

# FRANKLIN TEMPLETON ICAV

30. Juni 2023



FRANKLIN  
TEMPLETON

---

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

---

Franklin FTSE China UCITS ETF

---

Franklin FTSE India UCITS ETF

---

Franklin FTSE Korea UCITS ETF

---

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

---

Franklin Euro Green Bond UCITS ETF

---

Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF

---

Franklin USD Investment Grade Corporate Bond  
UCITS ETF

---

Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF

---

Franklin Emerging Markets UCITS ETF

---

Franklin European Dividend UCITS ETF

---

Franklin European Equity UCITS ETF

---

Franklin Global Dividend UCITS ETF

---

Franklin Global Equity SRI UCITS ETF

---

Franklin U.S. Equity UCITS ETF

---

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate  
UCITS ETF

---

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

---

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

---

Franklin Catholic Principles Emerging Markets  
Sovereign Debt UCITS ETF

---

Franklin Metaverse UCITS ETF

---

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned  
Climate UCITS ETF

# INHALT

	<b>Seite</b>
Verzeichnis .....	3
Allgemeine Informationen.....	5
Bericht des Verwaltungsrats .....	9
Bericht des Anlageverwalters.....	13
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber.....	38
Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers.....	39
Bilanz .....	45
Gesamtergebnisrechnung .....	52
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögen .....	58
Erläuterungen zum Abschluss.....	64
<b>Vermögensaufstellung</b>	
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF .....	157
Franklin FTSE China UCITS ETF .....	160
Franklin FTSE India UCITS ETF .....	178
Franklin FTSE Korea UCITS ETF .....	183
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF .....	187
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF .....	190
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF.....	194
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF .....	200
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF .....	203
Franklin Emerging Markets UCITS ETF .....	210
Franklin European Dividend UCITS ETF .....	219
Franklin European Equity UCITS ETF .....	222
Franklin Global Dividend UCITS ETF .....	226
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF .....	230
Franklin U.S. Equity UCITS ETF .....	237
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF .....	243
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF .....	254
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF .....	262
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF .....	267
Franklin Metaverse UCITS ETF .....	270
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF .....	272
Offenlegung zu Vergütungen (ungeprüft).....	282

# INHALT

Übersicht über Portfolioveränderungen (ungeprüft) .....	284
Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft) .....	326

# VERZEICHNIS

## VERWALTUNGSRAT

Joseph Carrier (US-Amerikaner) (am 23. Februar 2023 ernannt)  
Fionnuala Doris (Irin) (am 23. Februar 2023 ernannt)\*  
Joseph Keane (Ire) (am 23. Februar 2023 ernannt)\*  
Joseph Larocque (US-Amerikaner) (Vorsitzender) (am 23. Februar 2023 ernannt)  
Jaspal Sagger (Brite) (am 23. Februar 2023 ernannt)  
Jane Trust (US-Amerikanerin) (am 24. Februar 2023 ernannt)  
Craig Tyle (US-Amerikaner) (am 27. Juli 2023 ernannt)\*  
Caroline Baron (Französin) (am 9. November 2022 zurückgetreten)  
Robert Burke (Ire) (am 23. Februar 2023 zurückgetreten)\*  
Frank Ennis (Ire) (am 24. Januar 2023 zurückgetreten)\*  
William Jackson (Brite) (am 17. Juli 2023 zurückgetreten)  
Gregory McGowan (US-Amerikaner) (am 23. Februar 2023 zurückgetreten)  
Patrick O'Connor (US-Amerikaner) (am 23. Februar 2023 zurückgetreten)  
Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht geschäftsführend.

## EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ

70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
D02 R296  
Irland

## ANLAGEVERWALTER

Franklin Advisers, Inc.  
One Franklin Parkway  
San Mateo  
CA 94403-1906  
USA

Franklin Templeton Institutional, LLC  
280 Park Avenue  
New York  
NY 10017  
USA

Franklin Templeton Investment  
Management Limited  
Cannon Place  
78 Cannon Street  
London  
EC4N 6HL  
Vereinigtes Königreich

Franklin Advisory Services LLC  
One Franklin Parkway  
San Mateo  
CA 94403-1906  
USA

\* Unabhängige Verwaltungsratsmitglieder.

## REGISTRIERUNGSNUMMER

C167746

## UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants and Registered Auditors  
One Spencer Dock  
North Wall Quay  
Dublin 1  
D01 X9R7  
Irland

## RECHTSBERATER

Matheson  
70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
D02 R296  
Irland

## VERWAHRSTELLE

State Street Custodial Services (Ireland) Limited  
78 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
D02 HD32  
Irland

## VERWALTER

State Street Fund Services (Ireland) Limited  
78 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
D02 HD32  
Irland

## VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Franklin Templeton International Services S.à r.l.  
8A, rue Albert Borschette  
L-1246 Luxemburg

## VERTRETER IN DER SCHWEIZ

Franklin Templeton Switzerland Limited  
Stockerstrasse 38  
CH-8002 Zürich  
Schweiz

# VERZEICHNIS (Fortsetzung)

## AUTORISIERTE TEILNEHMER

Susquehanna International Securities Limited  
International Centre  
Memorial Road  
IFSC Dublin 1  
D01 T6T0  
Irland

Jane Street Financial Limited  
Floor 30  
20 Fenchurch Street  
London EC3M 3BY  
Vereinigtes Königreich

Commerzbank AG  
Kaiserplatz  
Frankfurt/Main 60311  
Deutschland

Citigroup Global Markets Limited  
Canada Square  
Canary Wharf  
London E14 5LB  
Vereinigtes Königreich

Flow Traders B.V.  
Jacob Bontiusplaats 9  
Amsterdam 1018LL  
Niederlande

Societe Generale  
29, Boulevard Haussmann  
Paris 75009  
Frankreich

## GESELLSCHAFTSSEKRETÄR

Matsack Trust Limited  
70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
Irland

## ZAHLSTELLE IN ÖSTERREICH (bis zum

30. September 2022)  
Unicredit Bank Austria AG  
Schottengasse 6 – 8  
1010 Wien  
Österreich

## FAZILITÄTSSTELLE IM VEREINIGTEN KÖNIGREICH

Franklin Templeton Investment Management Limited  
Cannon Place  
78 Cannon Street  
London EC4N 6HL  
Vereinigtes Königreich

## ZAHLSTELLE IN DÄNEMARK

Skandinaviska Enskilda Banken, Dänemark  
Filial af Skandinaviska Enskilda Banken AB  
(publ) Sverige  
Bernstorffsgade 50  
1577 Kopenhagen  
V Dänemark

## ZAHLSTELLE IN DER SCHWEIZ

BNP Paribas, Paris,  
Niederlassung Zürich  
Selnausstrasse 16  
CH-8002 Zürich  
Schweiz

## INFORMATIONSTELLE IN DEUTSCHLAND

Franklin Templeton International Services S.à r.l.,  
Niederlassung Deutschland  
Mainzer Landstrasse 16 60325  
Frankfurt  
Deutschland

## ZAHLSTELLE IN SCHWEDEN

Skandinaviska Enskilda Banken AB  
Kungsträdgårdsgatan 8  
SE-106 40 Stockholm  
Schweden

# ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Franklin Templeton ICAV (der „Fonds“ oder die „ICAV“) ist eine als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtete irische Investmentgesellschaft (Irish Collective Asset-Management Vehicle, ICAV) mit der Registrierungsnummer C167746. Die ICAV wurde am 11. Juli 2017 registriert. Die ICAV ist von der irischen Zentralbank (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß den Bestimmungen der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in ihrer jeweils gültigen Fassung) und der Central Bank (Supervision And Enforcement) Act 2013 (Section 48(1) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities)) Regulations von 2019 (in ihrer jeweils gültigen Fassung) (zusammen die „OGAW-Vorschriften“) zugelassen. In diesem Dokument feststehende, aber nicht definierte Begriffe haben dieselbe Bedeutung, die ihnen im Prospekt der ICAV vom 1. Dezember 2022 (der „Prospekt“) zugeschrieben wird.

Die ICAV ist gemäß dem ICAV-Gesetz für die Zwecke der Anlage in Wertpapieren gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen.

Die ICAV wurde als Umbrella-Fonds mit mehreren Teilfonds errichtet (Teilfonds und Anteilklassen siehe nachstehend), die jeweils eine Anteilklasse umfassen. Der Verwaltungsrat kann jeweils mit vorheriger Zustimmung der Zentralbank verschiedene Anteilserien auflegen, die separate Vermögensportfolios repräsentieren. Jede solche Serie stellt einen Teilfonds dar. Jeder Teilfonds trägt seine eigenen Verbindlichkeiten und gemäß irischem Recht haben weder die ICAV noch von der ICAV bestellte Dienstleister, der Verwaltungsrat, ein Zwangsverwalter, Prüfer oder Insolvenzverwalter oder eine andere Person Zugang zu den Vermögenswerten eines Teilfonds, um die Verbindlichkeiten eines anderen Teilfonds zu begleichen.

Die ICAV hat die Franklin Templeton International Services S.a.r.l. als Verwaltungsgesellschaft (die Verwaltungsgesellschaft) ernannt.

Die Verwaltungsgesellschaft der ICAV hat Franklin Advisory Services LLC und Franklin Templeton Investment Management Limited als Anlageverwalter für alle indexnachbildenden Teilfonds (gemäß nachstehender Definition) ernannt.

Die Verwaltungsgesellschaft der ICAV hat Franklin Templeton Investment Management Limited als Anlageverwalter in Bezug auf den Franklin Euro Green Bond UCITS ETF und den Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF ernannt.

Die Verwaltungsgesellschaft der ICAV hat die Franklin Advisers Inc. und die Franklin Templeton Investment Management Limited als Anlageverwalter in Bezug auf den Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF ernannt.

Die Verwaltungsgesellschaft der ICAV hat das Investmentmanagement an die Franklin Advisers Inc. delegiert, die wiederum die Franklin Templeton Institutional LLC als Untereinlageverwalter in Bezug auf den Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF beauftragt hat.

Die Verwaltungsgesellschaft hat zudem die State Street Fund Services (Ireland) Limited als Verwalter für den Fonds ernannt.

Das für jede Anteilserie geführte, jeweils einen Teilfonds darstellende Anlagenportfolio wird gemäß den Anlagezielen und der Anlagepolitik angelegt, die für den jeweiligen Teilfonds gelten und im betreffenden Prospekt nachtrag angegeben sind. Anteile können in verschiedene Klassen unterteilt werden, um unter anderem Unterschieden bei Ausschüttungspolitik, Kosten, Gebührenregelungen (einschließlich unterschiedlicher Gesamtkostenquoten) oder Währungen Rechnung zu tragen oder eine Währungsabsicherung gemäß den jeweiligen Richtlinien und Anforderungen der Zentralbank vorzusehen.

Im Allgemeinen kann nur ein autorisierter Teilnehmer direkt mit dem Teilfonds am Primärmarkt Transaktionen zur Begebung oder Rücknahme von Anteilen durchführen (zu unterscheiden vom Sekundärmarkt, an dem die Anteile eventuell gehandelt werden). Die ETF-Anteile sind für den Sekundärhandel an jeder zulässigen Börse notiert, und einzelne ETF-Anteile können von Anlegern an zulässigen Börsen über einen Makler/Händler gekauft und verkauft werden. Der Teilfonds legt Creation Units für autorisierte Teilnehmer auf oder nimmt sie von diesen zurück. Anteile an den Teilfonds können an jedem Handelstag zum Nettoinventarwert je Anteil am maßgeblichen Handelstag, abzüglich eines angemessenen Betrags für Abgaben und Gebühren, begeben oder zurückgegeben werden. Der Teilfonds wird im Allgemeinen Creation Units für einen Wertpapierkorb (und/oder einen Barbetrag) auflegen oder zurücknehmen, den der Teilfonds täglich festlegt. Alle anderen Anleger können ETF-Anteile über den Sekundärmarkt, dem die autorisierten Teilnehmer angehören, über eine Börsennotierung oder außerbörslich erwerben. Ein Anleger, der ETF-Anteile am Sekundärmarkt kauft, wird für die ETF-Anteile den Kurs des Sekundärmarktes zahlen (eventuell fallen auch Maklerkosten und Spreads an), der in unterschiedlichem Ausmaß vom Nettoinventarwert pro Anteil abweichen kann. Weitere Informationen zum Kauf und Verkauf am Primär- und Sekundärmarkt finden sich im Prospekt.

# ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

## Teilfonds und Anteilklassen

Zum 30. Juni 2023 sind einundzwanzig Teilfonds aktiv. Achtzehn dieser Teilfonds bilden einen Index nach (die „indexnachbildenden Teilfonds“), und drei der Teilfonds werden vom Anlageverwalter aktiv gemanagt, um ein bestimmtes Anlageziel zu erreichen (die „aktiv gemanagten Teilfonds“).

Die folgende Tabelle führt die Teilfonds der ICAV auf, die indexnachbildende Teilfonds sind.

Teilfonds	Auflegungsdatum	Funktionale Währung	Anteilklasse	Strategie
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	4. Juni 2019	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin FTSE China UCITS ETF	4. Juni 2019	USD	Anteile USD Accumulating	optimiert
Franklin FTSE India UCITS ETF	25. Juni 2019	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	4. Juni 2019	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	21. Mrz. 2022	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	27. Sept. 2018	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	17. Okt. 2017	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin European Dividend UCITS ETF	6. Sept. 2017	EUR	Anteile EUR Distributing	replizierend
Franklin European Equity UCITS ETF	12. Sept. 2018	EUR	Anteile EUR Accumulating	replizierend
Franklin Global Dividend UCITS ETF	6. Sept. 2017	USD	Anteile USD Distributing	replizierend
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	6. Sept. 2017	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	6. Sept. 2017	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	29. Juli 2020	EUR	Anteile EUR Accumulating	replizierend
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	29. Juli 2020	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	14. Juni 2022	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	27. Juni 2022	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin Metaverse UCITS ETF*	6. Sept. 2022	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*	09. Mrz. 2023	USD	Anteile USD Accumulating	replizierend

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt.

Die folgende Tabelle führt die Teilfonds der ICAV auf, die aktiv gemanagte Teilfonds sind.

Teilfonds	Auflegungsdatum	Funktionale Währung	Anteilklasse	Strategie
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	29. April 2019	EUR	Anteile EUR Accumulating	aktiv gemanagt
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	19. Juni 2018	EUR	Anteile EUR Distributing	aktiv gemanagt
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	24. Apr. 2023	EUR	EUR Thesaurierende Anteile**	aktiv gemanagt
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	19. Juni 2018	USD	Anteile USD Distributing	aktiv gemanagt

\*\*Die Anteilklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

Alle Anteile der Teilfonds mit Ausnahme des Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF wurden entsprechend der funktionalen Währung des Teilfonds zu einem Preis von 25 EUR bzw. 25 USD aufgelegt. Der Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF wurde zu einem Preis von 20 USD aufgelegt.

# ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

## Börsennotierungen

Die Teilfonds der ICAV sind zum 30. Juni 2023 an den folgenden Börsen notiert:

Teilfonds	Basiswährung	London Stock Exchange*	Deutsche Börse	Borsa Italiana	SIX Swiss Exchange	Euronext Amsterdam Stock Exchange
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	7. Juni 2019	5. Juni 2019	7. Juni 2019	19. Juni 2019	15. Sept. 2021
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	7. Juni 2019	5. Juni 2019	7. Juni 2019	19. Juni 2019	15. Sept. 2021
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	28. Juni 2019	26. Juni 2019	28. Juni 2019	28. Juni 2019	15. Sept. 2021
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	7. Juni 2019	5. Juni 2019	7. Juni 2019	19. Juni 2019	15. Sept. 2021
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	23. Mrz. 2022	22. Mrz. 2022	23. Mrz. 2022	-	-
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	2. Mai 2019	30. Apr. 2019	2. Mai 2019	19. Juni 2019	15. Sept. 2021
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF**	EUR	27. Juni 2018	26. Juni 2018	14. Sept. 2018	26. Sept. 2018	-
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	27. Juni 2018	26. Juni 2018	14. Sept. 2018	26. Sept. 2018	-
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	USD	01. Okt. 2018	28. Sept. 2018	1. Okt. 2018	01. Okt. 2018	-
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	19. Okt. 2017	18. Okt. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	-
Franklin European Dividend UCITS ETF	EUR	08. Sept. 2017	07. Sept. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	-
Franklin European Equity UCITS ETF	EUR	14. Sept. 2018	13. Sept. 2018	14. Sept. 2018	26. Sept. 2018	-
Franklin Global Dividend UCITS ETF	USD	08. Sept. 2017	07. Sept. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	-
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	08. Sept. 2017	07. Sept. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	15. Sept. 2021
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	8. Sept. 2017	7. Sept. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	-
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	31. Juli 2020	30. Juli 2020	31. Juli 2020	16. Nov. 2020	15. Sept. 2021
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	31. Juli 2020	30. Juli 2020	31. Juli 2020	16. Nov. 2020	15. Sept. 2021
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	17. Juni 2022	15. Juni 2022	21. Juni 2022	-	-
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	-	28. Juni 2022	30. Juni 2022	-	-
Franklin Metaverse UCITS ETF***	USD	9. Sept. 2022	7. Sept. 2022	9. Sept. 2022	-	-
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF***	USD	14. Mrz. 2023	10. Mrz. 2023	14. Mrz. 2023	-	-

\* Zum Handel zugelassen.

\*\* Am 24. April 2023 legte der Teilfonds EUR Thesaurierende Anteile auf, und die Anteile werden seit dem 25. April 2023 an der Deutschen Börse und seit dem 27. April 2023 an der Borsa Italiana notiert. Für die thesaurierenden Anteile bestanden zum 30. Juni 2023 keine anderen Börsennotierungen.

\*\*\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Jeder der indexnachbildenden Teilfonds soll die nachstehend aufgeführten Referenzindizes nachbilden beziehungsweise replizieren.

Teilfonds	Referenzindex („Index“)
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	FTSE Brazil 30/18 Capped Index
Franklin FTSE China UCITS ETF	FTSE China 30/18 Capped Index
Franklin FTSE India UCITS ETF	FTSE India 30/18 Capped Index



# ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

## Börsennotierungen (Fortsetzung)

Teilfonds	Referenzindex („Index“)
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	FTSE Korea 30/18 Capped Index
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	FTSE Taiwan 30/18 Capped Index
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	AC Asia ex Japan Index
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	Emerging Markets Index
Franklin European Dividend UCITS ETF	European Dividend Index
Franklin European Equity UCITS ETF	Europe Equity Index
Franklin Global Dividend UCITS ETF	Global Dividend Index
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	Global Equity SRI Index
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	U.S. Large Cap Equity Index
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Index
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	STOXX Europe 600 Paris-Aligned Benchmark Index
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	MSCI China Climate Paris Aligned Net Total Return Index
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index
Franklin Metaverse UCITS ETF*	Solactive Global Metaverse Innovation Index
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*	MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned Net Total Return Index

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Ist eine vollständige Nachbildung des Index nach vernünftigem Ermessen nicht möglich, verwendet der Teilfonds eine Optimierungsmethode, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das einen vergleichbaren Ertrag erwirtschaftet wie der Index.

Die konkreten Anlageziele und -strategien und die Anlagepolitik der einzelnen Teilfonds sind im Bericht des jeweiligen Anlageverwalters beschrieben.

Die Anlagepolitik der **indexnachbildenden Teilfonds** besteht darin, die Wertentwicklung des betreffenden Index so genau wie möglich nachzubilden, ungeachtet dessen, ob der Indexstand steigt oder fällt. Dabei ist der Tracking Error (Nachbildungsfehler) zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und der des Index möglichst gering zu halten. Um dieses Anlageziel zu erreichen, zielt der Anlageverwalter darauf ab, den Index zu replizieren, indem er alle Indexwertpapiere in ähnlichen Anteilen hält, wie sie im Index gewichtet sind.

Die **Anlagen der aktiv gemanagten Teilfonds** werden vom Anlageverwalter oder seinen Beauftragten aktiv gemanagt, um ihr Anlageziel zu erreichen – beispielsweise, um eine Überrendite über einen Index zu erzielen, statt ihn nur nachzubilden. Wird ein Teilfonds aktiv gemanagt, so hat der Anlageverwalter vorbehaltlich der im betreffenden Prospektnachtrag angegebenen Anlageziele und Anlagepolitik mehr Ermessensfreiheit bei der Zusammenstellung des Teilfondsportfolios. Ein aktiv gemanagter Teilfonds strebt nicht danach, die Wertentwicklung eines Index abzubilden.

# BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023

Der Verwaltungsrat der ICAV legt hiermit seinen Bericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 vor. Der Abschluss der ICAV wurde gemäß Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), irischem Recht einschließlich des Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 (das „ICAV-Gesetz“) und den OGAW-Vorschriften aufgestellt.

## Geschäftsrückblick

Die ICAV wurde am 11. Juli 2017 gegründet. Die Auflegungsdaten der einzelnen Teilfonds der ICAV sind auf Seite 6 angegeben.

Die Ergebnisse für das Geschäftsjahr sind auf den Seiten 52 bis 57 aufgeführt. Eine detaillierte Analyse der Wertentwicklung der ICAV ist im Bericht des Anlageverwalters auf den Seiten 13 bis 37 zu entnehmen. Die ICAV wird weiterhin als Investmentgesellschaft wie im Prospekt beschrieben tätig sein.

Der Anlageverwalter beobachtet fortlaufend die Auswirkungen der Russland-Ukraine-Krise auf die ICAV. Einzelheiten zur Russland-Ukraine-Krise sind den Angaben zu wesentlichen Ereignissen im Geschäftsjahr in Erläuterung 15 zum Abschluss zu entnehmen.

Der Jahresabschluss wurde auf Basis der Unternehmensfortführung erstellt, da der Verwaltungsrat keine Kenntnis von irgendetwas erhalten hat, das darauf hindeutet, dass die Teilfonds nicht für zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Jahresabschlusses („der Bewertungszeitraum“) ihre operative Tätigkeit fortsetzen können. Der Abschluss für den Franklin European Equity UCITS ETF wurde nicht auf Basis der Unternehmensfortführung erstellt, da dieser Teilfonds am 16. November 2023 den Handel einstellt.

## Corporate Governance

### Entsprechenserklärung zur Corporate Governance

Die ICAV hat den Corporate Governance Code for Collective Investment Management Schemes and Management Companies (der „Kodex“) der Irish Funds Industry Association vollständig übernommen. Der Wortlaut des Kodex ist auf der Website der Irish Funds abrufbar: [www.irishfunds.ie](http://www.irishfunds.ie). Die ICAV hat dem Kodex im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 voll entsprochen.

### Beschreibung der Aufgaben des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Jahresberichts und des Abschlusses der Teilfonds der ICAV in Übereinstimmung mit den anwendbaren Gesetzen und Vorschriften zuständig.

Das ICAV-Gesetz schreibt dem Verwaltungsrat vor, für jeden Berichtszeitraum einen Abschluss aufzustellen. Auf der Grundlage dieses Gesetzes hat der Verwaltungsrat beschlossen, den Abschluss gemäß FRS 102 *The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland* (dem im Vereinigten Königreich und Irland geltenden Bilanzierungsstandard) aufzustellen.

Der Abschluss muss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Teilfonds der ICAV am Ende des Geschäftsjahres sowie der Gewinn- und Verlustrechnung der Teilfonds der ICAV für das Geschäftsjahr vermitteln. Nach irischem Recht genehmigen die Verwaltungsratsmitglieder den Jahresabschluss nur dann, wenn sie sich davon überzeugt haben, dass er ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der Gesellschaft am Ende des Geschäftsjahres und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft für das Geschäftsjahr vermittelt. Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses hat der Verwaltungsrat:

- geeignete Rechnungslegungsgrundsätze zu wählen und sie konsequent anzuwenden;
- Beurteilungen und Schätzungen vorzunehmen, die angemessen und umsichtig sind;
- anzugeben, ob geltende Bilanzierungsgrundsätze ordnungsgemäß angewandt wurden, vorbehaltlich der Angabe und Erläuterung wesentlicher Abweichungen davon im Abschluss; und
- den Abschluss auf Basis der Unternehmensfortführung zu erstellen, es sei denn, man kann davon ausgehen, dass die Teilfonds das Unternehmen nicht fortführen.

# BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Beschreibung der Aufgaben des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, angemessene Buchhaltungsunterlagen zu führen, die ausreichen:

- die Transaktionen der Gesellschaft korrekt aufzuzeichnen und zu erklären;
- die Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Teilfonds der ICAV jederzeit mit angemessener Genauigkeit offen zu legen; und
- es ihm ermöglichen sicherzustellen, dass die Abschlüsse mit dem ICAV-Gesetz und den OGAW-Vorschriften übereinstimmen, und eine Prüfung dieser Abschlüsse ermöglicht wird.

Zu diesem Zweck hat der Verwaltungsrat Franklin Templeton International Services S.à r.l., (die „Verwaltungsgesellschaft“) ernannt, die die Aufgabe der Führung der Geschäftsbücher der Teilfonds und Wahrnehmung zusätzlicher Verwaltungsaufgaben an den Verwalter, State Street Fund Services (Ireland) Limited (der „Verwalter“) delegiert hat. Die Geschäftsbücher werden von der State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin, Irland, geführt. Der Verwaltungsrat hat die allgemeine Verantwortung für die Ergreifung von Maßnahmen, die ihm vernünftigerweise zum Schutz des Vermögens der Teilfonds der ICAV zur Verfügung stehen. In diesem Zusammenhang hat er das Vermögen der Teilfonds der Verwahrstelle zur Verwahrung anvertraut. Er ist allgemein zuständig dafür, zumutbare, ihm zur Verfügung stehende Maßnahmen zu ergreifen, um Betrug und andere Unregelmäßigkeiten aufzudecken. Der Verwaltungsrat ist außerdem für die Erstellung eines Berichts des Verwaltungsrats (Lagebericht) verantwortlich, der den Anforderungen des ICAV-Gesetzes entspricht.

Der Abschluss wird auf der Website [www.franklintempleton.com](http://www.franklintempleton.com) veröffentlicht. Der Verwaltungsrat ist gemeinsam mit der Verwaltungsgesellschaft verantwortlich für die Pflege und Integrität der auf dieser Website enthaltenen Finanzdaten. Die Gesetze der Republik Irland, welche die Darstellung und Veröffentlichung von Abschlüssen regeln, können von den Gesetzen in anderen Ländern abweichen.

## Ausschüttungen

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 und das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 festgesetzte Dividenden sind in Erläuterung 12 zum Abschluss angegeben.

## Finanzinstrumente

Einzelheiten über den Einsatz von Finanzinstrumenten durch die ICAV, einschließlich übertragbarer Wertpapiere und derivativer Finanzinstrumente sind in den Erläuterungen 1, 6 und 11 zum Abschluss offen gelegt. Eine vollständige Aufstellung der von den Teilfonds gehaltenen Wertpapiere und derivativen Finanzinstrumente zum Geschäftsjahresende ist den Vermögensaufstellungen der jeweiligen Teilfonds zu entnehmen.

## Risikomanagementziele und -politik

Näheres zu den Risikomanagementzielen und der Risikomanagementpolitik der ICAV sowie dem bestehenden Markt-, Kredit- und Gegenpartierisiko sowie dem Liquiditätsrisiko der Teilfonds am Geschäftsjahresende ist Erläuterung 6 zum Abschluss zu entnehmen.

Weitere Einzelheiten zu den Risiken der ICAV, einschließlich nicht-finanzieller Risiken, sind im Prospekt aufgeführt.

Einzelheiten zu den Auswirkungen der russisch/ukrainischen Krise sind im Abschnitt Geschäftsentwicklung in diesem Bericht des Verwaltungsrats auf Seite 9 enthalten.

## Wichtige Kennzahlen (Key Performance Indicators)

Der Verwaltungsrat erachtet die Veränderung des Nettoinventarwerts („NIW“) pro Anteil als wichtige Kennzahl für die ICAV. Zu den vom Verwaltungsrat für die einzelnen Teilfonds überwachten wichtigen Kennzahlen gehören die Veränderung des NIW pro Anteil im Monatsvergleich, der Abgleich der Wertentwicklung der einzelnen Teilfonds mit der Wertentwicklung des betreffenden Index sowie die Entwicklung des Anteilskapitals.

## Transaktionen mit verbundenen Parteien

Vorschrift 41(1) der OGAW-Vorschriften der Zentralbank besagt, dass „ein Verantwortlicher sicherstellen muss, dass jede Transaktion zwischen einem OGAW und einer verbundenen Partei a) nach dem Fremdvergleichsgrundsatz und b) im besten Interesse der Anteilinhaber des OGAW erfolgt“.

Wie gemäß Vorschrift 81(4) der OGAW-Vorschriften der Zentralbank vorgeschrieben, haben sich die Verwaltungsratsmitglieder vergewissert, dass durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die von Vorschrift 41(1) vorgeschriebenen Pflichten auf alle Transaktionen mit einer verbundenen Person angewendet werden; und bei allen Transaktionen mit verbundenen Personen, die im Jahresverlauf eingegangen wurden, wurden die von Vorschrift 41(1) vorgeschriebenen Pflichten erfüllt.

# BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Transaktionen mit verbundenen Parteien (Fortsetzung)

Die Verwaltungsratsmitglieder haben sich vergewissert, dass (i) durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die von Vorschrift 43(1) der OGAW-Vorschriften der Zentralbank vorgeschriebenen Pflichten auf alle Transaktionen mit einer verbundenen Person angewendet werden (so wie in Vorschrift 42 der OGAW-Vorschriften der Zentralbank definiert); und (ii) bei allen Transaktionen mit verbundenen Parteien, die im Berichtszeitraum, auf den sich der Bericht bezieht, eingegangen wurden, die von Vorschrift 43(1) der OGAW-Vorschriften der Zentralbank vorgeschriebenen Pflichten erfüllt wurden.

## Geschäftsvorfälle mit nahe stehenden Unternehmen und Personen

Sämtliche Geschäftsvorfälle mit nahe stehenden Unternehmen und Personen während des Geschäftsjahres sind in Erläuterung 10 zum Abschluss angegeben.

## Getrennte Haftung

Die ICAV ist ein Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds. Daher können die Vermögenswerte eines Teilfonds nach irischem Recht nicht zur Begleichung von Verbindlichkeiten anderer Teilfonds der ICAV herangezogen werden.

Die getrennte Haftung stellt sicher, dass einem Teilfonds entstandene Verbindlichkeiten ausschließlich durch die Vermögenswerte dieses Teilfonds getilgt werden. Ein Rückgriff auf andere Teilfonds zur Abgeltung solcher Verbindlichkeiten kann generell nicht erfolgen.

Jeder Teilfonds ist dafür verantwortlich, ungeachtet seines Rentabilitätsniveaus seine Kosten und Aufwendungen zu zahlen. Unbeschadet des Vorstehenden kann weder garantiert noch zugesichert werden, dass die Haftungstrennung der Teilfonds in jedem Fall Bestand hat, wenn vor einem Gericht in einer anderen Rechtsordnung Klage gegen die ICAV erhoben wird.

## Beschäftigte

Die ICAV hatte im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 keine Beschäftigten.

## Diversität

Die Ernennungen in den Verwaltungsrat erfolgen nach Leistung unter gebührender Berücksichtigung der Anforderungen der irischen Zentralbank und des Kodex der Irish Funds Industry Association unter anderem in Bezug auf die Zusammensetzung, Unabhängigkeit, Sachkenntnis, Erfahrung, Eignung und Integrität des Verwaltungsrats. Bei künftigen Ernennungen wird es auch zur Strategie des Verwaltungsrats gehören, die Vorteile der Diversität (einschließlich Alter, Geschlecht, Ausbildung und Berufshintergrund) während des Auswahl- und Ernennungsverfahrens zu berücksichtigen. Der Verwaltungsrat ist jedoch weiterhin bestrebt, Personen mit den geeignetsten Kompetenzen und Erfahrungen zu ernennen und wird dabei die Diversität berücksichtigen, ohne ihr jedoch Vorrang einzuräumen. Daher wurden keine formellen Diversitätsziele oder -vorgaben festgelegt, über die zu berichten wäre.

## Wesentliche Ereignisse im Geschäftsjahr

Näheres zu wesentlichen Ereignissen mit Auswirkungen auf die ICAV während des Geschäftsjahres ist Erläuterung 15 zum Abschluss zu entnehmen.

## Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

Näheres zu wesentlichen Ereignissen mit Auswirkungen auf die ICAV seit dem Ende des Geschäftsjahres ist Erläuterung 16 zum Abschluss zu entnehmen.

## Verwaltungsratsmitglieder

Die Namen und Nationalitäten der Personen, die zu irgendeinem Zeitpunkt innerhalb des am 30. Juni 2023 abgelaufenen Geschäftsjahres Verwaltungsratsmitglieder waren, sind nachstehend aufgeführt:

# BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Verwaltungsratsmitglieder (Fortsetzung)

Joseph Carrier (US-Amerikaner) (am 23. Februar 2023 ernannt)  
Fionnuala Doris (Irin) (am 23. Februar 2023 ernannt)\*  
Joseph Keane (Ire) (am 23. Februar 2023 ernannt)\*  
Joseph Larocque (US-Amerikaner) (Vorsitzender) (am 23. Februar 2023 ernannt)  
Jaspal Sagger (Brite) (am 23. Februar 2023 ernannt)  
Jane Trust (US-Amerikanerin) (am 24. Februar 2023 ernannt)  
Craig Tyle (US-Amerikaner) (am 27. Juli 2023 ernannt)\*  
Caroline Baron (Französin) (am 9. November 2022 zurückgetreten)  
Robert Burke (Ire) (am 23. Februar 2023 zurückgetreten)\*  
Frank Ennis (Ire) (am 24. Januar 2023 zurückgetreten)\*  
William Jackson (Brite) (am 17. Juli 2023 zurückgetreten)  
Gregory McGowan (US-Amerikaner) (am 23. Februar 2023 zurückgetreten)  
Patrick O'Connor (US-Amerikaner) (am 23. Februar 2023 zurückgetreten)

\* Unabhängige Verwaltungsratsmitglieder.

## Sekretär

Matsack Trust hatte während des gesamten Geschäftsjahres das Amt des Gesellschaftssekretärs inne.

## Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs der ICAV an Anteilen und Verträgen

Während beziehungsweise am Ende des Geschäftsjahres waren weder die Verwaltungsratsmitglieder noch der Gesellschaftssekretär wesentlich am Kapital der ICAV oder an einem Vertrag oder einer Vereinbarung mit der ICAV beteiligt, ob als wirtschaftlicher Eigentümer oder nicht.

## Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Die während des Geschäftsjahres angefallenen und am Ende des Geschäftsjahres zahlbaren Honorare der Verwaltungsratsmitglieder sind in Erläuterung 5 zum Abschluss aufgeführt.

## Politische Spenden

Die ICAV nahm während des laufenden oder des vorherigen Geschäftsjahres keine politischen Spenden vor.

## Prüfungsrelevante Informationen

Der Verwaltungsrat hat seiner Auffassung nach alle Maßnahmen ergriffen, die vom Verwaltungsrat ergriffen werden sollten, um Kenntnis von prüfungsrelevanten Informationen zu erlangen und dafür zu sorgen, dass die Abschlussprüfer der Gesellschaft diese Informationen kennen. Soweit den Verwaltungsratsmitgliedern bekannt ist, gibt es keine prüfungsrelevanten Informationen, von denen die Abschlussprüfer der Gesellschaft keine Kenntnis haben.

## Unabhängige Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Chartered Accountants, wurden am 13. Juni 2017 als unabhängige Abschlussprüfer der ICAV bestellt und haben ihre Bereitschaft bekundet, dieses Amt gemäß Section 125 des ICAV-Gesetzes von 2015 weiter auszuüben.

