907)
3.700	Shimizu Corp	Citibank	(1.200)	(200)	Tobu Railway Co Ltd	Citibank	16
(300)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Credit Suisse	475	(200)	Toho Co Ltd/Tokyo	Credit Suisse	158
(100)	Shinsei Bank Ltd	Credit Suisse	(12)	(1.100)	Tokai Carbon Co Ltd	JP Morgan	(6.274)
(1.800)	Shinsei Bank Ltd	JP Morgan	(214)	7.800	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Deutsche Bank	(2.838)
900	Shionogi & Co Ltd	Deutsche Bank	(64)	1.000	Tokio Marine Holdings Inc	Deutsche Bank	(451)
300	Shionogi & Co Ltd	Credit Suisse	69	(1.700)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Deutsche Bank	2.501
100	Shionogi & Co Ltd	JP Morgan	23	(300)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	JP Morgan	190
600	Shiseido Co Ltd	Deutsche Bank	2.497	(100)	Tokyo Century Corp	Credit Suisse	340
3.000	Shizuoka Bank Ltd/The	Bank of America		(900)	Tokyu Corp	Credit Suisse	(612)
		Merrill Lynch	(1.780)	1.000	Toppa Printing Co Ltd	Deutsche Bank	(229)
5.700	Showa Shell Sekiyu KK	JP Morgan	(5.546)	(500)	Toray Industries Inc	Citibank	200
(1.100)	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	Deutsche Bank	209	(4.800)	Toray Industries Inc	Deutsche Bank	2.199
(300)	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	JP Morgan	26	(300)	Toray Industries Inc	JP Morgan	267
6.600	Skylark Co Ltd	JP Morgan	1.357	(11.000)	Toshiba Corp	Bank of America	(609)
(100)	SMC Corp/Japan	Deutsche Bank	720			Merrill Lynch	(234)
(200)	SoftBank Group Corp	Citibank	1.082	(13.000)	Toshiba Corp	Credit Suisse	(1.367)
(100)	SoftBank Group Corp	Deutsche Bank	644	(4.000)	Toshiba Corp	JP Morgan	(380)
(200)	Sohgo Security Services Co Ltd		815	400	Tosoh Corp	Bank of America	
(21.600)	Sojitz Corp	Bank of America		200	Tosoh Corp	Merrill Lynch	(123)
		Merrill Lynch	5.980	300	Tosoh Corp	JP Morgan	10
1.100	Sompo Holdings Inc	Deutsche Bank	35				
200	Sony Corp	Deutsche Bank	(176)				
(500)	Sony Financial Holdings Inc	JP Morgan	178				
600	Sotetsu Holdings Inc	Citibank	(190)				
1.500	Square Enix Holdings Co Ltd	Citibank	3.204				
(200)	Stanley Electric Co Ltd	JP Morgan	364				
(400)	Start Today Co Ltd	Credit Suisse	(981)				
(100)	Start Today Co Ltd	Citibank	47				
(300)	Start Today Co Ltd	Deutsche Bank	47				
1.000	Subaru Corp	Citibank	(1.978)				
300	Sugi Holdings Co Ltd	Citibank	(71)				
(2.000)	Sumco Corp	JP Morgan	301				
1.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Deutsche Bank	47				
4.000	Sumitomo Chemical Co Ltd	JP Morgan	664				
3.300	Sumitomo Corp	Bank of America					
		Merrill Lynch	(2.963)				

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Japon suite				Pays-Bas suite			
500	TOTO Ltd	Citibank	(435)	(205)	Akzo Nobel NV	Citibank	(18)
100	TOTO Ltd	Deutsche Bank	(190)	(6.374)	Altice NV (Right)	JP Morgan	(37.428)
100	TOTO Ltd	JP Morgan	–	(6.374)	Altice NV 'A'	JP Morgan	29.480
(600)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Credit Suisse	(574)	824	Aperam SA	Bank of America	
(700)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Citibank	150	946	Aperam SA	Merrill Lynch	(478)
200	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Citibank	(87)	92	ArcelorMittal	Credit Suisse	(611)
800	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Deutsche Bank	(664)			Bank of America	
200	Toyo Suisan Kaisha Ltd	JP Morgan	(664)	142	ArcelorMittal	Merrill Lynch	(219)
(700)	Toyo Tire & Rubber Co Ltd	Credit Suisse	390	373	ASM International NV	Credit Suisse	(189)
(300)	Toyo Tire & Rubber Co Ltd	Citibank	373			Bank of America	
300	Toyobo Co Ltd	Citibank	(415)	(377)	ASML Holding NV	Merrill Lynch	(802)
500	Toyoda Gosei Co Ltd	JP Morgan	(146)			Bank of America	
1.700	Toyota Boshoku Corp	JP Morgan	(2.031)	1.700	ASR Nederland NV	Merrill Lynch	(358)
(200)	Toyota Industries Corp	Credit Suisse	570	1.822	BE Semiconductor Industries NV	Citibank	(4.590)
(1.600)	Toyota Industries Corp	Citibank	8.733			Deutsche Bank	(5.174)
900	Toyota Motor Corp	Deutsche Bank	(4.222)	(3.112)	Boskalis Westminster	Bank of America	
200	Toyota Tsusho Corp	Credit Suisse	(475)			Merrill Lynch	373
100	TS Tech Co Ltd	Bank of America	(222)	(127)	Boskalis Westminster	Citibank	44
		Merrill Lynch	(222)	(652)	Galapagos NV	JP Morgan	(6.024)
300	TS Tech Co Ltd	Deutsche Bank	(664)	(31)	Heineken NV	Citibank	(17)
200	TS Tech Co Ltd	JP Morgan	47	(63)	Heineken NV	Bank of America	
(1.000)	Tsumura & Co	Credit Suisse	277			Merrill Lynch	55
(300)	Tsuruha Holdings Inc	Credit Suisse	(237)	(109)	Heineken NV	Credit Suisse	155
(900)	TV Asahi Holdings Corp	Credit Suisse	1.609	(46)	IMCD Group NV	JP Morgan	(85)
700	Ube Industries Ltd	Credit Suisse	(997)	(868)	IMCD NV	Citibank	955
300	Ulvac Inc	Citibank	(1.246)	(42)	IMCD NV	Deutsche Bank	27
300	Ulvac Inc	Deutsche Bank	(2.029)	2.367	ING Groep NV	Deutsche Bank	(2.201)
(1.200)	Unicharm Corp	Credit Suisse	(3.019)	810	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America	
(1.800)	Universal Entertainment Corp	JP Morgan	(3.417)			Merrill Lynch	(71)
(300)	Ushio Inc	Deutsche Bank	370	315	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Credit Suisse	75
(2.300)	USS Co Ltd	Citibank	3.202	703	Koninklijke Ahold Delhaize NV	JP Morgan	167
(100)	USS Co Ltd	JP Morgan	246	146	Koninklijke DSM NV	Citibank	(403)
(200)	Welcia Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(237)	353	Koninklijke DSM NV	JP Morgan	21
(1.000)	Welcia Holdings Co Ltd	JP Morgan	(1.187)	2.146	Koninklijke Philips NV	Deutsche Bank	429
200	West Japan Railway Co	Credit Suisse	(381)	(1.961)	Koninklijke Vopak NV	Credit Suisse	(1.686)
100	West Japan Railway Co	JP Morgan	(191)	(57)	Koninklijke Vopak NV	JP Morgan	(49)
(2.800)	Yahoo Japan Corp	Citibank	89	1.045	NN Group NV	Citibank	(2.707)
(500)	Yakult Honsha Co Ltd	Citibank	949	(121)	OCI NV	Credit Suisse	(312)
4.000	Yamaguchi Financial Group Inc	Credit Suisse	(2.120)	(2.109)	OCI NV	Deutsche Bank	422
(300)	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	534	(308)	OCI NV	JP Morgan	(795)
(1.200)	Yamato Holdings Co Ltd	Citibank	218	3.081	Philips Lighting NV '144A'	Credit Suisse	(5.669)
(300)	Yamato Holdings Co Ltd	Deutsche Bank	(342)	12.040	PostNL NV	Citibank	(2.492)
(200)	Yamato Holdings Co Ltd	JP Morgan	(138)	3.077	PostNL NV	Deutsche Bank	(314)
200	Yamazaki Baking Co Ltd	Credit Suisse	51	1.696	PostNL NV	JP Morgan	(382)
200	Yamazaki Baking Co Ltd	Citibank	134	496	Randstad NV	Bank of America	
2.300	Yamazaki Baking Co Ltd	Deutsche Bank	418			Merrill Lynch	(1.061)
(700)	Yaskawa Electric Corp	Credit Suisse	609	430	Randstad NV	Citibank	(1.204)
600	Yokogawa Electric Corp	Bank of America		94	Randstad NV	Deutsche Bank	(201)
		Merrill Lynch	(460)	586	SBM Offshore NV	Citibank	(612)
700	Yokogawa Electric Corp	JP Morgan	(2.121)	(385)	TomTom NV	Bank of America	
600	Yokohama Rubber Co Ltd/The	Deutsche Bank	(973)			Merrill Lynch	82
(100)	Zenkoku Hosho Co Ltd	Citibank	(103)	(3.934)	TomTom NV	Credit Suisse	(87)
1.400	Zensho Holdings Co Ltd	Bank of America		108	Unibail-Rodamco SE (Reit)	Credit Suisse	(707)
		Merrill Lynch	(210)	(118)	Unilever NV - CVA	Bank of America	
2.200	Zeon Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(86)
		Merrill Lynch	(348)	(135)	Unilever NV - CVA	Deutsche Bank	(98)
400	Zeon Corp	Deutsche Bank	(63)	(74)	Unilever NV - CVA	JP Morgan	(88)
			(42.955)	1.013	Wolters Kluwer NV	Bank of America	
						Merrill Lynch	1.438
				24	Wolters Kluwer NV	JP Morgan	51
							(43.660)
Pays-Bas				Norvège			
504	Aalberts Industries NV	Bank of America		(567)	Aker ASA 'A'	JP Morgan	(1.902)
		Merrill Lynch	151	(1.089)	Gjensidige Forsikring ASA	JP Morgan	125
362	Aalberts Industries NV	Citibank	(253)	3.559	Leroy Seafood Group ASA	Credit Suisse	(3.014)
(180)	Akzo Nobel NV	Bank of America		557	Leroy Seafood Group ASA	Citibank	(86)
		Merrill Lynch	(114)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Norvège suite				Singapour suite			
(466)	Marine Harvest ASA	Bank of America		1.200	Keppel Corp Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	244			Merrill Lynch	(392)
5.456	Orkla ASA	Deutsche Bank	229	2.800	Keppel Corp Ltd	Deutsche Bank	(915)
73	Salmar ASA	Bank of America		1.300	Keppel Corp Ltd	JP Morgan	(267)
		Merrill Lynch	(165)	18.000	Mapletree Commercial		
856	Salmar ASA	Deutsche Bank	(1.938)		Trust (Reit)	Citibank	(231)
(620)	Schibsted ASA 'B'	Citibank	390	79.700	Mapletree Industrial		
(28)	Schibsted ASA 'B'	Deutsche Bank	—		Trust (Reit)	Citibank	511
1.995	Statoil ASA	JP Morgan	1.338	4.400	Mapletree Industrial		
1.313	Subsea 7 SA	Bank of America			Trust (Reit)	JP Morgan	—
		Merrill Lynch	468	800	Mapletree Logistics		
5.299	Subsea 7 SA	JP Morgan	7.165		Trust (Reit)	Citibank	5
584	Subsea 7 SA	Citibank	(355)	22.100	Mapletree Logistics		
2.009	Telenor ASA	Citibank	(516)		Trust (Reit)	Deutsche Bank	—
187	TGS Nopec Geophysical			5.400	Oversea-Chinese Banking		
	Co ASA	Citibank	(106)		Corp Ltd	Deutsche Bank	(1.799)
2.580	TGS Nopec Geophysical			23.900	SATS Ltd	Bank of America	
	Co ASA	JP Morgan	3.326			Merrill Lynch	(6.126)
(1.756)	Wallenius Wilhelmsen			3.100	SATS Ltd	Credit Suisse	(675)
	Logistics	Deutsche Bank	534	1.600	SATS Ltd	JP Morgan	(349)
(374)	Yara International ASA	Bank of America		(31.500)	Sembcorp Industries Ltd	Deutsche Bank	3.229
		Merrill Lynch	243	(8.000)	Sembcorp Industries Ltd	JP Morgan	666
(197)	Yara International ASA	Citibank	(4)	11.600	Singapore Airlines Ltd	Credit Suisse	966
(580)	Yara International ASA	Deutsche Bank	377	100	Singapore Airlines Ltd	JP Morgan	8
(447)	Yara International ASA	JP Morgan	379	(23.300)	Singapore Post Ltd	Bank of America	
			6.732			Merrill Lynch	448
				(3.200)	Singapore Post Ltd	JP Morgan	—
				(3.100)	Singapore Press Holdings Ltd	Citibank	199
Portugal				29.100	Singapore Technologies		
(125.282)	Banco Comercial Portugues				Engineering Ltd	Citibank	186
	SA 'R'	Credit Suisse	4.786	1.300	Singapore Technologies		
(1.601)	Galp Energia SGPS SA	Credit Suisse	608		Engineering Ltd	JP Morgan	17
1.627	Jeronimo Martins SGPS SA	Bank of America		(55.500)	Singapore		
		Merrill Lynch	(464)		Telecommunications Ltd	Bank of America	16.968
709	Jeronimo Martins SGPS SA	Credit Suisse	(3)	10.600	Singapore	Bank of America	
186	Jeronimo Martins SGPS SA	Citibank	(81)		Telecommunications Ltd	Merrill Lynch	(964)
(6.618)	NOS SGPS SA	Bank of America		14.100	StarHub Ltd	Deutsche Bank	(1.897)
		Merrill Lynch	1.615	31.500	Suntec Real Estate		
(587)	NOS SGPS SA	Credit Suisse	170		Investment Trust (Reit)	JP Morgan	(2.220)
(980)	NOS SGPS SA	Citibank	343	2.500	United Overseas Bank Ltd	Credit Suisse	(1.922)
28.057	Sonae SGPS SA	JP Morgan	(2.273)	1.700	United Overseas Bank Ltd	Deutsche Bank	(1.438)
			4.701	6.400	UOL Group Ltd	Bank of America	
						Merrill Lynch	(1.968)
Singapour				(23.900)	Wilmar International Ltd	Deutsche Bank	(919)
15.700	Ascendas Real Estate			86.500	Yangzijiang Shipbuilding		
	Investment Trust (Reit)	Credit Suisse	(201)		Holdings Ltd		
2.500	Ascendas Real Estate			4.200	Yanlord Land Group Ltd	Credit Suisse	(13.580)
	Investment Trust (Reit)	Deutsche Bank	(16)	6.100	Yanlord Land Group Ltd	Credit Suisse	135
13.500	CapitaLand Commercial	Bank of America			Yanlord Land Group Ltd	Citibank	(156)
	Trust (Reit)	Merrill Lynch	(346)	71.000	Yanlord Land Group Ltd	Bank of America	
(12.200)	CapitaLand Ltd	Deutsche Bank	1.173			Merrill Lynch	—
53.000	CapitaLand Mall Trust (Reit)	Credit Suisse	—				(11.937)
6.100	CapitaLand Mall Trust (Reit)	Citibank	(117)	Corée du Sud			
3.300	CapitaLand Mall Trust (Reit)	JP Morgan	—	(195)	Amorepacific Corp	Citibank	(744)
(1.600)	City Developments Ltd	Deutsche Bank	1.035	(173)	BGF retail Co Ltd	JP Morgan	1.168
7.100	ComfortDelGro Corp Ltd	Bank of America		(3.937)	BNK Financial Group Inc	Citibank	2.336
		Merrill Lynch	500	(195)	CELLTRION HEALTHCARE		
6.500	ComfortDelGro Corp Ltd	Credit Suisse	791		Co Ltd	Citibank	(1.509)
14.800	ComfortDelGro Corp Ltd	Citibank	664	(61)	Celltrion Healthcare Co Ltd	JP Morgan	(1.103)
5.200	ComfortDelGro Corp Ltd	Deutsche Bank	366	(14)	CJ CheilJedang Corp	Deutsche Bank	26
34.100	Genting Singapore Plc	Bank of America		(44)	CJ CheilJedang Corp	JP Morgan	(265)
		Merrill Lynch	(1.311)	64	CJ Corp	Credit Suisse	(750)
21.800	Genting Singapore Plc	Credit Suisse	1.397	57	CJ Corp	Citibank	(686)
8.800	Genting Singapore Plc	Deutsche Bank	(338)	158	CJ Corp	Deutsche Bank	(2.532)
(4.500)	Hongkong Land Holdings Ltd	Citibank	(270)	(125)	CJ Logistics Corp	Bank of America	
(800)	Hongkong Land Holdings Ltd	Deutsche Bank	(279)			Merrill Lynch	2.253
4.700	Hutchison Port Holdings			(286)	CJ Logistics Corp	JP Morgan	613
	Trust (Unit)	Credit Suisse	(262)	108	Coway Co Ltd	Credit Suisse	(131)
19.500	Hutchison Port Holdings			314	Coway Co Ltd	JP Morgan	(378)
	Trust (Unit)	Deutsche Bank	(2.243)				

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

			Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Corée du Sud suite				Corée du Sud suite			
663	Daelim Industrial Co Ltd	Bank of America		(317)	LOTTE Corp	Deutsche Bank	511
		Merrill Lynch	(2.020)	(312)	Lotte Corp	Credit Suisse	642
36	Daelim Industrial Co Ltd	Citibank	(60)	(953)	Lotte Corp	JP Morgan	1.955
774	DB Insurance Co Ltd	Deutsche Bank	(1.557)	(56)	Lotte Shopping Co Ltd	Citibank	(24)
(123)	Dongsuh Cos Inc	Credit Suisse	136	(160)	Lotte Shopping Co Ltd	Deutsche Bank	1.705
(1.348)	Dongsuh Cos Inc	Citibank	468	(4)	Lotte Shopping Co Ltd	JP Morgan	34
11	E-MART Inc	Deutsche Bank	(109)	(176)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	Credit Suisse	35
225	GS Holdings Corp	JP Morgan	(372)	(6.391)	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	JP Morgan	1.283
(1.111)	GS Retail Co Ltd	JP Morgan	1.592	(92)	NAVER Corp	Citibank	978
151	Hana Financial Group Inc	Bank of America		30	NCSOFT Corp	Credit Suisse	252
		Merrill Lynch	(507)	11	NCSOFT Corp	Deutsche Bank	(16)
278	Hankook Tire Co Ltd	Credit Suisse	(1.199)	(80)	Netmarble Corp '144A'	Credit Suisse	(1.422)
(69)	Hanmi Science Co Ltd	JP Morgan	76	(495)	Netmarble Corp '144A'	JP Morgan	(8.801)
(414)	Hanon Systems	Credit Suisse	269	(42)	Orion Corp/Republic of Korea	Credit Suisse	(145)
(1.304)	Hanon Systems	JP Morgan	845	(180)	Orion Corp/Republic of Korea	JP Morgan	(622)
(302)	Hanon Systems	Deutsche Bank	190	(4)	Ottogi Corp	Citibank	(124)
(412)	Hanssem Co Ltd	Citibank	(416)	7	Ottogi Corp	Credit Suisse	340
2.003	Hanwha Chemical Corp	Credit Suisse	(2.451)	23	POSCO	Citibank	(223)
7.473	Hanwha Life Insurance Co Ltd	Citibank	(2.294)	57	POSCO	Deutsche Bank	(1.469)
(74)	HYOSUNG Corp	Credit Suisse	(111)	143	POSCO	JP Morgan	(2.271)
(36)	Hyosung Corp	Citibank	(38)	281	S-1 Corp	Citibank	(466)
(26)	Hyosung Corp	Deutsche Bank	52	84	S-1 Corp	Credit Suisse	(303)
(12)	Hyosung Corp	JP Morgan	(18)	80	S-1 Corp	JP Morgan	(288)
274	Hyundai Development			(209)	S-Oil Corp	Citibank	787
	Co-Engineering & Construction	Credit Suisse	(14)	(66)	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	Citibank	(1.916)
43	Hyundai Development			(23)	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	Credit Suisse	(1.172)
	Co-Engineering & Construction	JP Morgan	(2)	(99)	Samsung Biologics Co Ltd '144A'	Deutsche Bank	(3.551)
(152)	Hyundai Glovis Co Ltd	Citibank	987	(1.141)	Samsung C&T Corp	Citibank	3.804
(404)	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	Citibank	3.762	(262)	Samsung Card Co Ltd	JP Morgan	490
(207)	Hyundai Heavy Industries Holdings Co Ltd	Credit Suisse	3.717	(275)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Citibank	(1.381)
(115)	Hyundai Mobis Co Ltd	Citibank	2.601	850	Samsung Electronics Co Ltd	Credit Suisse	(1.334)
(566)	Hyundai Motor Co	Citibank	2.322	2.300	Samsung Electronics Co Ltd	Citibank	(1.786)
(219)	Hyundai Steel Co	Citibank	78	148	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	Citibank	(1.281)
2.318	Industrial Bank of Korea	JP Morgan	(1.422)	(9.823)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Bank of America	
(739)	Kakao Corp	Citibank	5.136			Merrill Lynch	2.181
(630)	Kangwon Land Inc	Citibank	268	(2.814)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Citibank	787
115	KB Financial Group Inc	Credit Suisse	(612)	36	Samsung Life Insurance Co Ltd	Deutsche Bank	(284)
879	KB Financial Group Inc	JP Morgan	(4.670)	(334)	Samsung SDI Co Ltd	Citibank	933
(83)	KCC Corp	JP Morgan	2.973	52	Samsung SDS Co Ltd	JP Morgan	(249)
679	Kia Motors Corp	Bank of America		53	Samsung SDS Co Ltd	Citibank	(315)
		Merrill Lynch	(1.392)	450	Samsung Securities Co Ltd	Citibank	(40)
(2.363)	Korea Aerospace Industries Ltd	Bank of America	(1.863)	109	Samsung Securities Co Ltd	Deutsche Bank	(69)
(237)	Korea Aerospace Industries Ltd	Credit Suisse	219	1.024	Shinhan Financial Group Co Ltd	Credit Suisse	(2.661)
(46)	Korea Aerospace Industries Ltd	JP Morgan	42	(77)	SillaJen Inc	Credit Suisse	(902)
583	Korea Electric Power Corp	JP Morgan	(1.692)	(74)	SillaJen Inc	JP Morgan	(867)
335	Korea Investment Holdings Co Ltd	JP Morgan	1.518	189	SK Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(3.371)
(15)	Korea Zinc Co Ltd	Citibank	274	125	SK Hynix Inc	Credit Suisse	974
55	KT Corp	Credit Suisse	(17)	1.181	SK Hynix Inc	Citibank	(1.571)
47	KT&G Corp	Citibank	(141)	149	SK Hynix Inc	Deutsche Bank	1.007
39	KT&G Corp	Deutsche Bank	(89)	14	SK Innovation Co Ltd	Credit Suisse	64
6	LG Chem Ltd	JP Morgan	36	247	SK Innovation Co Ltd	Citibank	294
1.368	LG Corp	Citibank	(4.154)	6	SK Innovation Co Ltd	JP Morgan	27
292	LG Corp	Deutsche Bank	(1.534)	12	SK Telecom Co Ltd	Citibank	(19)
1.981	LG Display Co Ltd	Citibank	(702)	407	SK Telecom Co Ltd	Deutsche Bank	220
768	LG Electronics Inc	Citibank	(3.585)	1.819	Woori Bank	Credit Suisse	(247)
43	LG Household & Health Care Ltd	Credit Suisse	1.538	27	Yuhan Corp	Credit Suisse	294
4	LG Household & Health Care Ltd	JP Morgan	154	212	Yuhan Corp	Citibank	602
91	Lotte Chemical Corp	Deutsche Bank	(899)	60	Yuhan Corp	Deutsche Bank	78
							(25.302)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Espagne				Espagne suite			
(19)	Acciona SA	Credit Suisse	43	179	Indra Sistemas SA	JP Morgan	(107)
(44)	Acciona SA	Citibank	155	(112)	Industria de Diseno Textil SA	Bank of America	
(447)	Acerinox SA	Deutsche Bank	72			Merrill Lynch	(63)
186	ACS Actividades de			(1.262)	Industria de Diseno Textil SA	Deutsche Bank	(707)
	Construccion y Servicios SA	Citibank	(179)	(1.140)	Industria de Diseno Textil SA	Credit Suisse	(536)
170	ACS Actividades de			287	International Consolidated		
	Construccion y Servicios SA	Deutsche Bank	(122)		Airlines Group SA	Credit Suisse	(56)
1.534	ACS Actividades de			2.079	Mapfre SA	Bank of America	
	Construccion y Servicios SA	JP Morgan	(598)			Merrill Lynch	(601)
92	Aena SME SA '144A'	Credit Suisse	(1.224)	199	Mapfre SA	Credit Suisse	(60)
(4.840)	Almirall SA (Right)	Deutsche Bank	(978)	4.437	Mediaset Espana		
(4.840)	Almirall SA	Deutsche Bank	1.016		Comunicacion SA	Credit Suisse	(2.094)
136	Amadeus IT Group SA	JP Morgan	331	720	Mediaset Espana		
82	Amadeus IT Group SA	Bank of America			Comunicacion SA	Deutsche Bank	(348)
		Merrill Lynch	266	1.273	Mediaset Espana		
7	Amadeus IT Group SA	Credit Suisse	33		Comunicacion SA	JP Morgan	(601)
47	Amadeus IT Group SA	Citibank	70	(1.299)	Melia Hotels International SA	Bank of America	
1.139	Amadeus IT Group SA	Deutsche Bank	3.690			Merrill Lynch	39
332	Atresmedia Corp de Medios			(304)	Melia Hotels International SA	Credit Suisse	201
	de Comunicacion SA	Deutsche Bank	(145)	(302)	Melia Hotels International SA	Deutsche Bank	9
1.450	Atresmedia Corp de Medios			(3.957)	Prosegur Cia de Seguridad SA	Citibank	950
	de Comunicacion SA	Citibank	(667)	1.054	Repsol SA	Bank of America	
494	Atresmedia Corp de Medios					Merrill Lynch	(522)
	de Comunicacion SA	JP Morgan	(212)	7.468	Repsol SA	Credit Suisse	859
(465)	Banco Bilbao Vizcaya			(979)	Siemens Gamesa		
	Argentaria SA	Credit Suisse	421		Renewable Energy SA	Deutsche Bank	551
(207)	Banco Bilbao Vizcaya			(375)	Siemens Gamesa	Bank of America	
	Argentaria SA	Citibank	158		Renewable Energy SA	Merrill Lynch	268
(1.752)	Banco de Sabadell SA	Credit Suisse	410	(5.944)	Siemens Gamesa		
(25.573)	Banco de Sabadell SA	Deutsche Bank	7.033		Renewable Energy SA	Citibank	6.598
(1.047)	Banco Santander SA	Bank of America		9.559	Telefonica SA	Credit Suisse	(7.714)
		Merrill Lynch	892	149	Viscofan SA	Credit Suisse	(45)
(6.424)	Banco Santander SA	Credit Suisse	4.937	296	Viscofan SA	Citibank	(296)
(5.294)	Bankia SA	Bank of America		(4.180)	Zardoya Otis SA	Credit Suisse	2.006
		Merrill Lynch	2.472	(50)	Zardoya Otis SA	JP Morgan	24
(11.178)	Bankia SA	Deutsche Bank	5.220	(759)	Zardoya Otis SA	Citibank	330
1.379	Bankinter SA	Citibank	(891)				
898	Bankinter SA	Deutsche Bank	(850)				26.392
(119)	Bolsas y Mercados			Suède			
	Espanoles SHMSF SA	Citibank	67	(672)	AAK AB	Credit Suisse	(1.144)
(1.103)	CaixaBank SA	Bank of America		3.542	Ahlsell AB '144A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	677			Merrill Lynch	52
(1.405)	CaixaBank SA	Citibank	725	(3)	Assa Abloy AB 'B'	Bank of America	
(183)	Cellnex Telecom SA '144A'	Bank of America				Merrill Lynch	-
		Merrill Lynch	320	(3.880)	Assa Abloy AB 'B'	JP Morgan	208
(3.541)	Cellnex Telecom SA '144A'	Deutsche Bank	6.197	187	Atlas Copco AB 'A'	JP Morgan	23
361	Cia de Distribucion Integral			182	Atlas Copco AB 'A'	Bank of America	
	Logista Holdings SA	Credit Suisse	834			Merrill Lynch	(66)
(323)	CIE Automotive SA	Citibank	336	772	Atlas Copco AB 'A'	Citibank	(905)
7.705	Distribuidora Internacional	Bank of America		848	Atlas Copco AB 'A'	Deutsche Bank	(149)
	de Alimentacion SA	Merrill Lynch	(2.782)	516	Atlas Copco AB 'A'	Citibank	-
2	Ebro Foods SA	Bank of America		848	Atlas Copco AB 'A'	Deutsche Bank	658
		Merrill Lynch	1	187	Atlas Copco AB 'A'	JP Morgan	145
2.222	Ebro Foods SA	JP Morgan	1.067	182	Atlas Copco AB 'A'	Bank of America	
494	Endesa SA	Bank of America				Merrill Lynch	-
		Merrill Lynch	(477)	(1.338)	BillerudKorsnas AB	Bank of America	
(140)	Ferrovial SA	Credit Suisse	(44)			Merrill Lynch	(137)
(2.980)	Ferrovial SA	JP Morgan	(932)	2.575	Boliden AB	Bank of America	
(140)	Ferrovial SA (Right)	Credit Suisse	61			Merrill Lynch	(2.906)
(2.980)	Ferrovial SA (Right)	JP Morgan	1.296	167	Boliden AB	Deutsche Bank	(189)
(1.189)	Gas Natural SDG SA	Citibank	1.344	2.575	Boliden AB	Bank of America	
2.823	Gestamp Automocion	Bank of America				Merrill Lynch	1.436
	SA '144A'	Merrill Lynch	198	167	Boliden AB	Deutsche Bank	93
3.386	Gestamp Automocion			1.200	Castellum AB	Deutsche Bank	(239)
	SA '144A'	Credit Suisse	(322)	1.295	Electrolux AB 'B'	Bank of America	
886	Grupo Catalana Occidente SA	Bank of America				Merrill Lynch	(1.096)
		Merrill Lynch	(709)	764	Electrolux AB 'B'	Credit Suisse	(782)
95	Grupo Catalana Occidente SA	Credit Suisse	(109)	(654)	Essity AB 'B'	JP Morgan	414
49	Grupo Catalana Occidente SA	Deutsche Bank	(39)	1.578	Fabege AB	Credit Suisse	344
1.678	Indra Sistemas SA	Citibank	(755)				

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes				Plus-values/ (moins-values) latentes			
Nombre	Description	Contrepartie	EUR	Nombre	Description	Contrepartie	EUR
Suède suite				Suède suite			
235	Fastighets AB Balder 'B'	Bank of America		8.187	Svenska Cellulosa		
		Merrill Lynch	(55)		AB SCA 'B'	Citibank	(1.689)
608	Fastighets AB Balder 'B'	JP Morgan	35	405	Svenska Handelsbanken	Bank of America	
(480)	Getinge AB 'B'	Bank of America			AB 'A'	Merrill Lynch	(116)
		Merrill Lynch	7	(4)	Sweco AB 'B'	Credit Suisse	(6)
(665)	Getinge AB 'B'	Credit Suisse	201	(2.915)	Sweco AB 'B'	Citibank	(170)
(331)	Deutsche AB 'B'	Deutsche Bank	5	(143)	Swedbank AB 'A'	Deutsche Bank	136
(348)	Hennes & Mauritz AB 'B'	Bank of America		(149)	Swedbank AB 'A'	JP Morgan	94
		Merrill Lynch	156	2.651	Swedish Match AB	Citibank	(206)
(1.710)	Hennes & Mauritz AB 'B'	JP Morgan	2.689	391	Swedish Orphan Biovitrum AB	JP Morgan	(228)
(34)	Hexagon AB 'B'	Bank of America		(4.263)	Telefonaktiebolaget LM	Bank of America	
		Merrill Lynch	(34)		Ericsson 'B'	Merrill Lynch	1.236
(823)	Hexagon AB 'B'	Credit Suisse	(889)	(3.651)	Telefonaktiebolaget LM		
(757)	Hexpol AB	Citibank	129		Ericsson 'B'	Credit Suisse	1.854
(4.142)	Hexpol AB	JP Morgan	403	(999)	Telia Co AB	Citibank	190
934	Holmen AB	Credit Suisse	(173)	(416)	Trelleborg AB 'B'	Bank of America	
1.575	Hufvudstaden AB 'A'	Deutsche Bank	(414)			Merrill Lynch	488
(507)	Husqvarna AB 'B'	Bank of America		2.924	Volvo AB 'B'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(58)			Merrill Lynch	(1.579)
(95)	Husqvarna AB 'B'	Citibank	7	1.098	Wallenstam AB 'B'	Deutsche Bank	(150)
(1.895)	ICA Gruppen AB	Credit Suisse	1.199				7.904
(204)	ICA Gruppen AB	Citibank	77				
(499)	Industrivarden AB 'C'	Bank of America		Suisse			
		Merrill Lynch	337	32	Adecco Group AG Reg	Credit Suisse	(129)
(378)	Industrivarden AB 'C'	Citibank	509	1.130	Adecco Group AG Reg	Deutsche Bank	(4.073)
(208)	Industrivarden AB 'C'	Deutsche Bank	141	160	Allreal Holding AG Reg	Bank of America	
(93)	Indutrade AB	Credit Suisse	(40)			Merrill Lynch	(585)
(1.997)	Intrum AB	Credit Suisse	3.711	(141)	ams AG	Deutsche Bank	786
(669)	Investor AB 'B'	Bank of America		(489)	ams AG	JP Morgan	3.576
		Merrill Lynch	1.068	(1.004)	Aryzta AG	Credit Suisse	6.211
(131)	Investor AB 'B'	Credit Suisse	395	(16)	Aryzta AG	Deutsche Bank	95
1.906	JM AB	Bank of America		528	Baloise Holding AG Reg	Credit Suisse	(4.689)
		Merrill Lynch	(1.716)	22	Baloise Holding AG Reg	Citibank	(184)
76	JM AB	JP Morgan	(13)	46	Banque Cantonale		
(1.194)	Kinnevik AB 'B'	Credit Suisse	1.685		Vaudoise Reg	Citibank	(801)
614	L E Lundbergforetagen			(5)	Barry Callebaut AG Reg	Citibank	148
	AB 'B'	JP Morgan	(1.210)	43	BKW AG	JP Morgan	(135)
1.006	Loomis AB 'B'	Citibank	(39)	13	Bucher Industries AG Reg	Bank of America	
1.801	Lundin Petroleum AB	Bank of America				Merrill Lynch	(240)
		Merrill Lynch	(70)	114	Bucher Industries AG Reg	Citibank	(2.422)
674	Lundin Petroleum AB	Credit Suisse	1.358	22	Bucher Industries AG Reg	JP Morgan	(437)
(474)	Modern Times Group	Bank of America		52	Cembra Money Bank AG	Bank of America	
	MTG AB 'B'	Merrill Lynch	415			Merrill Lynch	(192)
980	NCC AB 'B'	Citibank	(210)	240	Cembra Money Bank AG	Deutsche Bank	(888)
(485)	Nibe Industrier AB 'B'	Bank of America		(931)	Cie Financiere Richemont	Bank of America	
		Merrill Lynch	152		SA Reg	Merrill Lynch	4.929
(7.619)	Nibe Industrier AB 'B'	Credit Suisse	2.165	(35)	Cie Financiere Richemont		
(4.791)	Nordea Bank AB	Bank of America			SA Reg	Credit Suisse	138
		Merrill Lynch	2.965	(159)	Clariant AG Reg	Bank of America	
(518)	Nordea Bank AB	Credit Suisse	208			Merrill Lynch	40
4.938	Peab AB	Credit Suisse	(1.345)	(394)	Clariant AG Reg	Deutsche Bank	99
(477)	Saab AB 'B'	JP Morgan	(766)	(130)	Cosmo Pharmaceuticals NV	Citibank	2.071
202	Sandvik AB	Bank of America		(758)	Cosmo Pharmaceuticals NV	JP Morgan	24.816
		Merrill Lynch	(100)	(2.736)	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America	
332	Sandvik AB	Credit Suisse	(103)			Merrill Lynch	4.550
2.311	Sandvik AB	Deutsche Bank	(1.147)	(540)	Credit Suisse Group AG Reg	JP Morgan	733
957	Sandvik AB	JP Morgan	(298)	(27)	Dufry AG Reg	Bank of America	
345	Securitas AB 'B'	JP Morgan	(12)			Merrill Lynch	237
1.120	Skandinaviska Enskilda			(507)	Dufry AG Reg	JP Morgan	4.746
	Banken AB 'A'	Credit Suisse	(477)	(1.880)	EFG International AG	Credit Suisse	737
(693)	Skanska AB 'B'	Bank of America		(4.786)	EFG International AG	Citibank	917
		Merrill Lynch	300	(7)	Emmi AG Reg	Bank of America	(79)
(2.129)	Skanska AB 'B'	Credit Suisse	2.134	(15)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Bank of America	
(595)	Skanska AB 'B'	Citibank	431			Merrill Lynch	209
61	SKF AB 'B'	Bank of America		(112)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Deutsche Bank	1.560
		Merrill Lynch	(81)	(7)	Flughafen Zuerich AG Reg	Deutsche Bank	39
609	SKF AB 'B'	Deutsche Bank	(809)	(243)	Flughafen Zuerich AG Reg	JP Morgan	127
412	SKF AB 'B'	JP Morgan	(533)	22	Forbo Holding AG Reg	JP Morgan	(1.015)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Suisse suite				Taiwan suite			
1.536	GAM Holding AG	Bank of America		(68.000)	Asia Cement Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.260)			Merrill Lynch	1.619
368	GAM Holding AG	Credit Suisse	(417)	(1.000)	Asustek Computer Inc	Citibank	110
(107)	Geberit AG Reg	Citibank	1.472	234.000	AU Optronics Corp	Deutsche Bank	2.164
38	Georg Fischer AG Reg	Credit Suisse	728	38.000	AU Optronics Corp	JP Morgan	296
6	Georg Fischer AG Reg	Citibank	(439)	1.000	Catcher Technology Co Ltd	Deutsche Bank	36
(15)	Givaudan SA Reg	Bank of America		3.000	Chailease Holding Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	797			Merrill Lynch	(295)
47	Helvetia Holding AG Reg	Credit Suisse	(1.514)	141.000	Chang Hwa Commercial	Bank of America	
162	Julius Baer Group Ltd	Bank of America			Bank Ltd	Merrill Lynch	535
		Merrill Lynch	(688)	(14.000)	Cheng Shin Rubber		
230	Julius Baer Group Ltd	Credit Suisse	(589)		Industry Co Ltd	Citibank	424
343	Kuehne + Nagel International	Bank of America		(1.000)	Cheng Shin Rubber		
	AG Reg	Merrill Lynch	(1.359)		Industry Co Ltd	JP Morgan	25
8	Kuehne + Nagel International			(1.000)	Cheng Shin Rubber		
	AG Reg	JP Morgan	(50)		Industry Co Ltd	Deutsche Bank	(14)
672	Logitech International SA Reg	Credit Suisse	(35)	(9.000)	China Development Financial	Bank of America	
(94)	Lonza Group AG	Bank of America			Holding Corp	Merrill Lynch	(2)
		Merrill Lynch	(180)	12.000	China Life Insurance	Bank of America	
(50)	Lonza Group AG	Citibank	235		Co Ltd/Taiwan	Merrill Lynch	(25)
(57)	Lonza Group AG	Deutsche Bank	(109)	3.000	China Life Insurance		
(203)	Nestle SA Reg	Bank of America			Co Ltd/Taiwan	Citibank	(124)
		Merrill Lynch	329	(84.000)	China Steel Corp	Citibank	(653)
866	Novartis AG Reg	Bank of America		(19.000)	Chunghwa Telecom Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.775)			Merrill Lynch	(43)
114	Novartis AG Reg	JP Morgan	(340)	2.000	Compal Electronics Inc	Citibank	(10)
(72)	Panalpina Welttransport			6.000	Compal Electronics Inc	Deutsche Bank	(50)
	Holding AG Reg	JP Morgan	282	75.000	Compal Electronics Inc	JP Morgan	497
(205)	Pargesa Holding SA	Deutsche Bank	884	17.000	CTBC Financial Holding		
7	Partners Group Holding AG	Credit Suisse	(162)		Co Ltd	Deutsche Bank	(169)
8	Partners Group Holding AG	Deutsche Bank	(171)	(22.000)	Delta Electronics Inc	Citibank	2.294
478	PSP Swiss Property AG Reg	Bank of America		(6.000)	Eclat Textile Co Ltd	Bank of America	
		Merrill Lynch	(957)			Merrill Lynch	1.021
12	PSP Swiss Property AG Reg	Deutsche Bank	(24)	1.000	Eva Airways Corp	Bank of America	
119	Roche Holding AG	Bank of America				Merrill Lynch	
		Merrill Lynch	(1.274)	9.000	Eva Airways Corp	Citibank	1
76	Roche Holding AG	Credit Suisse	(814)	10.000	Eva Airways Corp	JP Morgan	(70)
392	Roche Holding AG	Citibank	(3.584)	31.000	Far Eastern New		
50	SFS Group AG	Credit Suisse	(218)		Century Corp	Deutsche Bank	302
29	SGS SA Reg	Credit Suisse	1.767	118.000	Far Eastern New		
65	Sonova Holding AG Reg	JP Morgan	490		Century Corp	JP Morgan	(81)
21	Straumann Holding AG Reg	Credit Suisse	(567)	(3.000)	Far EastTone		
14	Straumann Holding AG Reg	Citibank	(183)		Telecommunications Co Ltd	Deutsche Bank	(115)
(69)	Sulzer AG Reg	Credit Suisse	36	90.000	First Financial Holding Co Ltd	Bank of America	
(44)	Sunrise Communications	Bank of America				Merrill Lynch	(722)
	Group AG '144A'	Merrill Lynch	31	10.000	Formosa Chemicals		
(39)	Sunrise Communications				& Fibre Corp	Deutsche Bank	648
	Group AG '144A'	Credit Suisse	5	3.000	Formosa Chemicals		
157	Swiss Life Holding AG Reg	Bank of America			& Fibre Corp	JP Morgan	285
		Merrill Lynch	(2.912)	6.000	Formosa Chemicals		
134	Swiss Prime Site AG Reg	Bank of America			& Fibre Corp	Citibank	(282)
		Merrill Lynch	(163)	(1.000)	Formosa Petrochemical Corp	Citibank	105
48	Swiss Re AG	Bank of America		1.000	Formosa Plastics Corp	Deutsche Bank	(93)
		Merrill Lynch	(349)	7.000	Formosa Plastics Corp	JP Morgan	271
529	Swiss Re AG	Deutsche Bank	(3.841)	(9.000)	Hon Hai Precision Industry		
128	Swisscom AG Reg	Credit Suisse	(1.906)		Co Ltd	JP Morgan	(980)
68	Valiant Holding AG Reg	Credit Suisse	(497)	(13.445)	Hon Hai Precision Industry		
(810)	Vifor Pharma AG	Deutsche Bank	5.395		Co Ltd	Citibank	(615)
1.414	Vontobel Holding AG Reg	Credit Suisse	(985)	(2.000)	Hotai Motor Co Ltd	Bank of America	
494	Vontobel Holding AG Reg	Citibank	(516)			Merrill Lynch	837
324	Vontobel Holding AG Reg	Deutsche Bank	(212)	75.000	Hua Nan Financial Holdings		
4	Zurich Insurance Group AG	JP Morgan	(79)		Co Ltd	Deutsche Bank	(297)
			23.177	251.000	Innolux Corp	Deutsche Bank	544
				11.000	Innolux Corp	JP Morgan	(38)
				(105.000)	Inventec Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(3.038)
(6.000)	Advantech Co Ltd	Bank of America		(3.000)	Inventec Corp	JP Morgan	(104)
		Merrill Lynch	567	(1.000)	Largan Precision Co Ltd	JP Morgan	(2.451)
(16.000)	ASE Industrial Holding Co Ltd	Bank of America		16.000	Lite-On Technology Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.838			Merrill Lynch	344