## Im Namen des Verwaltungsrats:

Joseph Keane  
Verwaltungsratsmitglied

Fionnuala Doris  
Verwaltungsratsmitglied

-----  
Datum: 17. Oktober 2023

-----

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS

## Konjunktur- und Marktüberblick für den Bericht des Anlageverwalters

### Zwölfmonatiger Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Globale Aktien stiegen insgesamt kräftig im zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023. Nach ihrem Tief Mitte Oktober 2022 kam es zu einer Rally bei globalen Aktien, denn viele Anleger hofften, dass die US-Notenbank (Fed) das Tempo ihrer geldpolitischen Straffung bald verlangsamen würde. Dieser Optimismus schwand jedoch, und Aktien beendeten weltweit das Jahr 2022 mit ihrem schlimmsten Jahresverlust seit der globalen Finanzkrise von 2008. Globale Aktien begannen das Jahr 2023 mit einer kräftigen Rally im Januar, allerdings erlebten die Finanzmärkte im März aufgrund der Bankenunruhe in den Vereinigten Staaten und in der Schweiz eine erhöhte Volatilität. Das ziemlich schnelle Handeln seitens der Behörden in beiden Ländern zum Aufhalten einer möglichen Ausweitung beruhigte jedoch die Anleger. Im zweiten Quartal 2023 profitierten globale Aktien von nachlassenden Sorgen um die Bankenbranche, der Verabschiedung eines die US-Schuldenobergrenze vorübergehend aussetzenden Gesetzes, generell die Konsensschätzungen übertreffenden Erstquartalsberichten von Unternehmen sowie von langsameren oder pausierenden Zinserhöhungen mehrerer Zentralbanken. Gemessen an den MSCI-Indizes in US-Dollar (USD) haben Industrieländeraktien einen globalen Index im zwölfmonatigen Berichtszeitraum übertroffen. Aktien aus Schwellenländern und Frontier-Märkten haben indessen deutlich schwächer als dieser abgeschnitten, und Frontier-Märkte verbuchten einen Verlust.

An den Kreditmärkten schlugen sich in den Mustern bei Renditen von Staatsanleihen im zwölfmonatigen Berichtszeitraum größtenteils die Entwicklungen in der Zentralbankpolitik nieder. Deshalb stiegen die Anleiherenditen in Industrieländern generell in diesem Zeitraum, während diejenigen in vielen Schwellenländern fielen. Die Rendite auf die 10-jährige US Treasury Note stieg im Geschäftsjahr bis Ende Juni 2023 um 82 Basispunkte (Bp.), während die 10-jährige deutsche Bundesanleihe um 106 Bp. auf 2,39 % anstieg. Die Anleiherenditen zogen im Vereinigten Königreich kräftig an (ein Plus von 216 Bp. auf 4,38 %), wobei dieser Zeitraum mit einiger politischer und fiskalischer Unruhe Ende 2022 sowie einer hartnäckig hohen Inflation einherging. Andernorts in der Eurozone, anderen Industrieländern Europas und in Neuseeland stiegen die Anleiherenditen generell zwischen 60 und 100 Bp., kleinere Anstiege waren in Australien und Kanada zu verzeichnen. Die Renditen der zehnjährigen japanischen Staatsanleihe legte im Berichtszeitraum um 17 Bp. auf 0,39 % zu, nachdem die Zielspanne der Bank of Japan (BoJ) von 25 Bp. auf 50 Bp. im Berichtszeitraum angehoben wurde. In den Schwellenländern gaben die Anleiherenditen generell in Mitteleuropa, Lateinamerika und Asien ohne Japan nach.

Im zwölfmonatigen Berichtszeitraum übertrafen US-Aktien die Aktien in den meisten Industrie- und Schwellenländern (alle in USD). Besser als erwartete Gewinnberichte von Unternehmen, die Aussetzung der Schuldenobergrenze, nachlassende Sorgen um US-Regionalbanken, ein robustes Wirtschaftswachstum, Begeisterung für künstliche Intelligenz sowie Hoffnungen auf ein Ende der Zinserhöhungskampagne der Fed stärkten US-Aktien. Das Bruttoinlandsprodukt (BIP) stieg in den ersten drei Monaten von 2023 das dritte Quartal in Folge. Die Veränderung im PCE-Deflator für persönliche Konsumausgaben im Jahresvergleich – der die volatilsten Lebensmittel- und Energiepreise ausschließt und der von der Fed bevorzugte Inflationsmaßstab ist – mäßigte sich bis Mai 2023 etwas, blieb aber deutlich über dem langfristigen Inflationsziel der Zentralbank von 2,0 %. Nachdem die Fed im Berichtszeitraum siebenmal den US-Leitzins um insgesamt 350 Bp. auf das höchste Niveau seit 2007 anhub, ließ sie den Leitzins im Juni unverändert mit der Anmerkung „sie wäre darauf vorbereitet, die geldpolitische Haltung bei auftretenden Risiken entsprechend anzupassen.“

Aktien in Europa übertrafen im zwölfmonatigen Berichtszeitraum diejenigen in den meisten großen Regionen (alle in USD). Dies lag an dem sich nach seinem deutlichen Rückgang gegenüber dem USD im dritten Quartal 2022 festigenden Euro, der sich nach der Unruhe Anfang 2023 stabilisierenden Bankenbranche und rückläufigen Energiepreisen. Angesichts der im ersten Quartal in eine Rezession abrutschenden Eurozone und der Inflationsabkühlung hofften viele Anleger auf ein langsames Zinserhöhungstempo oder eine Zinspause seitens der Europäischen Zentralbank (EZB). In ihren Bestrebungen zur Eindämmung der Inflation hob die EZB ihren Leitzins im zwölfmonatigen Berichtszeitraum achtmal um insgesamt 400 Bp. an, wodurch dieser auf sein höchstes Niveau seit der globalen Finanzkrise anstieg. Das britische BIP schrumpfte im dritten Quartal 2022 im Quartalsvergleich und wuchs mäßig in den beiden darauffolgenden Quartalen. Die Bank of England hob ihren Leitzins im zwölfmonatigen Berichtszeitraum achtmal um insgesamt 375 Bp. auf sein höchstes Niveau seit der globalen Finanzkrise an.

Japanische Aktien blieben im zwölfmonatigen Berichtszeitraum hinter US-Aktien zurück, übertrafen aber Aktien in den meisten anderen Industrie- und Schwellenländern, alle in USD. Die Aktien im Land standen durch die Konjunkturschwäche im dritten Quartal 2022 unter Druck, profitierten aber vom robusten Wachstum in darauffolgenden Quartalen, von der allgemein expansiven Politik der BoJ und von einem schwachen Yen. Japans BIP schrumpfte in den drei Monaten bis Ende September im Quartalsvergleich, wuchs aber in den darauffolgenden beiden Quartalen. Auf ihrer Sitzung im Dezember 2022 beließ die BoJ ihren Leitzins unverändert, erweiterte aber ihr Zielband für die Rendite der 10-jährigen Staatsanleihe, wodurch die Zinsen am langen Ende steigen konnten. Danach beließ sie beide auf ihren vier anschließenden Sitzungen unverändert.

Schwellenländeraktien stiegen insgesamt leicht an, schnitten deutlich schwächer als Industrieländeraktien ab, übertrafen allerdings Aktien aus Frontier-Märkten, alle in USD. Durch Anlegersorgen bezüglich einer globalen Rezession, der Unsicherheit im Hinblick auf Chinas Konjunkturerholung nach dem Ende der chinesischen Null-Covid-Politik im Dezember 2022 sowie geopolitischer Spannungen zwischen China und dem Westen gerieten Aktien aus China und anderen Schwellenländern unter Druck. In dem Bestreben, das Wirtschaftswachstum anzukurbeln, senkte die People's Bank of China den Referenzzins für einjährige Kredite (der für Unternehmens-

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS (Fortsetzung)

und Privatkredite angewandt wird) und den Referenzzins für fünfjährige Kredite (der als hypothekarischer Referenzzinssatz angewandt wird) zweimal im Berichtszeitraum. Zentralbanken anderer Schwellenländer, wie die Reserve Bank of India, die Bank of Korea und die Bank of Mexico, erhöhten ihre Leitzinsen über den Großteil des zwölfmonatigen Berichtszeitraums, pausierten aber gegen dessen Ende.

## Performance-Überblick

Die nachstehende Tabelle zeigt die Einzelheiten zur Performance der indexnachbildenden Teilfonds.

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Teilfondsrendite basierend auf dem Nettoinventarwert für das Jahr zum 30. Juni 2023 – 1-Jahres-Rendite	Rendite des Referenzindex für das Jahr zum 30. Juni 2023 – 1-Jahres-Rendite
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF*	USD	29,24 %	29,42 %
Franklin FTSE China UCITS ETF*	USD	-17,24 %	-17,18 %
Franklin FTSE India UCITS ETF*	USD	13,19 %	15,28 %
Franklin FTSE Korea UCITS ETF*	USD	11,70 %	11,62 %
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*	USD	12,34 %	12,51 %
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF*	USD	1,75 %	2,36 %
Franklin Emerging Markets UCITS ETF*	USD	6,13 %	6,79 %
Franklin European Dividend UCITS ETF*	EUR	3,64 %	2,97 %
Franklin European Equity UCITS ETF*	EUR	14,93 %	14,75 %
Franklin Global Dividend UCITS ETF*	USD	6,35 %	6,54 %
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF*	USD	12,05 %	12,29 %
Franklin U.S. Equity UCITS ETF*	USD	13,95 %	13,82 %
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	EUR	18,07 %	16,49 %
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	USD	21,14 %	18,98 %
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*	USD	-21,41 %	-21,21 %
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*	USD	6,27 %	6,65 %
Franklin Metaverse UCITS ETF**/*	USD	21,97 %	27,60 %
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF**/*	USD	2,34 %	0,90 %

Die nachstehende Tabelle zeigt die Einzelheiten zur Performance der aktiv gemanagten Teilfonds.

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Teilfondsrendite basierend auf dem Nettoinventarwert für das Jahr zum 30. Juni 2023 – 1-Jahres-Rendite	Rendite des Referenzindex für das Jahr zum 30. Juni 2023 – 1-Jahres-Rendite
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF*	EUR	-2,99 %	-3,83 %
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF*	EUR	1,23 %	0,89 %
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF*	USD	0,94 %	1,55 %

\* Die Wertentwicklung des Teilfonds wird ohne Gebühren und Aufwendungen berechnet, aus denen sich die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER) zusammensetzt, sowie ohne Berücksichtigung von Provisionen und Kosten, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen. Die Wertentwicklung basiert auf dem Nettoinventarwert (NIW) des ETF, der sich vom Marktkurs des ETF unterscheiden kann. Gegebenenfalls berücksichtigt der NIW eine Bestimmung bezogen auf Kapitalertragsteuern auf Portfoliobestände; der Referenzindex enthält keine derartige Bestimmung. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung.

\*\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS (Fortsetzung)

## Tracking Error (Nachbildungsfehler)

Die passiv gemanagten Teilfonds der Franklin Templeton ICAV sollen so genau wie möglich die Wertentwicklung ihrer jeweiligen systematischen regelbasierten unternehmenseigenen Indizes nachvollziehen, wie im Prospekt beschrieben. Das gängige Instrument zur Beurteilung, ob dieses Ziel erreicht wurde, ist der realisierte Tracking Error.

Der realisierte Tracking Error ist die Standardabweichung der erzielten Überrenditen über ein Jahr. Er ist ein Maßstab für die Beständigkeit der Erträge im Verhältnis zum Referenzindex über einen festgelegten Zeitraum.

Der realisierte Tracking Error kann von mehreren Faktoren beeinflusst werden, insbesondere von der Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER) des Teilfonds, von den Transaktionszeitpunkten, wenn der Index neugewichtet wird, von Techniken für das effiziente Portfoliomanagement, die eingesetzt werden, um Indexerträge zu replizieren, und von dem für vom Fonds vereinnahmte Dividenden oder Zinsen geltenden Steuersatz gegenüber dem für die Gesamtertragsberechnung des Index zugrunde gelegten Steuersatz.

Nachstehende Tabelle stellt den erwarteten Tracking Error der Teilfonds (wie im Prospekt auf Ex-ante-Basis angegeben) dem tatsächlich realisierten Tracking Error der Teilfonds zum 30. Juni 2023 gegenüber:

Teilfonds	Erwarteter Tracking Error	Annualisierter realisierter Tracking Error
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	2,00 %	1,49 %
Franklin FTSE China UCITS ETF	0,80 %	0,13 %
Franklin FTSE India UCITS ETF	1,00 %	1,85 %
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	0,50 %	0,09 %
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*	1,00 %	0,12 %
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	0,80 %	0,50 %
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	0,80 %	0,39 %
Franklin European Dividend UCITS ETF	0,80 %	0,21 %
Franklin European Equity UCITS ETF	0,50 %	0,40 %
Franklin Global Dividend UCITS ETF	0,50 %	0,09 %
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	0,50 %	0,10 %
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	0,50 %	0,27 %
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	0,50 %	0,15 %
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	0,20 %	0,05 %
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*	1,00 %	0,04 %
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*	1,00 %	0,31 %
Franklin Metaverse UCITS ETF**	1,00 %	0,03 %
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF**	1,00 %	0,21 %

\* Der realisierte Tracking Error wird gewöhnlich aus den Erträgen über 36 Monate errechnet. Die Ertragshistorie des Teilfonds ist zu kurz, um einen statistisch signifikanten Tracking Error zu liefern.

\*\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.



# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS (Fortsetzung)

Im Berichtszeitraum erzielten die Teilfonds und ihre jeweiligen Referenzindizes die im Bericht des Anlageverwalters angegebene Wertentwicklung. Die Outperformance/(Underperformance) eines Teilfonds gegenüber seinem jeweiligen Referenzindex ist vor allem den zeitlichen Differenzen von Handelsgeschäften, wenn der Index neugewichtet wird, der vom Teilfonds getragenen Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER) und dem für vom Teilfonds vereinnahmte Dividenden oder Zinsen geltenden Zinssatz gegenüber dem für die Gesamtertragsberechnung des Referenzindex zugrunde gelegten Steuersatz zuzuschreiben. Der höhere Tracking Error und die Underperformance gegenüber dem Index des Franklin FTSE India UCITS ETF lassen sich auf die Effekte aus der Besteuerung von Kapitalgewinnen in diesem Markt zurückführen.

**Franklin Advisers, Inc.**  
**Franklin Templeton Institutional, LLC**  
**Franklin Templeton Investment Management Limited**  
**Franklin Advisory Services LLC**  
**17. Oktober 2023**

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Energie, Basiskonsumgüter und Industrie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Petrobras, Atacadao und Itau Unibanco.

Die Sektoren, die im selben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Nicht-Basiskonsumgüter, das Gesundheitswesen und Kommunikationsdienstleistungen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten B3, Lojas Renner und Vibra Energia.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Brasilien. Er versucht, die Wertentwicklung des FTSE Brazil 30/18 Capped Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Keine Papiere im Bestand dürfen mehr als 30 % des Basisindex ausmachen; sie werden aus dem FTSE 500 Emerging Index (Anlageuniversum) ausgewählt, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapierenebene zu minimieren. Dabei darf das nächst größte Unternehmen eine maximale Gewichtung von nicht mehr als 18 % haben.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Vale SA ADR	11,16
Petroleo Brasileiro SA ADR (preferred stock)	7,58
Itau Unibanco Holding SA ADR	6,23
Petroleo Brasileiro SA ADR	5,43
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	4,08
Banco Bradesco SA ADR	3,96
Ambev SA ADR	3,10
Localiza Rent a Car SA	2,78
WEG SA	2,73
Centrais Eletricas Brasileiras SA	2,55

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Finanzwerte	25,52
Energie	18,39
Grundstoffe	16,56
Basiskonsumgüter	12,80
Versorger	10,74
Industrie	5,87
Zyklische Konsumgüter	5,70
Kommunikation	1,60
Technologie	0,64

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Brasilien	97,82

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 war die Energie der einzige Sektor, der zur absolute Wertentwicklung des Teilfonds beitrug. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Li Auto, Trip.com Group und PetroChina.

Die Sektoren, die im selben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Nicht-Basiskonsumgüter, Basiskonsumgüter und Immobilien. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Alibaba, Meituan und JD.com.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in China. Er versucht, die Wertentwicklung des FTSE China 30/18 Capped Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Die Positionen des Basisindex umfassen chinesische Large- und Mid-Cap-Aktien aus dem Universum des FTSE Global Equity Index Series auf Basis der Marktkapitalisierung.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Tencent Holdings Ltd	12,78
Alibaba Group Holding Ltd	8,63
Meituan	4,03
China Construction Bank Corp 'H' Shares	2,92
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Anteile	2,03
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' Anteile	1,94
JD.com Inc	1,92
Baidu Inc	1,83
NetEase Inc	1,71
BYD Co Ltd 'H' Anteile	1,49

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Kommunikation	35,64
Finanzwerte	19,74
Zyklische Konsumgüter	11,78
Basiskonsumgüter	11,34
Industrie	6,85
Energie	4,41
Technologie	4,00
Grundstoffe	3,05
Versorger	2,45

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- Nettovermögen
Kaimaninseln	51,59
China	42,38
Hongkong	3,06
Vereinigte Staaten	1,08
Bermuda	0,96
Singapur	0,19

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Finanzen, Nicht-Basiskonsumgüter und Werkstoffe. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten HDFC, Axis Bank und L&T.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Versorger, Energie und Informationstechnologie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Reliance Industries, Infosys und Adani Total Gas.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds Fonds investiert in Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Indien. Er versucht, die Wertentwicklung des FTSE India 30/18 Capped Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Die Positionen des Basisindex umfassen indische Large- und Mid-Cap-Aktien aus dem FTSE All-World Index auf Basis der Marktkapitalisierung im Streubesitz.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt-nettovermögens
Reliance Industries Ltd	9,36
Housing Development Finance Corp Ltd	5,43
Infosys Ltd	5,11
Tata Consultancy Services Ltd	3,68
Hindustan Unilever Ltd	2,59
Axis Bank Ltd	2,46
Bharti Airtel Ltd	2,22
Bajaj Finance Ltd	1,91
Larsen & Toubro Ltd	1,86
Asian Paints Ltd	1,65

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt-nettovermögens
Finanzwerte	21,86
Basiskonsumgüter	15,73
Technologie	13,34
Energie	11,89
Zyklische Konsumgüter	11,56
Industrie	10,48
Grundstoffe	7,45
Versorger	4,37
Kommunikation	4,00

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt-nettovermögens
Indien	100,68

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Werkstoffe und Nicht-Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Samsung Electronics, Posco und SK Hynix.

Die Sektoren, die im selben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Kommunikationsdienstleistungen, Basiskonsumgüter und das Gesundheitswesen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Naver, Kakao und HMM.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds Fonds investiert in Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Südkorea. Er versucht, die Wertentwicklung des FTSE Korea 30/18 Capped Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Die Positionen des Basisindex umfassen südkoreanische Large- und Mid-Cap-Aktien aus dem FTSE All-World Index auf Basis der Marktkapitalisierung im Streubesitz.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtvermögens
Samsung Electronics Co Ltd	26,90
SK Hynix Inc	5,86
Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock)	3,87
Samsung SDI Co Ltd	3,31
LG Chem Ltd	2,97
POSCO Holdings Inc	2,73
Hyundai Motor Co	2,68
NAVER Corp	2,47
Kia Corp	2,08
LG Energy Solution Ltd	1,80

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamtvermögens
Technologie	38,73
Zyklische Konsumgüter	13,70
Industrie	10,90
Finanzwerte	9,49
Grundstoffe	8,11
Basiskonsumgüter	8,09
Kommunikation	8,09
Energie	1,89
Versorger	0,56

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamtvermögens
Südkorea	99,56

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Nicht-Basiskonsumgüter und Finanzen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten TSMC, Delta Electronics und Mediatek.

Die Sektoren, die im selben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Werkstoffe, Kommunikationsdienstleistungen und Immobilien. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Formosa Plastics, Silergy und Evergreen Marine.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds strebt ein Engagement in Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Taiwan an. Er versucht, die Wertentwicklung des FTSE Taiwan 30/18 Capped Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Keine Papiere im Bestand dürfen mehr als 30 % des Basisindex ausmachen; sie werden aus dem FTSE 500 Emerging Index (Anlageuniversum) ausgewählt, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapiererebene zu minimieren. Dabei darf das nächst größte Unternehmen eine maximale Gewichtung von nicht mehr als 18 % haben.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	30,28
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	4,71
MediaTek Inc	3,58
Delta Electronics Inc	2,60
United Microelectronics Corp	2,00
Fubon Financial Holding Co Ltd	1,57
CTBC Financial Holding Co Ltd	1,57
Chunghwa Telecom Co Ltd	1,54
Mega Financial Holding Co Ltd	1,47
Nan Ya Plastics Corp	1,43

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Technologie	48,37
Industrie	18,23
Finanzwerte	16,39
Zyklische Konsumgüter	5,29
Grundstoffe	4,86
Kommunikation	3,49
Basiskonsumgüter	1,66
Energie	0,40

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Taiwan	96,14
Kaimaninseln	2,55

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS

## Franklin Euro Green Bond UCITS ETF

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 trugen die Duration sowie die Positionierung des Teilfonds auf der Renditekurve in Eurozone-Anleihen zur relativen Wertentwicklung bei. Die Sektorallokation des Teilfonds steigerte die relativen Renditen zusätzlich, insbesondere übergewichtete Positionen in Unternehmensanleihen aus dem Industriesektor in der Eurozone (jeweils mit Investment-Grade-Rating und hoch rentierlich).

Das Engagement des Teilfonds in Zinsderivaten schmälerte indessen den relativen Wert. Auch die Wertpapierauswahl des Teilfonds, vor allem in Staatsanleihen der Eurozone, belastete die relative Wertentwicklung. Die Allokation des Teilfonds auf lokalen Märkten beeinträchtigte die relativen Ergebnisse zusätzlich, vor allem das Engagement auf dem britischen Markt.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Das Ziel des Teilfonds ist es, ein Engagement am europäischen Markt für grüne Anleihen zu bieten und gleichzeitig die Gesamtergebnisse zu maximieren.

Der Teilfonds Fonds investiert überwiegend in:

- Anleihen, die als grün gekennzeichnet sind und auf europäische Währungen lauten.

In geringerem Umfang kann der Teilfonds Fonds auch investieren in:

- Klimaschutzanleihen
- Derivate zur Absicherung, für das effiziente Portfoliomanagement und/oder zu Anlagezwecken.

Der Teilfonds Fonds verfolgt eine aktiv gemanagte Anlagestrategie. Demzufolge hält der Teilfonds ein Portfolio aus aktiv ausgewählten und gemanagten Anlagen und versucht nicht, die Wertentwicklung eines Index nachzubilden. Wird auf einen Index Bezug genommen, dann als Referenzgröße für die Wertentwicklung des Teilfonds. Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, werden gemäß den in den OGAW-Vorschriften festgesetzten Grenzen überwiegend auf anerkannten Märkten weltweit notiert oder gehandelt.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtvermögens
Bundesobligation	6,79
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	5,76
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4,05
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4,00
Netherlands Government Bond	3,46
Ireland Government Bond	3,38
Kingdom of Belgium Government Bond	2,62

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtvermögens
Region Wallonne Belgium	2,33
Austria Treasury Bill	2,31

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamtvermögens
Staatsanleihen	39,60
Finanzwerte	27,39
Versorger	16,44
Industrie	5,64
Kommunikation	3,20
Zyklische Konsumgüter	2,13
Energie	1,47
Basiskonsumgüter	0,79

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamtvermögens
Deutschland	25,00
Niederlande	14,59
Frankreich	13,87
Belgien	6,91
Spanien	6,87
Irland	4,87
Österreich	3,92
Italien	3,66
Schweden	3,51
Norwegen	3,24
Sonstige	10,22

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 trugen die Durations sowie die Positionierung des Teilfonds auf der Renditekurve in Eurozone-Anleihen zu den relativen Ergebnissen bei. Die Sektorallokation des Teilfonds trug zusätzlich zu den relativen Renditen bei, insbesondere übergewichtete Positionen in Unternehmensanleihen aus dem Finanzsektor in der Eurozone (jeweils hoch rentierlich und mit Investment-Grade-Rating). Auch die Währungspositionierung des Teilfonds steigerte den relativen Wert, vor allem das Engagement im Euro.