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Taiwan suite				Royaume-Uni suite			
3.000	Lite-On Technology Corp	Citibank	52	(1.145)	Antofagasta Plc	JP Morgan	(835)
1.000	Lite-On Technology Corp	Deutsche Bank	23	3.317	Ashmore Group Plc	Credit Suisse	(1.052)
(7.000)	MediaTek Inc	Citibank	1.883	622	Ashmore Group Plc	Deutsche Bank	(217)
(99.000)	Mega Financial Holding Co Ltd	Citibank	1.652	935	Ashmore Group Plc	JP Morgan	(297)
(2.000)	Nan Ya Plastics Corp	Citibank	178	(357)	ASOS Plc	Bank of America	
(5.000)	Nanya Technology Corp	JP Morgan	(720)	666	Associated British Foods Plc	Merrill Lynch	(1.523)
(1.000)	Nanya Technology Corp	Citibank	(65)	121	Associated British Foods Plc	Citibank	(653)
1.000	Novatek Microelectronics Corp	Citibank	(19)	408	Associated British Foods Plc	Deutsche Bank	(69)
2.000	Novatek Microelectronics Corp	Deutsche Bank	(103)	(74)	AstraZeneca Plc	JP Morgan	(275)
5.000	Novatek Microelectronics Corp	JP Morgan	508	565	Aviva Plc	Citibank	(39)
25.000	Pegatron Corp	Deutsche Bank	(2.680)	(1.076)	B&M European Value Retail SA	Bank of America	
4.000	Pou Chen Corp	Deutsche Bank	(112)	(918)	B&M European Value Retail SA	Merrill Lynch	(208)
59.000	Pou Chen Corp	JP Morgan	(975)	(1.585)	B&M European Value Retail SA	Credit Suisse	(270)
5.000	Pou Chen Corp	Citibank	44	(1.125)	Babcock International Group Plc	Deutsche Bank	(225)
6.000	President Chain Store Corp	Deutsche Bank	(26)	(1.708)	Babcock International Group Plc	JP Morgan	(398)
(15.000)	Quanta Computer Inc	Bank of America		(1.708)	Babcock International Group Plc	Credit Suisse	(1.106)
(33.000)	Quanta Computer Inc	Merrill Lynch	(127)	400	BAE Systems Plc	Deutsche Bank	(1.765)
(45.000)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	117	2.798	BAE Systems Plc	Credit Suisse	163
54.000	Taishin Financial Holding Co Ltd	Merrill Lynch	190	(11.796)	Balfour Beatty Plc	Citibank	(6)
33.000	Taishin Financial Holding Co Ltd	Citibank	(183)	(1.082)	Balfour Beatty Plc	Deutsche Bank	—
(29.000)	Taiwan Cement Corp	JP Morgan	200	4.395	Barratt Developments Plc	JP Morgan	(32)
(7.000)	Taiwan Cement Corp	Bank of America		336	Barratt Developments Plc	Bank of America	
97.000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	Merrill Lynch	57	(915)	BBA Aviation Plc	Merrill Lynch	(993)
4.000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	(511)	(18.054)	BBA Aviation Plc	Deutsche Bank	(76)
(2.000)	Taiwan High Speed Rail Corp	Deutsche Bank	453	1.620	Beazley Plc	Credit Suisse	(6)
(10.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	Citibank	34	298	Bellway Plc	Deutsche Bank	(536)
(1.000)	Taiwan Mobile Co Ltd	JP Morgan	(38)	134	Bellway Plc	Citibank	(102)
12.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Bank of America		97	Berkeley Group Holdings Plc	JP Morgan	(459)
4.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Merrill Lynch	(740)	627	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America	
27.000	Uni-President Enterprises Corp	JP Morgan	19	412	Berkeley Group Holdings Plc	Merrill Lynch	(223)
109.000	United Microelectronics Corp	Deutsche Bank	(2.403)	119	Berkeley Group Holdings Plc	Credit Suisse	162
22.000	United Microelectronics Corp	Citibank	(605)	2.916	Bodycote Plc	Citibank	43
2.000	Yageo Corp	Deutsche Bank	(2.929)	(16.210)	boohoo.com Plc	Deutsche Bank	273
35.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	Citibank	271	(804)	boohoo.com Plc	JP Morgan	198
5.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	Deutsche Bank	(382)	(1.020)	BP Plc	JP Morgan	2.878
73.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	Bank of America	(58)	(4.973)	BP Plc	Bank of America	
		Citibank	(873)	(2.205)	BP Plc	Merrill Lynch	(1.137)
			(2.197)	(622)	British American Tobacco Plc	Credit Suisse	(195)
Royaume-Uni				(134)	British American Tobacco Plc	Bank of America	
(264)	Abcam Plc	Deutsche Bank	733	(948)	British American Tobacco Plc	Merrill Lynch	35
(829)	Admiral Group Plc	Bank of America	425	(206)	British American Tobacco Plc	Citibank	806
(594)	Aggreko Plc	Merrill Lynch		(622)	British American Tobacco Plc	Deutsche Bank	75
(125)	Aggreko Plc	Citibank	271	(134)	British American Tobacco Plc	Citibank	(632)
313	Anglo American Plc	Deutsche Bank	(2.929)	(948)	British American Tobacco Plc	Bank of America	
1.470	Anglo American Plc	Citibank	(382)	(206)	British American Tobacco Plc	Merrill Lynch	(38)
		Bank of America	(58)	1.606	British American Tobacco Plc	Credit Suisse	(460)
		Merrill Lynch	(10)	6.056	British Land Co Plc/The (Reit)	JP Morgan	(100)
3.833	Anglo American Plc	Deutsche Bank	(26)	150	Britvic Plc	JP Morgan	(81)
(424)	Antofagasta Plc	Bank of America	(29)	1.221	Britvic Plc	Citibank	3.524
		Merrill Lynch			BT Group Plc	JP Morgan	113
				1.096	BT Group Plc	Bank of America	
				(2.343)	BTG Plc	Merrill Lynch	(36)
				(798)	Bunzl Plc	Deutsche Bank	(32)
					Bunzl Plc	Bank of America	
				(489)	Bunzl Plc	Merrill Lynch	(374)
				1.032	Burberry Group Plc	Bank of America	
				(36.810)	Cairn Energy Plc	Merrill Lynch	(774)
				(1.231)	Cairn Energy Plc	Citibank	(50)
				(8.597)	Cairn Energy Plc	JP Morgan	2.219
					Cairn Energy Plc	Bank of America	
					Cairn Energy Plc	Merrill Lynch	8.315
					Cairn Energy Plc	Credit Suisse	48
					Cairn Energy Plc	Citibank	3.531

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes				Plus-values/ (moins-values) latentes			
Nombre	Description	Contrepartie	EUR	Nombre	Description	Contrepartie	EUR
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(7.334)	Capital & Counties Properties Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.464)	318 (254)	Grafton Group Plc (Unit) Great Portland Estates Plc (Reit)	JP Morgan Bank of America Merrill Lynch	(140) 3
(1.162)	Capital & Counties Properties Plc	Deutsche Bank	(232)	(2.328)	Great Portland Estates Plc (Reit)	Citibank	(258)
(9.767)	Cineworld Group Plc	Credit Suisse	936	(4.414)	Greene King Plc	JP Morgan	(2.094)
(6.788)	Cineworld Group Plc	Deutsche Bank	877	(931)	Greene King Plc	Deutsche Bank	(246)
1.457 (357)	Close Brothers Group Plc Cobham Plc	Citibank Bank of America Merrill Lynch	(2.410) (24)	(2.409)	GVC Holdings Plc	JP Morgan	(3.985)
(37.720)	Cobham Plc	Credit Suisse	(3.120)	(487)	Hammerson Plc (Reit)	Deutsche Bank	13
(3.812)	Cobham Plc	Deutsche Bank	(259)	(924)	Hargreaves Lansdown Plc	Citibank	358
(165)	Compass Group Plc	Credit Suisse	(74)	(1.971)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	(200)
(100)	Compass Group Plc	Citibank	(12)	(87)	Hikma Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	(19)
(1.076)	ConvaTec Group Plc '144A'	Bank of America Merrill Lynch	(18)	660	HomeServe Plc	Citibank	184
(2.724)	ConvaTec Group Plc '144A'	Citibank	(582)	11.906	Howden Joinery Group Plc	JP Morgan	(2.336)
(8.528)	ConvaTec Group Plc '144A'	Deutsche Bank	(146)	(1.374)	HSBC Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	273
(116)	Croda International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(183)	(244)	HSBC Holdings Plc	Citibank	68
(30)	Croda International Plc	Deutsche Bank	(47)	811	IG Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	46
939	CYBG Plc	Credit Suisse	(332)	182	IG Group Holdings Plc	Citibank	(37)
(1.310)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	844	3.352	IMI Plc	Citibank	(994)
(969)	Daily Mail & General Trust Plc 'A'	Deutsche Bank	625	212	IMI Plc	Credit Suisse	220
(236)	Dechra Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	(54)	159	IMI Plc	Deutsche Bank	73
(519)	Derwent London Plc (Reit)	JP Morgan	734	426	Imperial Brands Plc	Credit Suisse	453
(714)	Diageo Plc	Credit Suisse	(819)	6.015	Inchcape Plc	Credit Suisse	(480)
714	Direct Line Insurance Group Plc	Citibank	(147)	320	Inchcape Plc	Citibank	(13)
3.605	Direct Line Insurance Group Plc	Deutsche Bank	(502)	9.943 (5.242)	Indivior Plc Informa Plc	JP Morgan Bank of America Merrill Lynch	1.021 (2.057)
3.619	Dixons Carphone Plc	Citibank	(2.054)	(824)	Informa Plc	Deutsche Bank	(323)
1.283	Dixons Carphone Plc	Credit Suisse	(503)	(820)	Inmarsat Plc	Bank of America Merrill Lynch	73
(594)	Domino's Pizza Group Plc	Credit Suisse	(127)	(2.903)	Inmarsat Plc	Credit Suisse	537
(921)	Drax Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	174	225	InterContinental Hotels Group Plc	Credit Suisse	133
(189)	Drax Group Plc	Citibank	59	(155)	Intertek Group Plc	Deutsche Bank	(785)
(5.188)	Drax Group Plc	JP Morgan	(758)	(3.043)	Investec Plc	Deutsche Bank	292
(1.174)	DS Smith Plc	Credit Suisse	(206)	3.561	ITV Plc	Credit Suisse	557
(1.252)	DS Smith Plc	Deutsche Bank	(157)	(1.556)	IWG Plc	Deutsche Bank	(25)
(330)	DS Smith Plc	JP Morgan	(58)	(940)	IWG Plc	JP Morgan	(830)
2.367	Dunelm Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1.755)	613	J Sainsbury Plc	Credit Suisse	172
87	Dunelm Group Plc	Deutsche Bank	(65)	1.129	J Sainsbury Plc	Citibank	18
(1.269)	easyJet Plc	JP Morgan	(623)	4.276	J Sainsbury Plc	Deutsche Bank	781
5.438	Electrocomponents Plc	Deutsche Bank	6.403	14.102	J Sainsbury Plc	JP Morgan	3.958
(7.439)	Essentra Plc	Bank of America Merrill Lynch	(968)	6.729	JD Sports Fashion Plc	Deutsche Bank	(791)
(827)	Essentra Plc	Citibank	70	(7.430)	John Wood Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	424
410	Experian Plc	Credit Suisse	624	(2.651)	John Wood Group Plc	Credit Suisse	(2.711)
491	Ferguson Plc	Bank of America Merrill Lynch	1.120	(587)	Johnson Matthey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(308)
(901)	Fevertree Drinks Plc	Citibank	(1.295)	(258)	Johnson Matthey Plc	Citibank	88
(438)	Fresnillo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(540)	1.280	Jupiter Fund Management Plc	Deutsche Bank	(117)
(2.935)	Fresnillo Plc	Credit Suisse	(2.478)	9.855	Jupiter Fund Management Plc	JP Morgan	(798)
(645)	Fresnillo Plc	Citibank	(261)	145	Jupiter Fund Management Plc	Citibank	(54)
(972)	G4S Plc	Bank of America Merrill Lynch	(130)	(4.789)	Just Eat Plc	Deutsche Bank	(1.890)
(2.036)	G4S Plc	Credit Suisse	(295)	683	KAZ Minerals Plc	Credit Suisse	415
(1.118)	G4S Plc	Citibank	(15)	1.554	KAZ Minerals Plc	Citibank	(869)
5.888	GlaxoSmithKline Plc	Deutsche Bank	3.990	319	KAZ Minerals Plc	Deutsche Bank	(11)
(2.002)	Glencore Plc	Bank of America Merrill Lynch	113	35	Kingfisher Plc	Citibank	3
(14.647)	Glencore Plc	Credit Suisse	(2.515)	1.632	Kingfisher Plc	Deutsche Bank	300
(7.148)	Glencore Plc	Deutsche Bank	404	327	Kingfisher Plc	JP Morgan	68
296	Grafton Group Plc (Unit)	Credit Suisse	(130)	(328)	Lancashire Holdings Ltd	Credit Suisse	(26)
4.709	Grafton Group Plc (Unit)	Citibank	(510)	(1.886)	Lancashire Holdings Ltd	Citibank	172
				(109)	Lancashire Holdings Ltd	JP Morgan	(9)
				1.083	Land Securities Group Plc (Reit)	JP Morgan	(680)
				11.586	Legal & General Group Plc	Citibank	(2.075)
				25.745	Lloyds Banking Group Plc	Deutsche Bank	(949)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Royaume-Uni suite				Royaume-Uni suite			
(449)	London Stock Exchange Group Plc	Deutsche Bank	(36)	(3.101)	Rolls-Royce Holdings Plc	JP Morgan	566
27.629	Man Group Plc	Bank of America		(9.830)	Rotork Plc	Citibank	2.030
		Merrill Lynch		(11.268)	Royal Bank of Scotland Group Plc	Citibank	2.661
13.108	Marks & Spencer Group Plc	Citibank	(3.404)	(723)	Royal Dutch Shell Plc 'B'	JP Morgan	(454)
(9.005)	Mediclinic International Plc	Deutsche Bank	6.575	3.596	Royal Mail Plc	Bank of America	
(741)	Meggitt Plc	Deutsche Bank	(62)			Merrill Lynch	(3.955)
(646)	Melrose Industries Plc	Citibank	80	13.807	Royal Mail Plc	Deutsche Bank	(15.185)
(31.840)	Melrose Industries Plc	Deutsche Bank	(1.308)	(58)	RPC Group Plc	Credit Suisse	(8)
(2.927)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Credit Suisse	110	(6.654)	RPC Group Plc	Bank of America	
(11.073)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Citibank	1.781	(125)	RPC Group Plc	Merrill Lynch	(1.093)
(534)	Merlin Entertainments Plc '144A'	Deutsche Bank	20	462	RSA Insurance Group Plc	Citibank	39
(1.469)	Metro Bank Plc	Citibank	2.045	(3.657)	Saga Plc	Deutsche Bank	(7)
773	Mondi Plc	Citibank	(220)	(2.898)	Saga Plc	Credit Suisse	317
15.680	Moneysupermarket.com Group Plc			(733)	Saga Plc	Deutsche Bank	245
1.888	National Express Group Plc	JP Morgan	250	3.091	Sage Group Plc/The	JP Morgan	64
		Bank of America		1.023	Schroders Plc	Citibank	(430)
		Merrill Lynch				Bank of America	
224	National Express Group Plc	Credit Suisse	(52)	(464)	Severn Trent Plc	Merrill Lynch	(1.949)
6.521	National Express Group Plc	JP Morgan	15			Bank of America	
(3.312)	National Grid Plc	Bank of America	432	(2.491)	Shaftesbury Plc (Reit)	Merrill Lynch	(101)
		Merrill Lynch		(1.144)	Shaftesbury Plc (Reit)	Credit Suisse	2.345
(1.652)	NEX Group Plc	Credit Suisse	(76)	(495)	Shire Plc	Deutsche Bank	803
(62)	NEX Group Plc	Citibank	(499)	(296)	Sky Plc	JP Morgan	(455)
78	Next Plc	Bank of America	(13)			Bank of America	
		Merrill Lynch		(256)	Sky Plc	Merrill Lynch	83
17	Next Plc	Credit Suisse	182	(471)	Sky Plc	Citibank	54
543	Next Plc	Citibank	127	719	Smith & Nephew Plc	Deutsche Bank	132
100	Next Plc	JP Morgan	37	1.063	Smith & Nephew Plc	Credit Suisse	581
(752)	NMC Health Plc	Credit Suisse	746	3.367	Smith & Nephew Plc	Citibank	515
(3.351)	Ocado Group Plc	Bank of America	(34)	482	Smith & Nephew Plc	Deutsche Bank	2.574
		Merrill Lynch		1.434	Smiths Group Plc	JP Morgan	366
(789)	Ocado Group Plc	JP Morgan	(13.526)			Bank of America	
7.511	Pagegroup Plc	JP Morgan	(3.034)	(3.469)	Sophos Group Plc '144A'	Merrill Lynch	1.628
943	Pearson Plc	Credit Suisse	(300)	327	Spectris Plc	JP Morgan	(1.979)
1.557	Pearson Plc	Deutsche Bank	(60)	234	Spectris Plc	Citibank	56
291	Pearson Plc	JP Morgan	(53)	(12)	Spirax-Sarco Engineering Plc	JP Morgan	246
(164)	Pennon Group Plc	Bank of America	(19)			Bank of America	
		Merrill Lynch		(187)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Merrill Lynch	(31)
(4.853)	Pennon Group Plc	JP Morgan	(80)	(4.262)	Sports Direct International Plc	Credit Suisse	(597)
2.079	Persimmon Plc	Deutsche Bank	(2.281)	(2.847)	Sports Direct International Plc	Credit Suisse	(141)
897	Petrofac Ltd	Credit Suisse	640	1.917	SSE Plc	Citibank	426
5.335	Petrofac Ltd	Deutsche Bank	(3.506)			Bank of America	
(10.119)	Phoenix Group Holdings	Credit Suisse	23	2.446	SSP Group Plc	Merrill Lynch	(667)
(38)	Phoenix Group Holdings	Citibank	10			Bank of America	
(380)	Playtech Plc	Bank of America	137	8.511	SSP Group Plc	Merrill Lynch	700
(521)	Playtech Plc	JP Morgan	(37)	(1.711)	St James's Place Plc	Credit Suisse	(340)
6.360	QinetiQ Group Plc	Citibank	1.480	(8.641)	Standard Life Plc	Credit Suisse	(439)
(116)	Randgold Resources Ltd	Bank of America		3.162	TalkTalk Telecom Group Plc	Credit Suisse	1.459
		Merrill Lynch		4.680	Tate & Lyle Plc	Deutsche Bank	(743)
(317)	Randgold Resources Ltd	JP Morgan	(251)			Bank of America	
(154)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America	29	444	Tate & Lyle Plc	Merrill Lynch	4.987
		Merrill Lynch		1.425	Tate & Lyle Plc	Citibank	441
(638)	Reckitt Benckiser Group Plc	Credit Suisse	(155)	1.573	Taylor Wimpey Plc	Deutsche Bank	1.518
(209)	Reckitt Benckiser Group Plc	JP Morgan	(1.230)	18.533	Taylor Wimpey Plc	Citibank	(258)
(541)	Redrow Plc	Credit Suisse	(403)	(4.841)	Tesco Plc	JP Morgan	(381)
3.103	Redrow Plc	Deutsche Bank	111			Bank of America	
(248)	Redrow Plc	Citibank	(3.310)	(2.216)	Tesco Plc	Merrill Lynch	(55)
4.496	RELX Plc	Deutsche Bank	54	(931)	Tesco Plc	Deutsche Bank	(25)
(6.515)	Rentokil Initial Plc	Citibank	3.744	2.570	Thomas Cook Group Plc	Citibank	(4)
1.371	Rightmove Plc	Deutsche Bank	(1.895)			Bank of America	
(27.761)	Rolls Royce Holdings Plc	Citibank	1.533	31.477	Thomas Cook Group Plc	Merrill Lynch	(742)
		Bank of America		2.809	Thomas Cook Group Plc	Deutsche Bank	(9.086)
(220.171)	Rolls Royce Holdings Plc	Merrill Lynch	—	999	TP ICAP Plc	JP Morgan	(612)
(391)	Rolls-Royce Holdings Plc	JP Morgan	(251)	1.679	Travis Perkins Plc	Citibank	(202)
		Bank of America		94	Travis Perkins Plc	Citibank	(10)
		Merrill Lynch	62			Bank of America	
						Merrill Lynch	61

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Royaume-Uni suite				Etats-Unis suite			
159	TUI AG	Bank of America		380	Advanced Energy Industries Inc	Bank of America	
639	TUI AG	Merrill Lynch	(65)			Merrill Lynch	600
(1.920)	Tullow Oil Plc	JP Morgan	(51)	(1.106)	Advanced Micro Devices Inc	Credit Suisse	(2.155)
		Bank of America		(2.505)	Advanced Micro Devices Inc	JP Morgan	(4.880)
		Merrill Lynch	(103)	(62)	AECOM	Bank of America	
(6.446)	Tullow Oil Plc	Deutsche Bank	(346)			Merrill Lynch	11
(1.343)	UBM Plc	Credit Suisse	(644)	(885)	AECOM	Deutsche Bank	152
(252)	UBM Plc	Citibank	(75)	126	AerCap Holdings NV	Deutsche Bank	(48)
(594)	UBM Plc	JP Morgan	(285)	1.827	AerCap Holdings NV	JP Morgan	643
(3.719)	United Utilities Group Plc	Credit Suisse	(331)	134	AerCap Holdings NV	Citibank	(24)
659	Vedanta Resources Plc	Deutsche Bank	(571)	810	AES Corp/VA	Deutsche Bank	307
(1.934)	Virgin Money Holdings UK Plc	Deutsche Bank	(38)	1.587	AES Corp/VA	JP Morgan	1.287
		Citibank	(836)	19	Affiliated Managers Group Inc	Credit Suisse	(61)
10.776	Vodafone Group Plc	Deutsche Bank	2.211	1.138	Aflac Inc	Bank of America	
(2.062)	Weir Group Plc/The	Bank of America				Merrill Lynch	(98)
3.018	WH Smith Plc	Bank of America		252	AGCO Corp	Citibank	(526)
		Merrill Lynch	(1.515)	424	Agilent Technologies Inc	JP Morgan	(1.707)
256	WH Smith Plc	Deutsche Bank	(129)	123	Agilent Technologies Inc	Citibank	(228)
(272)	Whitbread Plc	Bank of America		(435)	Agios Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	(4.028)
		Merrill Lynch	(140)	55	AGNC Investment Corp (Reit)	Bank of America	
(327)	Whitbread Plc	Credit Suisse	112			Merrill Lynch	12
9.560	William Hill Plc	Bank of America		(206)	Air Lease Corp	Deutsche Bank	57
		Merrill Lynch	534	45	Air Products & Chemicals Inc	Bank of America	
1.412	William Hill Plc	Credit Suisse	617			Merrill Lynch	(128)
8.936	Wm Morrison Supermarkets Plc	Deutsche Bank	(418)	28	Air Products & Chemicals Inc	Deutsche Bank	(80)
(328)	Workspace Group Plc (Reit)	Bank of America		(6.150)	AK Steel Holding Corp	Deutsche Bank	(1.636)
		Merrill Lynch	(120)	74	Akamai Technologies Inc	Credit Suisse	121
(54)	Workspace Group Plc (Reit)	Citibank	(3)	59	Akamai Technologies Inc	Deutsche Bank	(35)
(1.030)	WPP Plc	Citibank	1.451	(131)	Albemarle Corp	Credit Suisse	784
			(47.890)	(200)	Albemarle Corp	Citibank	1.474
				165	Alcoa Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(183)
				814	Alcoa Corp	Citibank	(307)
				361	Alcoa Inc	JP Morgan	(1.397)
				32	Align Technology Inc	JP Morgan	1.969
				56	Align Technology Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	2.567
				(439)	Alkermes Plc	Deutsche Bank	(467)
				(74)	Alkermes Plc	JP Morgan	(209)
				(37)	Alleghany Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	455
				(429)	Allegheny Technologies Inc	Citibank	(44)
				(1.411)	Allegheny Technologies Inc	Deutsche Bank	(291)
				(111)	Allegiant Travel Co	Bank of America	
						Merrill Lynch	357
				24	Allegion Plc	Deutsche Bank	42
				225	Allegion Plc	JP Morgan	504
				(9)	Allergan Plc	Credit Suisse	(62)
				(65)	Allergan Plc	Deutsche Bank	52
				(210)	Allergan Plc	JP Morgan	(1.454)
				(315)	ALLETE Inc	JP Morgan	(162)
				(41)	Alliance Data Systems Corp	Citibank	15
				308	Alliant Energy Corp	JP Morgan	(103)
				83	Allison Transmission Holdings Inc	Credit Suisse	(40)
				1.637	Allison Transmission Holdings Inc	Citibank	(3.302)
				25	Allison Transmission Holdings Inc	Deutsche Bank	(24)
				(44)	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(10)
				541	Allstate Corp/The	Citibank	(1.133)
				(382)	Ally Financial Inc	Credit Suisse	200
				(149)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Deutsche Bank	12
				40	Alphabet Inc 'A'	Bank of America	
						Merrill Lynch	345
				(10)	Alphabet Inc 'C'	Citibank	(120)
				(29)	Altria Group Inc	Credit Suisse	(14)
				(533)	Altria Group Inc	Deutsche Bank	(608)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

			Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(43)	Amazon.com Inc	Bank of America		592	Apple Hospitality Inc (Reit)	Credit Suisse	422
		Merrill Lynch	(1.894)	93	Apple Hospitality Inc (Reit)	Deutsche Bank	76
(672)	Ambarella Inc	Deutsche Bank	150	(70)	Apple Inc	Deutsche Bank	(62)
(14)	Ambarella Inc	Credit Suisse	1	(30)	Apple Inc	Citibank	(8)
731	AMC Networks Inc 'A'	Bank of America		123	Applied Industrial		
		Merrill Lynch	853		Technologies Inc	Citibank	48
62	AMC Networks Inc 'A'	JP Morgan	280	704	Applied Industrial		
(34)	AMERCO	Credit Suisse	127		Technologies Inc	Deutsche Bank	–
(21)	AMERCO	Bank of America		181	Applied Materials Inc	Credit Suisse	(531)
		Merrill Lynch	412	185	Applied Materials Inc	Bank of America	
(10)	AMERCO	JP Morgan	32			Merrill Lynch	(415)
857	Ameren Corp	Credit Suisse	1.670	859	Applied Materials Inc	Citibank	903
15	Ameren Corp	Deutsche Bank	36	129	Applied Materials Inc	JP Morgan	(219)
33	American Airlines Group Inc	Credit Suisse	5	(111)	Aptiv Plc	Credit Suisse	(333)
382	American Airlines Group Inc	Deutsche Bank	(10)	(82)	Aptiv Plc	JP Morgan	(246)
(731)	American Campus	Bank of America		(955)	Aqua America Inc	Credit Suisse	(697)
	Communities Inc (Reit)	Merrill Lynch	(1.123)	(597)	Aramark	Bank of America	
149	American Eagle Outfitters Inc	Citibank	50			Merrill Lynch	(436)
1.628	American Eagle Outfitters Inc	Bank of America		36	Arch Capital Group Ltd	Deutsche Bank	7
		Merrill Lynch	1.271	(216)	Archer-Daniels-Midland Co	Citibank	161
227	American Express Co	Credit Suisse	(216)	(169)	Archer-Daniels-Midland Co	JP Morgan	(13)
87	American Express Co	JP Morgan	(83)	(279)	Arconic Inc	Bank of America	
396	American Financial					Merrill Lynch	26
	Group Inc/OH	Credit Suisse	(150)	(877)	Arconic Inc	Credit Suisse	(53)
(492)	American Homes 4 Rent			(149)	Arconic Inc	Citibank	90
	'A' (Reit)	Credit Suisse	293	(232)	Arconic Inc	Deutsche Bank	22
(94)	American International	Bank of America		(39)	Arista Networks Inc	Credit Suisse	164
	Group Inc	Merrill Lynch	56	(372)	Array BioPharma Inc	Bank of America	
(28)	American International					Merrill Lynch	(338)
	Group Inc	Credit Suisse	13	(299)	Array BioPharma Inc	Credit Suisse	(719)
(111)	American International			257	ARRIS International Plc	Credit Suisse	(313)
	Group Inc	Deutsche Bank	67	(269)	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America	
(131)	American International					Merrill Lynch	155
	Group Inc	JP Morgan	62	36	ASGN Inc	Credit Suisse	(170)
10	American National			124	ASGN Inc	Bank of America	
	Insurance Co	Deutsche Bank	–			Merrill Lynch	(509)
(41)	American Tower Corp (Reit)	Citibank	(12)	(67)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Credit Suisse	(17)
(223)	American Water Works Co Inc	Deutsche Bank	(505)	(264)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Deutsche Bank	(79)
48	Ameriprise Financial Inc	Credit Suisse	176	(102)	Aspen Insurance Holdings Ltd	JP Morgan	(26)
304	Ameriprise Financial Inc	Citibank	(1.477)	779	Aspen Technology Inc	Bank of America	
184	AmerisourceBergen Corp	Deutsche Bank	(365)			Merrill Lynch	949
(379)	AMETEK Inc	JP Morgan	(329)	489	Associated Banc-Corp	Bank of America	
63	Amgen Inc	Deutsche Bank	421			Merrill Lynch	231
743	Amgen Inc	JP Morgan	7.423	180	Assurant Inc	Bank of America	
331	Amkor Technology Inc	Citibank	131			Merrill Lynch	786
158	Amkor Technology Inc	JP Morgan	99	807	Assured Guaranty Ltd	JP Morgan	229
216	AMN Healthcare Services Inc	JP Morgan	(108)	1.080	AT&T Inc	Bank of America	
(605)	Amphenol Corp 'A'	Deutsche Bank	151			Merrill Lynch	130
(2.153)	AmTrust Financial Services Inc	Deutsche Bank	(92)	167	AT&T Inc	Deutsche Bank	28
481	Anadarko Petroleum Corp	Bank of America		146	AT&T Inc	JP Morgan	73
		Merrill Lynch	285	412	Athene Holding Ltd 'A'	Credit Suisse	(488)
64	Anadarko Petroleum Corp	Deutsche Bank	38	298	Athene Holding Ltd 'A'	Deutsche Bank	(453)
(199)	Analog Devices Inc	Credit Suisse	(1.013)	48	Atmos Energy Corp	Citibank	144
(548)	Analog Devices Inc	Deutsche Bank	(1.783)	31	Atmos Energy Corp	JP Morgan	52
(11)	Anixter International Inc	Credit Suisse	(12)	(71)	Autodesk Inc	Bank of America	
(52)	Anixter International Inc	Deutsche Bank	67			Merrill Lynch	314
(198)	Anixter International Inc	JP Morgan	(212)	(11)	Autodesk Inc	Deutsche Bank	49
35	Ansys Inc	Deutsche Bank	(53)	(142)	Autodesk Inc	Credit Suisse	215
113	Antero Resources Corp	Bank of America		(165)	Autodesk Inc	JP Morgan	249
		Merrill Lynch	1	53	Automatic Data Processing Inc	Citibank	96
416	Antero Resources Corp	Credit Suisse	161	131	Automatic Data Processing Inc	Deutsche Bank	386
38	Antero Resources Corp	Deutsche Bank	–	(99)	AutoNation Inc	Deutsche Bank	5
121	Anthem Inc	Citibank	(437)	13	AutoZone Inc	Bank of America	
412	AO Smith Corp	Deutsche Bank	325			Merrill Lynch	(66)
137	AO Smith Corp	JP Morgan	108	77	Avery Dennison Corp	Bank of America	
52	Aon Plc	Citibank	(144)			Merrill Lynch	35
280	Apache Corp	JP Morgan	10	481	Avery Dennison Corp	Deutsche Bank	219
91	Apache Corp	Credit Suisse	3	57	Avery Dennison Corp	Citibank	(163)
(1)	Apergy Corp	JP Morgan	(37)	114	Avis Budget Group Inc	Deutsche Bank	(366)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(259)	Avnet Inc	Bank of America		42	Boeing Co/The	JP Morgan	590
		Merrill Lynch	322	(17)	Booking Holdings Inc	Credit Suisse	793
(369)	Avnet Inc	Credit Suisse	342	151	Booz Allen Hamilton	Bank of America	
(812)	Avnet Inc	Citibank	223		Holding Corp	Merrill Lynch	539
(321)	Avnet Inc	Deutsche Bank	57	909	Booz Allen Hamilton		
550	AVX Corp	Credit Suisse	(61)		Holding Corp	Citibank	3.019
(736)	Axalta Coating Systems Ltd	Deutsche Bank	82	242	BorgWarner Inc	Citibank	(777)
(108)	Axalta Coating Systems Ltd	Citibank	86	112	BorgWarner Inc	Deutsche Bank	(175)
(461)	B&G Foods Inc	Bank of America		112	Boston Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	254
		Merrill Lynch	(475)	(330)	Boston Scientific Corp	Citibank	(125)
(162)	B&G Foods Inc	Deutsche Bank	(167)	(41)	Boyd Gaming Corp	Citibank	(58)
(459)	Balchem Corp	Credit Suisse	(1.083)	(479)	Boyd Gaming Corp	Deutsche Bank	(793)
(65)	Balchem Corp	Citibank	(106)	161	Brandywine Realty	Bank of America	
(46)	Balchem Corp	Deutsche Bank	(242)		Trust (Reit)	Merrill Lynch	66
(1.194)	Ball Corp	JP Morgan	594	1.842	Brandywine Realty		
(94)	BancorpSouth Bank	Citibank	61		Trust (Reit)	JP Morgan	(364)
70	Bank of Hawaii Corp	Credit Suisse	25	(271)	Bright Horizons Family		
323	Bank of Hawaii Corp	Citibank	(286)		Solutions Inc	Credit Suisse	(626)
(124)	Bank of New York Mellon			(113)	Brighthouse Financial Inc	Credit Suisse	315
	Corp/The	Credit Suisse	159	(261)	Brighthouse Financial Inc	JP Morgan	728
(515)	Bank of the Ozarks Inc	Citibank	429	242	Brinker International Inc	Bank of America	
(245)	BankUnited Inc	Citibank	149			Merrill Lynch	71
15	Barnes Group Inc	Deutsche Bank	10	177	Brinker International Inc	Citibank	30
755	Baxter International Inc	Citibank	246	446	Brinker International Inc	JP Morgan	(869)
58	Baxter International Inc	JP Morgan	132	620	Bristol-Myers Squibb Co	Bank of America	
(186)	BB&T Corp	Credit Suisse	259			Merrill Lynch	367
(501)	Beacon Roofing Supply Inc	JP Morgan	3.485	(407)	Brixmor Property Group		
(65)	Becton Dickinson and Co	Credit Suisse	(182)		Inc (Reit)	JP Morgan	(355)
(72)	Becton Dickinson and Co	Citibank	57	(97)	Brixmor Property Group	Bank of America	
995	Bed Bath & Beyond Inc	Deutsche Bank	495		Inc (Reit)	Merrill Lynch	(124)
509	Bed Bath & Beyond Inc	Credit Suisse	537	(98)	Broadcom Inc	Citibank	(1.092)
(60)	Belden Inc	Deutsche Bank	11	(14)	Broadcom Inc	JP Morgan	(152)
(87)	Belden Inc	JP Morgan	246	88	Broadridge Financial		
(64)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Citibank	285		Solutions Inc	Credit Suisse	342
(41)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Credit Suisse	116	369	Broadridge Financial		
(286)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	JP Morgan	808		Solutions Inc	JP Morgan	1.435
69	Berry Global Group Inc	Credit Suisse	29	(212)	Brown & Brown Inc	Bank of America	
563	Best Buy Co Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(82)
		Merrill Lynch	(4.793)	592	Bruker Corp	Citibank	(132)
50	Best Buy Co Inc	Credit Suisse	(298)	119	Brunswick Corp/DE	Credit Suisse	391
93	BGC Partners Inc 'A'	Bank of America		243	Burlington Stores Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(37)			Merrill Lynch	1.760
1.192	Big Lots Inc	Deutsche Bank	(1.596)	49	BWX Technologies Inc	Bank of America	
266	Big Lots Inc	JP Morgan	192			Merrill Lynch	(26)
(4)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Credit Suisse	(125)	322	BWX Technologies Inc	Citibank	(238)
(142)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	JP Morgan	(4.431)	153	CA Inc	JP Morgan	120
18	Bio-Techne Corp	Bank of America		301	CA Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	2			Merrill Lynch	49
54	Bio-Techne Corp	Credit Suisse	17	812	CA Inc	Deutsche Bank	132
22	Bio-Techne Corp	Deutsche Bank	3	(6)	Cable One Inc	Bank of America	
167	Biogen Inc	Credit Suisse	4.157			Merrill Lynch	90
19	Biogen Inc	Citibank	310	407	Cabot Corp	Bank of America	
13	Biogen Inc	Deutsche Bank	253			Merrill Lynch	(262)
83	Biogen Inc	JP Morgan	2.066	130	Cabot Oil & Gas Corp	Citibank	15
(114)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America		1.290	Cabot Oil & Gas Corp	Deutsche Bank	(310)
		Merrill Lynch	(238)	39	CACI International Inc 'A'	Credit Suisse	243
(215)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Citibank	(650)	179	Cadence Design Systems Inc	Deutsche Bank	238
(142)	BioMarin Pharmaceutical Inc	JP Morgan	(526)	1.373	Cadence Design Systems Inc	JP Morgan	2.039
(435)	Black Hills Corp	Credit Suisse	4	(519)	Caesars Entertainment Corp	Bank of America	
(127)	Black Hills Corp	Deutsche Bank	(118)			Merrill Lynch	156
(393)	Black Knight Inc	JP Morgan	(34)	(106)	Caesars Entertainment Corp	Credit Suisse	(50)
(250)	Blackbaud Inc	Citibank	(28)	(5.990)	Caesars Entertainment Corp	Deutsche Bank	1.799
(6)	Blackbaud Inc	Credit Suisse	18	(126)	Cal-Maine Foods Inc	Bank of America	
(1.666)	Blackstone Mortgage					Merrill Lynch	(87)
	Trust Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	(858)	(772)	Cal-Maine Foods Inc	Deutsche Bank	(530)
1.938	Bloomin' Brands Inc	JP Morgan	(4.275)	(629)	Callon Petroleum Co	Citibank	788
(156)	Bluebird Bio Inc	Citibank	234	(5.560)	Callon Petroleum Co	JP Morgan	10.451
(164)	Blueprint Medicines Corp	Citibank	(159)	78	Camden Property Trust (Reit)	Deutsche Bank	244
19	Boeing Co/The	Credit Suisse	267	172	Campbell Soup Co	JP Morgan	(1.060)
53	Boeing Co/The	Citibank	(13)				

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(250)	Capital One Financial Corp	Bank of America		27	Chemours Co/The	Credit Suisse	(15)
		Merrill Lynch	337	346	Chemours Co/The	JP Morgan	(193)
(49)	Capital One Financial Corp	Deutsche Bank	66	(935)	Cheniere Energy Inc	Bank of America	
176	Capitol Federal Financial Inc	Credit Suisse	44			Merrill Lynch	(3.996)
1.012	Capitol Federal Financial Inc	JP Morgan	252	(56)	Cheniere Energy Inc	Citibank	(244)
190	Capitol Federal Financial Inc	Citibank	(7)	(45)	Cheniere Energy Inc	JP Morgan	(184)
290	Capitol Federal Financial Inc	Deutsche Bank	45	504	Chevron Corp	Bank of America	
(40)	Cardinal Health Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(2.505)
		Merrill Lynch	54	1.136	Chimera Investment		
(87)	Cardinal Health Inc	Deutsche Bank	118		Corp (Reit)	JP Morgan	614
(64)	Cardinal Health Inc	JP Morgan	3	(87)	Chipotle Mexican Grill Inc	Citibank	(261)
(143)	Carlisle Cos Inc	Bank of America		(17)	Chipotle Mexican Grill Inc	Deutsche Bank	(151)
		Merrill Lynch	(412)	160	Choice Hotels International Inc	JP Morgan	79
(787)	CarMax Inc	Credit Suisse	(3.823)	(183)	Chubb Ltd	Deutsche Bank	602
(109)	CarMax Inc	Citibank	(341)	(207)	Church & Dwight Co Inc	JP Morgan	115
(169)	CarMax Inc	Deutsche Bank	(553)	(14)	Churchill Downs Inc	Citibank	54
(78)	CarMax Inc	JP Morgan	(379)	127	Cigna Corp	Credit Suisse	179
108	Carnival Corp	Bank of America		5	Cigna Corp	JP Morgan	7
		Merrill Lynch	(206)	184	Cigna Corp	Bank of America	
70	Carnival Corp	Citibank	(126)			Merrill Lynch	(587)
(211)	Carpenter Technology Corp	Bank of America		787	Cimarex Energy Co	Citibank	(3.492)
		Merrill Lynch	(386)	115	Cimarex Energy Co	Credit Suisse	(580)
(26)	Carpenter Technology Corp	JP Morgan	(90)	(21)	Cimpress NV	Deutsche Bank	(12)
158	Carter's Inc	Deutsche Bank	438	(25)	Cimpress NV	JP Morgan	(45)
217	Carter's Inc	JP Morgan	1.311	(267)	Cincinnati Financial Corp	Credit Suisse	277
(28)	Casey's General Stores Inc	Bank of America		(194)	Cinemark Holdings Inc	Citibank	155
		Merrill Lynch	61	(55)	Cinemark Holdings Inc	JP Morgan	241
(20)	Casey's General Stores Inc	Credit Suisse	15	39	Cintas Corp	Bank of America	
(126)	Casey's General Stores Inc	JP Morgan	92			Merrill Lynch	14
(222)	Catalent Inc	Credit Suisse	(67)	76	Cintas Corp	Credit Suisse	452
(55)	Catalent Inc	JP Morgan	(17)	264	Cisco Systems Inc	Bank of America	
630	Cathay General Bancorp	Credit Suisse	622			Merrill Lynch	(562)
62	Cathay General Bancorp	Citibank	(20)	614	Cisco Systems Inc	Citibank	(343)
(133)	Cboe Global Markets Inc	Bank of America		47	CIT Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	1.084			Merrill Lynch	(145)
667	CBRE Group Inc 'A'	Deutsche Bank	17	461	CIT Group Inc	JP Morgan	(1.195)
135	CBRE Group Inc 'A'	JP Morgan	56	(99)	Citigroup Inc	Deutsche Bank	568
342	CBS Corp 'B non-voting share'	JP Morgan	(267)	(194)	Citigroup Inc	JP Morgan	833
38	CDK Global Inc	Bank of America		678	Citizens Financial Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	25			Merrill Lynch	(1.298)
711	CDK Global Inc	Citibank	915	108	Citizens Financial Group Inc	Credit Suisse	(77)
36	Celanese Corp 'A'	Credit Suisse	194	539	Citrix Systems Inc	Credit Suisse	(282)
308	Celanese Corp 'A'	Citibank	293	97	Citrix Systems Inc	Deutsche Bank	45
185	Celgene Corp	Credit Suisse	(800)	(54)	Clean Harbors Inc	Credit Suisse	(73)
418	Celgene Corp	Bank of America		(155)	Clean Harbors Inc	Deutsche Bank	(233)
		Merrill Lynch	(1.396)	(688)	Clean Harbors Inc	JP Morgan	(933)
188	Celgene Corp	Citibank	239	51	Clorox Co/The	Bank of America	
(86)	Centennial Resource					Merrill Lynch	218
	Development Inc/DE 'A'	Citibank	106	217	Clorox Co/The	JP Morgan	685
(3.872)	Centennial Resource			(211)	Clovis Oncology Inc	Citibank	377
	Development Inc/DE 'A'	Deutsche Bank	4.553	(322)	Clovis Oncology Inc	JP Morgan	(1.448)
105	CenterPoint Energy Inc	Credit Suisse	(44)	487	CMS Energy Corp	Citibank	798
2.062	CenterPoint Energy Inc	JP Morgan	(867)	(113)	Coca-Cola Co/The	Bank of America	
(1.398)	CenturyLink Inc	Citibank	1.224			Merrill Lynch	(96)
(503)	CenturyLink Inc	Deutsche Bank	475	(37)	Coca-Cola Co/The	Credit Suisse	(29)
(68)	Cerner Corp	Citibank	(12)	(148)	Coca-Cola Co/The	Citibank	(58)
(122)	CF Industries Holdings Inc	Bank of America		(222)	Coca-Cola Co/The	Deutsche Bank	(189)
		Merrill Lynch	48	(97)	Coca-Cola Co/The	JP Morgan	(75)
(417)	CF Industries Holdings Inc	JP Morgan	(1.249)	(617)	Coca-Cola European		
54	CH Robinson Worldwide Inc	JP Morgan	209		Partners Plc	Credit Suisse	106
218	Charles River Laboratories			(511)	Coca-Cola European		
	International Inc	JP Morgan	438		Partners Plc	Deutsche Bank	75
(46)	Charles Schwab Corp/The	Credit Suisse	67	(187)	Cognex Corp	Bank of America	
(121)	Charles Schwab Corp/The	Deutsche Bank	333			Merrill Lynch	189
495	Cheesecake Factory Inc/The	JP Morgan	(892)	(176)	Cognex Corp	Credit Suisse	122
19	Chemed Corp	Bank of America		(42)	Cognex Corp	Citibank	5
		Merrill Lynch	1	107	Cognizant Technology		
251	Chemed Corp	Citibank	118		Solutions Corp 'A'	JP Morgan	45
(574)	Chemical Financial Corp	JP Morgan	(345)				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
27	Coherent Inc	Bank of America		(2.003)	Cousins Properties Inc (Reit)	Bank of America	
(228)	Colfax Corp	Merrill Lynch	(84)	(1.089)	Covanta Holding Corp	Merrill Lynch	(834)
(982)	Colfax Corp	Credit Suisse	63	294	Cracker Barrel Old Country Store Inc	JP Morgan	(771)
413	Colgate-Palmolive Co	JP Morgan	270	302	Crane Co	Citibank	565
1.579	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Citibank	411	39	Credit Acceptance Corp	Deutsche Bank	(220)
(233)	Comcast Corp 'A'	Bank of America	623	8	Credit Acceptance Corp	Citibank	(477)
(114)	Comcast Corp 'A'	Merrill Lynch	196	(84)	Cree Inc	Deutsche Bank	48
231	Comerica Inc	Credit Suisse	(43)	(1.028)	Cree Inc	Citibank	(155)
35	Comerica Inc	Bank of America		(203)	Crown Castle International Corp (Reit)	Deutsche Bank	(3.335)
37	Comerica Inc	Merrill Lynch	(819)	408	Crown Holdings Inc	JP Morgan	(164)
70	Commerce Bancshares Inc/MO	Credit Suisse	(45)	59	Crown Holdings Inc	JP Morgan	(95)
404	Commerce Bancshares Inc/MO	Deutsche Bank	(131)	(155)	CSX Corp	Deutsche Bank	3
(173)	Commercial Metals Co	Credit Suisse	(8)	(70)	CSX Corp	Bank of America	
(74)	CommScope Holding Co Inc	Citibank	(274)	(220)	CSX Corp	Merrill Lynch	(367)
(530)	CommScope Holding Co Inc	Credit Suisse	(333)	308	CubeSmart (Reit)	Credit Suisse	(288)
194	Community Bank System Inc	Bank of America		35	CubeSmart (Reit)	Deutsche Bank	(521)
(90)	Compass Minerals International Inc	Merrill Lynch	(1)	106	CubeSmart (Reit)	Credit Suisse	48
(120)	Compass Minerals International Inc	Citibank	136	166	Cullen/Frost Bankers Inc	JP Morgan	16
(356)	Compass Minerals International Inc	JP Morgan	185	405	Cummins Inc	Deutsche Bank	(473)
781	Conagra Brands Inc	Credit Suisse	224	37	Cummins Inc	Bank of America	
176	Conagra Brands Inc	Deutsche Bank	335	249	Cummins Inc	Merrill Lynch	(601)
(64)	Concho Resources Inc	JP Morgan	886	152	Curtiss-Wright Corp	Credit Suisse	(41)
(48)	Concho Resources Inc	Bank of America	(215)	(45)	CVS Health Corp	Deutsche Bank	(463)
(38)	Concho Resources Inc	Merrill Lynch	—	(70)	CyrusOne Inc (Reit)	Credit Suisse	256
(187)	Conduent Inc	JP Morgan	1.087	(664)	CyrusOne Inc (Reit)	JP Morgan	(158)
(207)	Conduent Inc	Credit Suisse	311	1.307	Dana Inc	Bank of America	(120)
78	ConocoPhillips	Deutsche Bank	318	148	Dana Inc	Merrill Lynch	(940)
1.773	ConocoPhillips	JP Morgan	(26)	18	Dana Inc	Citibank	(1.526)
52	Consolidated Edison Inc	Credit Suisse	31	(183)	Danaher Corp	Deutsche Bank	(201)
261	Consolidated Edison Inc	JP Morgan	18	(60)	Danaher Corp	Bank of America	
(54)	Constellation Brands Inc 'A'	Credit Suisse	(411)	84	Darden Restaurants Inc	Merrill Lynch	(102)
311	Convergys Corp	Deutsche Bank	(7)	89	Darden Restaurants Inc	Credit Suisse	(88)
1.832	Convergys Corp	JP Morgan	(64)	119	Darden Restaurants Inc	Bank of America	
186	Copart Inc	Citibank	35	97	Darden Restaurants Inc	Merrill Lynch	81
51	Core Laboratories NV	Deutsche Bank	(1.667)	(1.308)	Darling Ingredients Inc	Credit Suisse	(294)
61	Core Laboratories NV	Credit Suisse	437	33	DaVita Inc	Deutsche Bank	114
375	Core Laboratories NV	Bank of America	32	606	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(321)
19	Core Laboratories NV	Merrill Lynch	46	102	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	Citibank	(741)
(57)	CoreCivic Inc (Reit)	Credit Suisse	238	(202)	DDR Corp	Credit Suisse	108
698	CoreLogic Inc/United States	Deutsche Bank	14	(1.062)	DDR Corp	Credit Suisse	(182)
(587)	Cornerstone OnDemand Inc	JP Morgan	821	136	Deckers Outdoor Corp	Bank of America	108
(77)	Cornerstone OnDemand Inc	Merrill Lynch	(52)	102	Deckers Outdoor Corp	Merrill Lynch	(74)
(393)	Corning Inc	Citibank	(1.189)	136	Deere & Co	Credit Suisse	(340)
(280)	Corning Inc	Deutsche Bank	(221)	34	Dell Technologies Inc Class V	Credit Suisse	1.779
233	Corporate Office Properties Trust (Reit)	Bank of America	132	359	Dell Technologies Inc Class V	Citibank	800
(81)	CoStar Group Inc	Merrill Lynch	94	406	Delphi Technologies Plc	JP Morgan	(1.137)
26	Costco Wholesale Corp	Credit Suisse	97	406	Delta Air Lines Inc	Credit Suisse	266
81	Costco Wholesale Corp	Deutsche Bank	233	15	Delta Air Lines Inc	Deutsche Bank	2.222
(109)	Cotiviti Holdings Inc	Credit Suisse	(91)	797	Deluxe Corp	Citibank	(1.080)
(527)	Cotiviti Holdings Inc	JP Morgan	(439)	(568)	DENTSPLY SIRONA Inc	Credit Suisse	230
(873)	Coty Inc 'A'	Deutsche Bank	788	(136)	DENTSPLY SIRONA Inc	Deutsche Bank	23
(780)	Coty Inc 'A'	Bank of America		1.314	Devon Energy Corp	Credit Suisse	(2.004)
(2.217)	Coty Inc 'A'	Merrill Lynch	509	580	Devon Energy Corp	Bank of America	
		Credit Suisse	4.928	(641)	DexCom Inc	Merrill Lynch	1.467
				386	Diamond Offshore Drilling Inc	Citibank	271
				1.849	Diamond Offshore Drilling Inc	Citibank	(79)
				(62)	Diamondback Energy Inc	JP Morgan	1.349
				(137)	Diamondback Energy Inc	JP Morgan	(1.628)
						Credit Suisse	(295)
						JP Morgan	(1.412)
						Bank of America	
						Merrill Lynch	372
						Credit Suisse	1.551