Das Engagement des Teilfonds in Zinsderivaten schmälerte indessen den relativen Wert. Auch die Wertpapierauswahl des Teilfonds, vor allem in Investment-Grade-Unternehmensanleihen der Eurozone aus dem Finanzsektor, belastete die relative Wertentwicklung.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds zielt darauf ab, laufende Erträge zu erzielen und gleichzeitig die Gesamrenditen am Markt für auf Euro lautende kurzfristige festverzinsliche Wertpapiere zu maximieren.

Der Teilfonds Fonds investiert überwiegend in:

- kurzfristige, fest- und variabel verzinsliche, auf Euro lautende Schuldtitel mit Investment-Grade-Rating, die von staatlichen Stellen und Unternehmen einschließlich außereuropäischer Emittenten begeben wurden.

In geringerem Umfang kann der Teilfonds Fonds auch investieren in:

- Schuldtitel von geringerer Bonität, beispielsweise Wertpapiere ohne Investment Grade oder notleidende Wertpapiere (maximal 20 % des Fondsvermögens).
- Derivate zur Absicherung, für das effiziente Portfoliomanagement und/oder zu Anlagezwecken.

Der Teilfonds Fonds verfolgt eine aktiv gemanagte Anlagestrategie. Demzufolge hält der Teilfonds ein Portfolio aus aktiv ausgewählten und gemanagten Anlagen und versucht nicht, die Wertentwicklung eines Index nachzubilden. Wird auf einen Index Bezug genommen, dann als Referenzgröße für die Wertentwicklung des Teilfonds. Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, werden gemäß den in den OGAW-Vorschriften festgesetzten Grenzen überwiegend auf anerkannten Märkten weltweit notiert oder gehandelt.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtvermögens
Austria Treasury Bill	7,78
German Treasury Bill	7,71

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtvermögens
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	6,75
Denmark Government International Bond	4,82
Bundessobligation	4,57
European Union Bill	1,92
German Treasury Bill	1,90
Instituto de Credito Oficial	1,82
France Treasury Bill BTF	1,17

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamtvermögens
Staatsanleihen	45,43
Finanzwerte	28,36
Basiskonsumgüter	8,69
Industrie	4,51
Kommunikation	2,12
Zyklische Konsumgüter	1,93
Technologie	1,75
Versorger	0,88
Grundstoffe	0,39
Hypothekenbesicherte Wertpapiere	0,12

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamtvermögens
Deutschland	16,33
Frankreich	13,36
Italien	8,20
Österreich	8,02
Niederlande	7,04
Vereinigte Staaten	6,68
Luxemburg	6,27
Dänemark	6,06
Spanien	5,36
Vereinigtes Königreich	2,78
Sonstige	14,08

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.



# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 schmälerete die Wertpapierauswahl die relativen Renditen, vor allem aufgrund von Positionen im Bankensektor, die eine beträchtliche Volatilität im Geschäftsjahr erlebten, u. a. die Silicon Valley Bank und die Credit Suisse. Unsere Auswahl in den Sektoren Versicherung, zyklische Konsumgüter und Kommunikation wirkte sich indessen positiv auf die Wertentwicklung aus. Auch unsere Branchenallokation bremste die Wertentwicklung, insbesondere eine Übergewichtung von USTs, die infolge kräftig steigender Spreads schwach abschnitten. Dies wurde teilweise durch ein Übergewichtetes Engagement in den Sektoren Versicherung und Kommunikation sowie eine Untergewichtung von zyklischen Konsumgütern ausgeglichen. Die Renditekurven- und die Durationspositionierung des Fonds wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung im Geschäftsjahr aus.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds verfolgt das Ziel, auf dem USD-Rentenmarkt laufende Erträge zu erwirtschaften und gleichzeitig das Kapital zu erhalten.

Der Teilfonds Fonds investiert überwiegend in:

- auf US-Dollar lautende, fest- und variabel verzinsliche Unternehmensschuldtitel und von US-Unternehmen emittierte Anlagen mit Investment Grade.

In geringerem Umfang kann der Teilfonds Fonds auch investieren in:

- nicht US-amerikanische Wertpapiere einschließlich von Emittenten aus Schwellenländern begebene
- Derivate zur Absicherung, für das effiziente Portfoliomanagement und/oder zu Anlagezwecken.

Der Teilfonds Fonds verfolgt eine aktiv gemanagte Anlagestrategie. Demzufolge hält der Teilfonds ein Portfolio aus aktiv ausgewählten und gemanagten Anlagen und versucht nicht, die Wertentwicklung eines Index nachzubilden. Wird auf einen Index Bezug genommen, dann als Referenzgröße für die Wertentwicklung des Teilfonds. Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, werden gemäß den in den OGAW-Vorschriften festgesetzten Grenzen überwiegend auf anerkannten Märkten weltweit notiert oder gehandelt.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt-nettovermögens
United States Treasury Floating Rate Note	4,28
HSBC Holdings Plc	2,47
Electricite de France SA	2,14

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt-nettovermögens
Verizon Communications Inc	2,10
BNP Paribas SA	2,06
AT&T Inc	2,06
Citigroup Inc	2,00
Morgan Stanley	1,98
Enel Finance International NV	1,96
Comcast Corp	1,86

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt-nettovermögens
Finanzwerte	28,80
Basiskonsumgüter	21,11
Kommunikation	11,79
Versorger	9,30
Energie	7,02
Zyklische Konsumgüter	5,46
Staatsanleihen	4,28
Grundstoffe	4,14
Technologie	4,05
Industrie	2,65

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt-nettovermögens
Vereinigte Staaten	74,63
Frankreich	5,18
Niederlande	3,79
Vereinigtes Königreich	3,61
Schweiz	1,83
Japan	1,51
Kanada	1,48
Irland	1,44
Norwegen	1,43
Singapur	1,17
Sonstige	2,53

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Energie und Finanzen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Posco, ITC und PetroChina.

Die Sektoren, die im selben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Industrie, Versorger und Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Kweichow Moutai, Adani Total Gas und Anhui Conch Cement.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds Fonds investiert in Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Asien ohne Japan. Er versucht, die Wertentwicklung des AC Asia ex Japan Equity Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Die Positionen des Basisindex umfassen typischerweise etwa 150 Aktien großer und mittlerer Unternehmen in Entwicklungs- und Schwellenländern Asiens, die aus dem MSCI AC Asia ex Japan Index (dem „Anlageuniversum“) ausgewählt wurden. Dabei kommt ein Multi-Faktor-Auswahlverfahren zum Einsatz, das vier Anlagestilfaktoren (Qualität, Wert, Momentum und niedrige Volatilität) zugrunde legt.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Infosys Ltd	2,14
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2,12
Tata Consultancy Services Ltd	2,08
Bank Central Asia Tbk PT	2,04
MediaTek Inc	1,97
China Construction Bank Corp 'H' Shares	1,90
Bank of China Ltd 'H' Shares	1,88
POSCO Holdings Inc	1,87
Samsung Electronics Co Ltd	1,86
ITC Ltd	1,81

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Finanzwerte	27,24
Technologie	18,45
Basiskonsumgüter	15,81
Energie	9,72
Industrie	8,51
Grundstoffe	6,87
Zyklische Konsumgüter	5,22
Kommunikation	4,70
Versorger	1,85

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
China	28,37
Taiwan	16,26
Indien	14,13
Südkorea	12,68
Indonesien	7,98
Hongkong	6,25
Kaimaninseln	6,22
Thailand	2,92
Malaysia	1,49
Singapur	1,10
Sonstige	0,97

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Energie und Finanzen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Posco, ITC und Gold Fields.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Industrie, Immobilien und Versorger. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Adani Total Gas, Kweichow Moutai und Anhui Conch Cement.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds Fonds investiert in Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung aus Schwellenländern weltweit. Er versucht, die Wertentwicklung des Emerging Markets Equity Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds ist darauf ausgerichtet, den Basisindex nachzubilden, indem er alle darin erfassten Wertpapiere proportional zu ihrer Gewichtung im Index hält. Die Positionen des Basisindex bestehen aus dem obersten Quartil der Aktien, die anhand eines transparenten Multi-Faktor-Auswahlverfahrens aus dem MSCI Emerging Markets Index (dem „Anlageuniversum“) ausgewählt werden. Das Auswahlverfahren legt vier Anlagestilfaktoren zugrunde (Qualität, Wert, Momentum und niedrige Volatilität).

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt-nettvermögens
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1,13
Ambev SA ADR	1,10
HCL Technologies Ltd	1,10
ITC Ltd	1,09
POSCO Holdings Inc	1,08
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1,08
Infosys Ltd	1,07
Tata Consultancy Services Ltd	1,04
Kia Corp	1,01
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1,01

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt-nettvermögens
Finanzwerte	20,89
Basiskonsumgüter	15,68
Grundstoffe	14,10
Technologie	12,04
Energie	12,01
Zyklische Konsumgüter	8,16
Industrie	6,74
Kommunikation	6,70
Versorger	2,60

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt-nettvermögens
China	21,61
Taiwan	13,14
Indien	10,47
Südkorea	9,13
Brasilien	8,32
Saudi-Arabien	4,55
Südafrika	4,54
Kaimaninseln	3,58
Indonesien	3,09
Türkei	3,07
Sonstige	17,42

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin European Dividend UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Finanzen, Informationstechnologie und Industrie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Besi, Hannover Re und Assicurazioni Generali.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Kommunikationsdienstleistungen, Energie und Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Aker, Anglo American und Telenor.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds Fonds investiert in Aktien qualitativ hochwertiger Unternehmen aus den europäischen Industrieländern mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung und hohen und anhaltenden Dividendenerträgen. Er versucht, die Wertentwicklung des European Dividend Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds ist darauf ausgerichtet, den Basisindex nachzubilden, indem er alle darin erfassten Wertpapiere proportional zu ihrer Gewichtung im Basisindex hält. Die Positionen des Basisindex bestehen aus 50 Aktien, die anhand eines transparenten Auswahlverfahrens aus dem MSCI Europe IMI ex REITS (dem „Anlageuniversum“) ausgewählt werden, das zunächst auf beständige Dividenden und Renditen filtert und im Anschluss auf Qualität.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
BE Semiconductor Industries NV	3,28
Iberdrola SA	3,16
Rio Tinto Plc	3,13
Koninklijke KPN NV	3,09
Allianz SE	3,08
Hannover Rueck SE	3,05
Zurich Insurance Group AG	3,04
GSK Plc	3,03
Imperial Tobacco Group Plc	3,02
Assicurazioni Generali SpA	3,01

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Finanzwerte	27,93
Kommunikation	16,16
Basiskonsumgüter	15,20
Versorger	11,52
Grundstoffe	11,04
Industrie	6,82
Energie	6,14
Technologie	3,28
Zyklische Konsumgüter	0,84

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Vereinigtes Königreich	23,24
Spanien	12,09
Frankreich	9,98
Schweiz	9,36
Finnland	8,03
Italien	7,62
Deutschland	7,21
Niederlande	6,37
Dänemark	5,98
Norwegen	5,19
Sonstige	3,86

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Nicht-Basiskonsumgüter, Industrie und Finanzen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Hermes International, Inditex und Ferrari.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Kommunikationsdienstleistungen, Versorger und Immobilien. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Telefonica, BAT und Persimmon.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds Fonds investiert in Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Europa. Er versucht, die Wertentwicklung des Europe Equity Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds ist darauf ausgerichtet, den Basisindex nachzubilden, indem er alle darin erfassten Wertpapiere proportional zu ihrer Gewichtung im Basisindex hält. Die Positionen des Basisindex umfassen typischerweise etwa 125 Aktien großer und mittlerer Unternehmen aus Industrieländern in Europa, die aus dem MSCI Europe Index (dem „Anlageuniversum“) ausgewählt wurden. Dabei kommt ein Multi-Faktor-Auswahlverfahren zum Einsatz, das vier Anlagestilfaktoren (Qualität, Wert, Momentum und niedrige Volatilität) zugrunde legt.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Industria de Diseno Textil SA	2,24
Ferrari NV	2,16
UniCredit SpA	2,14
Banco Santander SA	2,10
Deutsche Post AG	2,10
RELX Plc	2,10
Stellantis NV	2,07
Equinor ASA	2,06
Mercedes-Benz Group AG	2,05
Glencore Plc	2,05

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Basiskonsumgüter	22,31
Finanzwerte	18,69
Zyklische Konsumgüter	18,10
Industrie	10,47
Energie	9,66
Grundstoffe	9,10
Kommunikation	6,32
Technologie	3,10
Versorger	1,74

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Vereinigtes Königreich	24,57
Niederlande	13,11
Frankreich	10,67
Deutschland	9,79
Schweiz	9,17
Spanien	8,39
Italien	5,91
Dänemark	4,70
Norwegen	4,29
Schweden	3,04
Sonstige	5,85

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Global Dividend UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Industrie, Werkstoffe und Finanzen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Eaton, Nucor und Merck.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Immobilien und Versorger. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Pfizer, 3M und GSK.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien qualitativ hochwertiger Unternehmen aus Schwellen- und Industrieländern weltweit mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung und hohen und anhaltenden Dividendenerträgen. Er versucht, die Wertentwicklung des Global Dividend Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds ist darauf ausgerichtet, den Basisindex nachzubilden, indem er alle darin erfassten Wertpapiere proportional zu ihrer Gewichtung im Basisindex hält. Die Positionen des Basisindex bestehen aus 100 Aktien, die anhand eines transparenten Auswahlverfahrens aus dem MSCI ACWI ex REITS (dem „Anlageuniversum“) ausgewählt werden, das zunächst auf beständige Dividenden und Renditen filtert und im Anschluss auf Qualität.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Broadcom Inc	2,45
Nucor Corp	2,29
Eaton Corp Plc	2,24
QUALCOMM Inc	2,18
Emerson Electric Co	2,13
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2,09
Texas Instruments Inc	2,05
Cisco Systems Inc	2,04
United Parcel Service Inc	2,04
Johnson & Johnson	2,03

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Finanzwerte	28,43
Basiskonsumgüter	21,58
Industrie	13,55
Technologie	12,96
Grundstoffe	8,67
Kommunikation	8,53
Zyklische Konsumgüter	3,54
Energie	2,37
Versorger	0,25

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Vereinigte Staaten	44,60
Schweiz	9,99
Japan	9,02
Australien	6,64
Kanada	5,46
Vereinigtes Königreich	5,13
Taiwan	3,05
Irland	2,84
Saudi-Arabien	2,72
Deutschland	2,70
Sonstige	7,73

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren das Gesundheitswesen, Industrie und Nicht-Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten HCA Healthcare, Biogen und W.W. Grainger.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Immobilien, Versorger und Werkstoffe. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Boliden, American Tower und Nutrien.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung aus Industrie- und Schwellenländern weltweit, die als ökologisch und sozial verantwortungsvoll gelten. Er versucht, die Wertentwicklung des Global Equity SRI Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds ist darauf ausgerichtet, den Basisindex nachzubilden, indem er alle darin erfassten Wertpapiere proportional zu ihrer Gewichtung im Basisindex hält. Die Positionen des Basisindex bestehen aus 230 Aktien, die anhand eines transparenten Multi-Faktor-Auswahlverfahrens aus dem MSCI ACWI SRI Index ausgewählt werden, das vier Anlagestilfaktoren zugrunde legt (Qualität, Wert, Momentum und niedrige Volatilität).

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Old Dominion Freight Line Inc	1,20
WW Grainger Inc	1,14
Cummins Inc	1,11
Moody's Corp	1,08
Illinois Tool Works Inc	1,08
Bank of New York Mellon Corp	1,07
HCA Healthcare Inc	1,06
Fastenal Co	1,05
RELX Plc	1,05
Microsoft Corp	1,05

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Basiskonsumgüter	26,13
Finanzwerte	18,78
Zyklische Konsumgüter	12,87
Industrie	10,79
Kommunikation	8,91
Technologie	8,53
Grundstoffe	8,02
Energie	3,07
Versorger	2,43

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Vereinigte Staaten	40,70
Japan	9,27
Kanada	9,21
Vereinigtes Königreich	5,64
Australien	3,54
Frankreich	3,00
Taiwan	2,74
Niederlande	2,37
Schweiz	2,28
Südafrika	2,07
Sonstige	18,71

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Industrie und Nicht-Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Meta, Applied Materials und Lam Research.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Versorger und Immobilien. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Pfizer, Dollar General und Verizon.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung aus den USA und versucht, die Wertentwicklung des U.S. Large Cap Equity Index (des „Basisindex“) möglichst genau nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds ist darauf ausgerichtet, den Basisindex nachzubilden, indem er alle darin erfassten Wertpapiere proportional zu ihrer Gewichtung im Basisindex hält. Die Positionen des Basisindex bestehen aus 250 Aktien, die anhand eines transparenten Multi-Faktor-Auswahlverfahrens aus dem Russell 1000® Index (dem „Anlageuniversum“) ausgewählt werden, das vier Anlagehilfaktoren zugrunde legt (Qualität, Wert, Momentum und niedrige Volatilität).

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Illinois Tool Works Inc	1,07
Lowe's Co Inc	1,06
Air Products and Chemicals Inc	1,04
KLA Corp	1,04
Home Depot Inc	1,03
Apple Inc	1,03
Meta Platforms Inc	1,02
Eli Lilly & Co	1,02
Philip Morris International Inc	1,02
Broadcom Inc	1,02

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Basiskonsumgüter	28,36
Technologie	16,91
Zyklische Konsumgüter	15,01
Industrie	12,28
Energie	8,51
Finanzwerte	7,59
Kommunikation	6,01
Grundstoffe	4,58
Versorger	0,63

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Vereinigte Staaten	97,05
Irland	1,71
Niederlande	0,55
Guernsey	0,25
Jersey	0,20
Bermuda	0,12

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.



# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Nicht-Basiskonsumgüter, Informationstechnologie und Industrie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten LVMH, ASML und Novo Nordisk.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Kommunikationsdienstleistungen und Immobilien. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Vodafone, GSK und Telefonica.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds strebt ein Engagement in europäischen Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung an, die auf den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft ausgerichtet sind. Er versucht, die Wertentwicklung des STOXX Europe 600 Paris-Aligned Benchmark Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Keine Papiere im Bestand dürfen mehr als 4,5 % des Basisindex ausmachen; sie werden aus dem STOXX 600 Europe Index (Anlageuniversum) ausgewählt, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapierenebene zu minimieren.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	4,69
ASML Holding NV	4,45
Novo Nordisk A/S	4,26
AstraZeneca Plc	4,25
Novartis AG	3,01
SAP SE	2,86
Hermes International	2,60
Cie Financiere Richemont SA	2,48
L'Oreal SA	2,16
Nestle SA	2,13

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Basiskonsumgüter	32,51
Zyklische Konsumgüter	16,41
Finanzwerte	13,35
Technologie	11,27
Industrie	8,39
Kommunikation	7,50
Grundstoffe	6,45
Versorger	2,89
Energie	1,05

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Frankreich	23,23
Vereinigtes Königreich	17,21
Schweiz	15,45
Deutschland	13,71
Niederlande	8,77
Dänemark	7,42
Spanien	5,00
Schweden	2,53
Belgien	1,29
Irland	1,28
Sonstige	3,93

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Industrie und Nicht-Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten NVIDIA, Apple und Microsoft.

Im selben Zeitraum belasteten keine Sektoren die absolute Wertentwicklung des Teilfonds. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Pfizer, First Republic Bank und CVS.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds strebt ein Engagement in US-Aktien mit großer Marktkapitalisierung an, die auf den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft ausgerichtet sind. Er versucht, die Wertentwicklung des S&P 500 Paris-Aligned Climate Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Keine Papiere im Bestand dürfen mehr als 5 % des Basisindex ausmachen; sie werden aus dem S&P 500 Index (Anlageuniversum) ausgewählt, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapiererebene zu minimieren.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Apple Inc	7,80
Microsoft Corp	7,00
Amazon.com Inc	4,16
NVIDIA Corp	3,85
Alphabet Inc	2,60
Alphabet Inc	2,28
Tesla Inc	1,84
Visa Inc	1,76
UnitedHealth Group Inc	1,61
Mastercard Inc	1,47

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Technologie	29,53
Basiskonsumgüter	23,28
Kommunikation	15,28
Finanzwerte	14,17
Zyklische Konsumgüter	8,64
Industrie	7,08
Grundstoffe	1,51
Versorger	0,22
Energie	0,13

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Vereinigte Staaten	97,76
Irland	1,41
Schweiz	0,41
Bermuda	0,13
Jersey	0,10
Panama	0,03

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 trugen keine Sektoren zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds bei. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Li Auto, PDD und Trip.com Group.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Nicht-Basiskonsumgüter, Informationstechnologie und Industrie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Alibaba, Meituan und LONGi Green Energy.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds strebt ein Engagement in Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in China an, die auf den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft ausgerichtet sind. Der Fonds versucht, die Wertentwicklung des MSCI China Climate Paris Aligned Net Total Return Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Keine Papiere im Bestand dürfen mehr als 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds im Basisindex ausmachen; sie werden aus dem MSCI China Index (Anlageuniversum) ausgewählt, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapiererebene zu minimieren.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Tencent Holdings Ltd	15,41
Alibaba Group Holding Ltd	10,08
Baidu Inc	2,68
BYD Co Ltd 'H' Shares	2,44
Meituan	2,05
NetEase Inc	1,92
East Money Information Co Ltd	1,89
Pinduoduo Inc ADR	1,72
China Conch Venture Holdings Ltd	1,44

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Kommunikation	37,80
Basiskonsumgüter	14,07
Finanzwerte	12,04
Zyklische Konsumgüter	10,50
Energie	9,34
Industrie	6,90
Technologie	6,49
Versorger	1,80
Grundstoffe	0,59

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Kaimaninseln	51,41
China	44,16
Hongkong	1,77
Vereinigte Staaten	1,26
Bermuda	0,49
Singapur	0,44

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 beeinträchtigte die Sektorallokation des Teilfonds die relative Wertentwicklung. Auch die Allokation des Teilfonds auf lokalen Märkten belastete die relativen Ergebnisse leicht, vor allem das Engagement auf dem Markt der Eurozone.

Die Duration und die Positionierung des Teilfonds auf der Renditekurve in US-Anleihen trugen indessen zur relativen Wertentwicklung bei. Die Währungspositionierung des Teilfonds hatte bedingt durch das Engagement im Euro und im US-Dollar ebenfalls einen positiven Effekt auf die relativen Renditen. Auch die Wertpapierauswahl des Teilfonds trug zum relativen Wert bei, insbesondere in kolumbianischen Anleihen.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds strebt ein Engagement in auf Euro und US-Dollar lautenden Staatsanleihen von Schwellenländern an. Er versucht, die Wertentwicklung des ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Niveau des Basisindex steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die Wertpapiere aus, die den Basisindex bilden, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine Rendite bietet, die mit der des Basisindex vergleichbar ist, aber diesen nicht mit der gleichen Genauigkeit verfolgt wie ein Anlagevehikel, das den gesamten Basisindex abbildet. Das Engagement eines jeden Landes ist auf 10 % des Basisindex begrenzt. Die Wertpapiere werden aus dem ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index (Anlageuniversum) ausgewählt, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapirebene zu minimieren.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Brazilian Government International Bond	4,30
Colombia Government International Bond	4,29
Romanian Government International Bond	4,08
Romanian Government International Bond	3,63
Peruvian Government International Bond	3,52
Republic of South Africa Government International Bond	3,24
Chile Government International Bond	3,23
Israel Government International Bond	3,20
Philippine Government International Bond	2,97

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Staatsanleihen	91,55

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- Nettovermögens
Chile	10,68
Polen	10,03
Rumänien	9,70
Philippinen	8,98
Brasilien	7,03
Kolumbien	5,60
Israel	5,23
Peru	5,11
Dominikanische Republik	4,68
Panama	4,31
Sonstige	20,20

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Metaverse UCITS ETF

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Kommunikationsdienstleistungen und Nicht-Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten NVIDIA, Meta und AMD.