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
63	Dick's Sporting Goods Inc	JP Morgan	402	139	Empire State Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America	
568	Dick's Sporting Goods Inc	Citibank	3.710			Merrill Lynch	45
149	Dick's Sporting Goods Inc	Deutsche Bank	628	176	Encompass Health Corp	Citibank	219
(39)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America		60	Encompass Health Corp	Deutsche Bank	134
		Merrill Lynch	(5)	719	Encompass Health Corp	JP Morgan	1.172
(367)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	(891)	259	Energen Corp	Citibank	(200)
(38)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Citibank	(34)	455	Energizer Holdings Inc	Deutsche Bank	2.066
113	Discover Financial Services	Citibank	(417)	76	EnerSys	Deutsche Bank	439
762	Discovery Inc 'A'	Bank of America		(2.749)	Ensco Plc 'A'	Citibank	1.864
		Merrill Lynch	(1.328)	(7.007)	Ensco Plc 'A'	Deutsche Bank	2.947
(314)	DISH Network Corp 'A'	JP Morgan	1.053	(31)	Enstar Group Ltd	JP Morgan	122
328	Dolby Laboratories Inc 'A'	JP Morgan	217	94	Entegris Inc	Deutsche Bank	(12)
(212)	Dollar Tree Inc	Citibank	1.696	286	Entegris Inc	JP Morgan	172
(609)	Dominion Energy Inc	Credit Suisse	(193)	615	Entergy Corp	Deutsche Bank	1.351
(60)	Dominion Energy Inc	JP Morgan	(19)	(101)	Envision Healthcare Corp	Bank of America	
100	Domino's Pizza Inc	Deutsche Bank	265			Merrill Lynch	(114)
35	Domtar Corp	Credit Suisse	114	(614)	Envision Healthcare Corp	JP Morgan	(2.250)
679	Domtar Corp	Deutsche Bank	1.439	669	EOG Resources Inc	Deutsche Bank	(459)
96	Donaldson Co Inc	Credit Suisse	98	(374)	EPAM Systems Inc	Citibank	(347)
174	Donaldson Co Inc	JP Morgan	178	15	EPR Properties (Reit)	Credit Suisse	48
388	Donaldson Co Inc	Deutsche Bank	127	484	EPR Properties (Reit)	Citibank	482
(61)	Dorman Products Inc	Credit Suisse	75	(634)	EQT Corp	Bank of America	
(218)	Dorman Products Inc	Deutsche Bank	71			Merrill Lynch	435
(22)	Dorman Products Inc	JP Morgan	27	(658)	EQT Corp	JP Morgan	(514)
303	Douglas Emmett Inc (Reit)	JP Morgan	(5)	(186)	Equifax Inc	Bank of America	
(584)	DR Horton Inc	Credit Suisse	1.253			Merrill Lynch	(262)
328	DTE Energy Co	Deutsche Bank	163	(12)	Equifax Inc	Deutsche Bank	(17)
(89)	Duke Energy Corp	Bank of America		(62)	Equinix Inc (Reit)	Credit Suisse	(574)
		Merrill Lynch	5	(10)	Equinix Inc (Reit)	Deutsche Bank	(93)
(279)	Duke Energy Corp	Citibank	(670)	(3)	Equinix Inc (Reit)	JP Morgan	(28)
1.428	Duke Realty Corp (Reit)	JP Morgan	(233)	89	Equity Commonwealth (Reit)	Credit Suisse	(27)
26	Dun & Bradstreet Corp/The	Credit Suisse	177	985	Equity Commonwealth (Reit)	JP Morgan	(296)
19	Dun & Bradstreet Corp/The	Bank of America		109	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	9			Merrill Lynch	222
169	Dun & Bradstreet Corp/The	Citibank	141	524	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Citibank	1.489
(161)	Dunkin' Brands Group Inc	Bank of America		52	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	JP Morgan	9
		Merrill Lynch	93	493	Equity Residential (Reit)	JP Morgan	732
(55)	Dunkin' Brands Group Inc	Credit Suisse	22	(5)	Erie Indemnity Co 'A'	Citibank	8
(130)	Dycom Industries Inc	Citibank	(277)	(316)	Erie Indemnity Co 'A'	Deutsche Bank	84
111	E*TRADE Financial Corp	Bank of America		742	Essent Group Ltd	Credit Suisse	(930)
		Merrill Lynch	(51)	142	Essent Group Ltd	Citibank	(104)
428	E*TRADE Financial Corp	Credit Suisse	264	70	Essex Property Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(130)
472	East West Bancorp Inc	Credit Suisse	628	71	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Deutsche Bank	454
46	EastGroup Properties Inc (Reit)	Citibank	135	144	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Bank of America	
415	EastGroup Properties Inc (Reit)	JP Morgan	232			Merrill Lynch	1.017
425	Eastman Chemical Co	JP Morgan	(263)	265	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	JP Morgan	3.227
335	eBay Inc	Bank of America		169	Euronet Worldwide Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(158)			Merrill Lynch	(19)
219	EchoStar Corp 'A'	Citibank	(498)	34	Evercore Inc 'A'	Citibank	(175)
35	EchoStar Corp 'A'	Deutsche Bank	(112)	184	Evercore Inc 'A'	Deutsche Bank	(442)
(223)	Ecolab Inc	Credit Suisse	459	51	Evercore Inc 'A'	JP Morgan	(20)
(61)	Ecolab Inc	JP Morgan	126	165	Everest Re Group Ltd	Credit Suisse	(333)
126	Edison International	JP Morgan	90	(53)	Eversource Energy	Bank of America	
(801)	Education Realty Trust Inc (Reit)	JP Morgan	(1.561)			Merrill Lynch	15
159	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America		(247)	Eversource Energy	JP Morgan	53
		Merrill Lynch	364	(360)	Exact Sciences Corp	Bank of America	
69	Edwards Lifesciences Corp	Citibank	146			Merrill Lynch	(3.275)
55	Electronic Arts Inc	JP Morgan	375	(15)	Exact Sciences Corp	Deutsche Bank	(136)
10	Eli Lilly & Co	Bank of America		(167)	Exelixis Inc	Credit Suisse	77
		Merrill Lynch	19	539	Exelon Corp	Credit Suisse	178
638	Eli Lilly & Co	Citibank	1.188	300	Exelon Corp	Citibank	323
(790)	Ellie Mae Inc	Bank of America		(57)	Expedia Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(4.238)			Merrill Lynch	(260)
332	EMCOR Group Inc	Bank of America		(229)	Expedia Group Inc	Deutsche Bank	(1.046)
		Merrill Lynch	570	583	Expeditors International of Washington Inc	Citibank	1.096
41	EMCOR Group Inc	Deutsche Bank	70				

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
117	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	594	(4.522)	FNB Corp/PA	Bank of America	
1.115	Express Scripts Holding Co	Citibank	(1.612)	(74)	FNB Corp/PA	Merrill Lynch	1.126
(312)	Extended Stay America Inc (Unit)	Credit Suisse	(284)	(408)	FNF Group	Deutsche Bank	18
166	Extra Space Storage Inc (Reit)	Citibank	557	539	Ford Motor Co	Citibank	193
1.039	Exxon Mobil Corp	Citibank	(794)	1.909	Ford Motor Co	Deutsche Bank	171
358	F5 Networks Inc	Credit Suisse	1.214	(229)	Forest City Realty Trust Inc 'A' (Reit)	JP Morgan	524
37	F5 Networks Inc	JP Morgan	125	438	Fortinet Inc	Credit Suisse	(86)
(34)	Facebook Inc 'A'	Credit Suisse	(299)	124	Fortinet Inc	JP Morgan	1.808
(55)	Facebook Inc 'A'	Deutsche Bank	(229)	159	Fortinet Inc	Citibank	512
70	FactSet Research Systems Inc	Credit Suisse	502	125	Fortune Brands Home & Security Inc	Citibank	407
123	Fair Isaac Corp	Credit Suisse	1.046	1.316	Franklin Resources Inc	JP Morgan	177
19	Fair Isaac Corp	JP Morgan	162	173	Freeport-McMoRan Inc	Citibank	(1.152)
100	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Citibank	186	1.531	Freeport-McMoRan Inc	Citibank	15
7	Federal Realty Investment Trust (Reit)	JP Morgan	6	298	Freeport-McMoRan Inc	JP Morgan	1.906
27	FedEx Corp	Deutsche Bank	124	45	Fresh Del Monte Produce Inc	Citibank	(207)
(68)	FibroGen Inc	Bank of America		844	Fulton Financial Corp	Credit Suisse	6
(43)	Fidelity National Information Services Inc	Merrill Lynch	(166)	39	Fulton Financial Corp	Deutsche Bank	181
(247)	Fidelity National Information Services Inc	JP Morgan	55	307	Fulton Financial Corp	JP Morgan	5
666	Fifth Third Bancorp	Bank of America		307	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	Bank of America	
(702)	Financial Engines Inc	Merrill Lynch	(2.161)	170	Gap Inc/The	Merrill Lynch	117
(81)	Financial Engines Inc	Citibank	(60)	1.209	Gap Inc/The	Credit Suisse	(15)
(1.552)	Finisar Corp	Deutsche Bank	—	585	Gap Inc/The	Citibank	(3.248)
(259)	Finisar Corp	Credit Suisse	320	(616)	Gardner Denver Holdings Inc	JP Morgan	(50)
(175)	Finisar Corp	Deutsche Bank	47	(200)	Gardner Denver Holdings Inc	Bank of America	
(1.359)	FireEye Inc	JP Morgan	36	20	Garmin Ltd	Merrill Lynch	312
(216)	FireEye Inc	Bank of America	1.236	70	Garmin Ltd	Deutsche Bank	101
498	First American Financial Corp	Merrill Lynch	200	(45)	Gartner Inc	Citibank	1
(9)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Credit Suisse	(4)	(288)	Gartner Inc	Deutsche Bank	78
(165)	First Financial Bankshares Inc	JP Morgan	104	(57)	Gartner Inc	Citibank	(50)
(128)	First Hawaiian Inc	Bank of America	(184)	589	GATX Corp	Deutsche Bank	625
(166)	First Horizon National Corp	Merrill Lynch	(51)	(77)	GCI Liberty Inc	JP Morgan	(103)
(1.177)	First Horizon National Corp	Credit Suisse	88	(450)	GCI Liberty Inc 'A'	Bank of America	
1.509	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Citibank	141	38	Generac Holdings Inc	Merrill Lynch	583
(140)	First Republic Bank/CA	Bank of America	1.528	356	Generac Holdings Inc	JP Morgan	96
(333)	First Republic Bank/CA	Merrill Lynch	(187)	(3.966)	General Electric Co	Citibank	98
1.398	FirstEnergy Corp	Credit Suisse	(835)	(1.378)	General Electric Co	Citibank	4.204
162	FirstEnergy Corp	Bank of America	88	(486)	General Electric Co	Bank of America	
451	Fiserv Inc	Merrill Lynch	89	(1.386)	General Electric Co	Merrill Lynch	775
44	Fiserv Inc	Credit Suisse	852	466	General Motors Co	Credit Suisse	90
(168)	Five Below Inc	JP Morgan	83	1.338	General Motors Co	Deutsche Bank	779
(209)	FleetCor Technologies Inc	Bank of America	601	(68)	General Motors Co	Citibank	1.516
(388)	Flex Ltd	Merrill Lynch	(176)	(936)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	JP Morgan	6.592
(208)	Floor & Decor Holdings Inc	Citibank	67	152	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Citibank	(111)
(263)	Floor & Decor Holdings Inc	Credit Suisse	(255)	(210)	Gentex Corp	JP Morgan	(2.539)
538	Flowers Foods Inc	Deutsche Bank	(330)	(121)	Genuine Parts Co	Credit Suisse	104
(159)	Flowserve Corp	Credit Suisse	(997)	(145)	Genuine Parts Co	Credit Suisse	(162)
(83)	Flowserve Corp	Bank of America	257	(158)	GEO Group Inc/The (Reit)	Citibank	114
(756)	Flowserve Corp	Merrill Lynch	134	(171)	GEO Group Inc/The (Reit)	Bank of America	
(51)	FMC Corp	Deutsche Bank	3.361	(346)	GEO Group Inc/The (Reit)	Merrill Lynch	(231)
(34)	FMC Corp	JP Morgan	143	379	Gilead Sciences Inc	Credit Suisse	(99)
(22)	FMC Corp	Bank of America	63	1.181	Gilead Sciences Inc	Citibank	(145)
(89)	FMC Corp	Merrill Lynch	41	108	Glacier Bancorp Inc	Deutsche Bank	(552)
		JP Morgan	(34)	(366)	Global Payments Inc	Bank of America	156
					Global Payments Inc	Credit Suisse	2.635
					GoDaddy Inc 'A'	JP Morgan	97
					Goodyear Tire & Rubber Co/The	Bank of America	
					Graco Inc	Merrill Lynch	735
						Deutsche Bank	58
						JP Morgan	(416)
							(432)
							660

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
1	Graham Holdings Co 'B'	Bank of America		284	Hershey Co/The	Credit Suisse	(305)
		Merrill Lynch	(18)	993	Hewlett Packard Enterprise Co	Credit Suisse	(1.602)
27	Graham Holdings Co 'B'	Citibank	(227)	1.606	Hewlett Packard Enterprise Co	Citibank	(2.619)
4	Graham Holdings Co 'B'	Deutsche Bank	(74)	(382)	Hexcel Corp	JP Morgan	(984)
(710)	Gramercy Property Trust (Reit)	JP Morgan	(30)	838	Highwoods Properties		
988	Graphic Packaging Holding Co	Deutsche Bank	585		Inc (Reit)	Credit Suisse	841
(485)	Great Plains Energy Inc	Credit Suisse	(778)	40	Highwoods Properties		
406	Green Dot Corp 'A'	JP Morgan	3.498		Inc (Reit)	Deutsche Bank	89
1.046	Groupon Inc	Bank of America		164	Hill-Rom Holdings Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(85)			Merrill Lynch	708
395	Groupon Inc	JP Morgan	(22)	61	Hill-Rom Holdings Inc	Deutsche Bank	263
(925)	Guidewire Software Inc	Bank of America		286	Hillenbrand Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(2.048)			Merrill Lynch	(131)
(71)	Guidewire Software Inc	Deutsche Bank	(157)	131	Hillenbrand Inc	Credit Suisse	112
(2.642)	Gulfport Energy Corp	Credit Suisse	(4.671)	120	Hillenbrand Inc	JP Morgan	103
734	H&R Block Inc	Deutsche Bank	88	(974)	Hilltop Holdings Inc	Citibank	(184)
121	H&R Block Inc	JP Morgan	12	(75)	Hilton Worldwide	Bank of America	
90	Haemonetics Corp	Bank of America			Holdings Inc	Merrill Lynch	104
		Merrill Lynch	289	(244)	Hilton Worldwide		
170	Haemonetics Corp	Deutsche Bank	546		Holdings Inc	Citibank	285
(772)	Hain Celestial Group Inc/The	Deutsche Bank	477	(58)	Hilton Worldwide		
(36)	Hain Celestial Group Inc/The	Citibank	(2)		Holdings Inc	Deutsche Bank	81
162	Halliburton Co	Credit Suisse	(259)	712	HollyFrontier Corp	Bank of America	
71	Halliburton Co	Deutsche Bank	(165)			Merrill Lynch	6.514
900	Halliburton Co	JP Morgan	(1.437)	(570)	Hologic Inc	Credit Suisse	(1.008)
(79)	Hancock Holding Co	JP Morgan	(19)	(1.034)	Home BancShares Inc/AR	Credit Suisse	435
(482)	Hanesbrands Inc	Deutsche Bank	(484)	4	Home Depot Inc/The	Deutsche Bank	(5)
256	Hanover Insurance	Bank of America		158	Home Depot Inc/The	JP Morgan	213
	Group Inc/The	Merrill Lynch	578	(35)	Honeywell International Inc	Citibank	41
(492)	Harley-Davidson Inc	Deutsche Bank	(89)	(45)	Honeywell International Inc	Credit Suisse	(204)
(38)	Harris Corp	Bank of America		(1.952)	Hope Bancorp Inc	Citibank	469
		Merrill Lynch	114	(159)	Hope Bancorp Inc	Deutsche Bank	(19)
(25)	Harris Corp	Citibank	(14)	847	Host Hotels & Resorts		
(21)	Harris Corp	JP Morgan	46		Inc (Reit)	JP Morgan	1.236
274	Hartford Financial Services			(21)	Howard Hughes Corp/The	JP Morgan	117
	Group Inc/The	Citibank	(263)	389	HP Inc	Credit Suisse	102
69	Hartford Financial Services			161	HP Inc	Citibank	27
	Group Inc/The	JP Morgan	4	1.980	HP Inc	JP Morgan	518
61	Hasbro Inc	JP Morgan	(16)	(149)	HRG Group Inc	Citibank	(55)
276	Hawaiian Holdings Inc	Credit Suisse	201	45	Hubbell Inc	Citibank	(59)
71	Hawaiian Holdings Inc	Deutsche Bank	18	(28)	HubSpot Inc	Citibank	(178)
(62)	HB Fuller Co	JP Morgan	(40)	(135)	Hudson Pacific Properties	Bank of America	
749	HCA Healthcare Inc	Citibank	656		Inc (Reit)	Merrill Lynch	(175)
(210)	HCP Inc (Reit)	Credit Suisse	(56)	(40)	Hudson Pacific Properties		
(889)	HCP Inc (Reit)	Deutsche Bank	(351)		Inc (Reit)	Deutsche Bank	(52)
192	HD Supply Holdings Inc	Credit Suisse	191	(961)	Hudson Pacific Properties		
110	HD Supply Holdings INC	JP Morgan	110		Inc (Reit)	JP Morgan	(668)
226	Healthcare Realty			165	Humana Inc	Bank of America	
	Trust Inc (Reit)	Credit Suisse	(50)			Merrill Lynch	599
(264)	Healthcare Services			30	Humana Inc	Citibank	58
	Group Inc	Deutsche Bank	129	(1.982)	Huntington Bancshares		
(69)	Healthcare Services Group Inc	Bank of America			Inc/OH	JP Morgan	153
		Merrill Lynch	36	58	Huntington Ingalls	Bank of America	
(86)	Healthcare Services Group Inc	Citibank	10		Industries Inc	Merrill Lynch	234
(452)	Healthcare Services Group Inc	JP Morgan	574	27	Huntington Ingalls		
(905)	Healthcare Trust of America				Industries Inc	JP Morgan	28
	Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	(202)	924	Huntsman Corp	Credit Suisse	2.276
(616)	HealthEquity Inc	Bank of America		116	Huntsman Corp	JP Morgan	286
		Merrill Lynch	(3.072)	578	Huntsman Corp	Bank of America	
51	Heartland Express Inc	JP Morgan	59			Merrill Lynch	94
272	Heartland Express Inc	Deutsche Bank	243	(7)	Iberiabank Corp	Bank of America	
(106)	HEICO Corp 'A'	Credit Suisse	(136)			Merrill Lynch	(12)
183	Helen of Troy Ltd	JP Morgan	86	(349)	Iberiabank Corp	Credit Suisse	(1.063)
(49)	Henry Schein Inc	JP Morgan	6	293	IDACORP Inc	Credit Suisse	339
235	Herman Miller Inc	Bank of America		31	IDEX Corp	Credit Suisse	80
		Merrill Lynch	232	79	IDEX Corp	Deutsche Bank	154
700	Herman Miller Inc	Deutsche Bank	691	193	IDEXX Laboratories Inc	JP Morgan	959
13	Hershey Co/The	Bank of America		(147)	ILG Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(20)			Merrill Lynch	(101)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(1.067)	ILG Inc	Credit Suisse	(403)	375	ITT Inc	Citibank	(653)
367	Illinois Tool Works Inc	Bank of America		101	ITT Inc	Deutsche Bank	(62)
		Merrill Lynch	(117)	(92)	j2 Global Inc	Bank of America	
30	Illinois Tool Works Inc	Citibank	(43)			Merrill Lynch	(61)
(15)	Illumina Inc	Deutsche Bank	(112)	(26)	j2 Global Inc	Deutsche Bank	(17)
(63)	Illumina Inc	Credit Suisse	(882)	1.154	Jabil Inc	Deutsche Bank	971
(168)	Incyte Corp	Bank of America		171	Jabil Inc	JP Morgan	195
		Merrill Lynch	(185)	275	Jack Henry & Associates Inc	JP Morgan	522
(259)	Incyte Corp	Credit Suisse	(1.254)	(150)	Jacobs Engineering Group Inc	JP Morgan	(331)
235	Ingersoll-Rand Plc	Deutsche Bank	(83)	(277)	Jagged Peak Energy Inc	Deutsche Bank	259
257	Ingredion Inc	JP Morgan	523	(2.526)	Jagged Peak Energy Inc	JP Morgan	3.989
(159)	Insulet Corp	Credit Suisse	(1.502)	30	Jazz Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	534
(102)	Insulet Corp	JP Morgan	(964)	(200)	JB Hunt Transport Services Inc	JP Morgan	(1.783)
(429)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Credit Suisse	48	583	JBG SMITH Properties (Reit)	JP Morgan	455
(58)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Deutsche Bank	(73)	(598)	JELD-WEN Holding Inc	Credit Suisse	960
(22)	Integrated Device Technology Inc	Credit Suisse	(79)	28	JM Smucker Co/The	Bank of America	
(323)	Integrated Device Technology Inc	JP Morgan	(1.159)			Merrill Lynch	(87)
259	Intel Corp	Credit Suisse	445	(366)	John Bean Technologies Corp	JP Morgan	(94)
195	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Deutsche Bank	(749)	23	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America	
(411)	Intercept Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	18			Merrill Lynch	38
(450)	Intercontinental Exchange Inc	Credit Suisse	(568)	307	John Wiley & Sons Inc 'A'	Credit Suisse	316
(71)	Intercontinental Exchange Inc	Deutsche Bank	22	87	John Wiley & Sons Inc 'A'	Deutsche Bank	146
(66)	InterDigital Inc/PA	Bank of America		430	Johnson & Johnson	Citibank	(705)
		Merrill Lynch	(62)	47	Johnson & Johnson	Deutsche Bank	(167)
(14)	InterDigital Inc/PA	Deutsche Bank	(13)	178	Johnson & Johnson	JP Morgan	(246)
(206)	International Bancshares Corp	Credit Suisse	(420)	27	Jones Lang LaSalle Inc	Deutsche Bank	(61)
27	International Business Machines Corp	Credit Suisse	(19)	77	Jones Lang LaSalle Inc	JP Morgan	(743)
(33)	International Flavors & Fragrances Inc	Bank of America		307	JPMorgan Chase & Co	Credit Suisse	(1.049)
(46)	International Flavors & Fragrances Inc	Merrill Lynch	(2)	530	Juniper Networks Inc	Citibank	(91)
(200)	International Paper Co	Deutsche Bank	(3)	1.126	Juniper Networks Inc	Deutsche Bank	164
		Bank of America		(108)	Kansas City Southern	Deutsche Bank	(37)
(58)	International Paper Co	JP Morgan	(112)	390	KAR Auction Services Inc	Credit Suisse	(127)
257	Interpublic Group of Cos Inc/The	Bank of America		321	KBR Inc	Citibank	152
157	Interpublic Group of Cos Inc/The	Merrill Lynch	(375)	45	KBR Inc	JP Morgan	61
226	Interpublic Group of Cos Inc/The	Credit Suisse	(132)	189	KBR Inc	Deutsche Bank	250
(2.146)	InterXion Holding NV	Deutsche Bank	(330)	354	Kellogg Co	Deutsche Bank	978
20	Intuit Inc	JP Morgan	(976)	(281)	Kemper Corp	JP Morgan	(1.170)
		Bank of America		134	Kennametal Inc	Bank of America	
259	Intuit Inc	Merrill Lynch	203			Merrill Lynch	(115)
(8)	Intuitive Surgical Inc	Citibank	2.461	(168)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Bank of America	
881	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Citibank	(57)			Merrill Lynch	(281)
		Deutsche Bank	216	(2.358)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Citibank	(3.036)
885	Investors Bancorp Inc	Citibank	(266)	(761)	KeyCorp	JP Morgan	216
(161)	Invitation Homes Inc (Reit)	Credit Suisse	209	(919)	Keysight Technologies Inc	Deutsche Bank	(5.119)
(1.830)	Invitation Homes Inc (Reit)	JP Morgan	2.372	(17)	Keysight Technologies Inc	JP Morgan	(105)
(31)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	(153)	(374)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Citibank	(802)
(51)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America		99	Kimberly-Clark Corp	JP Morgan	66
		Merrill Lynch	(83)	(383)	Kimco Realty Corp (Reit)	Bank of America	
(90)	IPG Photonics Corp	Credit Suisse	(954)			Merrill Lynch	(437)
(13)	IPG Photonics Corp	Citibank	(14)	(257)	Kimco Realty Corp (Reit)	Deutsche Bank	(293)
(210)	IQVIA Holdings Inc	Bank of America		(2.188)	Kinder Morgan Inc/DE	Bank of America	
		Merrill Lynch	389			Merrill Lynch	(169)
(149)	iRobot Corp	Deutsche Bank	(469)	(611)	Kirby Corp	Deutsche Bank	(1.914)
(558)	Iron Mountain Inc (Reit)	Credit Suisse	57	(160)	KLX Inc	Credit Suisse	(316)
(58)	Itron Inc	Credit Suisse	463	(49)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Credit Suisse	(61)
(115)	Itron Inc	JP Morgan	918	(1.902)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Deutsche Bank	(2.041)
22	ITT Inc	JP Morgan	11	(573)	Kosmos Energy Ltd	Credit Suisse	(344)
141	ITT Inc	Bank of America		(1.842)	Kosmos Energy Ltd	Deutsche Bank	(806)
		Merrill Lynch	(87)	(1.465)	Kraft Heinz Co/The	Bank of America	
						Merrill Lynch	1.345
				(553)	Kraft Heinz Co/The	Deutsche Bank	508
				568	Kroger Co/The	Citibank	127
				757	Kronos Worldwide Inc	JP Morgan	507
				19	Kronos Worldwide Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	17
				27	Kronos Worldwide Inc	Deutsche Bank	24
				(140)	L Brands Inc	Bank of America	
						Merrill Lynch	(155)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(41)	L Brands Inc	Citibank	(21)	(220)	Lithia Motors Inc 'A'	Credit Suisse	(87)
21	L3 Technologies Inc	Credit Suisse	121	(38)	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America	
(226)	La Quinta Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	30
		Merrill Lynch	(225)	(353)	Live Nation Entertainment Inc	JP Morgan	15
(53)	La Quinta Holdings Inc	Credit Suisse	(92)	(44)	LKQ Corp	Bank of America	
(441)	La Quinta Holdings Inc	Citibank	(329)			Merrill Lynch	(31)
67	Laboratory Corp of America	Bank of America		(1.139)	LKQ Corp	Credit Suisse	(596)
	Holdings	Merrill Lynch	370	(412)	Loews Corp	Deutsche Bank	1.078
270	Lam Research Corp	Deutsche Bank	(97)	(190)	LogMeIn Inc	Credit Suisse	1.239
175	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Credit Suisse	565	219	Louisiana-Pacific Corp	Bank of America	
30	Lamb Weston Holdings Inc	Bank of America				Merrill Lynch	430
		Merrill Lynch	(68)	582	Louisiana-Pacific Corp	Deutsche Bank	1.144
472	Lamb Weston Holdings Inc	Deutsche Bank	(1.065)	1.869	Louisiana-Pacific Corp	JP Morgan	3.274
70	Lancaster Colony Corp	Citibank	212	(36)	Loxo Oncology Inc	Citibank	(518)
335	Landstar System Inc	Credit Suisse	1.596	128	LPL Financial Holdings Inc	Credit Suisse	(36)
191	Landstar System Inc	Deutsche Bank	869	50	LPL Financial Holdings Inc	Deutsche Bank	(67)
(696)	Laredo Petroleum Inc	Credit Suisse	463	(476)	Lumentum Holdings Inc	Credit Suisse	1.348
(1.138)	Laredo Petroleum Inc	Citibank	513	(60)	Lumentum Holdings Inc	Deutsche Bank	170
(157)	Las Vegas Sands Corp	Credit Suisse	(290)	184	LyondellBasell Industries		
(274)	LaSalle Hotel Properties (Reit)	Deutsche Bank	(769)		NV 'A'	Credit Suisse	1.350
(235)	LaSalle Hotel Properties (Reit)	Credit Suisse	(803)	100	LyondellBasell Industries		
(147)	LCI Industries	JP Morgan	88		NV 'A'	JP Morgan	734
(14)	LCI Industries	Deutsche Bank	(32)	793	LyondellBasell Industries		
456	Lear Corp	Bank of America			NV 'A'	Citibank	(2.096)
		Merrill Lynch	513	(17)	M&T Bank Corp	Credit Suisse	134
29	Lear Corp	Credit Suisse	160	(11)	Macerich Co/The (Reit)	Bank of America	
63	Lear Corp	Citibank	(225)			Merrill Lynch	(14)
53	Lear Corp	JP Morgan	292	(58)	Macerich Co/The (Reit)	Citibank	(25)
229	Legg Mason Inc	Bank of America		(207)	Macerich Co/The (Reit)	Deutsche Bank	(256)
		Merrill Lynch	(314)	(1.006)	Macquarie Infrastructure Corp	Deutsche Bank	(889)
78	Legg Mason Inc	Citibank	(139)	650	Macy's Inc	Bank of America	
333	Legg Mason Inc	Deutsche Bank	(457)			Merrill Lynch	3.057
102	Leggett & Platt Inc	JP Morgan	76	434	Macy's Inc	Citibank	853
(217)	Leidos Holdings Inc	Citibank	(147)	32	Macy's Inc	JP Morgan	155
(52)	Leidos Holdings Inc	Credit Suisse	42	(38)	Madison Square Garden		
(37)	LendingTree Inc	Credit Suisse	527		Co/The 'A'	Citibank	(25)
(94)	Lennar Corp 'A'	Credit Suisse	181	(38)	Madison Square Garden		
(151)	Lennar Corp 'A'	Deutsche Bank	(127)		Co/The 'A'	JP Morgan	(487)
(512)	Lennar Corp 'A'	Citibank	(580)	125	Magellan Health Inc	Credit Suisse	772
222	Lennox International Inc	JP Morgan	448	436	ManpowerGroup Inc	Credit Suisse	(1.568)
(446)	Lexington Realty Trust (Reit)	Deutsche Bank	(226)	10	ManpowerGroup Inc	Citibank	(15)
(18)	Liberty Broadband Corp 'C'	Bank of America		29	ManpowerGroup Inc	JP Morgan	(104)
		Merrill Lynch	36	29	Marathon Oil Corp	Deutsche Bank	4
(605)	Liberty Broadband Corp 'C'	Deutsche Bank	1.220	1.051	Marathon Oil Corp	JP Morgan	911
(122)	Liberty Latin America 'C'	Credit Suisse	(176)	677	Marathon Petroleum Corp	Bank of America	
(348)	Liberty Latin America 'C'	JP Morgan	(502)			Merrill Lynch	2.301
(259)	Liberty Media Corp-Liberty			203	Marathon Petroleum Corp	Credit Suisse	1.035
	Formula One 'C'	Credit Suisse	53	101	Marathon Petroleum Corp	Deutsche Bank	343
(89)	Liberty Media Corp-Liberty			(46)	Markel Corp	Citibank	1.617
	SiriusXM 'C'	Deutsche Bank	(105)	(26)	MarketAxess Holdings Inc	Credit Suisse	(296)
23	Liberty Property Trust (Reit)	Bank of America		(8)	MarketAxess Holdings Inc	Citibank	(43)
		Merrill Lynch	27	(148)	MarketAxess Holdings Inc	Deutsche Bank	(1.938)
808	Liberty Property Trust (Reit)	Credit Suisse	700	(85)	Marriott International	Bank of America	
341	LifePoint Health Inc	Bank of America			Inc/MD 'A'	Merrill Lynch	287
		Merrill Lynch	(527)	(85)	Marsh & McLennan Cos Inc	Citibank	109
36	LifePoint Health Inc	Deutsche Bank	(56)	(19)	Martin Marietta Materials Inc	Bank of America	
22	Ligand Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	712			Merrill Lynch	(77)
52	Ligand Pharmaceuticals Inc	Bank of America		(33)	Martin Marietta Materials Inc	Credit Suisse	(238)
		Merrill Lynch	430	(214)	Martin Marietta Materials Inc	JP Morgan	(1.541)
51	Ligand Pharmaceuticals Inc	Citibank	346	616	Marvell Technology Group Ltd	Citibank	(85)
36	Ligand Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	1.165	176	Marvell Technology Group Ltd	Credit Suisse	103
12	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America		944	Masco Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	26			Merrill Lynch	648
412	Lincoln Electric Holdings Inc	Credit Suisse	1.658	73	Masco Corp	Citibank	72
656	Lincoln National Corp	Citibank	(2.275)	(162)	MasTec Inc	Bank of America	
(42)	Lions Gate Entertainment	Bank of America				Merrill Lynch	181
	Corp 'B'	Merrill Lynch	(12)	(231)	Matador Resources Co	Bank of America	
(280)	Lions Gate Entertainment					Merrill Lynch	799
	Corp 'B'	Citibank	(26)	(1.030)	Matador Resources Co	Credit Suisse	4.199

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
456	Maxim Integrated Products Inc	Bank of America		(245)	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	528			Merrill Lynch	32
292	Maxim Integrated Products Inc	Credit Suisse	659	(30)	Mondelez International Inc 'A'	Credit Suisse	(18)
69	Maxim Integrated Products Inc	Deutsche Bank	80	(119)	Mondelez International Inc 'A'	Citibank	17
113	MAXIMUS Inc	Citibank	(81)	(125)	Mondelez International Inc 'A'	Deutsche Bank	16
(196)	MB Financial Inc	Bank of America		(237)	Monolithic Power Systems Inc	Credit Suisse	(1.961)
		Merrill Lynch	(1.030)	(6)	Monolithic Power Systems Inc	JP Morgan	(50)
(444)	MB Financial Inc	Credit Suisse	(2.374)	(478)	Monster Beverage Corp	Bank of America	
(14)	McCormick & Co Inc/MD	Bank of America				Merrill Lynch	(1.335)
	'non-voting share'	Merrill Lynch	44	172	Moody's Corp	Bank of America	
(31)	McCormick & Co Inc/MD					Merrill Lynch	245
	'non-voting share'	Citibank	1	33	Moody's Corp	Deutsche Bank	47
97	McKesson Corp	JP Morgan	(108)	78	Morningstar Inc	Citibank	284
(832)	Medical Properties Trust			(1.364)	Mosaic Co/The	Bank of America	
	Inc (Reit)	Credit Suisse	(307)			Merrill Lynch	(433)
(178)	Medicines Co/The	Deutsche Bank	(237)	622	Motorola Solutions Inc	Citibank	(21)
(1.555)	Medicines Co/The	Credit Suisse	(4.564)	45	Motorola Solutions Inc	Deutsche Bank	50
(440)	Medicines Co/The	Citibank	(884)	(528)	MRC Global Inc	Bank of America	
(41)	Medidata Solutions Inc	Citibank	(72)			Merrill Lynch	(168)
(386)	Medidata Solutions Inc	Deutsche Bank	(639)	(1.232)	MRC Global Inc	Credit Suisse	(740)
(414)	MEDNAX Inc	Citibank	370	67	MSA Safety Inc	Credit Suisse	189
(83)	Medtronic Plc	Credit Suisse	(212)	73	MSC Industrial Direct		
(489)	Medtronic Plc	Deutsche Bank	(758)		Co Inc 'A'	Citibank	(182)
(132)	Medtronic Plc	JP Morgan	(337)	281	MSC Industrial Direct		
(261)	Mellanox Technologies Ltd	Deutsche Bank	(750)		Co Inc 'A'	Deutsche Bank	(444)
510	Merck & Co Inc	Deutsche Bank	245	167	MSCI Inc	Credit Suisse	1.029
(345)	Mercury General Corp	Credit Suisse	(773)	66	MSCI Inc	Deutsche Bank	214
(73)	Mercury General Corp	Deutsche Bank	(61)	(139)	Mueller Industries Inc	Credit Suisse	(185)
(70)	MetLife Inc	Bank of America		(82)	Mueller Industries Inc	JP Morgan	(109)
		Merrill Lynch	111	2.100	Murphy Oil Corp	Citibank	(1.965)
(95)	MetLife Inc	Credit Suisse	75	(257)	Mylan NV	Deutsche Bank	(79)
(504)	MetLife Inc	Citibank	1.224	(4.563)	Nabors Industries Ltd	Deutsche Bank	2.154
96	Mettler-Toledo International Inc	JP Morgan	547	(1.390)	Nabors Industries Ltd	Citibank	561
3	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America		251	Nasdaq Inc	Citibank	282
		Merrill Lynch	(9)	12	National Beverage Corp	Citibank	61
2.019	MGIC Investment Corp	Credit Suisse	(321)	285	National Beverage Corp	Bank of America	
(225)	MGM Resorts International	Bank of America				Merrill Lynch	1.595
		Merrill Lynch	(23)	27	National Fuel Gas Co	JP Morgan	36
(1.242)	MGM Resorts International	Citibank	(288)	137	National Fuel Gas Co	Bank of America	
351	Michael Kors Holdings Ltd	Credit Suisse	(639)			Merrill Lynch	155
1.131	Michaels Cos Inc/The	Credit Suisse	592	69	National Fuel Gas Co	Deutsche Bank	78
44	Michaels Cos Inc/The	Deutsche Bank	6	(1.049)	National General		
(141)	Microchip Technology Inc	Credit Suisse	(537)		Holdings Corp	Credit Suisse	(864)
206	Micron Technology Inc	Citibank	21	(31)	National General		
319	Micron Technology Inc	Credit Suisse	2.897		Holdings Corp	Deutsche Bank	(38)
552	Micron Technology Inc	Deutsche Bank	2.435	497	National Health		
101	Microsoft Corp	Credit Suisse	313		Investors Inc (Reit)	Credit Suisse	1.467
141	Microsoft Corp	JP Morgan	437	15	National Health		
(364)	Mid-America Apartment	Bank of America			Investors Inc (Reit)	Citibank	39
	Communities Inc (Reit)	Merrill Lynch	(1.250)	19	National Health		
(364)	Middleby Corp/The	Citibank	590		Investors Inc (Reit)	Deutsche Bank	69
(94)	Minerals Technologies Inc	Bank of America		277	National Retail		
		Merrill Lynch	(149)		Properties Inc (Reit)	Deutsche Bank	535
(116)	Minerals Technologies Inc	JP Morgan	(214)	(700)	Navistar International Corp	Credit Suisse	(192)
77	MKS Instruments Inc	Bank of America		(39)	Navistar International Corp	JP Morgan	(11)
		Merrill Lynch	106	292	NCR Corp	Bank of America	
194	MKS Instruments Inc	Credit Suisse	874			Merrill Lynch	(130)
50	MKS Instruments Inc	JP Morgan	225	(171)	Nektar Therapeutics	Deutsche Bank	50
(15)	Mohawk Industries Inc	Bank of America		(133)	Nektar Therapeutics	JP Morgan	(566)
		Merrill Lynch	37	(579)	Neogen Corp	Credit Suisse	(2.291)
(97)	Mohawk Industries Inc	JP Morgan	613	783	NetApp Inc	Bank of America	
40	Molina Healthcare Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(1.261)
		Merrill Lynch	64	(196)	Netflix Inc	Bank of America	
365	Molina Healthcare Inc	Deutsche Bank	580			Merrill Lynch	(4.813)
(76)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Bank of America		(225)	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(92)			Merrill Lynch	(792)
(40)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Credit Suisse	(37)	(82)	Neurocrine Biosciences Inc	Credit Suisse	(985)
(45)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Deutsche Bank	(54)	(170)	Nevro Corp	Bank of America	
(353)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Citibank	(130)	(449)	Nevro Corp	Merrill Lynch	(149)
						Credit Suisse	(647)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(244)	New Jersey Resources Corp	Bank of America		233	Old Dominion Freight Line Inc	Credit Suisse	3.300
		Merrill Lynch	(314)	(465)	Old National Bancorp/IN	Deutsche Bank	(180)
(159)	New Jersey Resources Corp	Credit Suisse	(225)	(718)	Olin Corp	Bank of America	
(28)	New Jersey Resources Corp	Citibank	(34)			Merrill Lynch	18
421	New Relic Inc	Credit Suisse	9.001	(225)	Olin Corp	Credit Suisse	(71)
(829)	New Residential			(43)	Olin Corp	Deutsche Bank	1
	Investment Corp (Reit)	Citibank	75	(205)	Omega Healthcare		
(3.095)	New York Community				Investors Inc (Reit)	Deutsche Bank	(410)
	Bancorp Inc	Citibank	1.328	204	Omnicom Group Inc	Credit Suisse	(539)
(2.138)	Newell Brands Inc	Bank of America		170	Omnicom Group Inc	Deutsche Bank	(538)
		Merrill Lynch	3.835	76	Omnicom Group Inc	Bank of America	
2.271	Newfield Exploration Co	Credit Suisse	2.885			Merrill Lynch	(241)
7	NewMarket Corp	Credit Suisse	93	861	ON Semiconductor Corp	Citibank	1.153
12	NewMarket Corp	Deutsche Bank	233	461	ONE Gas Inc	Citibank	1.155
252	Newmont Mining Corp	Credit Suisse	(201)	60	ONE Gas Inc	Deutsche Bank	211
684	Newmont Mining Corp	JP Morgan	(546)	(634)	OneMain Holdings Inc	Deutsche Bank	724
41	Newmont Mining Corp	Citibank	9	(65)	ONEOK Inc	Credit Suisse	(231)
601	News Corp 'A'	Credit Suisse	(567)	(148)	ONEOK Inc	Citibank	(257)
242	News Corp 'A'	JP Morgan	(228)	(769)	ONEOK Inc	JP Morgan	(2.732)
(461)	Nexstar Media Group Inc 'A'	JP Morgan	(1.662)	(12.211)	OPKO Health Inc	JP Morgan	(6.183)
(52)	NextEra Energy Inc	Bank of America		(181)	Oracle Corp	Credit Suisse	(162)
		Merrill Lynch	(262)	(178)	Oracle Corp	Citibank	(93)
(610)	Nielsen Holdings Plc	Credit Suisse	(73)	(190)	Oracle Corp	JP Morgan	(170)
(97)	Nielsen Holdings Plc	Deutsche Bank	60	(457)	Ormat Technologies Inc	Bank of America	
1.039	NiSource Inc	JP Morgan	36			Merrill Lynch	278
(93)	Nordson Corp	Credit Suisse	283	(35)	Ormat Technologies Inc	Deutsche Bank	21
424	Nordstrom Inc	Deutsche Bank	(335)	(158)	Outfront Media Inc (Reit)	Bank of America	
(97)	Norfolk Southern Corp	Credit Suisse	(352)			Merrill Lynch	30
(60)	Norfolk Southern Corp	Deutsche Bank	(142)	505	Owens Corning	JP Morgan	(667)
69	Northern Trust Corp	Deutsche Bank	(315)	1.648	Owens-Illinois Inc	Bank of America	
60	NorthWestern Corp	Deutsche Bank	59			Merrill Lynch	863
(101)	Norwegian Cruise Line			39	Owens-Illinois Inc	Citibank	(8)
	Holdings Ltd	Credit Suisse	(168)	217	PACCAR Inc	Credit Suisse	(229)
(427)	Norwegian Cruise Line			150	Packaging Corp of America	Citibank	(563)
	Holdings Ltd	Deutsche Bank	(323)	(463)	PacWest Bancorp	Citibank	350
(57)	Norwegian Cruise Line			113	Papa John's International Inc	JP Morgan	(641)
	Holdings Ltd	JP Morgan	(95)	37	Paramount Group Inc (Reit)	Credit Suisse	2
507	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Bank of America		289	Paramount Group Inc (Reit)	Citibank	92
		Merrill Lynch	2.128	1.227	Park Hotels & Resorts	Bank of America	
33	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Deutsche Bank	139		Inc (Reit)	Merrill Lynch	1.959
99	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Credit Suisse	654	136	Parker-Hannifin Corp	JP Morgan	275
(874)	Nuance Communications Inc	Bank of America		(2.903)	Parsley Energy Inc 'A'	Bank of America	
		Merrill Lynch	(653)			Merrill Lynch	4.659
(160)	Nucor Corp	Bank of America		(131)	Patterson Cos Inc	Citibank	90
		Merrill Lynch	(305)	(210)	Patterson Cos Inc	Deutsche Bank	267
(54)	Nucor Corp	Citibank	(8)	(664)	Patterson-UTI Energy Inc	Credit Suisse	764
(49)	Nucor Corp	Deutsche Bank	(93)	(200)	Patterson-UTI Energy Inc	Citibank	228
(55)	Nucor Corp	JP Morgan	(123)	(271)	Patterson-UTI Energy Inc	Deutsche Bank	435
(100)	Nutanix Inc 'A'	Credit Suisse	193	(1.501)	Patterson-UTI Energy Inc	JP Morgan	1.726
(95)	NuVasive Inc	Citibank	(161)	(86)	PayPal Holdings Inc	Bank of America	
(525)	NuVasive Inc	Deutsche Bank	(969)			Merrill Lynch	(335)
(34)	NuVasive Inc	JP Morgan	(53)	(315)	PayPal Holdings Inc	JP Morgan	(1.787)
(130)	Nvent Electric Plc	JP Morgan	(2.968)	25	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America	
3	NVR Inc	Bank of America				Merrill Lynch	146
		Merrill Lynch	368	341	PBF Energy Inc 'A'	Citibank	1.086
6	NVR Inc	Credit Suisse	(230)	209	PBF Energy Inc 'A'	Deutsche Bank	1.218
3	NVR Inc	Citibank	232	131	Peabody Energy Corp	Bank of America	
1	NVR Inc	JP Morgan	(38)			Merrill Lynch	380
(1.173)	Oasis Petroleum Inc	Bank of America		175	Peabody Energy Corp	JP Morgan	936
		Merrill Lynch	(1.037)	1.163	Peabody Energy Corp	Citibank	2.505
(3.624)	Oasis Petroleum Inc	Citibank	(1.400)	(128)	Pebblebrook Hotel Trust (Reit)	Deutsche Bank	(375)
(426)	Oasis Petroleum Inc	Deutsche Bank	(377)	(113)	Pegasystems Inc	Bank of America	
10	Occidental Petroleum Corp	Credit Suisse	50			Merrill Lynch	(131)
447	Occidental Petroleum Corp	Citibank	(368)	(85)	Penske Automotive Group Inc	Credit Suisse	(88)
(322)	Oceaneering International Inc	Credit Suisse	(362)	(408)	Penske Automotive Group Inc	JP Morgan	(424)
(205)	Oceaneering International Inc	JP Morgan	(230)	(29)	Pentair Plc	Credit Suisse	4
284	OGE Energy Corp	Credit Suisse	290	(130)	Pentair Plc	JP Morgan	20
24	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America		(423)	Penumbra Inc	JP Morgan	(9.094)
		Merrill Lynch	273	1.000	People's United Financial Inc	Credit Suisse	(9)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
450	PepsiCo Inc	Credit Suisse	1.151	(111)	Proofpoint Inc	JP Morgan	598
22	PepsiCo Inc	Deutsche Bank	56	(268)	Prosperity Bancshares Inc	Deutsche Bank	331
161	Performance Food Group Co	Credit Suisse	449	(58)	Prosperity Bancshares Inc	JP Morgan	63
273	Performance Food Group Co	JP Morgan	761	45	Prudential Financial Inc	Bank of America	
2.011	Pfizer Inc	Credit Suisse	1.899			Merrill Lynch	(148)
55	Pfizer Inc	Deutsche Bank	18	263	Prudential Financial Inc	Deutsche Bank	(865)
48	Philip Morris International Inc	Bank of America		546	PS Business Parks Inc (Reit)	Credit Suisse	1.968
		Merrill Lynch	(27)	10	PS Business Parks Inc (Reit)	Deutsche Bank	45
1.046	Phillips 66	Deutsche Bank	1.508	(397)	PTC Inc	Citibank	(521)
(260)	Physicians Realty Trust (Reit)	Bank of America		(65)	PTC Inc	Credit Suisse	26
		Merrill Lynch	(96)	580	Public Service Enterprise Group Inc	Deutsche Bank	1.160
(1.556)	Physicians Realty Trust (Reit)	Credit Suisse	(160)	(49)	Public Storage (Reit)	Bank of America	
(40)	Physicians Realty Trust (Reit)	Citibank	(21)			Merrill Lynch	(257)
1.736	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America		(236)	Puma Biotechnology Inc	Credit Suisse	2.329
		Merrill Lynch	1.296	(22)	Puma Biotechnology Inc	Deutsche Bank	39
92	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	69	(563)	QEP Resources Inc	Citibank	382
(22)	Pinnacle Financial Partners Inc	Bank of America		(600)	QEP Resources Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(33)			Merrill Lynch	314
(539)	Pinnacle Financial Partners Inc	Credit Suisse	(1.434)	48	Qorvo Inc	Bank of America	
424	Pinnacle West Capital Corp	Citibank	979			Merrill Lynch	34
81	Pitney Bowes Inc	JP Morgan	1	8	Qorvo Inc	Citibank	1
1.294	Pitney Bowes Inc	Citibank	(405)	(178)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Credit Suisse	(493)
78	Planet Fitness Inc 'A'	Citibank	21	(325)	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Citibank	(814)
70	Plantronics Inc	Credit Suisse	443	(790)	Qualcomm Inc	Deutsche Bank	(980)
114	Plantronics Inc	Deutsche Bank	722	438	Quest Diagnostics Inc	Credit Suisse	3.011
(858)	Platform Specialty Products Corp			(207)	Qurate Retail Inc	Bank of America	
		Credit Suisse	(1.060)			Merrill Lynch	233
(5.663)	Platform Specialty Products Corp	Deutsche Bank	(4.472)	(82)	Qurate Retail Inc QVC Group 'A'	Credit Suisse	248
859	PNM Resources Inc	Citibank	1.180	974	Radian Group Inc	Bank of America	
44	Polaris Industries Inc	Deutsche Bank	181			Merrill Lynch	92
283	PolyOne Corp	Bank of America		555	Ralph Lauren Corp	Bank of America	
		Merrill Lynch	(32)			Merrill Lynch	11.913
18	Pool Corp	Citibank	(25)	(345)	Range Resources Corp	Credit Suisse	(423)
158	Popular Inc	Citibank	(216)	(2.000)	Range Resources Corp	Deutsche Bank	(1.717)
49	Portland General Electric Co	Deutsche Bank	76	304	Raymond James Financial Inc	Credit Suisse	1.412
395	Portland General Electric Co	JP Morgan	346	48	Raymond James Financial Inc	Deutsche Bank	112
(390)	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America		127	Rayonier Inc (Reit)	Bank of America	
		Merrill Lynch	107			Merrill Lynch	197
(478)	Portola Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	849	138	Rayonier Inc (Reit)	Citibank	69
(136)	Post Holdings Inc	Deutsche Bank	(82)	449	Rayonier Inc (Reit)	Deutsche Bank	698
536	Potlatch Corp (Reit)	JP Morgan	851	33	Raytheon Co	Citibank	114
(51)	PPG Industries Inc	Deutsche Bank	79	50	Raytheon Co	Deutsche Bank	101
(593)	PPL Corp	Bank of America		21	Raytheon Co	JP Morgan	25
		Merrill Lynch	25	(269)	RBC Bearings Inc	Deutsche Bank	(1.286)
45	Praxair Inc	Citibank	(96)	(28)	Realogy Holdings Corp	Credit Suisse	48
(21)	Prestige Brands Holdings Inc	Bank of America		(659)	RealPage Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	6			Merrill Lynch	(141)
(465)	Prestige Brands Holdings Inc	JP Morgan	(2.047)	(12)	RealPage Inc	Deutsche Bank	(3)
(102)	PriceSmart Inc	Credit Suisse	(369)	153	Red Hat Inc	Deutsche Bank	186
(62)	PriceSmart Inc	Deutsche Bank	(263)	192	Regal Beloit Corp	Deutsche Bank	198
(312)	PriceSmart Inc	JP Morgan	(1.245)	(65)	Regency Centers Corp (Reit)	Deutsche Bank	(96)
157	Primerica Inc	Bank of America		(473)	Regency Centers Corp (Reit)	JP Morgan	(12)
		Merrill Lynch	505	1.006	Regions Financial Corp	Bank of America	
583	Principal Financial Group Inc	Deutsche Bank	(1.741)			Merrill Lynch	(993)
55	Principal Financial Group Inc	Credit Suisse	(83)	115	Reliance Steel & Aluminum Co	Citibank	80
(53)	Procter & Gamble Co/The	Credit Suisse	(106)	260	Reliance Steel & Aluminum Co	Deutsche Bank	656
(24)	Procter & Gamble Co/The	Citibank	6	150	Republic Services Inc	Deutsche Bank	115
(33)	Procter & Gamble Co/The	JP Morgan	(66)	1.335	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Deutsche Bank	1.020
(220)	Procter & Gamble Co/The	Bank of America				JP Morgan	(297)
		Merrill Lynch	(68)	(787)	Rexnord Corp	Credit Suisse	137
663	Progressive Corp/The	Credit Suisse	768	40	RingCentral Inc 'A'	Credit Suisse	(32)
49	Prologis Inc (Reit)	Bank of America		(375)	RLI Corp/DE	Bank of America	
		Merrill Lynch	14	(1.572)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Merrill Lynch	(3.022)
46	Prologis Inc (Reit)	Credit Suisse	(25)			Deutsche Bank	(671)
(63)	Proofpoint Inc	Bank of America		(349)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Deutsche Bank	
		Merrill Lynch	255	738	Robert Half International Inc	Bank of America	
(39)	Proofpoint Inc	Citibank	12			Merrill Lynch	766

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
67	Rockwell Automation Inc	Bank of America		(95)	Signature Bank/New York NY	JP Morgan	119
199	Rockwell Automation Inc	Merrill Lynch	(22)	137	Signet Jewelers Ltd	Bank of America	
3	Rockwell Automation Inc	Deutsche Bank	(65)			Merrill Lynch	590
56	Rollins Inc	JP Morgan	7	98	Signet Jewelers Ltd	Citibank	282
(182)	Roper Technologies Inc	Citibank	32	319	Silgan Holdings Inc	Citibank	(25)
255	Ross Stores Inc	JP Morgan	(742)	39	Simon Property		
		Bank of America			Group Inc (Reit)	Credit Suisse	66
64	Royal Caribbean Cruises Ltd	Merrill Lynch	(724)	251	Simpson Manufacturing	Bank of America	
(153)	Royal Gold Inc	JP Morgan	77		Co Inc	Merrill Lynch	758
		Bank of America		38	Simpson Manufacturing		
		Merrill Lynch	(162)		Co Inc	JP Morgan	107
(328)	Royal Gold Inc	Deutsche Bank	(346)	(75)	Sinclair Broadcast		
1.889	RPC Inc	Deutsche Bank	(3.891)		Group Inc 'A'	Deutsche Bank	190
176	RPM International Inc	Deutsche Bank	32	571	Sirius XM Holdings Inc	Deutsche Bank	127
159	RPM International Inc	Credit Suisse	101	(169)	SITEONE LANDSCAPE		
(1.405)	RSP Permian Inc	Credit Suisse	7.090		SUPPLY Inc	Deutsche Bank	408
(62)	RSP Permian Inc	Citibank	120	46	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America	
44	Ryder System Inc	Bank of America				Merrill Lynch	76
		Merrill Lynch	9	265	Six Flags Entertainment Corp	Citibank	257
324	Ryder System Inc	Credit Suisse	114	151	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Citibank	(61)
387	Ryman Hospitality			75	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Deutsche Bank	15
	Properties Inc (Reit)	JP Morgan	1.026	43	Skyworks Solutions Inc	Credit Suisse	96
34	S&P Global Inc	JP Morgan	120	101	SL Green Realty Corp (Reit)	Citibank	156
190	S&P Global Inc	Citibank	(179)	(455)	SLM Corp	Bank of America	
(1.149)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Credit Suisse	(1.292)			Merrill Lynch	37
(279)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Deutsche Bank	(204)	(67)	SLM Corp	JP Morgan	4
(1.037)	Sabre Corp	Bank of America		(499)	SM Energy Co	Credit Suisse	(908)
		Merrill Lynch	(445)	(36)	SM Energy Co	JP Morgan	(65)
551	Sally Beauty Holdings Inc	Credit Suisse	142	92	Snap-on Inc	Bank of America	
1.665	Sally Beauty Holdings Inc	Deutsche Bank	(286)			Merrill Lynch	(88)
17	Sanderson Farms Inc	Bank of America		47	Snap-on Inc	Citibank	(178)
		Merrill Lynch	(179)	550	Sonoco Products Co	Citibank	-
320	Sanderson Farms Inc	Deutsche Bank	(3.373)	(224)	South Jersey Industries Inc	Credit Suisse	(300)
(222)	Sanmina Corp	JP Morgan	48	(961)	South Jersey Industries Inc	Deutsche Bank	(577)
(108)	Sarepta Therapeutics Inc	Citibank	(735)	(314)	South State Corp	Deutsche Bank	(445)
(471)	Sarepta Therapeutics Inc	Deutsche Bank	(1.811)	(743)	Southern Co/The	Deutsche Bank	(261)
(170)	SCANA Corp	Citibank	(108)	211	Southwest Airlines Co	Bank of America	
(67)	Science Applications					Merrill Lynch	(112)
	International Corp	JP Morgan	10	122	Southwest Airlines Co	Citibank	24
(70)	Scientific Games Corp/DE 'A'	Bank of America		147	Southwest Airlines Co	Deutsche Bank	(78)
		Merrill Lynch	(36)	(428)	Spark Therapeutics Inc	Bank of America	
(28)	Scientific Games Corp/DE 'A'	Credit Suisse	(198)			Merrill Lynch	(1.521)
(30)	Scientific Games Corp/DE 'A'	JP Morgan	(212)	(50)	Spark Therapeutics Inc	Deutsche Bank	(178)
(20)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Credit Suisse	(98)	(353)	Spectrum Brands		
(74)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Deutsche Bank	(141)		Holdings Inc	Deutsche Bank	(2.357)
424	Seagate Technology Plc	JP Morgan	633	(163)	Spire Inc	Bank of America	
(152)	Seattle Genetics Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(140)
		Merrill Lynch	(274)	376	Spirit AeroSystems		
(291)	Seattle Genetics Inc	Credit Suisse	(1.329)		Holdings Inc 'A'	Deutsche Bank	423
68	SEI Investments Co	Credit Suisse	81	42	Spirit AeroSystems		
94	SEI Investments Co	Citibank	(88)		Holdings Inc 'A'	JP Morgan	13
65	Selective Insurance Group Inc	Citibank	25	(663)	Spirit Airlines Inc	Bank of America	
74	Selective Insurance Group Inc	Deutsche Bank	102			Merrill Lynch	(239)
196	Selective Insurance Group Inc	Credit Suisse	84	(85)	Spirit Airlines Inc	Deutsche Bank	(31)
(1.919)	SemGroup Corp 'A'	Citibank	(165)	(3.036)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	JP Morgan	(769)
(767)	SemGroup Corp 'A'	Deutsche Bank	(165)	652	Sprouts Farmers Market Inc	Bank of America	
(86)	Sempra Energy	Bank of America				Merrill Lynch	(17)
		Merrill Lynch	(41)	140	Sprouts Farmers Market Inc	JP Morgan	37
(138)	Sempra Energy	Citibank	(281)	(609)	Square Inc 'A'	Bank of America	
(102)	Senior Housing Properties	Bank of America				Merrill Lynch	(2.148)
	Trust (Reit)	Merrill Lynch	(135)	(687)	SS&C Technologies		
(195)	Senior Housing Properties				Holdings Inc	Credit Suisse	(660)
	Trust (Reit)	JP Morgan	(261)	21	Stanley Black & Decker Inc	Citibank	(94)
(83)	Sensata Technologies			137	Stanley Black & Decker Inc	JP Morgan	176
	Holding Plc	Citibank	85	277	Starwood Property		
237	Sensient Technologies Corp	Credit Suisse	(210)		Trust Inc (Reit)	Deutsche Bank	73
(811)	ServiceMaster Global			39	State Street Corp	Bank of America	
	Holdings Inc	Credit Suisse	(1.740)			Merrill Lynch	(163)
(67)	ServiceNow Inc	Deutsche Bank	(487)	279	State Street Corp	Credit Suisse	(711)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
657	Steel Dynamics Inc	Deutsche Bank	682	169	Tech Data Corp	JP Morgan	1.762
(487)	Stericycle Inc	Bank of America		199	TechnipFMC Plc	Citibank	(326)
		Merrill Lynch	(263)	1.340	Tegna Inc	Credit Suisse	(173)
(36)	Stericycle Inc	Credit Suisse	(24)	1.015	Telephone & Data	Bank of America	
(66)	Stericycle Inc	JP Morgan	(44)		Systems Inc	Merrill Lynch	(340)
(869)	Sterling Bancorp/DE	Credit Suisse	(597)	(83)	Tempur Sealy International Inc	Deutsche Bank	196
(303)	Sterling Bancorp/DE	Deutsche Bank	(117)	269	Tenet Healthcare Corp	Credit Suisse	1.060
(129)	Stifel Financial Corp	JP Morgan	28	692	Tenneco Inc	Bank of America	
(1.191)	STORE Capital Corp (Reit)	JP Morgan	(1.012)			Merrill Lynch	(1.526)
(52)	Stryker Corp	Citibank	(133)	42	Tenneco Inc	Citibank	(118)
(1.867)	Summit Materials Inc 'A'	Bank of America		887	Teradata Corp	Citibank	1.066
		Merrill Lynch	2.243	59	Teradata Corp	JP Morgan	23
(232)	Summit Materials Inc 'A'	JP Morgan	325	973	Teradyne Inc	Deutsche Bank	2.480
(226)	Sun Communities Inc (Reit)	JP Morgan	(388)	(265)	TESARO Inc	Bank of America	
68	SunTrust Banks Inc	JP Morgan	1			Merrill Lynch	537
389	SunTrust Banks Inc	Deutsche Bank	(674)	(419)	TESARO Inc	Deutsche Bank	849
(790)	Symantec Corp	Credit Suisse	5.160	(84)	TESARO Inc	Citibank	306
(497)	Symantec Corp	Bank of America		(36)	Tesla Inc	JP Morgan	(104)
		Merrill Lynch	572	(57)	Tesla Inc	Bank of America	
(307)	Synchrony Financial	Credit Suisse	(411)			Merrill Lynch	(200)
(129)	Synchrony Financial	Citibank	163	(4)	Tesla Inc	Citibank	(45)
(14)	Synchrony Financial	Deutsche Bank	(5)	(286)	Tesla Inc	Deutsche Bank	(1.001)
(101)	Synchrony Financial	JP Morgan	(135)	75	Tetra Tech Inc	Deutsche Bank	196
(871)	Syneos Health Inc	Bank of America		(164)	Texas Capital Bancshares Inc	JP Morgan	394
		Merrill Lynch	(2.056)	391	Texas Instruments Inc	Credit Suisse	2.386
(201)	Syneos Health Inc	Deutsche Bank	(474)	291	Texas Roadhouse Inc	Citibank	659
(51)	SYNNEX Corp	Bank of America		(208)	TFS Financial Corp	JP Morgan	(126)
		Merrill Lynch	(7)	56	Thermo Fisher Scientific Inc	Deutsche Bank	60
(119)	SYNNEX Corp	Citibank	(88)	27	Thor Industries Inc	Credit Suisse	(155)
(24)	SYNNEX Corp	Deutsche Bank	(3)	45	Thor Industries Inc	Citibank	(372)
(38)	SYNNEX Corp	Credit Suisse	(46)	494	Timken Co/The	JP Morgan	(233)
(10)	SYNNEX Corp	JP Morgan	(12)	265	TJX Cos Inc/The	Bank of America	
111	Synopsys Inc	Citibank	(85)			Merrill Lynch	1.051
55	Synopsys Inc	Deutsche Bank	(13)	294	Toll Brothers Inc	Credit Suisse	(1.002)
391	Synopsys Inc	JP Morgan	(225)	81	Toll Brothers Inc	Citibank	13
829	Synovus Financial Corp	Credit Suisse	548	584	Torchmark Corp	Bank of America	
93	Synovus Financial Corp	Citibank	(60)			Merrill Lynch	(291)
454	Syntel Inc	Citibank	94	458	Toro Co/The	Bank of America	
174	Syntel Inc	Deutsche Bank	203			Merrill Lynch	594
61	Syntel Inc	JP Morgan	109	680	Toro Co/The	Citibank	(391)
432	Sysco Corp	Credit Suisse	1.060	158	Toro Co/The	Deutsche Bank	205
62	Sysco Corp	Deutsche Bank	141	107	Total System Services Inc	JP Morgan	(73)
530	T Rowe Price Group Inc	JP Morgan	3.334	53	Tractor Supply Co	Credit Suisse	391
(5)	T-Mobile US Inc	Citibank	6	114	Tractor Supply Co	Citibank	136
(70)	T-Mobile US Inc	Deutsche Bank	34	141	Tractor Supply Co	Deutsche Bank	511
(108)	Tanger Factory Outlet			(94)	TransDigm Group Inc	Credit Suisse	(365)
	Centers Inc (Reit)	Credit Suisse	(70)	1.986	Transocean Ltd	Deutsche Bank	(1.705)
(248)	Targa Resources Corp	Bank of America		48	Travelers Cos Inc/The	Credit Suisse	(20)
		Merrill Lynch	136	67	Travelers Cos Inc/The	JP Morgan	(28)
(1.016)	Targa Resources Corp	Credit Suisse	(584)	(90)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America	
(346)	Targa Resources Corp	Deutsche Bank	190			Merrill Lynch	(53)
(34)	Targa Resources Corp	JP Morgan	(20)	(624)	TreeHouse Foods Inc	Deutsche Bank	(370)
445	Target Corp	Bank of America		78	Trex Co Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	73			Merrill Lynch	536
102	Target Corp	Citibank	(193)	18	Trex Co Inc	Credit Suisse	8
(254)	Taubman Centers Inc (Reit)	Bank of America		(3.904)	TRI Pointe Group Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(329)			Merrill Lynch	(5.361)
(54)	Taubman Centers Inc (Reit)	Credit Suisse	85	(69)	Trimble Inc	Credit Suisse	67
163	TCF Financial Corp	Citibank	13	(513)	Trimble Inc	JP Morgan	495
364	TCF Financial Corp	Deutsche Bank	203	357	TriNet Group Inc	Bank of America	
167	TD Ameritrade Holding Corp	Citibank	(300)			Merrill Lynch	447
95	TD Ameritrade Holding Corp	Bank of America		79	TriNet Group Inc	Deutsche Bank	99
		Merrill Lynch	(120)	(106)	Trinity Industries Inc	Credit Suisse	(156)
186	TD Ameritrade Holding Corp	Deutsche Bank	(235)	(101)	Trinity Industries Inc	JP Morgan	(148)
101	TE Connectivity Ltd	Bank of America		188	Trinseo SA	Credit Suisse	(481)
		Merrill Lynch	(73)	515	Trinseo SA	Deutsche Bank	(1.061)
57	TE Connectivity Ltd	Credit Suisse	55	(231)	TripAdvisor Inc	Bank of America	
242	Tech Data Corp	Bank of America				Merrill Lynch	(395)
		Merrill Lynch	2.155	(117)	Triton International		
49	Tech Data Corp	Citibank	402		Ltd/Bermuda	Credit Suisse	(64)

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR			
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie	
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite			
(316)	Triton International Ltd/Bermuda	JP Morgan	(174)	114	Urban Edge Properties (Reit)	Bank of America	
846	Tupperware Brands Corp	Bank of America				Merrill Lynch	144
		Merrill Lynch	(349)	131	Urban Edge Properties (Reit)	Deutsche Bank	165
69	Tupperware Brands Corp	Deutsche Bank	(28)	99	Urban Edge Properties (Reit)	Credit Suisse	75
(1.046)	Twitter Inc	JP Morgan	(2.487)	143	Urban Outfitters Inc	Credit Suisse	322
(218)	Tyler Technologies Inc	Bank of America		208	Urban Outfitters Inc	Deutsche Bank	148
		Merrill Lynch	(732)	181	Urban Outfitters Inc	JP Morgan	407
90	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America		553	US Foods Holding Corp	Credit Suisse	1.277
		Merrill Lynch	114	(295)	US Silica Holdings Inc	Bank of America	
381	Tyson Foods Inc 'A'	JP Morgan	683			Merrill Lynch	149
50	Ubiquiti Networks Inc	Deutsche Bank	148	(151)	US Silica Holdings Inc	Citibank	148
778	UDR Inc (Reit)	Citibank	801	(949)	US Silica Holdings Inc	JP Morgan	(8)
70	UGI Corp	Deutsche Bank	67	(31)	USG Corp	JP Morgan	11
463	UGI Corp	JP Morgan	862	(743)	USG Corp	Bank of America	
(118)	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Bank of America				Merrill Lynch	(83)
		Merrill Lynch	(2)	(158)	Vail Resorts Inc	Deutsche Bank	(890)
(11)	Ultra Salon Cosmetics & Fragrance Inc	JP Morgan	(11)	7	Valero Energy Corp	Bank of America	
(133)	Ultimate Software Group Inc/The	Deutsche Bank	(615)			Merrill Lynch	49
(3)	Ultimate Software Group Inc/The	Credit Suisse	(22)	1.227	Valero Energy Corp	Credit Suisse	11.384
(330)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Bank of America		34	Valero Energy Corp	Citibank	112
		Merrill Lynch	(2.586)	(165)	Valley National Bancorp	Bank of America	
(40)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Deutsche Bank	(313)			Merrill Lynch	13
(532)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Credit Suisse	(6.401)	(1.168)	Valley National Bancorp	Credit Suisse	—
104	UMB Financial Corp	Bank of America		(615)	Valvoline Inc	Bank of America	
		Merrill Lynch	(163)			Merrill Lynch	58
(492)	Umpqua Holdings Corp	Bank of America		(77)	Valvoline Inc	Credit Suisse	44
		Merrill Lynch	21	(197)	Valvoline Inc	Deutsche Bank	19
(310)	Under Armour Inc 'A'	Deutsche Bank	(692)	(145)	Valvoline Inc	JP Morgan	82
(1.880)	Under Armour Inc 'A'	JP Morgan	(5.099)	107	Varian Medical Systems Inc	Deutsche Bank	66
(209)	Under Armour Inc 'C'	Credit Suisse	(491)	49	Vector Group Ltd	Citibank	16
(2.072)	Under Armour Inc 'C'	Deutsche Bank	(3.770)	719	Vector Group Ltd	Deutsche Bank	(6)
(38)	Union Pacific Corp	Bank of America		296	Vectren Corp	Citibank	279
		Merrill Lynch	(158)	(26)	Veeva Systems Inc 'A'	Deutsche Bank	(41)
(165)	Union Pacific Corp	Citibank	(314)	(131)	Veeva Systems Inc 'A'	Credit Suisse	(419)
(1.457)	United Bankshares Inc/WV	Credit Suisse	(2.501)	(129)	Ventas Inc (Reit)	Credit Suisse	(184)
46	United Continental Holdings Inc	Citibank	(27)	(151)	Ventas Inc (Reit)	Deutsche Bank	(290)
87	United Natural Foods Inc	Citibank	7	(3.601)	VEREIT Inc (Reit)	Citibank	(525)
116	United Rentals Inc	JP Morgan	148	(719)	VeriFone Systems Inc	Bank of America	
703	United States Cellular Corp	Deutsche Bank	(809)			Merrill Lynch	43
(99)	United Technologies Corp	Credit Suisse	(304)	(43)	Verint Systems Inc	Credit Suisse	(18)
(46)	United Technologies Corp	Deutsche Bank	(32)	625	VeriSign Inc	Bank of America	
(345)	United Technologies Corp	JP Morgan	(1.060)			Merrill Lynch	2.360
428	United Therapeutics Corp	Credit Suisse	1.921	55	VeriSign Inc	Deutsche Bank	208
47	United Therapeutics Corp	Bank of America		(538)	Verisk Analytics Inc	Deutsche Bank	(850)
		Merrill Lynch	4	104	Verizon Communications Inc	Credit Suisse	96
74	UnitedHealth Group Inc	Citibank	(111)	196	Verizon Communications Inc	Deutsche Bank	50
80	UnitedHealth Group Inc	JP Morgan	783	122	Vertex Pharmaceuticals Inc	Citibank	62
(498)	Uniti Group Inc (Reit)	Credit Suisse	(761)	37	VF Corp	Citibank	39
(1.651)	Uniti Group Inc (Reit)	Citibank	(1.006)	39	VF Corp	Deutsche Bank	103
(62)	Uniti Group Inc (Reit)	Deutsche Bank	(45)	(27)	Viacom Inc 'B'	Credit Suisse	64
(139)	Univar Inc	Bank of America		(24)	Viacom Inc 'B'	Deutsche Bank	26
		Merrill Lynch	(48)	(66)	ViaSat Inc	Credit Suisse	10
(197)	Univar Inc	Credit Suisse	(39)	(749)	ViaSat Inc	Citibank	(1.144)
(181)	Univar Inc	JP Morgan	(36)	(109)	ViaSat Inc	Deutsche Bank	(111)
(24)	Universal Display Corp	Citibank	12	(334)	Viavi Solutions Inc	Bank of America	
(98)	Universal Display Corp	JP Morgan	164			Merrill Lynch	72
(98)	Universal Display Corp	Bank of America		(363)	Viavi Solutions Inc	Credit Suisse	125
		Merrill Lynch	147	(438)	Viavi Solutions Inc	JP Morgan	150
680	Unum Group	Bank of America		35	Visa Inc 'A'	Citibank	2
		Merrill Lynch	(58)	342	Visa Inc 'A'	Deutsche Bank	(100)
101	Unum Group	JP Morgan	(21)	3.198	Vishay Intertechnology Inc	Credit Suisse	3.294
				311	Visteon Corp	Bank of America	
						Merrill Lynch	(1.285)
				230	Vistra Energy Corp	Credit Suisse	253
				455	VMware Inc 'A'	JP Morgan	976
				(178)	Vornado Realty Trust (Reit)	Bank of America	
						Merrill Lynch	(306)
				(199)	Vornado Realty Trust (Reit)	Deutsche Bank	(342)
				(50)	Vornado Realty Trust (Reit)	JP Morgan	5

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

			Plus-values/ (moins-values) latentes EUR				Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	
Nombre	Description	Contrepartie		Nombre	Description	Contrepartie		
Etats-Unis suite				Etats-Unis suite				
(161)	Voya Financial Inc	Credit Suisse	35	(424)	WEX Inc	JP Morgan	(2.325)	
(36)	Vulcan Materials Co	Citibank	(7)	(19)	Whirlpool Corp	Bank of America		
(50)	Vulcan Materials Co	JP Morgan	(73)			Merrill Lynch	186	
(429)	Vulcan Materials Co	Bank of America		(78)	Whirlpool Corp	Credit Suisse	544	
		Merrill Lynch	(401)	(28)	Whirlpool Corp	Citibank	443	
171	WABCO Holdings Inc	Citibank	(1.076)	9	White Mountains Insurance Group Ltd	JP Morgan	269	
(888)	Wabtec Corp/DE	Deutsche Bank	(3.529)	(708)	Whiting Petroleum Corp	Bank of America		
193	Walgreens Boots Alliance Inc	Citibank	(240)			Merrill Lynch	(2.333)	
198	Walgreens Boots Alliance Inc	Deutsche Bank	(311)	13	Williams-Sonoma Inc	JP Morgan	81	
275	Walmart Inc	Credit Suisse	(529)	590	Williams-Sonoma Inc	Deutsche Bank	4.061	
99	Walmart Inc	Deutsche Bank	(87)	196	Wintrust Financial Corp	Credit Suisse	24	
41	Walmart Inc	JP Morgan	(79)	404	Wolverine World Wide Inc	Deutsche Bank	624	
(14)	Walt Disney Co/The	Credit Suisse	24	(159)	Woodward Inc	Bank of America		
(223)	Walt Disney Co/The	JP Morgan	381			Merrill Lynch	(332)	
1.408	Washington Federal Inc	Credit Suisse	665	(163)	Workday Inc 'A'	Bank of America		
101	Washington Federal Inc	Deutsche Bank	13			Merrill Lynch	(28)	
601	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Citibank	320	(28)	Workday Inc 'A'	Deutsche Bank	(5)	
(98)	Waste Connections Inc	Bank of America		(44)	Workday Inc 'A'	Credit Suisse	44	
		Merrill Lynch	(191)	(110)	World Fuel Services Corp	Bank of America		
(985)	Waste Connections Inc	Deutsche Bank	(1.919)			Merrill Lynch	136	
364	Waste Management Inc	Bank of America		(375)	World Fuel Services Corp	Credit Suisse	428	
		Merrill Lynch	653	(40)	Worldpay Inc 'A'	Citibank	43	
30	Waste Management Inc	JP Morgan	31	(400)	Worldpay Inc 'A'	JP Morgan	1.404	
217	Waters Corp	JP Morgan	268	271	Worthington Industries Inc	Bank of America		
(121)	Wayfair Inc 'A'	Deutsche Bank	(1.095)			Merrill Lynch	651	
(95)	Wayfair Inc 'A'	JP Morgan	(864)	188	WP Carey Inc (Reit)	Bank of America		
(20.239)	Weatherford International Plc	Deutsche Bank	434			Merrill Lynch	342	
(50)	Webster Financial Corp	JP Morgan	(65)	(1.760)	WPX Energy Inc	Citibank	(393)	
(294)	WEC Energy Group Inc	Citibank	(686)	(240)	WPX Energy Inc	Deutsche Bank	(56)	
792	Weingarten Realty Investors (Reit)	Credit Suisse	1.190	(393)	WR Berkley Corp	Credit Suisse	(236)	
31	Weingarten Realty Investors (Reit)	JP Morgan	47	(1.305)	Wright Medical Group NV	Deutsche Bank	(1.411)	
117	Weingarten Realty Investors (Reit)	Bank of America		(1.608)	Wright Medical Group NV	Credit Suisse	(6.003)	
		Merrill Lynch	208	(187)	Wright Medical Group NV	JP Morgan	(698)	
(1.110)	Welbilt Inc	Bank of America		68	WW Grainger Inc	Bank of America		
		Merrill Lynch	(476)			Merrill Lynch	190	
(410)	Welbilt Inc	JP Morgan	(215)	(88)	Wynn Resorts Ltd	Citibank	(256)	
140	WellCare Health Plans Inc	Bank of America		415	Xcel Energy Inc	Deutsche Bank	324	
		Merrill Lynch	1.029	(68)	XL Group Ltd	Credit Suisse	(26)	
133	WellCare Health Plans Inc	Credit Suisse	1.080	(487)	XPO Logistics Inc	Bank of America		
6	WellCare Health Plans Inc	Deutsche Bank	44			Merrill Lynch	(978)	
30	WellCare Health Plans Inc	JP Morgan	244	(7)	XPO Logistics Inc	Citibank	(1)	
(421)	Wells Fargo & Co	Bank of America		57	Xylem Inc/NY	Bank of America		
		Merrill Lynch	289			Merrill Lynch	(44)	
(656)	Wells Fargo & Co	Deutsche Bank	450	45	Xylem Inc/NY	Credit Suisse	12	
(537)	Welltower Inc (Reit)	Credit Suisse	(1.028)	122	Xylem Inc/NY	Deutsche Bank	(94)	
(72)	Welltower Inc (Reit)	Bank of America		(65)	Yelp Inc	Credit Suisse	213	
		Merrill Lynch	(156)	(477)	Yelp Inc	Deutsche Bank	(197)	
(444)	Wendy's Co/The	Credit Suisse	354	2.242	Yum China Holdings Inc	JP Morgan	4.099	
(411)	Wendy's Co/The	Bank of America		429	Yum! Brands Inc	JP Morgan	(515)	
		Merrill Lynch	53	(37)	Zayo Group Holdings Inc	Deutsche Bank	(39)	
738	Werner Enterprises Inc	JP Morgan	2.660	(604)	Zayo Group Holdings Inc	JP Morgan	(93)	
(194)	WESCO International Inc	Credit Suisse	125	(824)	Zendesk Inc	Citibank	(1.273)	
(98)	Westar Energy Inc	JP Morgan	(308)	(535)	Zillow Group Inc 'C'	Citibank	(3.145)	
226	Western Alliance Bancorp	JP Morgan	39	(37)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Credit Suisse	142	
89	Western Digital Corp	Bank of America		(272)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Deutsche Bank	390	
		Merrill Lynch	207	(66)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America		
270	Western Digital Corp	Deutsche Bank	628			Merrill Lynch	95	
2.283	Western Union Co/The	Credit Suisse	372	271	Zions Bancorporation	JP Morgan	(251)	
(281)	WestRock Co	Bank of America		270	Zoetis Inc	JP Morgan	554	
		Merrill Lynch	316	52	Zoetis Inc	Deutsche Bank	61	
(147)	WestRock Co	Credit Suisse	71	(1.902)	Zynga Inc 'A'	Credit Suisse	(906)	
(227)	WestRock Co	Deutsche Bank	255				16.414	
				Total (exposition brute sous-jacente – 72.357.967 EUR)				(47.138)

BlackRock Total Advantage Fund suite

Swaps au 31 mai 2018

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR	Valeur de marché EUR
TRS	BRL 761.529	Fund receives Fixed 0,000% and pays Ibovespa Index	Bank of America Merrill Lynch	13/6/2018	1.623	1.623
TRS	BRL 86.967	Fund receives Ibovespa Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	13/6/2018	(2.330)	(2.330)
TRS	BRL 575.355	Fund receives Ibovespa Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	13/6/2018	(8.609)	(8.609)
TRS	KRW 1.262.706.400	Fund receives KOSPI 200 Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	14/6/2018	(17.283)	(17.283)
TRS	TWD 69.926.484	Fund receives Taiwan Stock Exchange Capitalization Weighted Stock Index and pays Fixed 0,000%	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(16.319)	(16.319)
TRS	THB 33.485.321	Fund receives Fixed 0,000% and pays SET50 Index	Bank of America Merrill Lynch	28/6/2018	(31.819)	(31.819)
TRS	THB 8.014.252	Fund receives SET50 Index and pays Fixed 0,000%	Credit Suisse	28/6/2018	(7.529)	(7.529)
TRS	THB 1.631.484	Fund receives SET50 Index and pays Fixed 0,000%	Credit Suisse	28/6/2018	(1.053)	(1.053)
TRS	PLN 2.587.830	Fund receives Fixed 0,000% and pays WIG20 Index	HSBC	15/6/2018	(29.065)	(29.065)
TRS	PLN 237.588	Fund receives WIG20 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	15/6/2018	(5.003)	(5.003)
TRS	TRY 232.557	Fund receives BIST 30 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	29/6/2018	864	864
TRS	TRY 189.995	Fund receives BIST 30 Index and pays Fixed 0,000%	HSBC	29/6/2018	(529)	(529)
TRS	TRY 2.002.200	Fund receives Fixed 0,000% and pays BIST 30 Index	HSBC	29/6/2018	(24.662)	(24.662)
Total (exposition brute sous-jacente – 5.445.152 EUR)					(141.714)	(141.714)

TRS (total return swaps) : swaps sur rendement total

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
15	EUR	Amsterdam Index	Juin 2018	1.666.650	(21.308)
114	AUD	Australian 10 Year Bond	Juin 2018	9.504.671	105.880
45	EUR	CAC 40 Index	Juin 2018	2.426.850	(37.945)
86	CAD	Canadian 10 Year Bond	Septembre 2018	5.099.024	146.325
(5)	EUR	DAX Index	Juin 2018	1.583.063	(14.563)
(7)	USD	E-Mini S&P 500 Index	Juin 2018	816.161	(18.324)
57	EUR	Euro Bund	Juin 2018	5.725.706	226.500
7	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	613.818	11.477
26	EUR	FTSE MIB Index	Juin 2018	2.824.900	(177.050)
(5)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index	Juin 2018	170.010	5.302
27	HKD	Hang Seng China Enterprises Index	Juin 2018	1.761.144	(7.573)
11	HKD	Hang Seng Index	Juin 2018	1.834.174	22
1	EUR	IBEX 35 Index	Juin 2018	94.720	(6.992)
12	SGD	MSCI Singapore Index	Juin 2018	301.038	(8.112)
98	SEK	OMX Stockholm 30 Index	Juin 2018	1.481.136	(42.006)
(7)	CAD	S&P/TSX 60 Index	Juin 2018	878.215	(17.743)
14	USD	SGX NIFTY 50 Index	Juin 2018	257.519	1.886
(5)	AUD	SPI 200 Index	Juin 2018	488.899	5.217
37	CHF	Swiss Market Index	Juin 2018	2.751.914	(70.915)
3	JPY	Topix Index	Juin 2018	414.001	(775)
(1)	GBP	UK Long Gilt Bond	Septembre 2018	144.831	(2.152)
(23)	USD	US Treasury 10 Year Note	Septembre 2018	1.979.887	(22.089)
Total				42.818.331	55.062

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

BlackRock Total Advantage Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
AUD	68.000	EUR	43.796	Citibank	20/6/2018	365
AUD	69.000	EUR	44.347	Citibank	18/7/2018	372
AUD	69.000	EUR	44.264	Citibank	15/8/2018	373
BRL	95.000	EUR	23.206	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(1.373)
CAD	103.000	EUR	64.055	Citibank	20/6/2018	4.133
CAD	101.000	EUR	64.671	JP Morgan	20/6/2018	2.193
CAD	962.000	EUR	613.825	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	23.041
CAD	101.000	EUR	64.564	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	2.201
CAD	889.000	EUR	566.540	Citibank	18/7/2018	21.130
CAD	963.000	EUR	613.422	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	23.165
CAD	1.678.000	EUR	1.091.993	JP Morgan	15/8/2018	15.562
CHF	30.000	EUR	25.614	Citibank	20/6/2018	512
CHF	79.000	EUR	66.367	HSBC	15/8/2018	2.476
CLP	26.744.000	EUR	35.725	Citibank	20/6/2018	589
CLP	2.251.000	EUR	3.003	Goldman Sachs	20/6/2018	54
CLP	37.858.000	USD	61.012	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(896)
CLP	59.495.000	USD	95.632	Citibank	20/6/2018	(1.194)
CLP	47.846.000	USD	76.075	Credit Suisse	20/6/2018	(246)
CLP	37.933.000	USD	61.133	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	(885)
CLP	59.617.000	USD	95.821	Citibank	18/7/2018	(1.170)
CLP	47.938.000	USD	76.230	Credit Suisse	18/7/2018	(239)
CLP	41.713.000	USD	66.180	Citibank	16/8/2018	(81)
CLP	33.091.000	USD	52.768	Credit Suisse	16/8/2018	(292)
EUR	393.268	AUD	629.000	Citibank	20/6/2018	(15.227)
EUR	13.734	AUD	22.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(553)
EUR	2.326.198	AUD	3.674.154	HSBC	20/6/2018	(59.928)
EUR	80.311	AUD	128.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(2.817)
EUR	209.478	AUD	332.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(6.135)
EUR	44.611	AUD	69.000	Citibank	18/7/2018	(109)
EUR	348.395	AUD	561.000	HSBC	18/7/2018	(15.192)
EUR	675.536	AUD	1.086.000	JP Morgan	18/7/2018	(28.307)
EUR	80.138	AUD	128.000	Morgan Stanley	18/7/2018	(2.819)
EUR	121.187	AUD	192.000	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	(3.250)
EUR	44.525	AUD	69.000	Citibank	15/8/2018	(112)
EUR	1.139.896	AUD	1.826.000	Goldman Sachs	15/8/2018	(41.371)
EUR	86.686	AUD	137.000	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	(1.942)
EUR	27.596	BRL	118.000	Citibank	20/6/2018	477
EUR	359.849	BRL	1.472.000	Goldman Sachs	20/6/2018	21.553
EUR	20.295	BRL	83.000	Morgan Stanley	20/6/2018	1.220
EUR	560.375	CAD	893.577	Goldman Sachs	20/6/2018	(31.202)
EUR	86.981	CAD	139.000	HSBC	20/6/2018	(5.040)
EUR	304.186	CAD	465.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(3.655)
EUR	106.407	CAD	164.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(2.165)
EUR	303.702	CAD	465.000	Morgan Stanley	18/7/2018	(3.685)
EUR	51.490	CAD	78.000	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	(72)
EUR	98.492	CAD	150.000	HSBC	15/8/2018	(514)
EUR	138.451	CAD	210.000	Morgan Stanley	15/8/2018	(158)
EUR	40.395	CAD	61.000	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	133
EUR	44.277	CHF	53.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(1.879)
EUR	100.394	CHF	117.185	Morgan Stanley	20/6/2018	(1.660)
EUR	44.290	CHF	53.000	Goldman Sachs	18/7/2018	(1.882)
EUR	124.939	CHF	148.000	JP Morgan	18/7/2018	(3.993)
EUR	28.042	CLP	20.957.000	Citibank	20/6/2018	(415)
EUR	43.487	CLP	32.713.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(933)
EUR	674.921	GBP	600.298	Deutsche Bank	20/6/2018	(9.657)
EUR	46.828	GBP	41.000	HSBC	20/6/2018	72
EUR	87.803	GBP	77.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(7)
EUR	245.342	GBP	215.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	157

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	16.069	GBP	14.000	HSBC	18/7/2018	116
EUR	87.735	GBP	77.000	Morgan Stanley	18/7/2018	(6)
EUR	183.675	GBP	161.000	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	216
EUR	87.662	GBP	77.000	Morgan Stanley	15/8/2018	(8)
EUR	131.153	GBP	115.000	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	216
EUR	273.881	HKD	2.661.468	Citibank	20/6/2018	(16.940)
EUR	129.575	HUF	40.984.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	1.202
EUR	447.474	HUF	142.037.622	Citibank	20/6/2018	2.574
EUR	515.061	HUF	160.833.947	Credit Suisse	20/6/2018	11.285
EUR	6.068	HUF	1.912.186	JP Morgan	20/6/2018	79
EUR	30.340	HUF	9.567.244	Morgan Stanley	20/6/2018	373
EUR	129.533	HUF	40.982.000	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	1.199
EUR	826.212	HUF	260.138.622	Citibank	18/7/2018	11.593
EUR	27.908	HUF	8.790.947	Credit Suisse	18/7/2018	380
EUR	6.066	HUF	1.912.186	JP Morgan	18/7/2018	78
EUR	30.332	HUF	9.567.244	Morgan Stanley	18/7/2018	372
EUR	129.538	HUF	40.998.000	Bank of America Merrill Lynch	15/8/2018	1.197
EUR	336.883	HUF	107.410.000	Citibank	15/8/2018	644
EUR	432.440	HUF	136.459.000	Goldman Sachs	15/8/2018	5.266
EUR	90.020	INR	7.251.000	JP Morgan	20/6/2018	(1.922)
EUR	256.586	JPY	32.405.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	276
EUR	41.413	JPY	5.414.000	Citibank	20/6/2018	(1.409)
EUR	138.252	JPY	17.984.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(3.993)
EUR	256.506	JPY	32.403.000	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	269
EUR	41.399	JPY	5.413.000	Citibank	18/7/2018	(1.406)
EUR	15.815	JPY	2.100.000	HSBC	18/7/2018	(791)
EUR	138.203	JPY	17.981.000	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	(3.987)
EUR	256.502	JPY	32.410.000	Bank of America Merrill Lynch	15/8/2018	267
EUR	39.126	JPY	5.123.000	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	(1.377)
EUR	33.848	KRW	44.752.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(1.758)
EUR	522.710	KRW	690.602.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(26.757)
EUR	16.893	KRW	22.235.000	UBS	20/6/2018	(798)
EUR	65.943	MXN	1.520.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	969
EUR	229.516	MXN	5.326.000	Citibank	20/6/2018	1.853
EUR	53.839	MXN	1.248.000	Goldman Sachs	20/6/2018	492
EUR	38.518	MXN	903.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(81)
EUR	185.106	MXN	4.320.000	Citibank	18/7/2018	1.749
EUR	65.924	MXN	1.530.000	Credit Suisse	18/7/2018	985
EUR	38.509	MXN	909.000	Morgan Stanley	18/7/2018	(73)
EUR	153.512	MXN	3.609.000	Citibank	15/8/2018	1.350
EUR	38.463	MXN	914.000	Morgan Stanley	15/8/2018	(73)
EUR	34.586	NOK	333.000	Credit Suisse	20/6/2018	(295)
EUR	396.730	NOK	3.809.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(2.260)
EUR	835.534	NOK	8.062.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(8.954)
EUR	131.110	NOK	1.266.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(1.502)
EUR	34.545	NOK	333.000	Credit Suisse	18/7/2018	(299)
EUR	1.062.100	NOK	10.259.000	Goldman Sachs	18/7/2018	(11.375)
EUR	131.053	NOK	1.267.000	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	(1.522)
EUR	1.231.673	NOK	11.837.000	JP Morgan	15/8/2018	(5.698)
EUR	47.055	NZD	81.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(1.614)
EUR	60.213	NZD	102.000	HSBC	20/6/2018	(1.074)
EUR	136.683	NZD	229.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(913)
EUR	128.733	NZD	218.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(2.254)
EUR	136.360	NZD	229.000	Morgan Stanley	18/7/2018	(932)
EUR	128.441	NZD	218.000	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	(2.255)

BlackRock Total Advantage Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	136.671	NZD	230.000	Morgan Stanley	15/8/2018	(942)
EUR	128.766	NZD	219.000	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	(2.265)
EUR	14.455	PLN	62.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	102
EUR	38.388	PLN	165.000	Citibank	20/6/2018	190
EUR	25.381	PLN	109.000	Deutsche Bank	20/6/2018	147
EUR	49.715	PLN	208.000	JP Morgan	20/6/2018	1.562
EUR	16.816	PLN	71.000	Morgan Stanley	20/6/2018	379
EUR	14.431	PLN	62.000	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	100
EUR	38.553	PLN	166.000	Citibank	18/7/2018	184
EUR	25.338	PLN	109.000	Deutsche Bank	18/7/2018	144
EUR	49.629	PLN	208.000	JP Morgan	18/7/2018	1.552
EUR	14.409	PLN	62.000	Bank of America Merrill Lynch	16/8/2018	100
EUR	38.491	PLN	166.000	Citibank	16/8/2018	181
EUR	15.965	RUB	1.145.000	Citibank	20/6/2018	226
EUR	218.018	RUB	17.376.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(20.820)
EUR	30.894	RUB	2.215.000	JP Morgan	20/6/2018	448
EUR	21.435	RUB	1.548.000	UBS	20/6/2018	157
EUR	836.654	SEK	8.494.200	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	10.101
EUR	257.708	SEK	2.620.000	Citibank	20/6/2018	2.761
EUR	104.136	SEK	1.085.000	Credit Suisse	20/6/2018	(1.443)
EUR	112.205	SEK	1.175.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(2.132)
EUR	758.244	SEK	7.791.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	118
EUR	80.290	SEK	824.000	Citibank	18/7/2018	104
EUR	104.043	SEK	1.084.000	Credit Suisse	18/7/2018	(1.444)
EUR	112.209	SEK	1.175.000	Deutsche Bank	18/7/2018	(2.133)
EUR	1.047.569	SEK	10.771.000	Goldman Sachs	18/7/2018	(584)
EUR	602.990	SEK	6.197.000	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	(56)
EUR	68.955	SEK	705.000	Citibank	15/8/2018	346
EUR	975.460	SEK	10.069.000	JP Morgan	15/8/2018	(4.421)
EUR	603.022	SEK	6.197.000	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	(49)
EUR	22.185	SGD	36.000	HSBC	20/6/2018	(861)
EUR	1.294.329	SGD	2.107.218	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(54.653)
EUR	1.202.100	SGD	1.957.000	HSBC	18/7/2018	(48.686)
EUR	743.821	SGD	1.191.000	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	(16.316)
EUR	20.629	THB	791.000	HSBC	20/6/2018	(578)
EUR	32.776	THB	1.223.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(13)
EUR	20.625	THB	792.000	HSBC	18/7/2018	(583)
EUR	32.754	THB	1.224.000	Morgan Stanley	18/7/2018	(21)
EUR	32.767	THB	1.226.000	Morgan Stanley	15/8/2018	(25)
EUR	117.073	TRY	618.000	Citibank	20/6/2018	908
EUR	28.381	TRY	150.000	Credit Suisse	20/6/2018	186
EUR	17.875	TRY	91.000	HSBC	20/6/2018	770
EUR	30.253	TRY	152.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	1.682
EUR	95.564	TRY	515.000	Citibank	18/7/2018	15
EUR	28.218	TRY	151.000	Credit Suisse	18/7/2018	203
EUR	17.877	TRY	92.000	HSBC	18/7/2018	808
EUR	30.313	TRY	154.000	JP Morgan	18/7/2018	1.740
EUR	95.802	TRY	523.000	Citibank	15/8/2018	25
EUR	28.232	TRY	153.000	Credit Suisse	15/8/2018	213
EUR	109.670	TWD	3.958.000	Deutsche Bank	20/6/2018	(3.694)
EUR	1.707.598	TWD	61.556.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(55.477)
EUR	109.645	TWD	3.956.000	Deutsche Bank	18/7/2018	(3.672)
EUR	967.498	TWD	34.619.000	Goldman Sachs	18/7/2018	(24.146)
EUR	119.085	USD	143.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(3.500)
EUR	80.301	USD	100.000	HSBC	20/6/2018	(5.423)
EUR	386.228	USD	478.000	JP Morgan	20/6/2018	(23.533)
EUR	4.843.062	USD	6.014.532	Morgan Stanley	20/6/2018	(312.846)
EUR	495.516	USD	605.000	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	(23.115)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
EUR	119.633	USD	144.000	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	(3.539)
EUR	354.274	USD	431.000	HSBC	18/7/2018	(14.387)
EUR	1.508.944	USD	1.876.391	Morgan Stanley	18/7/2018	(96.045)
EUR	1.538.918	USD	1.839.066	JP Morgan	15/8/2018	(30.854)
EUR	51.567	ZAR	758.000	Citibank	20/6/2018	242
EUR	131.463	ZAR	1.969.000	HSBC	20/6/2018	(1.859)
EUR	24.397	ZAR	369.000	Morgan Stanley	20/6/2018	(588)
EUR	20.945	ZAR	309.000	Citibank	18/7/2018	146
EUR	131.484	ZAR	1.981.000	HSBC	18/7/2018	(1.859)
EUR	24.383	ZAR	371.000	Morgan Stanley	18/7/2018	(590)
EUR	20.959	ZAR	311.000	Citibank	15/8/2018	143
GBP	145.000	EUR	165.323	Morgan Stanley	20/6/2018	35
GBP	87.000	EUR	98.422	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	792
GBP	516.000	EUR	589.946	Citibank	18/7/2018	(1.966)
GBP	92.000	EUR	104.539	Morgan Stanley	18/7/2018	295
GBP	87.000	EUR	98.344	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	792
GBP	635.000	EUR	724.127	HSBC	15/8/2018	(1.127)
HKD	790.000	EUR	86.634	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(310)
HKD	714.000	EUR	75.020	JP Morgan	20/6/2018	3.000
HUF	70.494.000	EUR	226.415	Citibank	20/6/2018	(5.608)
HUF	36.583.000	EUR	117.734	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	(3.175)
INR	8.778.000	EUR	107.666	Deutsche Bank	20/6/2018	3.638
INR	165.498.000	EUR	2.027.357	Morgan Stanley	20/6/2018	71.130
INR	3.832.000	EUR	47.089	UBS	20/6/2018	1.500
INR	24.294.000	USD	364.999	JP Morgan	20/6/2018	(4.849)
INR	156.298.000	USD	2.370.073	Citibank	18/7/2018	(55.895)
INR	24.294.000	USD	363.770	JP Morgan	18/7/2018	(4.736)
INR	160.429.000	USD	2.351.883	HSBC	16/8/2018	5.570
JPY	8.424.000	EUR	64.209	Citibank	20/6/2018	2.421
JPY	4.078.000	EUR	31.050	Goldman Sachs	20/6/2018	1.205
JPY	6.011.000	EUR	45.421	JP Morgan	20/6/2018	2.124
JPY	77.129.334	EUR	582.531	Morgan Stanley	20/6/2018	27.530
JPY	60.504.000	EUR	456.911	Citibank	18/7/2018	21.545
JPY	38.376.000	EUR	289.261	HSBC	18/7/2018	14.210
JPY	6.011.000	EUR	45.429	Morgan Stanley	18/7/2018	2.105
JPY	1.487.000	EUR	11.437	Citibank	15/8/2018	319
JPY	85.130.000	EUR	652.464	Goldman Sachs	15/8/2018	20.576
KRW	42.226.000	EUR	31.878	HSBC	20/6/2018	1.718
KRW	60.813.000	EUR	46.386	JP Morgan	20/6/2018	1.999
KRW	196.078.000	USD	181.913	Citibank	20/6/2018	63
KRW	58.766.000	USD	54.577	Deutsche Bank	20/6/2018	(30)
KRW	15.596.000	USD	14.432	Goldman Sachs	20/6/2018	37
KRW	17.662.000	USD	16.433	HSBC	20/6/2018	(34)
KRW	162.109.000	USD	150.480	Citibank	18/7/2018	117
KRW	15.610.000	USD	14.459	Goldman Sachs	18/7/2018	38
KRW	17.677.000	USD	16.465	HSBC	18/7/2018	(35)
KRW	58.823.000	USD	54.695	JP Morgan	18/7/2018	(36)
KRW	34.188.000	USD	31.826	Morgan Stanley	18/7/2018	(53)
KRW	162.306.000	USD	150.798	Citibank	16/8/2018	155
KRW	58.892.000	USD	54.790	Goldman Sachs	16/8/2018	(7)
MXN	1.245.000	EUR	54.291	Citibank	20/6/2018	(1.072)
MXN	7.138.000	EUR	305.250	Goldman Sachs	20/6/2018	(131)
MXN	1.315.000	EUR	57.247	JP Morgan	20/6/2018	(1.036)
MXN	7.482.000	EUR	323.728	Citibank	18/7/2018	(6.163)
MXN	5.243.000	EUR	220.466	Goldman Sachs	15/8/2018	588
NOK	2.386.000	EUR	249.910	Citibank	20/6/2018	22
NOK	276.000	EUR	28.655	JP Morgan	20/6/2018	256
NOK	1.981.000	EUR	206.802	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	707
NOK	1.488.000	EUR	155.699	Citibank	18/7/2018	2
NOK	1.542.000	EUR	161.412	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	(62)
NOK	1.489.000	EUR	155.648	Citibank	15/8/2018	4
NOK	1.542.000	EUR	161.252	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	(60)
NZD	26.000	EUR	15.386	Citibank	20/6/2018	237

BlackRock Total Advantage Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
NZD	47.000	EUR	27.598	Goldman Sachs	20/6/2018	642
NZD	439.000	EUR	258.567	HSBC	20/6/2018	5.210
NZD	288.000	EUR	167.304	JP Morgan	20/6/2018	5.743
NZD	81.000	EUR	47.476	Morgan Stanley	20/6/2018	1.193
NZD	327.000	EUR	190.824	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	5.657
NZD	331.000	EUR	195.567	JP Morgan	18/7/2018	2.876
NZD	370.000	EUR	214.816	Morgan Stanley	18/7/2018	7.009
NZD	327.000	EUR	190.402	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	5.643
NZD	697.000	EUR	407.314	Goldman Sachs	15/8/2018	9.713
NZD	328.000	EUR	190.597	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	5.651
PLN	2.023.000	EUR	478.846	Citibank	20/6/2018	(10.509)
PLN	369.000	EUR	86.257	Morgan Stanley	20/6/2018	(831)
PLN	2.318.000	EUR	548.753	Morgan Stanley	18/7/2018	(12.973)
PLN	2.004.000	EUR	466.853	Morgan Stanley	16/8/2018	(4.363)
RUB	37.484.000	EUR	525.483	Citibank	20/6/2018	(10.256)
RUB	15.541.000	USD	239.405	Goldman Sachs	18/7/2018	7.726
RUB	8.698.000	USD	136.006	Goldman Sachs	15/8/2018	2.255
SEK	245.000	EUR	23.740	JP Morgan	20/6/2018	100
SEK	3.204.000	EUR	304.064	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	7.710
SEK	3.080.000	EUR	292.024	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	7.698
SGD	543.000	EUR	334.740	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	12.873
SGD	680.000	EUR	429.026	Citibank	20/6/2018	6.291
SGD	125.000	EUR	77.630	JP Morgan	20/6/2018	2.392
SGD	139.000	EUR	87.218	Morgan Stanley	20/6/2018	1.766
SGD	705.000	EUR	444.437	Citibank	18/7/2018	6.153
SGD	470.000	EUR	289.091	HSBC	18/7/2018	11.302
SGD	139.000	EUR	87.058	Morgan Stanley	18/7/2018	1.782
SGD	451.000	EUR	285.901	Citibank	15/8/2018	1.942
THB	39.693.000	EUR	1.026.920	Citibank	20/6/2018	37.238
THB	7.315.000	EUR	190.410	Goldman Sachs	20/6/2018	5.703
THB	1.077.000	EUR	27.935	HSBC	20/6/2018	940
THB	2.979.000	EUR	78.743	Morgan Stanley	20/6/2018	1.123
THB	833.000	EUR	21.685	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	647
THB	4.242.000	EUR	109.569	Citibank	18/7/2018	4.019
THB	2.643.000	EUR	69.459	Goldman Sachs	18/7/2018	1.313
THB	2.981.000	EUR	78.707	Morgan Stanley	18/7/2018	1.116
THB	42.016.000	EUR	1.084.810	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	40.256
THB	48.062.000	EUR	1.255.807	HSBC	15/8/2018	29.740
THB	2.984.000	EUR	78.718	Morgan Stanley	15/8/2018	1.097
TRY	431.000	EUR	84.625	Citibank	20/6/2018	(3.610)
TRY	1.872.000	EUR	378.932	Morgan Stanley	20/6/2018	(27.053)
TRY	2.196.000	EUR	412.779	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	(5.348)
TRY	1.957.000	EUR	370.908	Goldman Sachs	15/8/2018	(12.524)
TWD	614.000	EUR	17.199	Citibank	20/6/2018	387
TWD	738.000	EUR	20.612	JP Morgan	20/6/2018	525
TWD	661.000	EUR	18.457	UBS	20/6/2018	475
TWD	739.000	EUR	20.645	JP Morgan	18/7/2018	524
TWD	2.061.000	USD	70.370	JP Morgan	20/6/2018	(1.293)
TWD	2.062.000	USD	70.556	JP Morgan	18/7/2018	(1.286)
USD	56.397	BRL	201.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	2.152
USD	197.750	BRL	719.000	Citibank	20/6/2018	4.278
USD	285.519	BRL	999.000	Deutsche Bank	20/6/2018	15.168
USD	15.849	BRL	57.000	JP Morgan	20/6/2018	486
USD	56.535	BRL	202.000	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	2.162
USD	198.061	BRL	722.000	Citibank	18/7/2018	4.297
USD	285.374	BRL	1.001.000	Deutsche Bank	18/7/2018	15.177
USD	252.389	BRL	872.000	JP Morgan	18/7/2018	16.463
USD	144.668	BRL	535.000	Citibank	15/8/2018	1.707
USD	62.191	BRL	233.000	Deutsche Bank	15/8/2018	49
USD	559.121	BRL	2.030.000	Goldman Sachs	15/8/2018	15.180

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
USD	127.397	CLP	75.986.000	Deutsche Bank	20/6/2018	6.032
USD	520.448	CLP	312.612.000	Citibank	18/7/2018	21.524
USD	127.384	CLP	75.986.000	Deutsche Bank	18/7/2018	5.985
USD	504.703	CLP	318.846.000	Credit Suisse	16/8/2018	(376)
USD	277.000	EUR	230.490	Citibank	20/6/2018	6.966
USD	309.000	EUR	259.864	Goldman Sachs	20/6/2018	5.024
USD	509.000	EUR	430.956	Morgan Stanley	20/6/2018	5.380
USD	1.397.000	EUR	1.194.993	State Street Bank & Trust Company	20/6/2018	2.574
USD	195.000	EUR	163.923	Citibank	18/7/2018	2.872
USD	310.000	EUR	260.094	Goldman Sachs	18/7/2018	5.068
USD	484.000	EUR	409.696	Morgan Stanley	18/7/2018	4.298
USD	1.399.000	EUR	1.193.861	State Street Bank & Trust Company	18/7/2018	2.787
USD	200.000	EUR	168.610	Bank of America Merrill Lynch	15/8/2018	2.104
USD	485.000	EUR	409.673	Morgan Stanley	15/8/2018	4.308
USD	1.402.000	EUR	1.193.905	State Street Bank & Trust Company	15/8/2018	2.801
USD	266.208	INR	18.022.000	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2018	(312)
USD	147.360	INR	10.033.000	Citibank	20/6/2018	(893)
USD	100.716	INR	6.812.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(37)
USD	121.369	INR	8.156.000	HSBC	20/6/2018	626
USD	147.625	INR	10.089.000	Citibank	18/7/2018	(979)
USD	367.703	INR	24.982.000	Goldman Sachs	18/7/2018	(577)
USD	121.602	INR	8.199.000	HSBC	18/7/2018	600
USD	108.961	INR	7.483.000	Citibank	16/8/2018	(891)
USD	224.805	INR	15.411.000	Goldman Sachs	16/8/2018	(1.490)
USD	285.230	KRW	304.768.000	JP Morgan	20/6/2018	2.027
USD	973.411	KRW	1.037.286.000	Citibank	18/7/2018	8.263
USD	285.505	KRW	304.677.000	JP Morgan	18/7/2018	2.076
USD	1.183.693	KRW	1.274.174.000	UBS	16/8/2018	(1.336)
USD	78.688	RUB	4.926.000	Citibank	20/6/2018	(254)
USD	59.848	RUB	3.736.000	Goldman Sachs	20/6/2018	(48)
USD	54.333	RUB	3.413.000	HSBC	20/6/2018	(336)
USD	45.966	RUB	2.889.000	JP Morgan	20/6/2018	(306)
USD	78.851	RUB	4.953.000	Citibank	18/7/2018	(280)
USD	59.958	RUB	3.755.000	Goldman Sachs	18/7/2018	(59)
USD	54.429	RUB	3.430.000	HSBC	18/7/2018	(344)
USD	45.892	RUB	2.894.000	JP Morgan	18/7/2018	(318)
USD	59.377	RUB	3.714.000	Citibank	15/8/2018	149
USD	38.785	RUB	2.413.000	Goldman Sachs	15/8/2018	274
USD	35.619	RUB	2.246.000	HSBC	15/8/2018	(156)
USD	215.284	TWD	6.437.000	Citibank	20/6/2018	183
USD	87.108	TWD	2.611.000	Credit Suisse	20/6/2018	(111)
USD	299.383	TWD	8.911.000	HSBC	20/6/2018	1.417
USD	41.172	TWD	1.230.000	JP Morgan	20/6/2018	65
USD	41.151	TWD	1.230.000	UBS	20/6/2018	47
USD	96.084	TWD	2.863.000	Bank of America Merrill Lynch	18/7/2018	177
USD	215.667	TWD	6.437.000	Citibank	18/7/2018	88
USD	87.238	TWD	2.611.000	Credit Suisse	18/7/2018	(171)
USD	203.969	TWD	6.050.000	HSBC	18/7/2018	1.167
USD	41.245	TWD	1.230.000	JP Morgan	18/7/2018	46
USD	41.213	TWD	1.230.000	UBS	18/7/2018	19
USD	96.281	TWD	2.863.000	Bank of America Merrill Lynch	15/8/2018	155
USD	216.075	TWD	6.436.000	Citibank	15/8/2018	38
USD	45.887	TWD	1.375.000	Credit Suisse	15/8/2018	(227)
USD	1.528.194	TWD	45.506.000	HSBC	15/8/2018	635
ZAR	2.723.000	EUR	180.792	Citibank	20/6/2018	3.584
ZAR	332.000	EUR	22.344	Goldman Sachs	20/6/2018	136
ZAR	176.000	EUR	11.614	JP Morgan	20/6/2018	303
ZAR	5.275.661	EUR	354.269	Morgan Stanley	20/6/2018	2.950
ZAR	7.689.000	EUR	504.922	Citibank	18/7/2018	12.632
ZAR	448.000	EUR	29.743	Citibank	15/8/2018	243
ZAR	4.917.000	EUR	322.777	Goldman Sachs	15/8/2018	6.329
						(483.473)

BlackRock Total Advantage Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes EUR
Catégorie d'Actions couverte en livres sterling						
EUR	79	GBP	70	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	0
GBP	4.433	EUR	5.060	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(4)
						(4)
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
EUR	71	USD	84	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1)
USD	5.874	EUR	4.938	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	101
						100
Total (exposition brute sous-jacente – 108.464.732 EUR)						(483.377)

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Gouvernement	89,80
Portefeuille de titres à la valeur de marché	89,80
Autres éléments de l'actif net	10,20
	100,00

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Nombre	Description	Valeur de marché GBP	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché GBP	% de l'actif net
OBLIGATIONS				BILLET DE TRÉSORERIE			
Australie				Finlande			
GBP 900.000	Commonwealth Bank of Australia FRN 11/1/2019	898.636	0,64	GBP 2.000.000	OP Corporate Bank Plc 25/10/2018 (Zero Coupon)	1.993.308	1,43
GBP 1.000.000	Commonwealth Bank of Australia RegS FRN 10/1/2019	999.475	0,72			1.993.308	1,43
		1.898.111	1,36	France			
Pays-Bas				GBP 4.000.000	Agence Centrale Des Organismes Regs 6/6/2018 (Zero Coupon)	3.999.712	2,87
GBP 1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 1/3/2019	999.090	0,72	GBP 4.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel 8/8/2018 (Zero Coupon)	3.994.867	2,86
GBP 300.000	Cooperatieve Rabobank UA RegS FRN 25/9/2018	300.077	0,21	GBP 2.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA RegS 24/7/2018 (Zero Coupon)	1.997.826	1,43
		1.299.167	0,93	GBP 6.500.000	BRED Banque Populaire SA 12/7/2018 (Zero Coupon)	6.494.171	4,65
Singapour						16.486.576	11,81
GBP 300.000	DBS Bank Ltd RegS FRN 26/7/2018	303.131	0,22	Allemagne			
GBP 500.000	DBS Bank Ltd RegS FRN 22/3/2019	499.392	0,36	GBP 6.000.000	Erste Abwicklungsanstalt 31/7/2018 (Zero Coupon)	5.993.108	4,29
		802.523	0,58			5.993.108	4,29
Royaume-Uni				Luxembourg			
GBP 1.500.000	HSBC Bank Plc RegS FRN 25/7/2018	1.500.345	1,07	GBP 1.000.000	DBS Bank Ltd 3/8/2018 (Zero Coupon)	998.623	0,71
		1.500.345	1,07	GBP 1.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 26/9/2018 (Zero Coupon)	997.446	0,71
Total des obligations		5.500.146	3,94	GBP 5.000.000	LMA SA 11/6/2018 (Zero Coupon)	4.999.110	3,58
CERTIFICATS DE DÉPÔT				GBP 3.000.000	Municipality Finance Plc 29/6/2018 (Zero Coupon)	2.998.277	2,15
France				GBP 1.000.000	OP Corporate Bank Plc 30/7/2018 (Zero Coupon)	999.033	0,72
GBP 5.000.000	BNP Paribas SA/London 0,66% 10/8/2018	5.000.000	3,58	GBP 3.000.000	OP Corporate Bank Plc 19/9/2018 (Zero Coupon)	2.993.245	2,14
		5.000.000	3,58			13.985.734	10,01
Japon				Pays-Bas			
GBP 1.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0,70% 10/8/2018	1.000.000	0,71	GBP 3.000.000	PACCAR Financial Europe BV Regs 7/6/2018 (Zero Coupon)	2.999.749	2,15
		1.000.000	0,71			2.999.749	2,15
Pays-Bas				Suède			
GBP 5.000.000	ABN AMRO Bank NV 0,69% 4/9/2018	5.000.000	3,58	GBP 6.000.000	Nordea Bank AB 8/8/2018 (Zero Coupon)	5.992.635	4,29
		5.000.000	3,58			5.992.635	4,29
Suède				Etats-Unis			
GBP 6.000.000	Svenska Handelsbanken AB 0,635% 8/8/2018	6.000.056	4,30	GBP 3.000.000	Bank of America NA/London 23/11/2018 (Zero Coupon)	3.000.000	2,15
		6.000.056	4,30	GBP 4.000.000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 11/6/2018 (Zero Coupon)	3.999.452	2,86
Royaume-Uni						6.999.452	5,01
GBP 1.000.000	ABN AMRO Bank NV 0,79% 1/8/2018	1.000.000	0,71	Total des billets de trésorerie		54.450.562	38,99
GBP 500.000	Cooperatieve Rabobank 0,90% 12/10/2018	500.000	0,36	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		96.443.054	69,06
GBP 6.000.000	ING Bank NV 0,81% 20/8/2018	6.000.000	4,30				
GBP 6.000.000	Nationwide Building Society 0,60% 14/8/2018	6.000.000	4,30				
GBP 3.000.000	Toronto-Dominion Bank/London 0,734% 9/11/2018	2.992.290	2,14				
GBP 3.000.000	Toronto-Dominion Bank/London 0,66% 14/9/2018	3.000.000	2,15				
		19.492.290	13,96				
Total des certificats de dépôt		36.492.346	26,13				

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund suite

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire				Organismes de placement collectif			
Nombre	Description	Valeur de marché GBP	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché GBP	% de l'actif net
OBLIGATIONS				Irlande			
GBP 5.500.000	Allemagne DZ Bank AG 0,78% 4/7/2018	5.501.815	3,94	13.423.534	Institutional Cash Series Plc - Institutional Sterling Liquidity Fund Agency Dis ¹	13.423.534	9,61
		5.501.815	3,94			13.423.534	9,61
GBP 6.000.000	Japon Norinchukin Bank/London 17/7/2018 (Zero Coupon)	5.996.220	4,30	Total des organismes de placement collectif		13.423.534	9,61
		5.996.220	4,30	Portefeuille de titres à la valeur de marché		129.064.071	92,42
GBP 700.000	Singapour DBS Bank Ltd/Hong Kong RegS FRN 23/3/2019	699.118	0,50	Autres éléments de l'actif net		10.583.554	7,58
		699.118	0,50	Total de l'actif net (GBP)		139.647.625	100,00
GBP 6.000.000	Royaume-Uni Lloyds Bank Plc FRN 12/11/2018*	6.000.000	4,30				
GBP 1.000.000	Mizuho Corporate Bank/London 0,79% 6/7/2018	1.000.330	0,71				
		7.000.330	5,01				
Total des obligations		19.197.483	13,75				
Total des autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire		19.197.483	13,75				

* Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

¹ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund suite

« Contracts for difference » au 31 mai 2018

[illegible]

* Ce titre n'est pas liquide sur le marché.

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

*** Le sous-jacent du CFD fait l'objet d'un concordat pour la dissolution de la SCPI.

BlackRock UK Equity Absolute Return Fund suite

Contrats à terme au 31 mai 2018

Nombre de contrats	Devise du contrat	Contrat/Description	Date d'expiration	Exposition brute sous-jacente GBP	(Moins-value) non réalisée GBP
(500)	GBP	FTSE 100 Index	Juin 2018	38.430.000	(2.675.420)
(98)	GBP	FTSE 250 Index	Juin 2018	4.094.342	(190.566)
Total				42.524.342	(2.865.986)

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes GBP
Catégorie d'Actions couverte en francs suisses						
CHF	5.008	GBP	3.690	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	134
GBP	17	CHF	24	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1)
						133
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	42.880.027	GBP	37.567.764	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	25.658
GBP	400.952	EUR	457.255	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	71
						25.729
Catégorie d'Actions couverte en yens japonais						
JPY	14.244.724.656	GBP	95.831.472	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	2.952.970
						2.952.970
Catégorie d'Actions couverte en dollars US						
USD	236.338	GBP	174.787	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	2.935
						2.935
Total (exposition brute sous-jacente – 136.960.308 GBP)						2.981.767

Répartition sectorielle au 31 mai 2018

	% de l'actif net
Finance	82,81
Organismes de placement collectif	9,61
Portefeuille de titres à la valeur de marché	92,42
Autres éléments de l'actif net	7,58
100,00	

BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 mai 2018

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				
Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net	
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		—	0,00	
Portefeuille de titres à la valeur de marché		—	0,00	
Autres éléments de l'actif net		168.926	100,00	
Total de l'actif net (USD)		168.926	100,00	

BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund suite

Opérations de change à terme en cours au 31 mai 2018

Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) latentes USD
Catégorie d'Actions couverte en euros						
EUR	10.290	USD	12.244	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(247)
USD	474	EUR	398	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	10
						(237)
Total (exposition brute sous-jacente – 12.461 USD)						(237)

L'Annexe des pages 631 à 645 fait partie intégrante de ces états financiers.

Annexe aux États Financiers

1. Organisation

BlackRock Strategic Funds (la « Société ») est une société anonyme constituée, conformément aux lois du Grand-Duché de Luxembourg, en tant que société d'investissement à capital variable. La Société a été agréée par la Commission de surveillance du secteur financier (la « CSSF ») en tant qu'OPCVM conformément aux dispositions de la Partie I de la loi du 17 décembre 2010 concernant les organismes de placement collectif dans des titres négociables, telle qu'amendée, et est réglementée par cette loi (la « Loi de 2010 »).

La Société a nommé BlackRock (Luxembourg) S.A. comme Société de Gestion.

Au 31 mai 2018, la Société offrait les actions de 35 Compartiments (dénommés individuellement « Compartiment » et collectivement « Compartiments »). La Société est un fonds à compartiments multiples, à responsabilité séparée entre ses Compartiments. Le passif de chaque Compartiment est distinct de celui des autres Compartiments, et la Société dans son ensemble n'est pas responsable, vis-à-vis de tierces parties, des passifs de chaque Compartiment. Chaque Compartiment sera constitué d'un portefeuille d'investissements séparé, tenu et investi conformément aux objectifs d'investissement applicables à ce Compartiment. Chaque Compartiment est un pool distinct d'actifs et est représenté par des actions distinctes, elles-mêmes divisées en catégories d'actions, comme indiqué à l'Appendice I.

Ces catégories d'actions ont des droits équivalents dans la Société, mais présentent des caractéristiques et des frais de vente différents, qui sont détaillés dans le Prospectus de la Société.

Catégories d'Actions lancées

Les Catégories d'Actions lancées au cours de l'exercice figurent à l'Appendice I.

Événements importants au cours de l'exercice

- ▶ Avec effet le 17 juillet 2017, Paul Freeman a été nommé président du Conseil d'administration de la Société.
- ▶ Avec effet le 29 septembre 2017, Frank Le Feuvre a quitté ses fonctions au sein du Conseil d'administration de la Société.
- ▶ Avec effet le 2 octobre 2017, le taux de la commission de gestion a été réduit, passant de 0,65 % à 0,55 % pour les Catégories D et I du Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund.
- ▶ Avec effet à compter du 6 novembre 2017, les Compartiments suivants peuvent obtenir une exposition directe aux obligations onshore chinoises via le Marché obligataire interbancaire chinois (« CIBM ») (dans la limite maximale de 10 % de la Valeur Nette d'Inventaire du Compartiment (la « VNI »)):

- ▶ BlackRock European Credit Strategies Fund
- ▶ BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund
- ▶ BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund
- ▶ BlackRock Fixed Income Strategies Fund
- ▶ BlackRock Global Absolute Return Bond Fund

- ▶ Un nouveau Prospectus a été publié le 24 novembre 2017.
- ▶ Avec effet le 29 novembre 2017, le Compartiment BlackRock Macro Opportunities Fund, libellé en USD, a été lancé.
- ▶ Avec effet le 30 novembre 2017, le Compartiment BlackRock Global Real Asset Securities Fund, libellé en USD, a été lancé.
- ▶ Avec effet le 6 décembre 2017, le Compartiment BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund, libellé en USD, a été lancé.
- ▶ Avec effet le 11 décembre 2017, le Compartiment BlackRock Total Advantage Fund, libellé en EUR, a été lancé.
- ▶ Avec effet le 12 décembre 2017, le Gestionnaire Financier par délégation du Compartiment BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund, BlackRock Investment Management (UK), a été remplacé par BlackRock Financial Management, Inc.
- ▶ Avec effet le 21 décembre 2017, Michael Gruener a été nommé aux fonctions d'Administrateur du Conseil d'administration de la Société.
- ▶ Conformément à la nouvelle réglementation entrant en vigueur en janvier 2018 en vertu de la directive UE 2014/65/UE sur les marchés d'instruments financiers, appelée « MiFID II », BlackRock ne paiera plus pour la recherche externe qu'il utilise par le biais des commissions de négociation client pour ses fonds visés par la MiFID II (les « Fonds visés par la MiFID II »). BlackRock couvrira ces coûts de recherche avec ses propres ressources. Les Fonds visés par la MiFID II comprennent ceux qui ont désigné une société MiFID du BlackRock Group comme gestionnaire des investissements ou ceux pour lesquels la gestion des investissements a été déléguée par cette société à une affiliée étrangère.

Au 31 mai 2018, tous les Compartiments sont considérés comme étant des Fonds visés par la MiFID II à l'exception des Compartiments BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund, BlackRock Asia Extension Fund, BlackRock Global Event Driven Fund, BlackRock Global Long/Short Equity Fund, BlackRock Impact World Equity Fund, BlackRock Latin American Opportunities Fund, BlackRock Macro Opportunities Fund, BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund, BlackRock Style Advantage Fund, BlackRock Systematic Global Equity Fund et BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund.

Annexe aux États Financiers suite

Ces Compartiments ont nommé directement une affiliée étrangère du BlackRock Group dans un pays tiers (c'est-à-dire hors Union européenne) pour exécuter la gestion de portefeuille. Les Compartiments ne sont pas visés par la MiFID II et seront soumis aux lois et pratiques de marché locales régissant la recherche externe dans la juridiction applicable de l'affiliée en question. Ceci signifie que les coûts de recherche externe devront être prélevés sur l'actif de ces Compartiments, et figureront dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net sous le titre « Autres frais ».

- ▶ Avec effet le 8 janvier 2018, le Compartiment BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund, libellé en USD, a été lancé.
- ▶ Avec effet le 26 janvier 2018, le Compartiment BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative, libellé en EUR, a été lancé.
- ▶ Avec effet le 2 février 2018, le Gestionnaire délégué externe suivant a été ajouté à la liste existante des Gestionnaires délégués externes du Compartiment BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund :
 - ▶ Acadian Asset Management LLC, au 260 Franklin Street, Boston, MA 02110, États-Unis.
- ▶ Un nouveau Prospectus a été publié le 9 février 2018.
- ▶ Avec effet le 30 mai 2018, le Gestionnaire délégué externe suivant a été retiré de la liste existante des Gestionnaires délégués externes du Compartiment BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund :
 - ▶ Pine River Capital Management LP, au 601 Carlson Parkway, Suite 330, Minnetonka, MN 55305, États-Unis.
- ▶ En 2018, un problème a été identifié dans le calcul de la Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») de certains Compartiments, en raison d'un problème dans la comptabilité des CFD. Les Compartiments significativement touchés sont :
 - ▶ BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund
 - ▶ BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund
 - ▶ BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund
 - ▶ BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund
 - ▶ BlackRock Global Long/Short Equity Fund
 - ▶ BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund

Une analyse complète de la compensation due aux Compartiments et des remboursements versés aux Actionnaires a été réalisée.

Des notifications formelles, à la CSSF, des VNI inexacts énoncés pour tous les Compartiments touchés ont été envoyées ainsi qu'une proposition de plan d'actions correctives.

Les remboursements aux Actionnaires résultant du nouveau calcul des VNI ont été mis en suspens en attendant les paiements finaux qui seront effectués en septembre 2018.

La VNI de chaque Compartiment concerné communiquée dans le Bilan présenté dans le présent document intitulé Rapport annuel et comptes révisés a été ajustée afin de refléter les calculs corrigés des différentes VNI.

2. Récapitulatif des principales règles comptables

Les états financiers ont été préparés conformément aux principes comptables généralement reconnus au Luxembourg et aux exigences juridiques et réglementaires relatives à la préparation des états financiers telles que prescrites par les autorités luxembourgeoises pour les OPCVM du Luxembourg, et avec les méthodes comptables suivantes :

(a) Valorisation des investissements et autres actifs

Les titres de placement de la Société sont valorisés comme suit :

- ▶ les titres négociables cotés en bourse ou négociés sur un autre marché réglementé sont évalués sur la base du dernier cours disponible en vigueur à la date d'évaluation. Pour les titres négociés sur des marchés clôturant après la valorisation, les derniers cours connus à ce moment ou à un autre moment seront utilisés. Lorsque ces valeurs mobilières et autres actifs sont cotés ou négociés sur ou par plusieurs bourses de valeurs ou marchés réglementés, le Conseil d'administration de la Société peut, à sa discrétion, sélectionner l'une de ces bourses de valeur ou l'un de ces marchés réglementés à cet effet. Des écarts dans la valeur des titres peuvent être constatés, par exemple lorsque les marchés sous-jacents sont fermés au public au moment du calcul de la VNI de certains Compartiments ou lorsque les gouvernements décident d'imposer des charges fiscales ou des frais de négociation sur les investissements étrangers. Par conséquent, les Administrateurs ont mis en œuvre des techniques de juste valeur afin d'estimer la juste valeur de ces investissements. De tels titres et instruments dérivés seront évalués à leur valeur de réalisation probable telle que déterminée par des personnes compétentes (les Administrateurs). En raison de l'incertitude inhérente au processus de juste valeur, ces valeurs estimées peuvent différer significativement des valeurs qui auraient été utilisées si un marché facile existait pour ces titres et des valeurs qui pourraient en fin de compte être recouvrées ;
- ▶ pour les titres non cotés ou les titres non négociés sur une bourse ou sur un autre marché réglementé (y compris les titres de fonds d'investissement fermés) ainsi que pour les titres cotés ou non cotés sur d'autres marchés pour lesquels aucun cours n'est disponible, ou les titres pour lesquels les cours ne sont pas, selon le Conseil d'administration de la Société, représentatifs de la juste valeur de marché, la valeur sera déterminée avec prudence et de bonne foi par le Conseil d'administration de la Société, sur la base des prix de cession ou d'acquisition attendus ;

Annexe aux États Financiers suite

▸ dans le cas où un titre ou un actif déterminé ne peut pas être valorisé selon les méthodes visées ci-dessus, ou si le Conseil d'administration de la Société estime qu'une autre méthode de valorisation reflète plus fidèlement la juste valeur de ce titre ou de cet actif par rapport au but recherché, la méthode de valorisation de ce titre ou de cet actif sera, à sa discrétion, arrêtée par le Conseil d'administration de la Société. Des écarts dans la valeur des titres peuvent être constatés, par exemple lorsque les marchés sous-jacents sont fermés au public aux fins du calcul de la « VNI » de certains Compartiments. Dans de telles circonstances, le Conseil d'administration de la Société pourra fixer certains seuils dont le dépassement entraînera un ajustement de la valeur de ces titres à leur juste valeur en appliquant une indexation spécifique. En outre, lorsque les gouvernements décident d'imposer des charges fiscales ou des frais de transaction sur les investissements étrangers, le Conseil d'administration de la Société peut ajuster la VNI afin de refléter ces charges.

Au 31 mai 2018, la juste valeur ajustée appliquée à certains titres et/ou instruments dérivés est présentée dans le tableau ci-dessous :

Compartiment	Monnaie	Valeur de marché des titres évalués à leur juste valeur	% de l'actif net
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	(46.381)	0,00
BlackRock Asia Extension Fund	USD	441.036	0,26
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	26.472	0,12
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	USD	153	0,00
BlackRock European Credit Strategies Fund	EUR	2	0,00
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	EUR	(71.355)	(0,03)
BlackRock European Opportunities Extension Fund	EUR	–	0,00
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	EUR	214.241	0,05
BlackRock Global Long/Short Equity Fund	USD	93	0,00
BlackRock Latin American Opportunities Fund	USD	–	0,00
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	USD	240.718	0,09
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	GBP	8.291	0,01

▸ les investissements dans des organismes de placement collectif de type ouvert sont évalués sur la base de la dernière VNI disponible des unités ou actions de cet organisme de placement collectif ;

- prêts de titres : les titres sont livrés à un courtier tiers, conformément aux instructions de l'agent de prêt, et continuent à être évalués comme faisant partie intégrante du portefeuille ;
- les actifs liquides comme les dépôts à terme et les instruments du marché monétaire sont évalués sur la base du coût amorti qui se rapproche de leur juste valeur ;
- les liquidités en banque et les frais prépayés sont évalués à leur montant nominal ;
- les actifs comprenant notamment des créances recouvrables sur des intérêts et des dividendes, des créances recouvrables pour investissements vendus ainsi que des créances recouvrables pour des actions de Compartiment souscrites, sont évalués à leur valeur nominale, à moins qu'il ne s'avère improbable que cette valeur nominale puisse être recouvrée ;
- les dettes comprenant, en particulier, les intérêts et les dividendes à payer, les revenus à distribuer, les sommes à payer pour les investissements achetés et les sommes à payer pour les actions de Compartiments à racheter sont évaluées à leur valeur nominale.

(b) Gains et pertes nets réalisés sur les ventes de placements

Les gains et pertes nets réalisés sur les ventes de placements ont été déterminés selon la méthode du coût moyen.

(c) Revenus/dépenses des placements

La Société constate les revenus des placements de la manière suivante :

- les intérêts créditeurs sont calculés quotidiennement et comprennent l'amortissement de la surcote/décote selon la méthode linéaire ;
- les intérêts bancaires, les dépôts à terme et les dépôts du marché monétaire sont comptabilisés selon la comptabilité d'engagements ;
- les produits de dividendes sont constatés à la date ex-dividende et après déduction de la retenue à la source ;
- les produits de prêts de titres sont cumulés sur une base hebdomadaire ;
- les frais de rendements négatifs sur actifs financiers en relation avec un taux d'intérêt négatif sur les actifs détenus sont cumulés quotidiennement et comptabilisés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net tout au long du cycle de vie de l'instrument sous-jacent.

▸ lorsqu'une obligation a été identifiée comme étant défaillante, l'accumulation des intérêts sur le titre défaillant est interrompue. Sur confirmation du défaut par les parties concernées, le montant recevable est sorti du bilan ;

Annexe aux États Financiers suite

- le taux d'intérêt de toute obligation perpétuelle, indiqué sous la description dans le portefeuille de titres, est le taux d'intérêt applicable à la fin de la période et n'est donné qu'à titre indicatif, puisque ces obligations portent un intérêt à taux variable.

(d) Instruments financiers dérivés

Au cours de l'exercice, les Compartiments ont conclu un certain nombre d'opérations de change à terme et de contrats à terme (*futures*) sur instruments financiers. Les opérations de change à terme et les contrats à terme sur instruments financiers en cours sont évalués à la juste valeur de marché de clôture à la date de valorisation. Les excédents ou les déficits issus de ces procédures ou de contrats non réglés sont portés au poste plus-values/(moins-values) non réalisées et sont inclus dans les Autres éléments de l'actif ou Autres éléments du passif (selon le cas) dans le Bilan. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les gains ou pertes nets réalisés lors du règlement ou de la clôture d'opérations de change à terme et de contrats à terme sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Les Compartiments peuvent vendre des options ou des swaptions d'achat et de vente couvertes et acheter des options ou des swaptions d'achat et de vente. Lorsque les Compartiments vendent et/ou achètent une option ou une swaption, un montant égal à la prime reçue ou payée par les Compartiments apparaît en tant que passif ou actif. Le passif correspondant à une option ou une swaption vendue et l'actif correspondant à une option ou une swaption achetée sont ensuite évalués aux prix du marché afin de refléter la valeur en cours de l'option ou de la swaption. Lorsqu'un titre est vendu ou acheté à travers l'exercice d'une option ou d'une swaption, la prime reçue (ou payée) est déduite de (ou ajoutée à) la base du titre vendu ou acheté. Lorsqu'une option ou une swaption expire (ou que les Compartiments effectuent une opération de clôture), les Compartiments réalisent un profit ou une perte sur l'option ou la swaption dans la mesure des primes reçues ou payées (ou un profit ou une perte dans la mesure où le coût des opérations de clôture est supérieur à la prime payée ou reçue). Pour les options de type contrat à terme, le Compartiment ne paie pas la prime à l'avance. Le Compartiment affiche une marge comme dans les contrats à terme, et la prime de l'option est évaluée quotidiennement au prix du marché. Les options/swaptions achetées à la valeur de marché et les options/swaptions vendues à la valeur de marché sont présentées dans le Bilan. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les gains ou pertes nets réalisés lors d'opérations d'expiration ou de clôture d'options et de swaptions sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Au cours de l'exercice, les Compartiments ont conclu des « *contracts for difference* » (« CFD »). Les CFD permettent aux investisseurs de prendre des positions longues synthétiques ou des positions courtes synthétiques avec une marge variable. Avec les CFD, à la différence des actions, l'acheteur est potentiellement redevable d'un montant beaucoup plus élevé que le montant payé sur marge.

Les positions en CFD sont prises sous réserve d'une charge financière quotidienne, appliquée à un taux préalablement convenu supérieur ou inférieur à l'indice de référence applicable. Les intérêts créditeurs et débiteurs correspondants sont comptabilisés quotidiennement en tant qu'intérêts sur CFD, dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les intérêts créditeurs à recevoir et débiteurs à payer sont comptabilisés en une position nette, dans le Bilan, en tant qu'intérêts et dividendes à recevoir ou intérêts et dividendes à payer.

Les positions en CFD peuvent recevoir ou payer des dividendes dans les cas où une position est détenue le jour où un dividende a été déclaré. Les produits ou les charges pour dividendes sont comptabilisés à la date ex-dividende et après déduction des retenues à la source, en tant que dividendes de CFD, après déduction des retenues à la source, dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les produits pour dividendes à recevoir et les charges pour dividendes à payer sont comptabilisés, dans le Bilan, en une position nette en tant qu'intérêts et dividendes à recevoir ou intérêts et dividendes à payer.

La valeur de marché des CFD est déterminée par le prix négocié à la bourse où les titres ou actifs sous-jacents sont négociés ou admis à la négociation. Pour les titres sous-jacents négociés sur des marchés clôturant après l'évaluation, les derniers cours connus à ce moment ou à un autre moment peuvent être utilisés.

Les plus-values nettes non réalisées et les moins-values nettes non réalisées sur CFD sont indiquées dans le Bilan.

La fluctuation de la valeur de marché, le cas échéant, est enregistrée en tant que variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les gains ou les pertes réalisés à l'échéance ou à l'extinction des CFD sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Les gains et pertes nets réalisés sur les ventes de CFD ont été déterminés sur la base des coûts selon le principe du « premier entré, premier sorti ».

Au 31 mai 2018, les Compartiments avaient des CFD non réglés, compris dans les sommes à recevoir pour placements vendus et les placements achetés à payer, dans le Bilan.

Le Compartiment peut conclure des opérations de swaps (« swaps »), dans lesquelles le Compartiment et une contrepartie conviennent de faire des versements périodiques nets sur la base d'un montant notionnel spécifié. Les opérations de swaps sont négociées de façon privée sur le marché de gré à gré (OTC) et peuvent être conclues en tant que contrat bilatéral (« swaps OTC ») ou faire l'objet d'une compensation centrale (« swaps faisant l'objet d'une compensation centrale »). Ces paiements périodiques perçus ou versés sont enregistrés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net en tant que, respectivement, gains et pertes réalisés. Les swaps sont valorisés sur la base des prix reçus quotidiennement.

Annexe aux États Financiers suite

par le service d'établissement des prix du Compartiment, les chambres de compensation centrale ou les courtiers, lesquels prix sont obtenus à l'aide de courbes et modèles quotidiens de swaps qui tiennent compte de plusieurs facteurs (données des marchés) comme les flux de trésorerie actualisés, les échanges et les valeurs des instruments de référence sous-jacents. Dans un swap faisant l'objet d'une compensation centrale, dès l'exécution du contrat de swap, celui-ci fait l'objet d'une novation en faveur d'une contrepartie de compensation et le Compartiment fait face à la contrepartie de compensation par l'intermédiaire d'un courtier. Au moment de conclure un swap faisant l'objet d'une compensation centrale, le Compartiment est tenu de déposer une marge initiale auprès du courtier sous la forme de numéraire ou de certains titres éligibles, pour un montant variant en fonction de la taille et du profil de risque du swap en question. Tout paiement initial effectué ou reçu lors de la conclusion d'un contrat de swap est considéré comme faisant partie du gain ou de la perte net(te) réalisé(e) du swap. La variation quotidienne de la valorisation des swaps faisant l'objet d'une compensation centrale est enregistrée comme un élément à recevoir ou à payer pour la marge de variation dans la position «Avoir en banque» du Bilan jusqu'à ce que le swap faisant l'objet d'une compensation centrale soit résilié, un gain ou une perte net(te) réalisé(e) étant alors enregistré(e). La variation nette des plus-values ou moins-values nettes non réalisées et les gains et pertes nets réalisés sur les ventes d'opérations de swap sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les intérêts créditeurs à recevoir et débiteurs à payer sur des swaps sont constatés sur une base quotidienne et comptabilisés en une position nette, dans le Bilan, en tant qu'intérêts et dividendes à recevoir ou intérêts et dividendes à payer. Au 31 mai 2018, les Compartiments avaient des swaps non réglés, compris dans les sommes à recevoir pour placements vendus et les placements achetés à payer, dans le Bilan.

Les Compartiments peuvent acheter des « titres à déterminer » (*To Be Announced Securities Contract* ou TBAs). Il s'agit d'une pratique de négociation courante sur le marché des titres adossés à des créances hypothécaires, selon laquelle, en vertu d'un contrat acheté, l'acheteur a droit à un titre provenant d'un bloc de créances hypothécaires, à un prix fixe et à une date ultérieure. Au moment de l'achat, le titre exact n'est pas connu, mais ses principales caractéristiques sont précisées. Bien que le prix ait été fixé au moment de l'achat, la valeur principale n'a pas été finalisée. Un TBA n'étant pas réglé au moment de l'achat, un effet de levier peut être créé au sein d'un Compartiment. Acheter des titres TBAs comporte un risque si la valeur du titre à acheter baisse avant la date de règlement. Risque supplémentaire : les parties contractantes ne seront peut-être pas à même d'honorer les engagements pris lors d'une telle transaction. Les TBAs sont indiqués séparément, après le portefeuille de titres.

Les Compartiments peuvent se défaire d'un engagement avant le règlement, s'ils le jugent opportun. Les produits des ventes de titres TBAs ne peuvent être perçus avant la date de règlement stipulée au contrat. Pendant la durée de l'engagement de vente de titres TBAs, des titres livrables équivalents, ou un engagement compensatoire d'achat de titres

TBAs (livrables à la date de l'engagement de vente ou avant), couvrent la transaction.

Si l'engagement de vente de titres TBAs se conclut par l'acquisition d'un engagement d'achat compensatoire, le Compartiment réalise un bénéfice ou un déficit sur l'engagement, indépendamment de tout bénéfice ou déficit non réalisé sur le titre sous-jacent. Si le Compartiment livre des titres en vertu de l'engagement, il réalise un bénéfice ou un déficit sur la vente des titres en fonction du prix unitaire fixé à la date à laquelle l'engagement a été conclu.

Au 31 mai 2018, les Compartiments avaient des TBAs non réglés, compris dans les sommes à recevoir pour placements vendus et les placements achetés à payer, dans le Bilan.

Les valeurs de marché des TBAs sont présentées dans le Bilan. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les gains et pertes nets réalisés sur les ventes de TBAs sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

(e) Change

Le cours des titres de placement libellés en une devise autre que la devise de référence du Compartiment concerné a été converti au taux de change en vigueur au moment de l'achat. Les investissements et autres actifs et passifs libellés dans une devise autre que la devise de référence du Compartiment concerné ont été convertis au taux de change en vigueur à Luxembourg aux heures d'évaluation respectives du Compartiment, le 31 mai 2018. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les gains et pertes nets réalisés lors de la cession ou du règlement d'autres actifs ou passifs dans des devises autres que la devise de référence du Compartiment concerné sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Les revenus et les frais en devises autres que la devise de référence du Compartiment concerné ont été convertis aux taux de change en vigueur à la date d'opération.

Les taux de change suivants ont été utilisés pour convertir les investissements et autres actifs et passifs libellés, pour tous les Compartiments, dans des devises autres que la devise de référence du Compartiment concerné, aux heures d'évaluation respectives des Compartiments, le 31 mai 2018.

	Tous les Compartiments (à l'exception des Compartiments BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, BlackRock Latin American Opportunities Fund et BlackRock UK Equity Absolute Return Fund)		BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	BlackRock Latin American Opportunities Fund	BlackRock UK Equity Absolute Return Fund
Devise	EUR	USD	EUR	USD	GBP
AED	0,2337	0,2722	0,2332	0,2722	0,2048
ARS	0,0344	0,0401	0,0343	0,0401	0,0302
AUD	0,6501	0,7575	0,6482	0,7563	0,5698
BRL	0,2305	0,2685	0,2300	0,2685	0,2020

Annexe aux États Financiers suite

	Tous les Compartiments (à l'exception des Compartiments BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, BlackRock Latin American Opportunities Fund et BlackRock UK Equity Absolute Return Fund)		BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	BlackRock Latin American Opportunities Fund	BlackRock UK Equity Absolute Return Fund
Devise	EUR	USD	EUR	USD	GBP
CAD	0,6625	0,7720	0,6604	0,7712	0,5807
CHF	0,8707	1,0145	0,8714	1,0146	0,7632
CLP	0,0014	0,0016	0,0014	0,0016	0,0012
CNY	0,1341	0,1562	0,1338	0,1562	0,1175
COP	0,0003	0,0003	0,0003	0,0003	0,0003
CZK	0,0387	0,0451	0,0387	0,0453	0,0340
DKK	0,1343	0,1565	0,1343	0,1571	0,1178
EGP	0,0480	0,0559	0,0479	0,0559	0,0420
EUR	1,0000	1,1651	1,0000	1,1691	0,8765
GBP	1,1409	1,3293	1,1399	1,3294	1,0000
GHS	0,1830	0,2132	0,1811	0,2120	0,1604
HKD	0,1094	0,1274	0,1092	0,1275	0,0958
HUF	0,0031	0,0037	0,0031	0,0037	0,0027
IDR	0,0001	0,0001	0,0001	0,0001	0,0001
ILS	0,2404	0,2801	0,2402	0,2805	0,2107
INR	0,0127	0,0148	0,0127	0,0148	0,0111
JPY	0,0079	0,0092	0,0079	0,0092	0,0069
KRW	0,0008	0,0009	0,0008	0,0009	0,0007
KZT	0,0026	0,0030	0,0026	0,0030	0,0023
LKR	0,0054	0,0063	0,0054	0,0063	0,0048
MXN	0,0429	0,0500	0,0428	0,0501	0,0376
MYR	0,2156	0,2513	0,2152	0,2513	0,1890
NGN	0,0024	0,0028	0,0024	0,0028	0,0021
NOK	0,1048	0,1221	0,1047	0,1222	0,0919
NZD	0,6016	0,7009	0,6011	0,6998	0,5273
PEN	0,2619	0,3052	0,2616	0,3057	0,2296
PHP	0,0163	0,0190	0,0163	0,0190	0,0143
PLN	0,2317	0,2700	0,2316	0,2707	0,2031
QAR	0,2357	0,2746	0,2353	0,2746	0,2066
RON	0,2149	0,2504	0,2145	0,2508	0,1884
RUB	0,0138	0,0161	0,0137	0,0160	0,0121
SEK	0,0973	0,1134	0,0970	0,1134	0,0853
SGD	0,6408	0,7466	0,6405	0,7469	0,5617
THB	0,0268	0,0313	0,0268	0,0313	0,0235
TRY	0,1894	0,2207	0,1888	0,2209	0,1660
TWD	0,0286	0,0334	0,0286	0,0334	0,0251
USD	0,8583	1,0000	0,8567	1,0000	0,7523
UYU	0,0276	0,0322	0,0274	0,0321	0,0242
ZAR	0,0679	0,0792	0,0676	0,0786	0,0596
ZMW	0,0831	0,0969	0,0830	0,0969	0,0729

(f) États financiers combinés

Les comptes de chaque Compartiment sont exprimés dans la devise de référence des Compartiments.

Les chiffres combinés de la Société sont exprimés en USD et comprennent le total des états financiers des différents Compartiments, convertis si nécessaire. Pour la conversion du Bilan, le taux de change en vigueur aux heures de valorisation respectives des Compartiments au Luxembourg

au 31 mai 2018 pour tous les Compartiments exprimés en EUR, à l'exclusion du Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, est :

EUR	
USD	0,8583

Pour le Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, le taux de change en vigueur à l'heure de valorisation du Compartiment au Luxembourg au 31 mai 2018 est :

EUR	
USD	0,8567

Pour le Compartiment BlackRock UK Equity Absolute Return Fund, le taux de change en vigueur à l'heure de valorisation du Compartiment au Luxembourg au 31 mai 2018 est :

GBP	
USD	0,7523

Pour le compte de résultat et l'évolution de l'actif net, le taux de change suivant est le taux moyen calculé sur l'année pour tous les Compartiments exprimés en EUR, à l'exclusion du Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund :

EUR	
USD	0,8415

Pour le Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, le taux de change suivant est le taux moyen calculé sur l'année :

EUR	
USD	0,8415

Pour le Compartiment BlackRock UK Equity Absolute Return Fund, le taux de change suivant est le taux moyen calculé sur l'exercice :

GBP	
USD	0,7457

Les chiffres combinés dans la section Compte de résultat et évolution de l'actif net et dans le Bilan ont été calculés à l'aide des taux de change moyens tout au long de l'année. L'ajustement des taux de change obtenu, de 452 867 414 USD, représente la variation des taux de change entre le 31 mai 2017 et le 31 mai 2018. Il s'agit d'un montant notionnel, qui n'a aucun impact sur l'actif net de chacun des Compartiments.

(g) Péréquation des revenus

La Société opère des arrangements d'égalisation des revenus en vue d'assurer que le montant de revenus nets constatés au sein d'un Compartiment et attribuables à chaque action n'est pas influencé par l'émission, la conversion ou le rachat des actions du Compartiment pendant un même exercice comptable.

Annexe aux États Financiers suite

L'égalisation des revenus est comprise dans le poste Mouvements du capital social dans la section Compte de résultat et évolution de l'actif net.

(h) Dilution

Si, lors d'un jour de négociation donné, le volume total des transactions effectuées sur des actions de toutes les catégories d'un Compartiment entraîne une augmentation ou une diminution nette des actions dépassant le seuil arrêté par le Conseil d'administration de la Société, la VNI du Compartiment concerné pourra être ajustée d'un montant reflétant les frais de négociation qui seront encourus de ce fait par le Compartiment et l'écart entre le cours acheteur et le cours vendeur des actifs dans lesquels le Compartiment investit. De plus, le Conseil d'administration de la Société peut décider d'inclure des charges fiscales anticipées dans le montant de l'ajustement. Conformément au Prospectus, un tel ajustement pour dilution sera appliqué, au 31 mai 2018, au Compartiment BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund.

La VNI par action publiée/négociée est indiquée dans le Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans et peut comprendre un ajustement pour dilution. Cet ajustement n'est pas constaté dans le Bilan ni dans la section intitulée Compte de résultat et évolution de l'actif net.

(i) Coûts de transaction

Les coûts de transaction sont des coûts incrémentiels directement attribuables à l'acquisition, à l'émission ou à la cession de titres et d'instruments dérivés. Un coût incrémentiel est un coût qui ne serait pas appliqué si l'entité n'avait pas acquis, émis ou cédé le titre. Lorsqu'un titre est initialement constaté, il est évalué à sa valeur de marché, plus les coûts de transaction directement attribuables à l'acquisition ou à l'émission du titre.

Les coûts de transaction, à l'exclusion des commissions par opération du Dépositaire pour l'achat ou la vente de titres, sont compris dans les gains/(pertes) nets réalisés ou dans la variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées, dans la section intitulée Compte de résultat et évolution de l'actif net de chaque Compartiment. Les commissions par opération du Dépositaire sont comprises dans les commissions du Dépositaire dans la section intitulée Compte de résultat et évolution de l'actif net. Pour de plus amples informations, veuillez vous référer aux points 6 et 13 de l'Annexe aux états financiers.

(j) Devises étrangères sur autres opérations

Les devises étrangères sur autres opérations correspondent aux plus-values/(moins-values) non réalisées sur les soldes de trésorerie et les contrats au comptant.

3. Société de Gestion

BlackRock (Luxembourg) S.A. a été nommée par la Société pour exercer en tant que Société de Gestion. La Société de

Gestion est autorisée à agir en qualité de gestionnaire de portefeuilles, conformément au Chapitre 15 de la Loi de 2010.

La Société a signé un contrat de société de gestion avec la Société de Gestion. En vertu de ce contrat, la Société de Gestion se voit confier la gestion quotidienne de la Société ainsi que la responsabilité de l'exécution directe, ou par voie de délégation, des opérations liées à la gestion de portefeuilles de la Société, à son administration et à la commercialisation des Compartiments.

En accord avec la Société, la Société de Gestion a décidé de déléguer plusieurs de ses fonctions, comme qu'indiqué ultérieurement dans le Prospectus.

BlackRock (Luxembourg) S.A. est une filiale à 100 % du BlackRock Group. Elle est réglementée par la CSSF.

4. Gestion, Gestionnaire délégué externe et commissions de distribution

Durant l'exercice, la Société a versé des commissions de gestion à la Société de Gestion.

La Société verse des commissions de gestion à un taux annuel indiqué à l'Annexe F du Prospectus. Le niveau des commissions de gestion varie de 0,30 % à 2,00 % de la VNI, sauf pour les Actions de Catégorie X, qui ne donnent lieu à aucune commission de gestion mais à une commission versée aux Gestionnaires Financiers par délégation ou à leurs affiliées, en vertu d'un contrat. Le niveau des commissions de gestion varie en fonction du Compartiment et de la Catégorie d'Actions auxquels appartiennent les titres achetés par l'investisseur. Ces commissions courent de jour en jour, ont pour assiette la VNI du Compartiment concerné et sont payées mensuellement. Certains coûts et certaines commissions, notamment celles des Gestionnaires Financiers par délégation, sont payés à l'aide de la commission de gestion.

S'agissant du Compartiment BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund, le Compartiment verse également au Gestionnaire Financier par délégation des commissions de gestionnaire délégué externe dont le montant global est d'au plus 1,00 % par an, sauf pour la Catégorie X, qui ne donne lieu à aucune commission de gestionnaire délégué externe. Le Gestionnaire Financier par délégation du Compartiment verse les commissions de gestionnaire délégué externe aux Gestionnaires délégués externes du Compartiment. Pour l'exercice clos le 31 mai 2018, le total des commissions versées au Gestionnaire délégué externe du Compartiment était de 3 191 405 USD.

Lorsqu'un Compartiment investit une part importante de son actif net dans d'autres organismes de placement collectif (« OPC »), le Gestionnaire Financier par délégation veillera à ce que la totalité de la commission de gestion (à l'exclusion de toute commission de performance, s'il y a lieu) facturée à ce Compartiment (y compris les commissions de gestion des autres OPCVM et OPC dans lesquels il investit) ne soit pas supérieure à 3,75 % de la VNI du Compartiment.

Annexe aux États Financiers suite

Au cours de l'exercice, les Compartiments suivants ont fait l'objet d'une diminution de la commission de gestion pour les investissements dans les fonds cibles gérés par BlackRock comptabilisée dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net sous le poste « Remise sur la commission de gestion » :

BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund, BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund, BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund, BlackRock European Select Strategies Fund, BlackRock Fixed Income Strategies Fund, BlackRock Global Absolute Return Bond Fund, BlackRock Macro Opportunities Fund, BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative, BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth, BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate et BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund.

Au cours de l'exercice, les Compartiments suivants ont fait l'objet d'un remboursement de commissions de la part de la Société de Gestion, comptabilisé dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net sous le poste « Remboursement des dépenses » :

BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund, BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund, BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund, BlackRock Emerging Markets Allocation Fund, BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund, BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund, BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund, BlackRock European Credit Strategies Fund, BlackRock European Select Strategies Fund, BlackRock Global Event Driven Fund, BlackRock Global Long/Short Equity Fund, BlackRock Global Real Asset Securities Fund, BlackRock Impact World Equity Fund, BlackRock Latin American Opportunities Fund, BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative, BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive, BlackRock Managed Index Portfolios – Growth, BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate, BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund, BlackRock Style Advantage Fund, BlackRock Sustainable Euro Bond Fund, BlackRock Systematic European Equity Fund, BlackRock Systematic Global Equity Fund, BlackRock Total Advantage Fund, BlackRock UK Equity Absolute Return Fund et BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund.

Au cours de l'exercice, la Société a versé des commissions de distribution à BlackRock Investment Management (UK) Limited, qui a agi en tant que Distributeur Principal.

La Société verse des commissions annuelles de 1,00 % de la VNI pour les Actions de Catégorie C et de 0,50 % de la VNI pour les Actions de Catégorie E. Ces commissions courent de jour en jour, ont pour assiette la VNI du Compartiment concerné (reflétant, le cas échéant, tout ajustement de la VNI du Compartiment concerné) et sont payées mensuellement.

Les commissions de gestion et de distribution par Catégorie d'Action et par Compartiment sont détaillées dans le Prospectus et les DICl de la Société. Les commissions de

gestion et de distribution payables au 31 mai 2018 sont comprises dans le Bilan sous le poste « Dépenses cumulées et autres éléments du passif ».

5. Commissions d'administration

La Société verse une commission d'administration à la Société de Gestion.

Le niveau de la commission d'administration peut varier, à la discrétion du Conseil d'administration de la Société et comme convenu avec la Société de Gestion, et sera applicable à divers taux dans les différents Compartiments et les différentes Catégories d'Actions émis par la Société. Cependant, le Conseil d'administration de la Société et la Société de Gestion ont décidé d'un commun accord que la commission d'administration actuellement versée ne devra pas dépasser 0,30 % par an. Elle est calculée quotidiennement, sur la base de la VNI de la Catégorie d'Actions concernée, et versée tous les mois.

Le Conseil d'administration de la Société et la Société de Gestion fixent le niveau de la commission d'administration à un taux visant à assurer que le total des frais sur encours de chaque Compartiment reste compétitif en comparaison avec un vaste marché de produits d'investissement similaires offerts aux investisseurs dans les Compartiments, en tenant compte d'un certain nombre de critères comme le secteur marchand du Compartiment et la performance de ce dernier par rapport à ses homologues.

La commission d'administration est utilisée par la Société de Gestion pour couvrir tous les coûts et dépenses de fonctionnement et d'administration, fixes et variables, supportés par la Société, à l'exception des commissions de dépositaire, des commissions de distribution, des commissions de prêts de titres et de tous coûts découlant d'emprunts (y compris, afin d'éviter toute ambiguïté, toute commission d'engagement qui pourrait être due au prêteur), ainsi que de tous les coûts de services professionnels associés aux demandes de remboursement de la retenue à la source (plus toutes taxes ou tous intérêts y afférents) et de toute taxe concernant les investissements ou la Société. Toutes commissions d'engagement découlant d'emprunts ou tous frais de services professionnels liés aux demandes de remboursement de la retenue à la source seront alloués aux Compartiments concernés sur une base juste et équitable.

Ces coûts et dépenses de fonctionnement et d'administration comprennent toutes dépenses et autres coûts recouvrables d'une tierce partie supportés par ou pour le compte de la Société, le cas échéant, y compris mais de façon non limitative les commissions d'agent comptable du compartiment, les commissions d'agent de transfert (notamment les frais de négociation du sous-agent de transfert et de la plateforme associée), tous les coûts professionnels tels que les commissions de consultants, de conseillers juridiques et de conseillers fiscaux et les frais d'audits, les commissions des Administrateurs, les frais de voyage, les débours raisonnables, les frais d'impression, de publication et de traduction et

Annexe aux États Financiers suite

tous les autres coûts liés aux rapports aux actionnaires, les droits de dépôt et les droits de permis, les frais des banques correspondantes et autres frais bancaires, le support technique et l'entretien des logiciels, les coûts et dépenses opérationnels attribués aux équipes de Services aux Investisseurs et autres services d'administration globaux fournis par différentes sociétés du BlackRock Group.

La Société de Gestion assume le risque financier de veiller à ce que le total des frais sur encours des Compartiments reste compétitif. Par conséquent, la Société de Gestion est en droit de conserver tout montant de la commission d'administration qui lui est versée et qui dépasserait les dépenses réelles supportées par la Société durant un exercice donné, considérant que tous coûts et dépenses supportés par la Société au cours d'un exercice donné qui dépasseraient le montant de la commission d'administration versé à la Société de Gestion seront à la charge de la Société de Gestion ou d'une autre société du BlackRock Group.

Les commissions d'administration payables au 31 mai 2018 sont comprises dans le Bilan sous le poste « Dépenses cumulées et autres éléments du passif ».

Les Administrateurs de la Société qui ne sont pas des employés du BlackRock Group reçoivent une rémunération annuelle brute de 30 000 EUR en contrepartie des tâches accomplies durant l'exercice clos le 31 mai 2018. Le président reçoit une rémunération annuelle brute de 33 500 EUR. Les Administrateurs qui sont également des employés de BlackRock Group n'ont droit à aucune rémunération en tant qu'Administrateur.

Vous trouverez ci-dessous les commissions versées à Deloitte Audit S.à r.l. pour l'exercice clos le 31 mai 2018.

	31 mai 2018 USD
Services d'audit et services liés à l'audit (hors TVA)	514.854
Services non liés à l'audit	—

6. Commissions du Dépositaire

Le Dépositaire reçoit une commission pour chaque Compartiment. Ces commissions rémunèrent le Dépositaire pour ses services de dépôt et les coûts par opération de chaque Compartiment. Elles varieront pour chaque Compartiment, en fonction de la valeur des actifs sous gestion et du volume d'opérations du Compartiment concerné.

Pour les Compartiments affichant un volume d'opérations faible (moins de 500 opérations par mois), la commission de dépôt, comptabilisée quotidiennement variera entre 0,005 % et 0,40 % par an, et les coûts de transaction entre 7 US\$ et 125 US\$.

Pour les Compartiments engagés dans des volumes d'opérations plus importants, le Dépositaire ne facture pas de commissions de dépôt ni de commissions par opération séparées. Le Dépositaire reçoit une commission qui est facturée à taux progressif en fonction de la valeur des actifs

sous gestion et du volume d'opérations au sein de chaque Compartiment. Ces commissions varieront entre 1 point de base et 25 points de base des actifs sous gestion, pour chaque Compartiment, selon qu'un Compartiment donné est considéré comme étant un « Compartiment à volume d'opérations moyen » (entre 501 et 1 500 opérations par mois) ou un « Compartiment à volume d'opérations élevé » (supérieur à 1 500 opérations sur instruments dérivés par mois).

Chacun des Compartiments est également soumis à une commission annuelle minimale qui sera fixée à 30 000 USD pour l'ensemble des Compartiments à faible volume d'opérations, 100 000 USD pour chaque Compartiment à volume d'opérations moyen, 150 000 USD pour chaque Compartiment à volume d'opérations élevé et 230 000 USD (350 000 USD avant le 6 novembre 2017) pour chaque Compartiment à volume d'opérations très élevé.

Les volumes d'opérations pour chaque Compartiment varient en fonction de la stratégie d'investissement du Compartiment concerné. Les commissions du Dépositaire regroupées de chaque Compartiment dépendent de la ventilation de ses actifs et de ses opérations au fil du temps.

Les commissions du Dépositaire payables au 31 mai 2018 sont comprises dans le Bilan sous le poste « Dépenses cumulées et autres éléments du passif ».

7. Commissions de performance

Une commission de performance peut être payable pour chaque Catégorie d'Actions de chaque Compartiment, à l'exception des actions de Catégorie X, en sus des commissions et des dépenses mentionnées dans le présent Prospectus. Cette commission de performance court chaque Jour d'Évaluation et est égale à 8 %, 15 % (avec effet le 29 novembre 2017, date de lancement du Compartiment BlackRock Macro Opportunities Fund), ou 20 % (selon le Compartiment concerné, comme indiqué à l'Annexe E du Prospectus) de l'excédent du rendement de la VNI par action par rapport au rendement de l'indice de référence approprié, comme indiqué de façon plus détaillée à l'Annexe E du Prospectus. Deux méthodes de calcul, la méthode de Type A et la méthode de Type B, sont utilisées – la méthode applicable à chaque Compartiment est indiquée à l'Annexe E du Prospectus. Vous pourrez obtenir de plus amples informations auprès de l'équipe locale de Services aux Investisseurs et du siège de la Société.

La cristallisation de la commission de performance a lieu le dernier jour de chaque Période de Performance ou lorsqu'un actionnaire fait racheter ou convertir tout ou partie de ses actions avant la fin d'une Période de Performance.

Au cours de l'exercice allant du 1^{er} juin 2017 au 31 mai 2018, la Société de Gestion a appliqué un plancher de 0,00 % aux références des commissions de performance des taux d'intérêts des indices EUR 3M LIBOR, SEK 3M LIBOR, CHF 3M LIBOR et JPY 3M LIBOR, utilisées pour calculer toute surperformance à l'aide de la méthode de calcul indiquée dans le Prospectus. Ce plancher a été appliqué pour plafonner de

Annexe aux États Financiers suite

façon efficace le montant des commissions de performance payables en ce qui concerne les références des commissions de performance des taux d'intérêt affichant actuellement des taux d'intérêt négatifs. La Société de Gestion continuera à contrôler l'environnement des taux d'intérêt et son effet sur la gestion des Compartiments, et elle se réserve le droit de retirer l'application du plancher de 0,00 % aux références des commissions de performance des taux d'intérêt des indices EUR 3M LIBOR, SEK 3M LIBOR, CHF 3M LIBOR et JPY 3M LIBOR sans préavis.

Les commissions de performance payables au 31 mai 2018 sont comprises dans le Bilan sous le poste « Dépenses cumulées et autres éléments du passif ».

8. Fiscalité

Luxembourg

La Société est une société d'investissement régie par le droit luxembourgeois. En conséquence, la Société n'est assujettie à aucun impôt sur le revenu ou sur les plus-values. Cependant, elle est assujettie à une taxe d'abonnement, calculée au taux annuel de 0,05 % de la VNI de chaque Compartiment à la fin de chaque trimestre, et, dans le cas de toutes les actions de Catégorie I, de Catégorie J, de Catégorie T et de Catégorie X, de 0,01 % de la VNI de chaque Compartiment à la fin de chaque trimestre. Pour l'exercice clos le 31 mai 2018, 8 199 056 USD ont été imputés au titre de la taxe luxembourgeoise.

Belgique

La Société est enregistrée auprès de l'autorité des services et marchés financiers en Belgique en application de l'article 154 de la loi amendée du 3 août 2012 relative aux opérations financières et aux marchés financiers. Les fonds enregistrés à des fins de distribution publique en Belgique sont soumis à une taxe annuelle de 0,0925 % de la VNI des parts distribuées en Belgique via des intermédiaires belges au 31 décembre de l'année précédente. Pour l'exercice clos le 31 mai 2018, 157 683 USD ont été facturés au titre de la taxe belge.

Royaume-Uni

Fonds Déclarants

Le régime des Fonds Déclarants au Royaume-Uni s'applique à la Société. Suivant ce régime, les personnes investissant dans des Fonds Déclarants au Royaume-Uni sont imposables sur la part de revenu du Fonds Déclarant au Royaume-Uni attribuable à leurs avoirs dans ce fonds, que le revenu soit distribué ou non, mais toute plus-value sur une cession de leurs avoirs est assujettie à un impôt sur les plus-values. Une liste des Compartiments qui possèdent actuellement le statut de Fonds Déclarant au Royaume-Uni est disponible à l'adresse suivante : <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>.

Autres taxes sur les transactions

D'autres pays peuvent imposer des taxes, taxes sur les transactions financières (« TTF ») ou autres taxes sur les transactions portant sur certains actifs détenus par les Compartiments (par exemple, les droits de timbre au Royaume-Uni et la TTF en France).

Retenue à la source

Les dividendes et intérêts touchés par la Société au titre de ses investissements peuvent être soumis à des retenues à la source dans les pays d'origine, qui généralement ne peuvent être récupérées, puisque la Société elle-même est exonérée d'impôt sur les revenus. Cependant, un récent précédent en Union européenne pourrait réduire le montant de cette retenue non récupérable. Les investisseurs sont invités à s'informer et, si nécessaire, à consulter leur conseiller sur les conséquences fiscales possibles de la souscription, de l'achat, de la détention, du rachat, de la conversion ou de la vente des Actions dans le pays dont ils sont ressortissants, ou dans lequel ils sont soit domiciliés soit résidents. Les investisseurs doivent prendre note du fait que l'assiette, les taux d'imposition ainsi que les exonérations fiscales existantes, peuvent changer. Les éventuels frais de retenue à la source sont indiqués de façon plus détaillée dans le Prospectus.

9. Gestionnaires Financiers par délégation, Gestionnaires délégués et Gestionnaires délégués externes

La Société de Gestion, BlackRock (Luxembourg) S.A., a délégué les services de gestion et de conseil en investissement aux Gestionnaires Financiers par délégation : BlackRock Financial Management, Inc. (BFM Inc.), BlackRock Institutional Trust Company N.A. (BTC), BlackRock Investment Management LLC (BIMLLC), BlackRock Investment Management (UK) Limited (BIM UK) et BlackRock (Singapore) Limited (BLKSin), comme indiqué dans le Prospectus.

Les Gestionnaires Financiers par délégation dispensent des services de conseil et de gestion dans les domaines de la sélection et de la ventilation stratégique des titres et des secteurs. BIM UK a sous-délégué certaines de ces fonctions à BlackRock Asset Management North Asia Limited (BAMNA), en ce qui concerne le Compartiment BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund, aux Gestionnaires délégués externes suivants : Acadian Asset Management LLC (Acadian), Benefit Street Partners LLC (Benefit Street), Boussard & Gavaudan Asset Management LP (Boussard & Gavaudan), GLG Partners LP (GLG), GSA Capital Partners LLP (GSA), LibreMax Capital LLC (LibreMax), Marathon Asset Management LP (MAMLP), Pine River Capital Management LP (PRCMLP) et QMS Capital Management LP (QMS). Avec effet le 30 mai 2018, Pine River Capital Management LP a été retiré de la liste des Gestionnaires délégués externes. Nonobstant la nomination de Gestionnaires Financiers par délégation, la Société de Gestion reconnaît son entière responsabilité devant la Société s'agissant de toutes les transactions d'investissement.

Compartiment	Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation	Gestionnaire(s) délégué(s)	Gestionnaire délégué externe(s)
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	BTC	–	–
BlackRock Asia Extension Fund	BTC	–	–
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	BIM UK	BAMNA	–

Annexe aux États Financiers suite

Compartiment	Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation	Gestionnaire(s) délégué(s)	Gestionnaire délégué externe(s)
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	BIM UK, BIMLLC	BAMNA	–
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	BIM UK	–	–
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	BIM UK	BAMNA	–
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	BTC, BIM UK, BLKSIn	BAMNA	–
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	BIM UK	BAMNA	–
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	BIM UK	–	–
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund ⁽¹⁾	BIM UK	–	–
BlackRock European Absolute Return Fund	BIM UK	–	–
BlackRock European Credit Strategies Fund	BIM UK, BFM Inc.	–	–
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	BIM UK	–	–
BlackRock European Opportunities Extension Fund	BIM UK	–	–
BlackRock European Select Strategies Fund	BIM UK	–	–
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	BIM UK	–	–
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	BTC, BIM UK, BFM Inc., BLKSIn	BAMNA	–
BlackRock Global Event Driven Fund	BIMLLC	–	–
BlackRock Global Long/Short Equity Fund	BFM Inc.	–	–
BlackRock Global Real Asset Securities Fund ⁽¹⁾	BIMLLC, BIM UK, BFM Inc., BLKSIn	–	–
BlackRock Impact World Equity Fund	BIMLLC	–	–
BlackRock Latin American Opportunities Fund	BIMLLC	–	–
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	BFM Inc., BIMLLC	–	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ⁽¹⁾	BIM UK, BIMLLC	BAMNA	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	BIM UK, BIMLLC	BAMNA	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	BIM UK, BIMLLC	BAMNA	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	BIM UK, BIMLLC	BAMNA	–
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	BFM Inc.	–	Acadian, Benefit Street, Boussard & Gavaudan, GLG, GSA, LibreMax, MAMLP, PRCMLP, QMS
BlackRock Style Advantage Fund	BIM UK, BIMLLC	–	–

Compartiment	Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation	Gestionnaire(s) délégué(s)	Gestionnaire délégué externe(s)
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund	BIM UK	–	–
BlackRock Systematic European Equity Fund	BIM UK	–	–
BlackRock Systematic Global Equity Fund	BIMLLC	–	–
BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾	BIMLLC, BIM UK, BFM Inc.	–	–
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	BIM UK	–	–
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund ⁽¹⁾	BIMLLC	–	–

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

10. Transactions avec des affiliées

La société holding faîtière de la Société de Gestion, du Distributeur Principal et des Gestionnaires Financiers par délégation est BlackRock, Inc., société de l'État du Delaware, aux États-Unis. PNC Financial Services Group Inc. (« PNC Group ») est un actionnaire important de BlackRock, Inc. Lorsqu'elles arrangeront des opérations sur titres pour la Société, les sociétés du PNC Group pourront avoir fourni des services de courtage en valeurs mobilières, des services de change, des services bancaires et d'autres services, ou pourront avoir agi en qualité de donneur d'ordre, à leurs conditions habituelles, et tirer un bénéfice de ces opérations. Une commission a été versée aux courtiers et agents conformément aux usages du marché et la Société a bénéficié des prix de gros ou autres réductions ou remises sur commissions en numéraire accordés par les courtiers ou agents. Les Gestionnaires Financiers par délégation auraient pu faire appel aux services de sociétés du PNC Group s'ils l'avaient jugé opportun, sous réserve que leurs commissions et autres conditions commerciales soient généralement comparables à celles des intermédiaires et agents extérieurs au Groupe opérant sur les marchés concernés, et que leur intervention soit compatible avec la politique précitée, qui consiste à obtenir les meilleurs résultats.

Au cours de l'exercice, aucune transaction importante n'a été effectuée en dehors du cadre ordinaire de l'activité ou à des conditions autres que les conditions d'usage. Aucune des transactions de la Société n'a été effectuée par l'entremise des sociétés BlackRock.

La Société a nommé BlackRock Advisors (UK) Limited, une partie liée à la Société, comme agent de prêt de titres. BlackRock Advisors (UK) Limited supporte tous les coûts opérationnels directement liés aux transactions de prêt de titres.

Certains Compartiments utilisent des techniques d'investissement croisés, c'est-à-dire que les Compartiments investissent dans d'autres Compartiments du fonds à compartiments multiples. Le bilan combiné ainsi que le compte de résultat et l'évolution de l'actif net combinés n'ont pas été

Annexe aux États Financiers suite

ajustés pour éliminer l'impact des investissements croisés. Les commissions sur les souscriptions et les rachats, ainsi que les commissions de gestion, ne sont pas appliquées aux actifs du Compartiment BlackRock Dynamic Diversified Growth investis dans d'autres Compartiments.

Le tableau ci-dessous présente la valeur de ces investissements croisés dans le portefeuille de titres du Compartiment concerné, au 31 mai 2018 :

Compartiment	Compartiment d'investissements croisés	Monnaie	Valeur de marché	% de l'actif net
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	BlackRock Strategic Funds - BlackRock Impact World Equity Fund X2 (GBP)	EUR	29.669.865	3,90
	BlackRock Strategic Funds - European Credit Strategies Fund I2RF	EUR	9.008.000	1,18

11. Dividendes

Pour les Catégories d'Actions de capitalisation, la politique actuelle des Administrateurs est de conserver et de réinvestir tout le revenu net.

Pour les Catégories d'Actions de Distribution, la politique est de distribuer la quasi-totalité du revenu des investissements (le cas échéant) pour la période après déduction des dépenses (ou du revenu brut dans le cas des Actions de Distribution (G)). Les Administrateurs peuvent également déterminer si et dans quelle mesure les dividendes peuvent comprendre les distributions de plus-values non réalisées nettes et réalisées nettes. Si des Catégories d'Actions de Distribution versent des dividendes comprenant des plus-values nettes réalisées ou des plus-values nettes non réalisées, ou dans le cas de Compartiments qui distribuent le revenu brut, les dividendes peuvent comprendre le capital initialement souscrit. Les Actionnaires sont priés de noter que lorsque les dividendes sont distribués de cette façon, ils peuvent être imposables en tant que revenu, selon la législation fiscale locale, et qu'à cet égard il conviendrait auxdits Actionnaires de prendre conseil auprès de leur conseiller fiscal professionnel.

Lorsqu'un Compartiment bénéficie du statut de Fonds Déclarant au Royaume-Uni et que ses revenus déclarés dépassent les distributions effectuées, l'excédent sera considéré comme un revenu réputé distribué et sera imposé en tant que revenu, conformément au statut fiscal de l'investisseur.

La Société peut opérer des arrangements d'égénéralisation des revenus en vue d'assurer que le montant de revenus nets constatés au sein d'un Compartiment (ou de revenus bruts dans le cas des Actions de Distribution (G)) et attribuables à chaque Action n'est pas influencé par l'émission, la conversion ou le rachat desdites Actions pendant un même exercice comptable.

12. Prêts de titres

Compartiment	Devise	Valeur des titres en prêt	Valeur de la garantie autre qu'en numéraire reçue
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	USD	527.335	685.194
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	EUR	811.253	897.340
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	USD	828.254	914.142
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	USD	5.299.833	6.133.907
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	USD	112.834.766	128.113.447
BlackRock European Absolute Return Fund	EUR	19.616.130	21.589.609
BlackRock European Opportunities Extension Fund	EUR	18.577.985	20.553.091
BlackRock European Select Strategies Fund	EUR	20.376.155	22.447.059
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	EUR	281.510.320	302.922.172
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	EUR	8.780.047	9.628.613
BlackRock Global Event Driven Fund	USD	7.346.604	7.824.932
BlackRock Impact World Equity Fund	USD	1.572.456	1.882.400
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ⁽¹⁾	EUR	2.311.286	2.506.885
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	EUR	4.285.641	4.672.588
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	EUR	419.890	461.583
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	EUR	2.441.688	2.648.322
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund	EUR	125.198	259.811
BlackRock Systematic European Equity Fund	EUR	325.454	358.330
BlackRock Systematic Global Equity Fund	USD	24.682.914	27.110.645

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

Le revenu perçu durant l'exercice par les Compartiments et issu des opérations de prêt de titres est indiqué dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net des Compartiments, sous le poste « Prêts de titres ».

13. Coûts de transaction

Pour atteindre son objectif d'investissement, un Compartiment engagera des coûts de transaction en lien avec l'activité de négociation dans son portefeuille de titres. Dans le tableau

Annexe aux États Financiers suite

ci-dessous, sont identifiables séparément les coûts de transaction engagés par chaque Compartiment pour l'exercice clos le 31 mai 2018. Ceci comprend les commissions des courtiers et les frais de règlement.

Compartiment	Monnaie	Coûts de transaction
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	1.883
BlackRock Asia Extension Fund	USD	–
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	USD	125.915
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	–
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	EUR	43.422
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	USD	260.294
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	USD	6.375
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	USD	600.845
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	USD	183.729
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund ⁽¹⁾	USD	–
BlackRock European Absolute Return Fund	EUR	443.831
BlackRock European Credit Strategies Fund	EUR	7.903
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	EUR	–
BlackRock European Opportunities Extension Fund	EUR	216.314
BlackRock European Select Strategies Fund	EUR	476.665
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	EUR	530
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	EUR	6.895
BlackRock Global Event Driven Fund	USD	56.362
BlackRock Global Long/Short Equity Fund	USD	–
BlackRock Global Real Asset Securities Fund ⁽¹⁾	USD	7.959
BlackRock Impact World Equity Fund	USD	118.127
BlackRock Latin American Opportunities Fund	USD	56.781
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	USD	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ⁽¹⁾	EUR	1.263
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	EUR	939
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	EUR	3.960
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	EUR	10.733
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	USD	126.506
BlackRock Style Advantage Fund	USD	–
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund	EUR	–

Compartiment	Monnaie	Coûts de transaction
BlackRock Systematic European Equity Fund	EUR	31.557
BlackRock Systematic Global Equity Fund	USD	453.261
BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾	EUR	–
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	GBP	–
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund ⁽¹⁾	USD	–

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

Tous les coûts de transaction ne sont pas identifiables séparément. Pour les CFD, les swaps, les opérations de change à terme, les contrats *futures*, les options, les swaptions et les TBAs, les coûts de transaction sont compris dans le prix d'achat et de vente de l'investissement. Bien qu'ils ne soient pas identifiables séparément, ces coûts de transaction sont pris en compte dans la performance de chaque Compartiment. Les coûts d'impact sur le marché ne sont pas identifiables séparément et par conséquent ne figurent pas dans le tableau ci-dessus.

14. Facilité de crédit

La Société a conclu un accord de facilité de crédit avec JPMorgan Chase Bank, N.A. (« JPMorgan ») en vertu duquel JPMorgan, avec d'autres prêteurs syndiqués, accordera une portion d'une facilité de crédit de 1,4 milliard d'USD aux Compartiments. La portion de la facilité de crédit de 1,4 milliard d'USD sera répartie entre les Compartiments, sur la base de l'avis de répartition daté du 27 avril 2018.

Cette facilité de crédit sera utilisée par les Compartiments à des fins de financement temporaire, y compris, sans s'y restreindre, le financement des rachats demandés par les investisseurs. Les intérêts et les commissions d'engagement en lien avec les montants prélevés sur cette facilité de crédit sont couverts par les actifs des compartiments concernés. Un nouveau Compartiment ne fera pas automatiquement l'objet d'une ligne de crédit et devra par conséquent être ajouté au moyen d'un processus d'adhésion. Ce processus comprend, entre autres, tout contrôle préalable nécessaire effectué par les prêteurs, dans le but d'autoriser l'ajout de nouveaux Compartiments. Durant cet exercice, ces Compartiments ne feront l'objet d'aucune ligne de crédit, ni ne pourront faire de prélèvements sur une quelconque ligne de crédit. De plus, rien ne garantit que l'ajout de nouveaux compartiments sera approuvé par les prêteurs, ni que le crédit sera disponible pour un Compartiment puisque la ligne de crédit est fonction de la disponibilité (sur une base d'allocation équitable) pour les Compartiments et autres fonds BlackRock parties à la convention de crédit. À ce titre, certains Compartiments peuvent ne pas faire l'objet de la ligne de crédit et ne supporteront aucuns frais associés à cette dernière.

Une commission d'engagement de prêt est facturée sur une base quotidienne, en relation avec cette facilité de crédit,

Annexe aux États Financiers suite

et est comprise dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif sous le poste « Commissions d'engagement de prêt ». La commission d'engagement de prêt facturée est de 0,10 % de l'encours.

15. Dus par / aux courtiers

Le poste Dus par/aux courtiers du Bilan correspond à une garantie en numéraire et une marge payée aux/reçue par les courtiers de compensation du Compartiment et différentes contreparties.

16. Événements ultérieurs

Avec effet le 11 juin 2018, le Compartiment BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund, libellé en USD, a été dissous.

Avec effet le 17 juillet 2018, le Compartiment BlackRock European Credit Strategies Fund, libellé en EUR, a été dissous.

Durant le mois d'août 2018, un problème a été identifié dans le calcul de la VNI du Compartiment BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund et une correction a été appliquée afin d'ajuster la VNI négociée à la VNI telle qu'indiquée dans le Bilan présenté dans le présent rapport annuel et les comptes révisés. Pour de plus amples informations, veuillez consulter le point 1 de l'Annexe aux états financiers.

17. Total des frais sur encours

Le total des frais sur encours (« TFE ») correspond au total de tous les frais (en excluant les intérêts bancaires, les coûts de transaction et les frais de rendements négatifs sur actifs financiers, mais en incluant les remboursements de frais) divisé par l'actif net moyen du Compartiment, exprimé en pourcentage. Toutes les données sont annualisées.

La commission de gestion peut être utilisée en partie pour payer la rémunération relative aux activités de distribution de la Société. Un remboursement peut être versé aux investisseurs institutionnels qui, d'un point de vue commercial, détiennent des actions de la Société pour des tierces parties.

Le TFE pour l'exercice allant du 1^{er} juin 2017 au 31 mai 2018 est le suivant :

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE (commission de performance comprise)	Commission liée à la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	Catégorie A	2,863 %	1,004 %
	Catégorie D	2,569 %	1,209 %
	Catégorie E	3,441 %	1,071 %
	Catégorie I	1,974 %	0,902 %
	Catégorie X	0,069 %	—
BlackRock Asia Extension Fund	Catégorie A	1,857 %	—
	Catégorie D	1,354 %	—
	Catégorie E	2,367 %	—
	Catégorie X	0,067 %	—

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE (commission de performance comprise)	Commission liée à la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	Catégorie A	1,896 %	—
	Catégorie D	1,393 %	—
	Catégorie E	2,398 %	—
	Catégorie X	0,110 %	—
	Catégorie Z	1,145 %	—
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	Catégorie A	1,853 %	—
	Catégorie D	1,352 %	—
	Catégorie E	2,358 %	—
	Catégorie X	0,071 %	—
	Catégorie Z	0,862 %	—
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund ⁽¹⁾ (2)	Catégorie A	1,659 %	—
	Catégorie D	1,011 %	—
	Catégorie E	2,189 %	—
	Catégorie I	0,755 %	—
	Catégorie X	0,173 %	—
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund ⁽³⁾	Catégorie A	1,961 %	—
	Catégorie D	1,450 %	—
	Catégorie E	2,447 %	—
	Catégorie I	1,160 %	—
	Catégorie X	0,158 %	—
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	Catégorie A	1,608 %	—
	Catégorie C	2,602 %	—
	Catégorie D	0,874 %	—
	Catégorie E	2,110 %	—
	Catégorie I	0,621 %	—
	Catégorie X	0,067 %	—
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund ⁽¹⁾	Catégorie A	1,949 %	—
	Catégorie D	1,452 %	—
	Catégorie E	2,450 %	—
	Catégorie X	0,157 %	—
	Catégorie Z	0,857 %	—
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Catégorie A	1,779 %	—
	Catégorie D	1,034 %	—
	Catégorie E	2,291 %	—
	Catégorie I	0,848 %	—
	Catégorie X	0,096 %	—
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund ⁽⁴⁾	Catégorie A	0,993 %	—
	Catégorie D	0,616 %	—
	Catégorie E	1,386 %	—
	Catégorie I	0,481 %	—
	Catégorie X	0,087 %	—
BlackRock European Absolute Return Fund	Catégorie A	1,867 %	—
	Catégorie D	1,367 %	—
	Catégorie E	2,366 %	—
	Catégorie I	1,078 %	—
BlackRock European Credit Strategies Fund	Catégorie H	1,755 %	—
	Catégorie I	1,069 %	—
	Catégorie T	0,807 %	—
	Catégorie U	1,256 %	—
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	Catégorie X	0,077 %	—
	Catégorie A	1,855 %	—
	Catégorie D	1,358 %	—
	Catégorie E	2,355 %	—
	Catégorie I	1,070 %	—
	Catégorie X	0,071 %	—

Annexe aux États Financiers suite

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE (commission de performance comprise)	Commission liée à la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock European Opportunities Extension Fund	Catégorie A	2,713 %	0,829 %
	Catégorie D	2,304 %	0,919 %
	Catégorie E	3,111 %	0,727 %
	Catégorie I	2,092 %	0,997 %
	Catégorie X	0,085 %	–
BlackRock European Select Strategies Fund ⁽¹⁾	Catégorie A	1,518 %	–
	Catégorie D	0,908 %	–
	Catégorie E	2,012 %	–
	Catégorie I	0,719 %	–
	Catégorie X	0,064 %	–
BlackRock Fixed Income Strategies Fund ⁽¹⁾	Catégorie A	1,254 %	–
	Catégorie D	0,854 %	–
	Catégorie E	1,754 %	–
	Catégorie I	0,665 %	–
	Catégorie X	0,064 %	–
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund ⁽¹⁾	Catégorie A	1,248 %	–
	Catégorie D	0,747 %	–
	Catégorie E	1,751 %	–
	Catégorie I	0,562 %	–
	Catégorie X	0,062 %	–
BlackRock Global Event Driven Fund	Catégorie A	1,873 %	–
	Catégorie D	1,377 %	0,011 %
	Catégorie E	2,466 %	0,085 %
	Catégorie I	1,077 %	0,002 %
	Catégorie X	0,073 %	–
	Catégorie Z	0,875 %	0,015 %
BlackRock Global Long/Short Equity Fund	Catégorie A	2,162 %	–
	Catégorie C	3,158 %	–
	Catégorie D	1,559 %	–
	Catégorie E	2,660 %	–
	Catégorie J	1,571 %	–
	Catégorie X	0,076 %	–
BlackRock Global Real Asset Securities Fund ⁽⁴⁾	Catégorie A	1,578 %	–
	Catégorie D	0,943 %	–
	Catégorie E	2,037 %	–
	Catégorie X	0,114 %	–
	Catégorie Z	0,644 %	–
BlackRock Impact World Equity Fund	Catégorie A	1,032 %	–
	Catégorie D	0,621 %	–
	Catégorie E	1,523 %	–
	Catégorie I	0,483 %	–
	Catégorie X	0,083 %	–
	Catégorie Z	0,083 %	–
BlackRock Latin American Opportunities Fund	Catégorie A	2,539 %	–
	Catégorie C	3,530 %	–
	Catégorie D	1,857 %	0,067 %
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽⁴⁾	Catégorie A	1,461 %	–
	Catégorie E	1,970 %	–
	Catégorie X	0,070 %	–
	Catégorie Z	0,770 %	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative ^{(1),(4)}	Catégorie A	1,155 %	–
	Catégorie D	0,519 %	–
	Catégorie IndexInvest	1,147 %	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive ⁽¹⁾	Catégorie A	1,141 %	–
	Catégorie D	0,514 %	–
	Catégorie I	0,429 %	–
	Catégorie IndexInvest	1,166 %	–
	Catégorie X	0,058 %	–

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TFE (commission de performance comprise)	Commission liée à la performance (en pourcentage de l'actif net moyen)
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth ⁽¹⁾	Catégorie A	1,158 %	–
	Catégorie D	0,526 %	–
	Catégorie I	0,453 %	–
	Catégorie IndexInvest	1,167 %	–
	Catégorie X	0,072 %	–
	Catégorie Z	0,072 %	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate ⁽¹⁾	Catégorie A	1,141 %	–
	Catégorie D	0,511 %	–
	Catégorie I	0,442 %	–
	Catégorie IndexInvest	1,161 %	–
	Catégorie X	0,055 %	–
	Catégorie Z	0,055 %	–
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	Catégorie A	2,728 %	–
	Catégorie D	1,981 %	–
	Catégorie E	3,236 %	–
	Catégorie I	1,695 %	–
	Catégorie X	0,070 %	–
	Catégorie Z	1,733 %	–
BlackRock Style Advantage Fund	Catégorie A	1,760 %	–
	Catégorie D	1,016 %	–
	Catégorie E	2,262 %	–
	Catégorie I	0,802 %	–
	Catégorie X	0,069 %	–
	Catégorie Z	0,857 %	–
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund	Catégorie A	0,971 %	–
	Catégorie D	0,603 %	–
	Catégorie E	1,469 %	–
	Catégorie I	0,472 %	–
	Catégorie X	0,075 %	–
	Catégorie Z	0,075 %	–
BlackRock Systematic European Equity Fund	Catégorie A	1,144 %	–
	Catégorie D	0,747 %	–
	Catégorie E	1,648 %	–
	Catégorie X	0,109 %	–
BlackRock Systematic Global Equity Fund	Catégorie A	1,123 %	–
	Catégorie D	0,737 %	–
	Catégorie E	1,632 %	–
	Catégorie I	0,492 %	–
	Catégorie X	0,090 %	–
BlackRock Total Advantage Fund ⁽⁴⁾	Catégorie A	1,362 %	–
	Catégorie D	0,808 %	–
	Catégorie E	1,311 %	–
	Catégorie I	0,620 %	–
	Catégorie X	0,076 %	–
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	Catégorie A	1,863 %	0,002 %
	Catégorie D	1,126 %	0,011 %
	Catégorie E	2,360 %	–
	Catégorie I	0,822 %	0,001 %
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund ⁽⁴⁾	Catégorie A	1,259 %	–
	Catégorie D	0,736 %	–

(1) Le TFE synthétique calculé correspond au total du TFE du compartiment et du TFE au prorata des fonds cibles sous-jacents moins toute remise sur les commissions de gestion reçues.

(2) Réduction de mi-exercice de la commission de gestion.

(3) Réduction des commissions de dépositaire en raison d'une chute significative des ASG.

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

Le TFE est calculé conformément aux lignes directrices de la Swiss Funds & Asset Management Association (« SFAMA »), modifiées en dernier lieu le 22 avril 2015.

Aux Actionnaires de
BlackRock Strategic Funds

RAPPORT DU RÉVISEUR D'ENTREPRISES AGRÉÉ

Opinion

Nous avons contrôlé les états financiers de BlackRock Strategic Funds (la « Société ») et de chacun de ses compartiments, à savoir le bilan, le portefeuille d'investissements au 31 mai 2018, le compte de résultat et l'évolution de l'actif net pour l'exercice clos à cette date, ainsi que l'annexe aux états financiers, y compris un résumé des principales règles comptables.

À notre avis, les présents états financiers donnent une image fidèle de la situation financière de BlackRock Strategic Funds et de chacun de ses compartiments au 31 mai 2018 ainsi que des résultats de leurs opérations et des changements apportés à leur actif net pour l'exercice clos à cette date en conformité avec les prescriptions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg en matière de préparation et de présentation des états financiers.

Fondement de l'opinion

Nous avons mené notre audit conformément à la loi du 23 juillet 2016 relative à la profession de l'audit (loi du 23 juillet 2016) et aux Normes de révision internationales (International Standards on Auditing ou ISA) telles qu'elles ont été adoptées pour le Luxembourg par la « Commission de Surveillance du Secteur Financier » (CSSF). Nos responsabilités en vertu de cette réglementation, de cette loi et de ces normes sont décrites de façon plus détaillée dans la section de notre rapport intitulée « Responsabilités du réviseur d'entreprises agréé s'agissant de l'audit des états financiers ». Nous sommes également indépendants de la Société conformément au Code d'éthique publié à l'intention des comptables professionnels par le Conseil des normes internationales de déontologie comptable (Code IESBA) tel qu'adopté pour le Luxembourg par la CSSF, ainsi qu'aux exigences éthiques concernant notre audit des états financiers, et nous nous sommes acquittés de nos responsabilités éthiques en vertu de ces normes de déontologie. Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus constituent une base raisonnable pour exprimer notre opinion.

Informations complémentaires

Le Conseil d'administration de la Société est responsable des informations complémentaires. Les informations complémentaires comprennent les informations contenues dans le rapport annuel mais ne comprennent pas les états financiers ni notre rapport de réviseur d'entreprises agréé sur ces derniers.

Notre opinion sur les états financiers ne couvre pas les informations complémentaires et nous n'exprimons aucune forme de conclusion assortie d'une assurance sur lesdites informations complémentaires.

En ce qui concerne notre audit des états financiers, il est de notre responsabilité de lire les informations complémentaires et, ce faisant, de considérer si ces informations complémentaires présentent une incompatibilité de fond avec les états financiers ou si les informations dont nous avons pris connaissance lors de l'audit semblent de toute autre façon comporter des inexactitudes importantes. Si, sur la base de notre travail, nous avons conclu que ces informations complémentaires comportent des inexactitudes importantes, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

Responsabilité du Conseil d'administration de la Société concernant les états financiers

Le Conseil d'administration de la Société est responsable de la préparation et de la présentation fidèle des états financiers, en conformité avec les prescriptions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg en matière de préparation et de présentation des états financiers, et de tout contrôle interne que le Conseil d'administration jugera nécessaire à la préparation d'états financiers exempts d'anomalies importantes dues à une fraude ou à une erreur.

Dans le cadre de la préparation des états financiers, le Conseil d'administration est chargé d'évaluer la capacité de la Société à poursuivre ses activités, d'indiquer, selon le cas, les questions liées à la poursuite des activités, et d'utiliser le principe comptable de continuité des activités, à moins que le Conseil d'administration ait l'intention de liquider la Société ou de cesser ses opérations, ou qu'il n'ait aucune autre solution réaliste.

Responsabilités du réviseur d'entreprises agréé s'agissant de l'audit des états financiers

Les objectifs de notre audit sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies importantes, dues à une fraude ou à une erreur, et de publier un rapport du réviseur d'entreprises agréé comprenant notre opinion. L'assurance raisonnable est un niveau d'assurance élevé, mais n'est pas une garantie selon laquelle un audit mené conformément aux dispositions de la loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF détectera toujours toute anomalie importante existante. Les anomalies peuvent découler d'une fraude ou d'une erreur, et sont réputées importantes si, individuellement ou collectivement, elles sont raisonnablement susceptibles d'influencer les décisions économiques des utilisateurs prises sur la base de ces états financiers.

Dans le cadre d'un audit conformément à la loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous exerçons un jugement professionnel et adoptons une attitude de scepticisme professionnel tout au long de l'audit. En outre, nous :

- identifions et évaluons les risques d'anomalie importante dans les états financiers, due à une fraude ou à une erreur, nous établissons et réalisons des procédures d'audit adaptées à ces risques, et nous obtenons les éléments probants qui constituent une base raisonnable pour exprimer notre opinion. Le risque de ne pas détecter une anomalie importante due à une fraude est plus élevé que lorsque celle-ci est due à une erreur, puisqu'une fraude peut comporter une collusion, une contrefaçon, des omissions intentionnelles, de fausses déclarations ou la dérogation à un contrôle interne.
- veillons à bien comprendre le contrôle interne concernant l'audit, afin d'établir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne de la Société.
- évaluons le caractère approprié des politiques comptables utilisées ainsi que le caractère raisonnable des estimations comptables et informations connexes émanant du Conseil d'administration de la Société.
- formulons des conclusions sur le caractère approprié de l'utilisation par le Conseil d'administration de la Société du principe comptable de continuité des activités et, sur la base des éléments probants obtenus, sur la présence ou non d'une incertitude importante quant aux événements ou conditions pouvant jeter un doute significatif sur la capacité de la Société à poursuivre ses activités. Si nous concluons à l'existence d'incertitudes importantes, nous sommes tenus, dans notre rapport du réviseur d'entreprises agréé, d'attirer l'attention sur les informations connexes figurant dans les états financiers ou, si ces informations sont inappropriées, de modifier notre opinion. Nos conclusions sont fondées sur les éléments probants obtenus au jour de notre rapport du réviseur d'entreprises agréé. Toutefois, des événements ou conditions à venir peuvent conduire la Société à cesser ses activités.
- évaluons la présentation générale, la structure et le contenu des états financiers, y compris les informations y figurant, et vérifions si les états financiers représentent les transactions et événements sous-jacents de manière à réaliser une présentation fidèle.

Nous communiquons avec les personnes chargées de la gouvernance en ce qui concerne, entre autres choses, l'étendue et le calendrier de l'audit ainsi que les principales conclusions de ce dernier, y compris les lacunes importantes du contrôle interne que nous identifions au cours de l'audit.

Pour Deloitte Audit, cabinet de révision agréé

Justin Griffiths, réviseur d'entreprises agréé

Partenaire

Le 26 septembre 2018

Société à responsabilité limitée au capital de 35 000 EUR
RCS Luxembourg B 67.895
N° d'autorisation d'établissement 10022179

Le rapport annuel contenu dans ce document a été extrait et traduit à partir du rapport annuel de la Société qui a été réalisé en anglais et sur lequel le cabinet Deloitte a exprimé l'opinion reportée et traduite ci-dessus. Seule la version anglaise du rapport annuel a été révisée par le réviseur, le cabinet Deloitte. Par conséquent, c'est à elle seule que se réfère le rapport d'audit. En cas de divergence entre la version anglaise et la traduction, la version anglaise fera foi. Le cabinet Deloitte n'exprime aucune opinion quant au caractère adéquat de l'extraction des comptes sur lesquels il a exprimé son opinion ou sur l'exactitude de la traduction effectuée.

Appendice I – Catégories d'Actions (non révisé)

Catégories d'actions émises

Au 31 mai 2018, la Société offrait les catégories d'actions suivantes.

Catégorie A

Action de Catégorie A de distribution couverte en francs suisses
Action de Catégorie A de distribution en euros
Action de Catégorie A de distribution couverte en euros
Action de Catégorie A de distribution en dollars US
Action de Catégorie A de distribution couverte en dollars US
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling
Action de Catégorie A de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
Action de Catégorie A de capitalisation en dollars australiens
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en francs suisses
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes tchèques
Action de Catégorie A de capitalisation en euros
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros
Action de Catégorie A de capitalisation en livres sterling
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises
Action de Catégorie A de capitalisation en dollars US
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en euros
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling

Catégorie C

Action de Catégorie C de capitalisation en dollars US

Catégorie D

Action de Catégorie D de distribution (G) en euros
Action de Catégorie D de distribution en euros
Action de Catégorie D de distribution couverte en euros
Action de Catégorie D de distribution couverte en livres sterling
Action de Catégorie D de distribution en dollars US
Action de Catégorie D de distribution couverte en dollars US
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling
Action de Catégorie D de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses
Action de Catégorie D de capitalisation en euros
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en euros
Action de Catégorie D de capitalisation en livres sterling
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en livres sterling
Action de Catégorie D de capitalisation en dollars US
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses

Catégorie D suite

Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en euros
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US

Catégorie E

Action de Catégorie E de distribution en euros
Action de Catégorie E de distribution couverte en euros
Action de Catégorie E de capitalisation en euros
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros
Action de Catégorie E de capitalisation en dollars US

Catégorie H

Action de Catégorie H de capitalisation couverte en francs suisses
Action de Catégorie H de capitalisation en euros
Action de Catégorie H de capitalisation couverte en dollars US
Action de Catégorie H de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling

Catégorie I¹

Action de Catégorie I de distribution en euros
Action de distribution (G) de Catégorie I couverte en EUR
Action de Catégorie I de distribution couverte en euros
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US
Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en CHF
Action PF de Catégorie I de capitalisation couverte en euros
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars canadiens
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en francs suisses
Action de Catégorie I de capitalisation en euros
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en livres sterling
Action de Catégorie I de capitalisation en yens japonais
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en couronnes suédoises
Action de Catégorie I de capitalisation en dollars US
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en francs suisses
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en euros
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en yens japonais
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en dollars US

Appendice I – Catégories d'Actions (non révisé) suite

Catégorie IndexInvest²

Action de distribution de Catégorie IndexInvest Balance EUR
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Chance EUR
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Substanz EUR
Action de distribution de Catégorie IndexInvest Wachstum EUR

Catégorie J¹

Action de Catégorie J de distribution en dollars US

Catégorie T¹

Action de Catégorie T de capitalisation en euros

Catégorie U

Action de Catégorie U de capitalisation couverte en francs suisses
Action de Catégorie U de capitalisation en euros
Action de Catégorie U de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en livres sterling
Action de Catégorie U de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en dollars US

Catégorie X¹

Action de Catégorie X de distribution en dollars australiens
Action de Catégorie X de distribution en euros
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars australiens
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars canadiens
Action de Catégorie X de capitalisation en euros
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en euros

Catégorie X¹ suite

Action de Catégorie X de capitalisation en livres sterling
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en livres sterling
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars néo-zélandais
Action de Catégorie X de capitalisation en dollars US
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US

Catégorie Z²

Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en BRL
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en francs suisses
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros
Action de Catégorie Z de capitalisation en livres sterling
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en livres sterling
Action de Catégorie Z de capitalisation en dollars US
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US

¹ disponible pour les investisseurs institutionnels.

² disponible à la discrétion de la Société de Gestion.

Catégories d'Actions lancées

Les dates communiquées sont les dates de lancement et de réactivation, mais les catégories peuvent avoir été amorcées à une date ultérieure.

Date d'effet	Compartiment	Type
7 juin 2017	BlackRock Style Advantage Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros
5 juillet 2017	BlackRock Style Advantage Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US
5 juillet 2017	BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros
19 juillet 2017	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros
19 juillet 2017	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de Catégorie X de distribution en euros
19 juillet 2017	BlackRock Global Event Driven Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US
19 juillet 2017	BlackRock Style Advantage Fund	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en francs suisses
19 juillet 2017	BlackRock Style Advantage Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en francs suisses
3 août 2017	BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie I de capitalisation en dollars US
4 octobre 2017	BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	Action de Catégorie I de distribution en euros
11 octobre 2017	BlackRock Global Event Driven Fund	Action de Catégorie A de distribution couverte en euros
25 octobre 2017	BlackRock Style Advantage Fund	Action de Catégorie I de capitalisation PF couverte en CHF
8 novembre 2017	BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation en livres sterling
22 novembre 2017	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en couronnes suédoises
22 novembre 2017	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de Catégorie I de distribution en euros
29 novembre 2017	BlackRock Fixed Income Strategies Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US
29 novembre 2017	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie A de capitalisation en dollars US
29 novembre 2017	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie X de capitalisation en dollars US
29 novembre 2017	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en BRL
29 novembre 2017	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en francs suisses
29 novembre 2017	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en euros
29 novembre 2017	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en livres sterling

Appendice I – Catégories d'Actions (non révisé) suite

Date d'effet	Compartiment	Type
29 novembre 2017	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation en dollars US
29 novembre 2017	BlackRock Style Advantage Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL
30 novembre 2017	BlackRock Global Real Asset Securities Fund	Action de Catégorie A de capitalisation en dollars US
30 novembre 2017	BlackRock Global Real Asset Securities Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US
30 novembre 2017	BlackRock Global Real Asset Securities Fund	Action de Catégorie E de capitalisation en euros
30 novembre 2017	BlackRock Global Real Asset Securities Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US
30 novembre 2017	BlackRock Global Real Asset Securities Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US
6 décembre 2017	BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	Action de Catégorie X de capitalisation en dollars US ⁽¹⁾
6 décembre 2017	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation en dollars US
6 décembre 2017	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en euros
6 décembre 2017	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni en dollars US
6 décembre 2017	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros
6 décembre 2017	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros
6 décembre 2017	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie X de capitalisation en dollars US
6 décembre 2017	BlackRock Systematic Global Equity Fund	Action de Catégorie X de capitalisation en dollars US
11 décembre 2017	BlackRock Total Advantage Fund	Action de Catégorie A de capitalisation en euros
11 décembre 2017	BlackRock Total Advantage Fund	Action de Catégorie D de capitalisation en euros
11 décembre 2017	BlackRock Total Advantage Fund	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US
11 décembre 2017	BlackRock Total Advantage Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
11 décembre 2017	BlackRock Total Advantage Fund	Action de Catégorie I de capitalisation en euros
11 décembre 2017	BlackRock Total Advantage Fund	Action de Catégorie X de capitalisation en euros
8 janvier 2018	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution en euros
8 janvier 2018	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution couverte en euros
8 janvier 2018	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution en dollars US
8 janvier 2018	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation en euros
8 janvier 2018	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en euros
8 janvier 2018	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation en dollars US
8 janvier 2018	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	Action de Catégorie D de distribution en dollars US
8 janvier 2018	BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund	Action de Catégorie D de capitalisation en dollars US
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de Catégorie A de distribution en euros
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de Catégorie A de capitalisation en euros
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en dollars US
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de Catégorie D de distribution en euros
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de Catégorie D de capitalisation en euros
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en dollars US
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	Action de distribution de Catégorie IndexInvest Balance EUR
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	Action de distribution de Catégorie IndexInvest Substanz EUR
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	Action de distribution de Catégorie IndexInvest Chance EUR
26 janvier 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	Action de distribution de Catégorie IndexInvest Wachstum EUR
28 février 2018	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de distribution (G) de Catégorie I couverte en EUR
28 février 2018	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en dollars canadiens
28 février 2018	BlackRock Style Advantage Fund	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en euros
7 mars 2018	BlackRock Global Event Driven Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais
7 mars 2018	BlackRock Systematic Global Equity Fund	Action de Catégorie X de capitalisation en euros
14 mars 2018	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie E de distribution en euros
14 mars 2018	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie E de distribution couverte en euros
14 mars 2018	BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie E de capitalisation en euros
14 mars 2018	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie E de capitalisation en euros
14 mars 2018	BlackRock Macro Opportunities Fund	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en euros

Appendice I – Catégories d'Actions (non révisé) suite

Date d'effet	Compartiment	Type
14 mars 2018	BlackRock Total Advantage Fund	Action de Catégorie E de capitalisation en euros
28 mars 2018	BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en yens japonais
11 avril 2018	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de Catégorie D de distribution en euros
18 avril 2018	BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US
25 avril 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US
25 avril 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US
25 avril 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en dollars US
2 mai 2018	BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	Action de Catégorie D de distribution couverte en euros
16 mai 2018	BlackRock Global Event Driven Fund	Action de Catégorie I de distribution couverte en euros
16 mai 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling
16 mai 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling
16 mai 2018	BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en livres sterling

⁽¹⁾ La Catégorie a été lancée le 15 novembre 2012, fermée le 16 septembre 2015 et réactivée le 6 décembre 2017.

Catégories d'Actions fermées

Date d'effet	Compartiment	Type
16 mai 2018	BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	Action de Catégorie I de distribution de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
16 mai 2018	BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	Action de capitalisation de Catégorie I
16 mai 2018	BlackRock Global Long/Short Equity Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en livres sterling
16 mai 2018	BlackRock Global Long/Short Equity Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en euros

Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)

Exposition globale

Conformément à la politique actuelle de BlackRock, l'exposition globale est mesurée selon l'« approche par les engagements » ou l'approche de la valeur à risque (« VaR »), et couvre l'ensemble des composantes du portefeuille.

L'approche par les engagements est une méthode qui regroupe les valeurs de marché sous-jacentes ou les valeurs notionnelles des instruments financiers dérivés afin de déterminer le degré d'exposition globale d'un Compartiment aux instruments financiers dérivés.

Conformément à la Loi de 2010, l'exposition globale d'un Compartiment selon la méthode par les engagements ne doit pas excéder 100 % de la Valeur Nette d'Inventaire de ce Compartiment.

Voici la liste des Compartiments qui utilisent l'approche par les engagements :

- BlackRock Global Real Asset Securities Fund⁽¹⁾
- BlackRock Impact World Equity Fund
- BlackRock Latin American Opportunities Fund
- BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative⁽¹⁾
- BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive
- BlackRock Managed Index Portfolios – Growth
- BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate
- BlackRock Systematic European Equity Fund
- BlackRock Systematic Global Equity Fund

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

La VaR est une mesure de risque statistique qui estime la perte potentielle due aux mouvements défavorables du marché, dans un environnement de marché normal.

Les calculs de la VaR pour les Compartiments de BlackRock Strategic Funds, à l'exception du Compartiment BlackRock Global Event Driven Fund, sont fondés sur un modèle de simulation historique ajustée. Le 1^{er} janvier 2018, le modèle de VaR utilisé pour le Compartiment BlackRock Global Event Driven Fund a été modifié et le modèle de simulation historique ajustée a été remplacé par un modèle de simulation de Monte-Carlo, afin de mesurer de façon plus appropriée l'exposition du Compartiment au risque de marché. Les deux modèles utilisent un indice de confiance de 99 %, une période de détention d'un jour et une période d'observation historique d'au moins un an (250 jours). Un chiffre de VaR est défini dans la perspective d'une probabilité spécifique et d'un horizon temporel spécifique. Une VaR à 99 % à un jour signifie que l'on prévoit que pendant 99 % du temps sur une période d'un jour, le Compartiment ne perdra pas plus que ce chiffre en pourcentage. Par conséquent, les VaR élevées indiquent un risque élevé.

Pour les Compartiments qui utilisent l'approche VaR relative, le service BlackRock chargé de l'analyse des risques et de l'analyse quantitative (« RQA » pour *Risk & Quantitative Analysis*) détermine un portefeuille de référence comme base pour le calcul de la VaR relative. Le portefeuille de référence est habituellement l'indice de référence établi lui aussi comme point de référence pour les données de performance du Compartiment concerné. Il s'agit d'un indice (ou d'indices composites) construit(s), par un ou plusieurs fournisseurs d'indice reconnus, à partir de titres dans lesquels les Compartiments peuvent investir. Ce processus prend dûment en compte de la disponibilité d'indices dont les règles de construction sont elles-mêmes conformes aux règles de diversification.

Lorsqu'un Compartiment est contrôlé à l'aide de la VaR, le Gestionnaire d'investissements observera la limite réglementaire et toute limite de risque interne éventuellement appropriée pour le portefeuille.

Le tableau ci-dessous présente l'utilisation la plus élevée, l'utilisation la plus faible et l'utilisation moyenne de la limite de VaR, exprimées en pourcentage de la limite réglementaire de la VaR absolue ou relative. En ce qui concerne la VaR relative, la VaR du portefeuille du Compartiment concerné n'excèdera pas le double de la VaR du portefeuille de référence. L'utilisation correspond au niveau de risque pris dans ce contexte.

Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)

suite

Compartiment	Approche de risque de marché	Référentiel risques	Utilisation la plus élevée de la limite de VaR (%)	Utilisation la plus faible de la limite de VaR (%)	Utilisation moyenne de la limite de VaR (%)
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	VaR absolue	N/A	24,33 %	16,10 %	19,97 %
BlackRock Asia Extension Fund	VaR relative	MSCI All Country Asia ex Japan Index	58,12 %	46,15 %	51,99 %
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	VaR absolue	N/A	27,50 %	13,64 %	19,03 %
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	VaR absolue	N/A	29,07 %	14,49 %	20,58 %
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	VaR absolue	N/A	26,16 %	8,05 %	13,14 %
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	VaR absolue	N/A	35,78 %	18,34 %	26,96 %
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	VaR relative	60 % MSCI Emerging Markets Index/ 40 % JPMorgan Emerging Markets Bond Index Plus	60,67 %	50,60 %	55,17 %
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	VaR relative	MSCI Emerging Markets Index	57,26 %	46,15 %	48,19 %
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	VaR absolue	N/A	36,67 %	9,84 %	19,08 %
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund ⁽¹⁾	VaR absolue	N/A	13,04 %	4,70 %	9,39 %
BlackRock European Absolute Return Fund	VaR absolue	N/A	11,63 %	8,05 %	10,06 %
BlackRock European Credit Strategies Fund	VaR absolue	N/A	19,01 %	9,17 %	13,20 %
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	VaR absolue	N/A	24,37 %	15,21 %	18,71 %
BlackRock European Opportunities Extension Fund	VaR relative	S&P Europe BMI Index	77,49 %	51,03 %	58,25 %
BlackRock European Select Strategies Fund	VaR relative	75 % Barclays Pan European Aggregate Index (Hedged EUR)/ 25 % MSCI Europe Index (Hedged EUR)	56,57 %	46,15 %	49,21 %
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	VaR absolue	N/A	7,38 %	1,79 %	3,12 %
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	VaR absolue	N/A	5,37 %	2,24 %	3,77 %
BlackRock Global Event Driven Fund	VaR absolue	N/A	19,19 %	7,98 %	12,81 %
BlackRock Global Long/Short Equity Fund	VaR absolue	N/A	19,23 %	13,17 %	15,47 %
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	VaR absolue	N/A	9,45 %	3,98 %	6,68 %
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	VaR absolue	N/A	35,11 %	16,85 %	23,35 %
BlackRock Style Advantage Fund	VaR absolue	N/A	28,17 %	16,55 %	21,53 %
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund	VaR absolue	N/A	11,91 %	6,48 %	9,01 %
BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾	VaR absolue	N/A	33,78 %	16,64 %	25,14 %
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	VaR absolue	N/A	18,56 %	7,60 %	10,78 %
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund ⁽¹⁾	VaR absolue	N/A	0,00 %	0,00 %	0,00 %

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

Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)

suite

Effet de levier

Le recours à des instruments dérivés peut exposer les Compartiments à un risque plus grand. En particulier, les contrats sur instruments dérivés peuvent être très volatils et le montant de la marge initiale est généralement faible par rapport à l'importance du contrat, de manière à donner une marge de manœuvre aux transactions en termes d'exposition au marché. Une légère évolution du marché peut avoir plus d'impact sur les instruments dérivés que sur les obligations ou les actions standard. Les positions spéculatives en instruments dérivés peuvent donc accroître la volatilité des Compartiments.

Aux fins de la présente publication, l'effet de levier est l'exposition aux investissements obtenue à travers l'utilisation d'instruments financiers dérivés. Il est calculé en utilisant la somme des valeurs notionnelles de tous les instruments financiers dérivés détenus par le Compartiment concerné, sans compensation, et est exprimé en pourcentage de la VNI.

Le tableau ci-dessous indique le niveau d'effet de levier utilisé au cours de l'exercice.

Compartiment	Effet de levier moyen utilisé au cours de l'exercice
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	642,70 %
BlackRock Asia Extension Fund	181,27 %
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	81,88 %
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	499,49 %
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	171,87 %
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	109,96 %
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	181,38 %
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	64,67 %
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	546,23 %
BlackRock Emerging Markets Short Duration Bond Fund ⁽¹⁾	89,62 %
BlackRock European Absolute Return Fund	74,50 %
BlackRock European Credit Strategies Fund	236,89 %
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	632,62 %
BlackRock European Opportunities Extension Fund	102,45 %
BlackRock European Select Strategies Fund	189,35 %
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	487,16 %
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	850,90 %
BlackRock Global Event Driven Fund	112,27 %
BlackRock Global Long/Short Equity Fund	326,13 %
BlackRock Macro Opportunities Fund ⁽¹⁾	774,28 %
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	667,04 %
BlackRock Style Advantage Fund	1171,93 %
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund	151,38 %
BlackRock Total Advantage Fund ⁽¹⁾	596,27 %
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	128,64 %
BlackRock USD High Yield Fixed Maturity Bond Fund ⁽¹⁾	0,00 %

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

Informations supplémentaires (non révisées)

Techniques de gestion efficace de portefeuille

La Société est autorisée, pour le compte de chaque Compartiment et sous réserve des conditions et des limites établies par la CSSF et le Prospectus, à utiliser des techniques et instruments liés aux titres négociables, y compris des investissements dans des instruments financiers dérivés (les « IFD ») de gré à gré, à condition que ces techniques et instruments soient utilisés en vue d'une gestion efficace de portefeuille, pour offrir une protection contre le risque de change ou à des fins d'investissement direct, s'il y a lieu.

Prêt de titres et swaps sur rendement total (TRS pour *Total Return Swaps*) (y compris les CFD)

Toutes les opérations de prêt de titres conclues par les Compartiments sont soumises à un accord juridique écrit entre les Compartiments et l'Agent de prêts de titres, BlackRock Advisors (UK) Limited, une partie liée à la Société, et séparément entre l'Agent de prêts de titres et la contrepartie emprunteuse approuvée. La garantie reçue en échange des titres prêtés est transférée en vertu d'un accord de transfert et est versée et détenue dans un compte auprès d'un gestionnaire de garantie tripartite au nom du Dépositaire pour le compte des Compartiments. La garantie reçue est séparée des actifs appartenant au Dépositaire des Compartiments ou à l'Agent de prêt de titres.

Tous les TRS (y compris les CFD) sont conclus par les Compartiments en vertu d'un contrat-cadre International Swaps and Derivatives Associations, Inc. (« Contrat-cadre ISDA ») ou d'un contrat similaire. Un Contrat-cadre ISDA est un contrat bilatéral entre les Compartiments et une contrepartie, qui régit les IFD de gré à gré (y compris les TRS et les CFD) conclus par les parties. Les expositions des parties en vertu du Contrat-cadre ISDA sont compensées et garanties ensemble, si bien que toutes informations fournies sur la garantie dans ce rapport concernent tous les IFD de gré à gré conclus par les Compartiments en vertu du Contrat-cadre ISDA, et non uniquement les TRS et les CFD. Toute garantie autre qu'en numéraire reçue/fournie par les Compartiments en vertu du Contrat-cadre ISDA est transférée de façon bilatérale en vertu d'un accord de transfert de propriété.

Le tableau suivant indique la valeur des titres en prêt exprimée en tant que proportion du total des actifs prêtables et de la VNI des Compartiments, et la valeur des TRS (y compris les CFD) en tant que proportion de la VNI des Compartiments, au 31 mai 2018, et des revenus/rendements perçus pour l'exercice clos le 31 mai 2018. Le total des actifs prêtables représente la valeur globale des actifs faisant partie du programme de prêt de titres des Compartiments. La valeur des TRS (y compris les CFD) est calculée en fonction de la valeur d'exposition sous-jacente sur une base absolue brute.

Compartiment	Monnaie	Titres en prêt		TRS (y compris les CFDs)		
		% des actifs prêtables	% de la NIV	% de la NIV 31 mai 2018	% de la NIV 31 mai 2017*	Rendements nets générés
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	N/A	N/A	671,35 %	594,53 %	57.363.491
BlackRock Asia Extension Fund	USD	N/A	N/A	170,54 %	153,92 %	35.428.396
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund	USD	4,38 %	1,96 %	54,50 %	71,88 %	(3.825.303)
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund	USD	N/A	N/A	524,80 %	540,37 %	265.070
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund	EUR	0,40 %	0,11 %	24,29 %	21,93 %	23.944.325
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund	USD	8,08 %	4,00 %	93,55 %	91,76 %	(8.068.853)
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund	USD	N/A	N/A	56,45 %	57,18 %	4.451.889
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund	USD	6,61 %	3,81 %	54,87 %	46,34 %	5.755.261
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund	USD	4,13 %	3,27 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock European Absolute Return Fund	EUR	8,24 %	1,83 %	69,02 %	61,30 %	19.313.426
BlackRock European Credit Strategies Fund	EUR	N/A	N/A	41,46 %	44,08 %	(6.280.565)
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	EUR	N/A	N/A	665,61 %	587,98 %	(1.090.637)
BlackRock European Opportunities Extension Fund	EUR	2,15 %	1,65 %	63,96 %	67,13 %	(274.372)
BlackRock European Select Strategies Fund	EUR	4,66 %	3,56 %	0,43 %	0,42 %	137.977
BlackRock Fixed Income Strategies Fund	EUR	4,02 %	2,83 %	0,19 %	0,48 %	(800.260)
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund	EUR	5,43 %	1,95 %	6,89 %	8,47 %	(1.236.980)
BlackRock Global Event Driven Fund	USD	3,36 %	0,53 %	104,00 %	108,18 %	4.603.098
BlackRock Global Long/Short Equity Fund	USD	N/A	N/A	246,10 %	250,81 %	12.086.290
BlackRock Impact World Equity Fund	USD	0,91 %	0,82 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative	EUR	2,67 %	2,24 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive	EUR	4,31 %	3,65 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth	EUR	0,33 %	0,27 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate	EUR	0,67 %	0,58 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund	USD	N/A	N/A	93,97 %	59,57 %	(3.050.035)
BlackRock Style Advantage Fund	USD	N/A	N/A	405,69 %	403,84 %	(54.252.603)

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Compartiment	Monnaie	Titres en prêt		TRS (y compris les CFDs)		
		% des actifs prêtables	% de la NIV	% de la NIV 31 mai 2018	% de la NIV 31 mai 2017*	Rendements nets générés
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund	EUR	0,44 %	0,40 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock Systematic European Equity Fund	EUR	2,15 %	1,99 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock Systematic Global Equity Fund	USD	4,78 %	4,21 %	N/A	N/A	N/A
BlackRock Total Advantage Fund	EUR	N/A	N/A	230,04 %	N/A	(371.213)
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund	GBP	N/A	N/A	41,90 %	95,79 %	2.306.750

* Les données comparatives ont été retraitées afin de refléter la valeur des TRS (y compris les CFD) fondée sur la valeur d'exposition sous-jacente sur une base absolue brute.

Le revenu total généré par les opérations de prêt de titres est divisé entre le Compartiment concerné et l'Agent de prêt de titres. Le Compartiment reçoit au moins 62,5 %, tandis que l'Agent de prêt de titres reçoit jusqu'à 37,5 % de ce revenu, tous les coûts opérationnels étant prélevés sur la part de l'Agent de prêt de titres. Le revenu perçu durant l'exercice par les Compartiments et issu des opérations de prêt de titres est indiqué dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net des Compartiments, sous le poste « Prêts de titres ». Tous les rendements et les coûts des TRS (y compris les CFD) sont comptabilisés au profit des Compartiments et ne sont soumis à aucun accord de partage des rendements et des coûts avec la Société de Gestion du Compartiment ou toute autre tierce partie.

Le tableau suivant indique la valeur des titres en prêt (identifiés individuellement dans le portefeuille de titres des Compartiments concernés) et la garantie associée ainsi que la valeur d'exposition sous-jacente sur une base absolue brute pour les TRS (y compris les CFD), analysées par contrepartie, au 31 mai 2018.

		Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)	
	Pays d'établissement de la contrepartie			Exposition sous-jacente 31 mai 2018	Exposition sous-jacente 31 mai 2017*
Contrepartie		Montant en prêt	Garantie reçue		
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	3.344.462.028	1.921.044.533
Goldman Sachs International	Etats-Unis	N/A	N/A	498.378.908	296.464.407
Morgan Stanley Group Inc	Etats-Unis	N/A	N/A	2.667.226.433	1.833.865.017
Total		N/A	N/A	6.510.067.369	4.051.373.957
BlackRock Asia Extension Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	154.469.526	110.116.023
Credit Suisse AG	Suisse	N/A	N/A	N/A	202.757
Morgan Stanley Group Inc	Etats-Unis	N/A	N/A	130.266.319	101.529.428
Total		N/A	N/A	284.735.845	211.848.208
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	4.967.752	N/A
JP Morgan Chase Bank NA	Etats-Unis	N/A	N/A	4.860.087	N/A
Macquarie Bank Ltd	Australie	203.656	329.724	N/A	6.975.595
Morgan Stanley Group Inc	Etats-Unis	N/A	N/A	4.796.821	N/A
Societe Generale SA	France	216.149	236.717	N/A	7.310.190
UBS AG	Suisse	107.530	118.753	N/A	7.342.531
Total		527.335	685.194	14.624.660	21.628.316
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)					
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	38.157.503	22.847.126
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	32.160.442	27.566.443
JP Morgan Chase Bank NA	Etats-Unis	N/A	N/A	58.629.325	58.085.513
Total		N/A	N/A	128.947.270	108.499.082

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)	
		Montant en prêt	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2018	Exposition sous-jacente 31 mai 2017*
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	28.389.812	41.887.376
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	7.738.567	8.322.209
BNP Paribas SA	France	N/A	N/A	31.613.884	37.770.835
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	55.437.824	93.422.401
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	8.238.403	N/A
Goldman Sachs International	Etats-Unis	N/A	N/A	9.182.979	N/A
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	811.253	897.340	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	2.399.012	N/A
Morgan Stanley Group Inc	Etats-Unis	N/A	N/A	39.045.655	6.449.089
Societe Generale SA	France	N/A	N/A	2.619.757	N/A
Total		811.253	897.340	184.665.893	187.851.910
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	408.350	2.556.106
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	109.032	119.858	N/A	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	142.956	2.095.223
Credit Suisse AG	Suisse	N/A	N/A	3.296.806	9.634.787
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	8.279.990	22.389.821
Goldman Sachs International	Etats-Unis	N/A	N/A	421.271	N/A
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	6.832.867	23.636.548
UBS AG	Suisse	719.222	794.284	N/A	N/A
Total		828.254	914.142	19.382.240	60.312.485
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	19.598.546	18.594.856
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	19.465.723	17.418.987
Total		N/A	N/A	39.064.269	36.013.843
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	205.555	169.486
Credit Suisse AG	Suisse	N/A	N/A	30.629.105	13.667.919
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	18.777.852	5.164.163
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	26.607.508	12.945.763
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	920.673	1.047.586	N/A	N/A
Macquarie Bank Ltd	Australie	244.387	395.669	N/A	N/A
The Bank of Nova Scotia	Canada	467.205	640.315	N/A	N/A
UBS AG	Suisse	3.667.568	4.050.337	N/A	71.470
Total		5.299.833	6.133.907	76.220.020	32.018.801
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)					
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	29.912.099	31.527.268	N/A	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	34.754.866	36.721.082	N/A	N/A
Goldman Sachs International	Etats-Unis	23.560.051	32.784.941	N/A	N/A
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	13.386.056	14.907.177	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	11.221.694	12.172.979	N/A	N/A
Total		112.834.766	128.113.447	N/A	N/A
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	218.174.797	168.166.564
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	14.547.780	15.992.301	N/A	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	232.449.581	152.074.603
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	63.470.753	133.257.609
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	225.858.815	219.765.797
UBS AG	Suisse	5.068.350	5.597.308	N/A	N/A
Total		19.616.130	21.589.609	739.953.946	673.264.573

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)	
		Montant en prêt	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2018	Exposition sous-jacente 31 mai 2017*
BlackRock European Credit Strategies Fund (en EUR)					
Bank of America	Etats-Unis	N/A	N/A	1.995.986	N/A
Credit Suisse AG	Suisse	N/A	N/A	17.867.397	86.401.801
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	14.548.303	85.750.585
Total		N/A	N/A	34.411.686	172.152.386
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund (en EUR)					
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	209.241.659	418.602.263
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	126.109.553	519.778.385
Goldman Sachs International	Etats-Unis	N/A	N/A	1.007.446.785	1.966.364.557
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	215.403.003	393.742.804
JP Morgan Chase Bank NA	Etats-Unis	N/A	N/A	214.657.153	776.046.338
Morgan Stanley Group Inc	Etats-Unis	N/A	N/A	42.032.642	151.990.616
Total		N/A	N/A	1.814.890.795	4.226.524.963
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	168.370.076	136.642.802
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	137.881.672	130.552.251
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	161.698.999	238.119.026
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	488.334	540.154	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.056.024	1.201.595	251.169.085	275.228.572
UBS AG	Suisse	17.033.627	18.811.342	N/A	N/A
Total		18.577.985	20.553.091	719.119.832	780.542.651
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	2.486.103	1.444.479
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	3.207.076	3.548.045	N/A	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	6.519.228	7.021.875	N/A	N/A
Goldman Sachs International	Etats-Unis	564.997	598.958	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	9.299.985	10.424.475	N/A	N/A
Societe Generale SA	France	784.869	853.706	N/A	N/A
Total		20.376.155	22.447.059	2.486.103	1.444.479
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	1.397.190	N/A
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	28.201.278	29.909.087	N/A	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	87.254.121	91.600.032	N/A	N/A
Credit Suisse AG	Suisse	N/A	N/A	4.619.833	12.499.382
Goldman Sachs International	Etats-Unis	10.854.751	11.507.226	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	43.414.624	47.157.447	12.542.500	21.051.477
Societe Generale SA	France	110.068.514	120.613.269	N/A	N/A
UBS AG	Suisse	1.717.032	2.135.111	N/A	N/A
Total		281.510.320	302.922.172	18.559.523	33.550.859
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)					
BNP Paribas SA	France	N/A	N/A	N/A	7.036.953
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	4.773.236	5.280.768	N/A	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	303.619	320.795	N/A	N/A
Goldman Sachs International	Etats-Unis	161.149	170.836	N/A	36.048.993
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	807.227	898.956	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	2.734.816	2.957.258	N/A	N/A
Societe Generale SA	France	N/A	N/A	31.068.028	10.509.942
Total		8.780.047	9.628.613	31.068.028	53.595.888

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)	
		Montant en prêt	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2018	Exposition sous-jacente 31 mai 2017*
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)					
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	2.197.095	2.315.731	N/A	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	246.300.594	111.060.575
Credit Suisse AG	Suisse	4.458.052	4.745.598	7.146.374	63.807.778
Goldman Sachs International	Etats-Unis	N/A	N/A	580.953.550	91.325.226
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	233.455.130	N/A
Morgan Stanley Group Inc	Etats-Unis	N/A	N/A	263.811.782	122.854.774
Societe Generale SA	France	1.973	2.161	N/A	N/A
UBS AG	Suisse	689.484	761.442	107.526.197	N/A
Total		7.346.604	7.824.932	1.439.193.627	389.048.353
BlackRock Global Long/Short Equity Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	70.115.707	100.723.484
Goldman Sachs International	Etats-Unis	N/A	N/A	135.906.556	155.447.117
Morgan Stanley Group Inc	Etats-Unis	N/A	N/A	103.255.085	115.910.110
Total		N/A	N/A	309.277.348	372.080.711
BlackRock Impact World Equity Fund (en USD)					
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	375.817	415.697	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	455.811	518.643	N/A	N/A
The Bank of Nova Scotia	Canada	488.117	668.975	N/A	N/A
UBS AG	Suisse	252.711	279.085	N/A	N/A
Total		1.572.456	1.882.400	N/A	N/A
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)					
Goldman Sachs International	Etats-Unis	2.311.286	2.506.885	N/A	N/A
Total		2.311.286	2.506.885	N/A	N/A
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)					
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	1.581.976	1.739.058	N/A	N/A
Goldman Sachs International	Etats-Unis	2.649.964	2.874.224	N/A	N/A
UBS AG	Suisse	53.701	59.306	N/A	N/A
Total		4.285.641	4.672.588	N/A	N/A
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)					
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	419.890	461.583	N/A	N/A
Total		419.890	461.583	N/A	N/A
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)					
Goldman Sachs International	Etats-Unis	2.441.688	2.648.322	N/A	N/A
Total		2.441.688	2.648.322	N/A	N/A
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	123.044.656	94.917.822
Credit Suisse AG	Suisse	N/A	N/A	30.674.129	10.067.286
JP Morgan Chase Bank NA	Etats-Unis	N/A	N/A	63.191.996	121.284.032
Morgan Stanley Group Inc	Etats-Unis	N/A	N/A	31.435.308	41.676.403
Total		N/A	N/A	248.346.089	267.945.543
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (en EUR)					
JP Morgan Chase Bank NA	Etats-Unis	8.073	8.815	N/A	N/A
Macquarie Bank Ltd	Australie	117.125	250.996	N/A	N/A
Total		125.198	259.811	N/A	N/A
BlackRock Style Advantage Fund (en USD)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	3.204.818.468	802.449.139
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	2.905.415.963	737.625.563
Credit Suisse AG	Suisse	N/A	N/A	2.352.788.962	105.696.086
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	2.255.376.325	N/A
JP Morgan Chase Bank NA	Etats-Unis	N/A	N/A	2.784.429.278	722.453.692
Total		N/A	N/A	13.502.828.996	2.368.224.480

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Prêts de titres		TRS (y compris les CFDs)	
		Montant en prêt	Garantie reçue	Exposition sous-jacente 31 mai 2018	Exposition sous-jacente 31 mai 2017*
BlackRock Systematic European Equity Fund (en EUR)					
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	79.864	88.339	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	24.166	27.497	N/A	N/A
Societe Generale SA	France	221.424	242.494	N/A	N/A
Total		325.454	358.330	N/A	N/A
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)					
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	3.123.017	3.433.117	N/A	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	6.497.294	7.007.081	N/A	N/A
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	7.850.234	8.683.267	N/A	N/A
JP Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.245.567	1.417.266	N/A	N/A
Macquarie Bank Ltd	Australie	3.535	5.724	N/A	N/A
Societe Generale SA	France	2.327.759	2.549.262	N/A	N/A
UBS AG	Suisse	3.635.508	4.014.928	N/A	N/A
Total		24.682.914	27.110.645	N/A	N/A
BlackRock Total Advantage Fund (en EUR)					
Bank of America NA	Etats-Unis	N/A	N/A	18.748.336	N/A
Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	N/A	N/A	14.495.575	N/A
Credit Suisse AG	Suisse	N/A	N/A	14.354.819	N/A
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	15.101.042	N/A
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	N/A	N/A	1.050.547	N/A
JP Morgan Chase Bank NA	Etats-Unis	N/A	N/A	14.052.800	N/A
Total		N/A	N/A	77.803.119	N/A
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (en GBP)					
Deutsche Bank AG	Allemagne	N/A	N/A	5.883.787	4.345.030
JP Morgan Chase Bank NA	Etats-Unis	N/A	N/A	147.099.441	136.040.041
Total		N/A	N/A	152.983.228	140.385.071

* Les données comparatives ont été retraitées afin de refléter la valeur des TRS (y compris les CFD) fondée sur la valeur d'exposition sous-jacente sur une base absolue brute.

Le tableau suivant fournit une analyse de l'échéance des TRS (y compris les CFD), au 31 mai 2018 :

	Échéance						Total
	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours	Opérations ouvertes	
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	14.989.845	–	6.495.077.524	6.510.067.369
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	12.815.229	–	4.038.558.728	4.051.373.957
BlackRock Asia Extension Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	284.735.845	284.735.845
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	211.848.208	211.848.208
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	14.624.660	14.624.660
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	21.628.316	21.628.316
BlackRock Asia Pacific Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	128.947.270	128.947.270
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	108.499.082	108.499.082

Informations supplémentaires (non révisées) suite

	Échéance						Total
	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours	Opérations ouvertes	
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	16.955.127	–	–	155.519.215	12.191.551	–	184.665.893
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	20.883.257	–	–	145.964.534	21.004.119	–	187.851.910
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	19.382.240	19.382.240
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	60.312.485	60.312.485
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	39.064.269	39.064.269
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	36.013.843	36.013.843
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	76.220.020	76.220.020
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	71.470	–	31.947.331	32.018.801
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	739.953.946	739.953.946
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	673.264.573	673.264.573
BlackRock European Credit Strategies Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	8.099.959	1.215.145	4.570.474	17.065.213	3.460.895	34.411.686
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	2.692.058	–	95.495.533	47.172.165	26.792.630	172.152.386
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	1.814.890.795	1.814.890.795
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	4.226.524.963	4.226.524.963
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	719.119.832	719.119.832
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	780.542.651	780.542.651
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	2.486.103	2.486.103
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	1.444.479	1.444.479
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	7.306.865	260.388	3.082.482	7.909.788	–	18.559.523
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	1.099.413	19.952.064	12.499.382	–	33.550.859
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	5.502.796	–	25.565.232	–	–	31.068.028
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	53.595.888	–	–	53.595.888
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	1.439.193.627	1.439.193.627
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	389.048.353	389.048.353

Informations supplémentaires (non révisées) suite

	Échéance						Total
	2 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours	Opérations ouvertes	
BlackRock Global Long/Short Equity Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	309.277.348	309.277.348
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	372.080.711	372.080.711
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	3.803	–	248.342.286	248.346.089
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	4.289.142	263.656.401	267.945.543
BlackRock Style Advantage Fund (en USD)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	294.730.668	–	–	–	13.208.098.328	13.502.828.996
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	83.051.238	–	–	–	2.285.173.242	2.368.224.480
BlackRock Total Advantage Fund (en EUR)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	5.445.152	–	–	–	72.357.967	77.803.119
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (en GBP)							
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2018	–	–	–	–	–	152.983.228	152.983.228
TRS (y compris les CFDs) 31 mai 2017*	–	–	–	–	–	140.385.071	140.385.071

* Les données comparatives ont été retraitées afin de refléter la valeur des TRS (y compris les CFD) fondée sur la valeur d'exposition sous-jacente sur une base absolue brute.

L'analyse de l'échéance ci-dessus est fondée sur la date d'échéance contractuelle de l'opération concernée. Les opérations ouvertes sont des opérations qui peuvent être rappelées ou résiliées sur une base quotidienne, et comprennent les titres en prêt et les CFD.

Garantie

Les Compartiments engagent des activités qui peuvent exiger de fournir une garantie à la contrepartie (« garantie fournie ») ou de détenir une garantie reçue (« garantie reçue ») d'une contrepartie.

Le tableau suivant présente une analyse par devise des garanties en numéraire et des garanties sous-jacentes autres qu'en numéraire reçues/fournies par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété, en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD de gré à gré (y compris les TRS et les CFD), au 31 mai 2018.

Monnaie	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
BlackRock Americas Diversified Equity Absolute Return Fund (en USD)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	28.297.000	–	–	–
Total	28.297.000	–	–	–

Monnaie	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
BlackRock Asia Extension Fund (en USD)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	11.689.534	260.000	–	–
Total	11.689.534	260.000	–	–
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	6.421	–
CAD	–	–	2.592	–
CHF	–	–	24.671	–
DKK	–	–	6.011	–
EUR	–	–	127.653	–
GBP	–	–	62.589	–
JPY	–	–	55.995	–
USD	–	–	399.262	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	273.000	183.000	–	–
Total	273.000	183.000	685.194	–
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CHF	–	–	78.189	–
EUR	–	–	89.167	–
GBP	–	–	154.297	–
JPY	–	–	82.240	–
USD	–	–	493.447	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	5.720.000	14.310.000	–	–
Total	5.720.000	14.310.000	897.340	–

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Monnaie	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	2.971	–
CAD	–	–	17.337	–
CHF	–	–	45.437	–
EUR	–	–	104.767	–
GBP	–	–	150.761	–
JPY	–	–	254.024	–
USD	–	–	338.845	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	1.233.000	–	–	–
Total	1.233.000	–	914.142	–
BlackRock Emerging Markets Allocation Fund (en USD)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	–	2.164.000	–	–
Total	–	2.164.000	–	–
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	22.324	–
CAD	–	–	300.596	–
CHF	–	–	253.152	–
DKK	–	–	7.214	–
EUR	–	–	678.413	–
GBP	–	–	793.171	–
JPY	–	–	1.932.964	–
USD	–	–	2.146.073	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	2.969.980	300.000	–	–
Total	2.969.980	300.000	6.133.907	–
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	–	–	3.743.762	–
CHF	–	–	41.747	–
DKK	–	–	770	–
EUR	–	–	83.548.507	–
GBP	–	–	7.176.030	–
JPY	–	–	584.935	–
NOK	–	–	964.606	–
SEK	–	–	1.869.087	–
USD	–	–	30.184.003	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	32.370.000	66.167.000	–	–
Total	32.370.000	66.167.000	128.113.447	–
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	20.939	–
CAD	–	–	122.172	–
CHF	–	–	320.191	–
EUR	–	–	9.046.805	–
GBP	–	–	3.779.887	–
JPY	–	–	1.790.096	–
USD	–	–	6.509.519	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	3.750.853	5.640.000	–	–
Total	3.750.853	5.640.000	21.589.609	–

Monnaie	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
BlackRock European Credit Strategies Fund (en EUR)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	560.000	2.800.000	–	–
Total	560.000	2.800.000	–	–
BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund (en EUR)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	4.210.000	1.120.000	–	417.503
Total	4.210.000	1.120.000	–	417.503
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	70.373	–
CAD	–	–	410.594	–
CHF	–	–	1.123.160	–
EUR	–	–	1.352.730	–
GBP	–	–	3.154.155	–
JPY	–	–	6.796.952	–
USD	–	–	7.645.127	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	16.549.313	3.230.000	–	–
Total	16.549.313	3.230.000	20.553.091	–
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	–	–	68.396	–
DKK	–	–	20.614	–
EUR	–	–	9.160.488	–
GBP	–	–	3.637.418	–
JPY	–	–	6.804.742	–
NOK	–	–	71.094	–
SEK	–	–	69.899	–
USD	–	–	2.614.408	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	–	757.000	–	–
Total	–	757.000	22.447.059	–
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	–	–	11.942.531	–
CHF	–	–	8.985.399	–
DKK	–	–	4.414.379	–
EUR	–	–	166.773.873	–
GBP	–	–	19.867.623	–
JPY	–	–	44.937.391	–
NOK	–	–	2.529.568	–
SEK	–	–	5.828.400	–
USD	–	–	37.643.008	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	3.760.000	40.931.000	–	13.200.220
Total	3.760.000	40.931.000	302.922.172	13.200.220

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Monnaie	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	–	–	19.508	–
CHF	–	–	3.442	–
DKK	–	–	39.008	–
EUR	–	–	2.827.890	–
GBP	–	–	779.887	–
JPY	–	–	3.275.955	–
MXN	–	–	212.127	–
NOK	–	–	269.823	–
SEK	–	–	107.423	–
USD	–	–	2.093.550	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	420.000	5.782.000	–	609.258
Total	420.000	5.782.000	9.628.613	609.258
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	59.349	–
CAD	–	–	16.620	–
CHF	–	–	43.558	–
EUR	–	–	2.565.557	–
GBP	–	–	723.397	–
JPY	–	–	501.416	–
USD	–	–	3.915.035	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	14.820.000	3.990.000	–	–
Total	14.820.000	3.990.000	7.824.932	–
BlackRock Global Long/Short Equity Fund (en USD)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	1.443.000	–	–	–
Total	1.443.000	–	–	–
BlackRock Impact World Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	1.044	–
CAD	–	–	227.779	–
CHF	–	–	52.186	–
EUR	–	–	338.743	–
GBP	–	–	256.934	–
JPY	–	–	481.113	–
USD	–	–	524.601	–
Total	–	–	1.882.400	–
BlackRock Macro Opportunities Fund (en USD)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	1.520.000	6.387.000	–	–
Total	1.520.000	6.387.000	–	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	–	–	231.382	–
GBP	–	–	439.780	–
JPY	–	–	231.274	–
USD	–	–	1.604.449	–
Total	–	–	2.506.885	–

Monnaie	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	222	–
CAD	–	–	1.294	–
CHF	–	–	3.393	–
EUR	–	–	1.222.077	–
GBP	–	–	825.858	–
JPY	–	–	284.131	–
USD	–	–	2.335.613	–
Total	–	–	4.672.588	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	–	–	253.179	–
GBP	–	–	82.807	–
USD	–	–	125.597	–
Total	–	–	461.583	–
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	–	–	244.437	–
GBP	–	–	464.592	–
JPY	–	–	244.322	–
USD	–	–	1.694.971	–
Total	–	–	2.648.322	–
BlackRock Multi-Manager Alternative Strategies Fund (en USD)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	650.060	6.217.555	–	–
Total	650.060	6.217.555	–	–
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	–	–	27.543	–
GBP	–	–	1.600	–
JPY	–	–	51.928	–
USD	–	–	178.740	–
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	–	28.000	–	–
Total	–	28.000	259.811	–
BlackRock Style Advantage Fund (en USD)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
USD	22.690.000	88.291.155	22.555.465	–
Total	22.690.000	88.291.155	22.555.465	–
BlackRock Systematic European Equity Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CHF	–	–	7.697	–
EUR	–	–	111.107	–
GBP	–	–	36.420	–
JPY	–	–	43.646	–
USD	–	–	159.460	–
Total	–	–	358.330	–

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Monnaie	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	–	–	15.124	–
CAD	–	–	87.634	–
CHF	–	–	986.591	–
DKK	–	–	104	–
EUR	–	–	8.165.110	–
GBP	–	–	5.461.940	–
JPY	–	–	3.136.225	–
USD	–	–	9.257.917	–
Total	–	–	27.110.645	–
BlackRock Total Advantage Fund (en EUR)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
EUR	–	123.248	–	–
Total	–	123.248	–	–
BlackRock UK Equity Absolute Return Fund (en GBP)				
Opérations sur instruments dérivés de gré à gré				
GBP	5.030.000	–	–	–
Total	5.030.000	–	–	–

Au 31 mai 2018, une partie des garanties en numéraire reçues par les Compartiments avaient été réinvestie dans des fonds du marché monétaire gérés par les affiliées de la Société de Gestion, comme indiqué dans le portefeuille de titres des Compartiments. Les Compartiments sont le propriétaire

légal d'une garantie entrante et peuvent vendre les actifs et conserver les liquidités en cas de défaut de paiement. Toutes les liquidités reçues ou fournies en garantie ont une échéance ouverte puisqu'elles ne sont pas soumises à une date d'échéance contractuelle.

Les garanties autres qu'en numéraire, reçues au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD de gré à gré, ne peuvent être vendues, réinvesties ni mises en gage.

Les rendements perçus par les Compartiments et issus du réinvestissement d'une garantie en numéraire dans des fonds du marché monétaire durant l'exercice clos le 31 mai 2018 sont résumés ci-dessous. Ces rendements représentent le rendement total cumulé du fonds du marché monétaire concerné sur l'exercice de douze mois se terminant le 31 mai 2018. Ces rendements ne tiennent pas compte de tout intérêt payable à la contrepartie en vertu des contrats de garantie correspondants.

Fonds du marché monétaire	Rendements totaux
Institutional Cash Series plc	
- Institutional Euro Liquidity Fund	(0,58) %
- Institutional GBP Liquidity Fund	0,22 %
- Institutional US Dollar Liquidity Fund	1,39 %

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Le tableau suivant présente une analyse du type, de la qualité et de l'échéance des garanties autres qu'en numéraire, reçues par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres, au 31 mai 2018.

	Échéance					
Type et qualité de la garantie	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours	Opérations ouvertes	Total
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	—	—	—	37	—	37
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	685.157	685.157
Total	—	—	—	37	685.157	685.194
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	—	—	—	154.297	—	154.297
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	743.043	743.043
Total	—	—	—	154.297	743.043	897.340
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	—	—	—	97.225	—	97.225
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	816.917	816.917
Total	—	—	—	97.225	816.917	914.142
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	—	—	—	153.615	—	153.615
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	5.980.292	5.980.292
Total	—	—	—	153.615	5.980.292	6.133.907
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	1.881.541	570.500	8.055.000	90.515.189	—	101.022.230
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	27.091.217	27.091.217
Total	1.881.541	570.500	8.055.000	90.515.189	27.091.217	128.113.447
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	—	—	—	12.972.411	—	12.972.411
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	8.617.198	8.617.198
Total	—	—	—	12.972.411	8.617.198	21.589.609
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	—	—	—	92.877	—	92.877
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	20.460.214	20.460.214
Total	—	—	—	92.877	20.460.214	20.553.091
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	138.674	42.047	114.601	6.305.521	—	6.600.843
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	15.846.216	15.846.216
Total	138.674	42.047	114.601	6.305.521	15.846.216	22.447.059

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Total
	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours	Opérations ouvertes	
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	4.934.124	1.496.067	13.424.740	147.930.249	–	167.785.180
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	135.136.992	135.136.992
Total	4.934.124	1.496.067	13.424.740	147.930.249	135.136.992	302.922.172
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	526.314	159.584	59.319	2.994.502	–	3.739.719
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	5.888.894	5.888.894
Total	526.314	159.584	59.319	2.994.502	5.888.894	9.628.613
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	–	–	–	3.280.949	–	3.280.949
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	4.543.983	4.543.983
Total	–	–	–	3.280.949	4.543.983	7.824.932
BlackRock Impact World Equity Fund (en USD)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	–	–	–	231.924	–	231.924
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	1.650.476	1.650.476
Total	–	–	–	231.924	1.650.476	1.882.400
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	–	–	–	838.465	–	838.465
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	1.668.420	1.668.420
Total	–	–	–	838.465	1.668.420	2.506.885
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	–	–	–	2.371.989	–	2.371.989
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	2.300.599	2.300.599
Total	–	–	–	2.371.989	2.300.599	4.672.588
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	–	–	–	374.420	–	374.420
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	87.163	87.163
Total	–	–	–	374.420	87.163	461.583
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	–	–	–	885.768	–	885.768
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	1.762.554	1.762.554
Total	–	–	–	885.768	1.762.554	2.648.322
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	–	–	–	1.600	–	1.600
Actions						
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	258.211	258.211
Total	–	–	–	1.600	258.211	259.811

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Total
	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours	Opérations ouvertes	
BlackRock Systematic European Equity Fund (en EUR)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	—	—	—	15.192	—	15.192
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	343.138	343.138
Total	—	—	—	15.192	343.138	358.330
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)						
Titres à revenu fixe						
De qualité	—	—	—	7.991.704	—	7.991.704
Actions						
Indice d'actions reconnu	—	—	—	—	19.118.941	19.118.941
Total	—	—	—	7.991.704	19.118.941	27.110.645

Le tableau suivant présente une analyse du type, de la qualité et de l'échéance des garanties autres qu'en numéraire, reçues/fournies par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des IFD de gré à gré, au 31 mai 2018.

Type et qualité de la garantie	Échéance				Total
	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours	Opérations ouvertes	
BlackRock European Credit Strategies Fund (en EUR)					
Titres à revenu fixe					
De qualité	—	—	417.503	—	417.503
Total	—	—	417.503	—	417.503
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)					
Titres à revenu fixe					
De qualité	—	—	13.200.220	—	13.200.220
Total	—	—	13.200.220	—	13.200.220
BlackRock Global Absolute Return Fund (en EUR)					
Titres à revenu fixe					
De qualité	—	—	609.258	—	609.258
Total	—	—	609.258	—	609.258
BlackRock Style Advantage Fund (en USD)					
Titres à revenu fixe					
De qualité	—	—	22.555.465	—	22.555.465
Total	—	—	22.555.465	—	22.555.465

Les titres de qualité sont ceux émis par une entité possédant une notation minimale de crédit de qualité attribuée par au moins une agence de notation mondialement reconnue : Standard & Poor's, Moody's ou Fitch.

Un indice d'actions reconnu contient au moins 20 actions parmi lesquelles aucune action individuelle ne représente plus de 20 % du total de l'indice et aucune combinaison de cinq actions ne représente plus de 60 % du total de l'indice.

L'analyse de l'échéance pour les titres à revenu fixe reçus ou fournis en garantie est fondée sur la date d'échéance contractuelle concernée, tandis que pour les actions, les ETF et les fonds du marché monétaire reçus ou fournis en garantie sont présentés en tant qu'opérations ouvertes puisqu'elles ne sont soumises à aucune date d'échéance contractuelle.

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Le tableau suivant présente une analyse des montants de garantie autre qu'en numéraire reçus par le Compartiment en relation avec des opérations de prêt de titres et détenus par le Dépositaire des Compartiments (ou via ses délégués) ou par l'entremise d'un système de règlement des titres, au 31 mai 2018.

	Garantie autre qu'en numéraire reçue
	Prêts de titres
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	685.194
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	897.340
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	914.142
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	6.133.907
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	49.962.141
Euroclear SA/NV	78.151.306
Total	128.113.447
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	21.589.609
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	20.553.091
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	21.289.425
Euroclear SA/NV	1.157.634
Total	22.447.059
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	159.199.202
Euroclear SA/NV	143.722.970
Total	302.922.172
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	6.326.965
Euroclear SA/NV	3.301.648
Total	9.628.613
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	5.509.201
Euroclear SA/NV	2.315.731
Total	7.824.932
BlackRock Impact World Equity Fund (en USD)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	1.882.400
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	2.506.885
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	4.672.588
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	461.583
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	2.648.322
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	259.811
BlackRock Systematic European Equity Fund (en EUR)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	358.330
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)	
State Street Bank Luxembourg S.C.A. (ou ses délégués)	27.110.645

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Le tableau suivant présente les dix plus grands émetteurs, en valeur, de garanties autres qu'en numéraire reçues par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD de gré à gré, au 31 mai 2018.

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Asia Pacific Absolute Return Fund (en USD)		
Waste Management Inc	23.974	0,09%
General Motors Co	23.971	0,09%
BP PLC	23.968	0,09%
Nestle SA	23.962	0,09%
Anthem Inc	23.954	0,09%
Equifax Inc	23.934	0,09%
Biogen Inc	23.929	0,09%
Roper Technologies Inc	23.914	0,09%
AbbVie Inc	23.910	0,09%
Intuitive Surgical Inc	23.871	0,09%
Autres émetteurs	445.807	1,65%
Total	685.194	2,55%
BlackRock Dynamic Diversified Growth Fund (en EUR)		
United Kingdom Gilt	154.297	0,02%
Morgan Stanley	82.244	0,01%
Berkshire Hathaway Inc	82.243	0,01%
Fifth Third Bancorp	82.243	0,01%
American Express Co	82.243	0,01%
E*TRADE Financial Corp	82.242	0,01%
Daiwa Securities Group Inc	82.240	0,01%
US Bancorp	82.232	0,01%
Intesa Sanpaolo SpA	82.228	0,01%
Zurich Insurance Group AG	78.189	0,01%
Autres émetteurs	6.939	0,01%
Total	897.340	0,12%
BlackRock Emerging Markets Absolute Return Fund (en USD)		
Time Warner Inc	79.264	0,38%
Exxon Mobil Corp	69.155	0,33%
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	62.701	0,30%
Schindler Holding AG	45.437	0,22%
Nippon Shinyaku Co Ltd	25.024	0,12%
Mizuho Financial Group Inc	23.529	0,11%
BCA Marketplace PLC	21.568	0,10%
United Kingdom Gilt	21.503	0,10%
Republic of Allemagne	21.502	0,10%
Etats-Unis Treasury	21.296	0,10%
Autres émetteurs	523.163	2,55%
Total	914.142	4,41%

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Emerging Markets Equity Strategies Fund (en USD)		
Time Warner Inc	404.194	0,29%
Exxon Mobil Corp	352.646	0,25%
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	319.736	0,23%
Schindler Holding AG	231.698	0,17%
Nippon Shinyaku Co Ltd	127.605	0,09%
Mizuho Financial Group Inc	119.980	0,09%
French Republic Government Bond OAT	116.725	0,08%
BCA Marketplace PLC	109.982	0,08%
E*TRADE Financial Corp	108.522	0,08%
Cornerstone OnDemand Inc	102.482	0,07%
Autres émetteurs	4.140.337	2,99%
Total	6.133.907	4,42%
BlackRock Emerging Markets Flexi Dynamic Bond Fund (en USD)		
Kingdom of Belgium Government Bond	19.006.314	0,55%
French Republic Government Bond OAT	14.848.744	0,43%
Republic of Allemagne	13.578.447	0,39%
Netherlands Government Bond	11.655.203	0,34%
Republic of Austria Government Bond	11.494.230	0,33%
Etats-Unis Treasury	8.805.624	0,26%
Finland Government Bond	7.862.684	0,23%
United Kingdom Gilt	7.096.459	0,21%
Canadian Government Bond	3.743.762	0,11%
PPL Corp	3.100.386	0,09%
Autres émetteurs	26.921.594	0,77%
Total	128.113.447	3,71%
BlackRock European Absolute Return Fund (en EUR)		
United Kingdom Gilt	2.869.004	0,27%
Republic of Allemagne	2.868.937	0,27%
Etats-Unis Treasury	2.841.502	0,27%
Republic of Austria Government Bond	2.569.386	0,24%
French Republic Government Bond OAT	1.823.583	0,17%
SAP SE	1.510.000	0,14%
Eni SpA	1.509.889	0,14%
Time Warner Inc	558.570	0,05%
Exxon Mobil Corp	487.334	0,05%
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	441.855	0,04%
Autres émetteurs	4.109.549	0,37%
Total	21.589.609	2,01%
BlackRock European Opportunities Extension Fund (en EUR)		
Time Warner Inc	1.877.232	0,17%
Exxon Mobil Corp	1.637.825	0,15%
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	1.484.980	0,13%
Schindler Holding AG	1.076.094	0,10%
Nippon Shinyaku Co Ltd	592.650	0,05%
Mizuho Financial Group Inc	557.235	0,05%
E*TRADE Financial Corp	553.523	0,05%
BCA Marketplace PLC	510.799	0,05%
Cornerstone OnDemand Inc	475.968	0,04%
HSBC Holdings PLC	454.637	0,04%
Autres émetteurs	11.332.148	1,00%
Total	20.553.091	1,83%

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock European Select Strategies Fund (en EUR)		
French Republic Government Bond OAT	1.633.951	0,29%
Republic of Allemagne	1.520.636	0,27%
Netherlands Government Bond	1.282.469	0,22%
United Kingdom Gilt	861.972	0,15%
Eni SpA	856.154	0,15%
UniCredit SpA	687.661	0,12%
Pola Orbis Holdings Inc	653.141	0,11%
Heiwado Co Ltd	630.310	0,11%
Okumura Corp	621.983	0,11%
WPP PLC	614.588	0,11%
Autres émetteurs	13.084.194	2,28%
Total	22.447.059	3,92%
BlackRock Fixed Income Strategies Fund (en EUR)		
French Republic Government Bond OAT	24.753.779	0,25%
Republic of Austria Government Bond	21.031.703	0,21%
Republic of Allemagne	20.521.535	0,21%
Kingdom of Belgium Government Bond	20.493.856	0,21%
Netherlands Government Bond	19.359.284	0,19%
Etats-Unis Treasury	13.539.059	0,14%
Canadian Government Bond	11.849.583	0,12%
Finland Government Bond	10.132.005	0,10%
Lululemon Athletica Inc	9.948.475	0,10%
Repsol SA	9.687.109	0,10%
Autres émetteurs	141.605.784	1,41%
Total	302.922.172	3,04%
BlackRock Global Absolute Return Bond Fund (en EUR)		
French Republic Government Bond OAT	627.313	0,14%
Republic of Allemagne	616.210	0,14%
Etats-Unis Treasury	566.413	0,13%
Finland Government Bond	563.878	0,12%
Stanley Electric Co Ltd	462.577	0,10%
Royal Dutch Shell PLC	462.561	0,10%
Brewin Dolphin Holdings PLC	399.386	0,09%
Qol Co Ltd	377.476	0,08%
United Kingdom Gilt	367.960	0,08%
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	319.724	0,07%
Autres émetteurs	4.865.115	1,08%
Total	9.628.613	2,13%
BlackRock Global Event Driven Fund (en USD)		
French Republic Government Bond OAT	651.567	0,05%
United Kingdom Gilt	595.762	0,04%
Express Scripts Holding Co	473.178	0,03%
Pioneer Natural Resources Co	472.563	0,03%
Hilton Worldwide Holdings Inc	466.528	0,03%
Costco Wholesale Corp	459.829	0,03%
Kingdom of Belgium Government Bond	439.988	0,03%
Republic of Allemagne	439.988	0,03%
Finland Government Bond	439.976	0,03%
Time Warner Inc	377.537	0,03%
Autres émetteurs	3.008.016	0,24%
Total	7.824.932	0,57%

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Impact World Equity Fund (en USD)		
French Republic Government Bond OAT	121.950	0,06%
United Kingdom Gilt	73.002	0,04%
West Fraser Timber Co Ltd	64.724	0,03%
Loblaw Cos Ltd	52.959	0,03%
Cranswick PLC	52.318	0,03%
XI Group Ltd	51.199	0,03%
Penn National Gaming Inc	50.971	0,03%
Canadian Natural Resources Ltd	50.404	0,03%
Pola Orbis Holdings Inc	49.181	0,03%
Eni SpA	48.378	0,03%
Autres émetteurs	1.267.314	0,64%
Total	1.882.400	0,98%
BlackRock Managed Index Portfolios – Conservative (en EUR)		
United Kingdom Gilt	439.780	0,43%
Etats-Unis Treasury	398.683	0,39%
Stryker Corp	231.523	0,22%
Fidelity National Information Services Inc	231.513	0,22%
QUALCOMM Inc	231.509	0,22%
Microsoft Corp	231.443	0,22%
Bayer AG	231.382	0,22%
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	231.274	0,22%
Booking Holdings Inc	99.647	0,10%
Xcel Energy Inc	79.169	0,08%
Autres émetteurs	100.962	0,11%
Total	2.506.885	2,43%
BlackRock Managed Index Portfolios – Defensive (en EUR)		
United Kingdom Gilt	816.207	0,70%
Etats-Unis Treasury	766.097	0,65%
Republic of Allemagne	311.978	0,27%
Republic of Austria Government Bond	279.404	0,24%
Bayer AG	265.926	0,23%
Stryker Corp	265.449	0,23%
Fidelity National Information Services Inc	265.438	0,23%
QUALCOMM Inc	265.432	0,23%
Microsoft Corp	265.357	0,23%
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	265.163	0,23%
Autres émetteurs	906.137	0,74%
Total	4.672.588	3,98%
BlackRock Managed Index Portfolios – Growth (en EUR)		
United Kingdom Gilt	82.807	0,05%
Republic of Allemagne	82.806	0,05%
Etats-Unis Treasury	82.014	0,05%
Republic of Austria Government Bond	74.160	0,05%
French Republic Government Bond OAT	52.634	0,04%
SAP SE	43.583	0,03%
Eni SpA	43.579	0,03%
Total	461.583	0,30%

Informations supplémentaires (non révisées) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (en EUR)		
United Kingdom Gilt	464.592	0,11%
Etats-Unis Treasury	421.177	0,10%
Stryker Corp	244.586	0,06%
Fidelity National Information Services Inc	244.575	0,06%
QUALCOMM Inc	244.570	0,06%
Microsoft Corp	244.501	0,06%
Bayer AG	244.437	0,06%
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	244.322	0,06%
Booking Holdings Inc	105.270	0,03%
Xcel Energy Inc	83.636	0,02%
Autres émetteurs	106.656	0,01%
Total	2.648.322	0,63%
BlackRock Sustainable Euro Bond Fund (en EUR)		
Verizon Communications Inc	22.816	0,07%
General Motors Co	22.793	0,07%
Square Enix Holdings Co Ltd	22.790	0,07%
BP PLC	22.786	0,07%
Emerson Electric Co	22.785	0,07%
Sundrug Co Ltd	22.784	0,07%
United Technologies Corp	22.778	0,07%
Waste Management Inc	22.776	0,07%
Biogen Inc	22.769	0,07%
AbbVie Inc	22.663	0,07%
Autres émetteurs	32.071	0,12%
Total	259.811	0,82%
BlackRock Systematic European Equity Fund (en EUR)		
WEC Energy Group Inc	23.092	0,14%
JPMorgan Chase & Co	23.088	0,14%
MSCI Inc	23.085	0,14%
Financial Engines Inc	19.902	0,12%
Wowow Inc	18.430	0,11%
Puma SE	17.994	0,11%
Zardoya Otis SA	15.661	0,10%
United Kingdom Gilt	15.190	0,09%
CGG SA	14.398	0,09%
Brown (N) Group Plc	14.166	0,09%
Autres émetteurs	173.324	1,06%
Total	358.330	2,19%

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
BlackRock Systematic Global Equity Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	2.108.979	0,36%
Republic of Allemagne	1.847.991	0,32%
French Republic Government Bond OAT	1.632.308	0,28%
Netherlands Government Bond	1.240.853	0,21%
E*TRADE Financial Corp	903.402	0,15%
Morgan Stanley	795.851	0,14%
American Express Co	795.842	0,14%
Fifth Third Bancorp	795.841	0,14%
Berkshire Hathaway Inc	795.840	0,14%
Daiwa Securities Group Inc	795.810	0,14%
Autres émetteurs	15.397.928	2,61%
Total	27.110.645	4,63%

À la fin de l'exercice, aucune garantie en titres reçue d'un émetteur unique, en relation avec une gestion efficace du portefeuille et des IFD de gré à gré, ne dépassait 20 % de la VNI de chaque Compartiment concerné.

À la fin de l'exercice, aucun des Compartiments n'avait été pleinement garanti en titres émis ou garantis par un État membre de l'UE.

Vous voulez en savoir davantage?



+44 (0)20 7743 3300



blackrockinternational.com

© 2018 BlackRock, Inc. Tous droits réservés. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS, iSHARES, SO WHAT DO I DO WITH MY MONEY, INVESTING FOR A NEW WORLD et BUILT FOR THESE TIMES sont des marques de commerce déposées et non déposées de BlackRock, Inc. ou de ses filiales aux États-Unis ou ailleurs. Toutes autres marques de commerce appartiennent à leurs détenteurs respectifs. PRISMA 18/1435 BSF AR FRE 0518

BLACKROCK®