Im selben Zeitraum war der Finanzsektor der einzige Sektor, der die absolute Wertentwicklung des Teilfonds belastete. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten die Signature Bank, PayPal und Silvergate Capital.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Der Teilfonds ist bestrebt, ein Aktienengagement in börsennotierten Unternehmen weltweit zu bieten, die im Metaversum tätig sind. Der Teilfonds versucht, die Wertentwicklung des Solactive Global Metaverse Innovation Index (des „Basisindex“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob das Indexniveau steigt oder fällt. Der Teilfonds ist darauf ausgerichtet, den Basisindex nachzubilden, indem er alle darin erfassten Wertpapiere proportional zu ihrer Gewichtung im Index hält. Die Positionen des Basisindex umfassen globale Aktien, die von Unternehmen emittiert werden, die als ein wesentliches Engagement in der Bereitstellung von zum Metaversum beitragenden Produkten und/oder Dienstleistungen aufweisend oder voraussichtlich aufweisend gelten.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt-nettovermögens
Meta Platforms Inc	4,57
NVIDIA Corp	4,49
Apple Inc	4,42
Block Inc	3,81
Alphabet Inc	3,62
PayPal Holdings Inc	3,45
Microsoft Corp	3,42
Electronic Arts Inc	3,20
QUALCOMM Inc	3,19
Advanced Micro Devices Inc	3,14

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt-nettovermögens
Technologie	52,80
Kommunikation	20,72
Basiskonsumgüter	11,32
Industrie	7,22
Finanzwerte	5,43
Zyklische Konsumgüter	1,48
Energie	0,89

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt-nettovermögens
Vereinigte Staaten	75,28
Kaimaninseln	6,51
Südkorea	6,09
Niederlande	3,04
Irland	2,81
Taiwan	2,15
Luxemburg	1,12
Schweden	0,74
Norwegen	0,65
Japan	0,58
Sonstige	0,89

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF

Da der Teilfonds zum 30. Juni 2023 aufgelegt wurde, waren die Sektoren, die den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, Finanzen, Informationstechnologie und Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten TSMC, Delta Electronics und Bharat Electronics.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Industrie, Immobilien und Werkstoffe. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Conch Cement, LONGi Green Energy Technology und Hanwha Solutions.

### Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

Das Ziel des Teilfonds ist es, ein Engagement in Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Schwellenländern zu bieten, die auf den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft ausgerichtet sind.

### Top-10-Positionen

30. Juni 2023

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamt- nettovermögens
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	8,16
Tencent Holdings Ltd	4,29
Samsung Electronics Co Ltd	3,23
Alibaba Group Holding Ltd	2,78
Samsung SDI Co Ltd	2,32
Delta Electronics Inc	1,93
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	1,42
Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	1,42
BYD Co Ltd 'H' Shares	1,24
Bharat Electronics Ltd	1,19

### Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2023

Sektor	% des Gesamt- nettovermögens
Finanzwerte	25,37
Kommunikation	17,58
Technologie	17,08
Industrie	12,98
Basiskonsumgüter	11,22
Zyklische Konsumgüter	6,46
Energie	4,02
Grundstoffe	3,18
Versorger	2,04

### Top-10-Länder\*

30. Juni 2023

Land	% des Gesamt- nettovermögens
Indien	16,79
Kaimaninseln	16,00
Taiwan	14,78
China	12,10
Südkorea	10,75
Saudi-Arabien	5,71
Brasilien	5,37
Thailand	3,25
Mexiko	3,02
Südafrika	2,84
Sonstige	9,32

\*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

# BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER

In unserer Eigenschaft als Verwahrstelle der ICAV haben wir die Geschäftsführung der Franklin Templeton ICAV (die „ICAV“) im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 überprüft. Dieser Bericht einschließlich des Prüfvermerks wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Teilfonds der ICAV erstellt. Dieser Bericht wurde gemäß Vorschrift 34 (1), (3) und (4) in Teil 5 der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2019, in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) und für keinen anderen Zweck erstellt. Wir akzeptieren oder übernehmen durch die Erteilung dieses Prüfvermerks keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht vorgelegt wird.

## **Obliegenheiten der Verwahrstelle**

Unsere Aufgaben und Pflichten sind in Vorschrift 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der OGAW-Vorschriften dargelegt. Eine dieser Aufgaben ist es, uns in jedem Rechnungszeitraum einen Überblick über die Geschäftsführung der ICAV zu verschaffen und den Anteilhabern darüber Bericht zu erstatten.

Aus unserem Bericht muss hervorgehen, ob die ICAV unserer Auffassung nach in diesem Zeitraum in Übereinstimmung mit den Bestimmungen des Errichtungsakts der ICAV sowie den OGAW-Vorschriften verwaltet wurde. Die ICAV trägt die Gesamtverantwortung für die Einhaltung dieser Bestimmungen. Sollte die ICAV diese nicht eingehalten haben, müssen wir als Verwahrstelle angeben, warum dies der Fall ist, und die Maßnahmen erläutern, die wir zur Bereinigung der Situation ergriffen haben.

## **Grundlage für den Prüfvermerk der Verwahrstelle**

Die Verwahrstelle führt Überprüfungen durch, die sie nach vernünftigem Ermessen für notwendig hält, um ihre Pflichten gemäß Vorschrift 34 (1), (3) und (4) in Teil 5 der OGAW-Vorschriften zu erfüllen und sicherzustellen, dass die ICAV in jeder wesentlichen Hinsicht:

- (i) gemäß den ihren Anlage- und Kreditaufnahmebefugnissen durch die Bestimmungen der Gründungsdokumente und die entsprechenden Vorschriften auferlegten Einschränkungen; und
- (ii) ansonsten gemäß den Gründungsdokumenten der ICAV (der „Errichtungsakt“) und den entsprechenden Vorschriften geführt wurde.

## **Prüfvermerk**

Unserer Auffassung nach wurde die ICAV im Geschäftsjahr in jeder wesentlichen Hinsicht:

- (i) gemäß den ihr von ihrem Errichtungsakt, den OGAW-Vorschriften und den OGAW-Vorschriften der Zentralbank auferlegten Beschränkungen ihrer Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse; und
- (ii) ansonsten gemäß den Bestimmungen des Errichtungsakts, der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Vorschriften der Zentralbank geführt.

**State Street Custodial Services (Ireland) Limited**  
**78 Sir John Rogerson's Quay**  
**Dublin 2**  
**Irland**

**Datum: 17. Oktober 2023**

# ***Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Anteilhaber der Teilfonds der Franklin Templeton ICAV***

## **Bericht zur Abschlussprüfung**

Die deutsche Version des Prüfberichts ist eine Übersetzung des originalen in englischer Sprache verfassten Berichts des Abschlussprüfers zu Informationszwecken. Im Falle von Abweichungen zwischen der englischen Version dieses Berichts und einer Übersetzung des Berichts in eine andere Sprache als Englisch, ist die englische Version maßgebend.

---

### **Prüfvermerk**

Unserer Auffassung nach vermittelt der Jahresabschluss der Franklin Templeton ICAV:

- ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Teilfonds zum 30. Juni 2023 und ihrer Ergebnisse für das an diesem Tag endende Geschäftsjahr;
- und wurde ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen (den vom Financial Reporting Council des Vereinigten Königreichs herausgegebenen Bilanzierungsgrundsätzen einschließlich Financial Reporting Standard 102, „der im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendende Bilanzierungsstandard“ und irischem Recht); und
- gemäß dem Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 und den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in ihrer jeweils gültigen Fassung) aufgestellt.

Wir haben den dem Jahresabschluss beigelegten Abschluss geprüft, der Folgendes umfasst:

- die Bilanz zum 30. Juni 2023;
- die Gesamtergebnisrechnung für das an diesem Tag endende Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens für das an diesem Tag endende Geschäftsjahr;
- die Vermögensaufstellung für die einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2023; und
- die Erläuterungen zum Abschluss der einzelnen Teilfonds, die eine Beschreibung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze enthalten.

Unser Prüfvermerk steht in Einklang mit unseren Berichten an den Verwaltungsrat.

---

### **Grundlage für den Prüfvermerk**

Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit den International Standards on Auditing (Ireland) („ISAs (Ireland)“) und geltendem Recht durchgeführt.

Unsere Obliegenheiten gemäß den ISAs (Ireland) sind im Abschnitt über die Zuständigkeiten der Abschlussprüfer für die Abschlussprüfung in unserem Bericht ausführlicher beschrieben. Unserer Auffassung nach bilden die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und geeignete Grundlage für unser Testat.

#### ***Unabhängigkeit***

Wir blieben unabhängig von der ICAV in Übereinstimmung mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Jahresabschlusses in Irland relevant sind, einschließlich des IAASA-Ethikstandards für börsennotierte Unternehmen von öffentlichem Interesse, und wir haben unsere anderen ethischen Verpflichtungen in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir erklären nach bestem Wissen und Gewissen, dass für die ICAV keine prüfungsfremden Leistungen erbracht wurden, die dem IAASA-Ethikstandard zufolge unzulässig sind.

Wir haben für die ICAV im Zeitraum vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023 keine prüfungsfremden Leistungen erbracht.

---

### **Klarstellungsvermerk - Aufstellung von Abschlüssen unter anderer Annahme als der Unternehmensfortführung**

Im Rahmen der Erteilung unseres Prüfvermerks für den Jahresabschluss verweisen wir auf Erläuterung 1(a) zum Abschluss, in der beschrieben wird, warum der Abschluss des Franklin European Equity UCITS Fund unter anderer Annahme als der der Unternehmensfortführung aufgestellt wurde.



---

## Unser Prüfungsansatz

### Überblick



#### Wesentlichkeit

- Wesentlichkeit für den Abschluss als Ganzes: 50 Basispunkte (2022: 50 Basispunkte) des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 30. Juni 2023 (2022: 30. Juni 2022) für jeden Teilfonds der ICAV.
- Toleranzwesentlichkeit: 75 % der Wesentlichkeit insgesamt.

---

#### Prüfungsumfang

- Die ICAV ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (ICAV) und hat die Franklin Templeton International Services S.á r.l (die „Verwaltungsgesellschaft“) beauftragt, bestimmte Pflichten und Aufgaben in der täglichen Verwaltung der ICAV zu erfüllen. Wir haben den Umfang unserer Prüfung auf die Anlagearten der Teilfonds, die umseitig angegebene Beteiligung Dritter, die Rechnungslegungsverfahren und -kontrollen sowie die Branche, in der die ICAV tätig ist, zugeschnitten. Wir betrachten jeden Teilfonds für sich.

---

#### Besonders wichtige Prüfungssachverhalte

- Bewertung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte.
- Bestand von ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten

---

### Umfang unserer Prüfung

Im Rahmen der Konzeptionierung unserer Prüfung legten wir die Wesentlichkeit fest und beurteilten die Risiken wesentlicher Falschangaben im Abschluss. Insbesondere achteten wir auf subjektive Beurteilungen des Verwaltungsrats, etwa bei der Auswahl von Preisinformationsquellen für die Bewertung des Anlageportfolios. Wie bei allen unseren Prüfungen haben wir auch das Risiko einer Beeinflussung der internen Kontrollen durch das Management berücksichtigt und unter anderem bewertet, ob Indizien für Voreingenommenheit von Verwaltungsratsmitgliedern vorlagen, die ein Risiko wesentlicher Falschangaben aufgrund von Betrug darstellen.

#### Besonders wichtige Prüfungssachverhalte

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte sind Sachverhalte, die nach pflichtgemäßen Ermessen der Abschlussprüfer bei der Prüfung des Abschlusses für den vorliegenden Zeitraum von größter Bedeutung waren, darunter die von den Abschlussprüfern ermittelten und als besonders bedeutsam beurteilten Risiken von Falschangaben (unabhängig davon, ob diese auf Betrug zurückzuführen sind) einschließlich solcher mit der größten Wirkung auf: die übergreifende Prüfungsstrategie, den Einsatz der Ressourcen bei der Prüfung und die Ausrichtung der Prüfungshandlungen des Auftragsteams. Diese Sachverhalte und alle unsere Äußerungen zu den Ergebnissen unserer diesbezüglichen Prüfungshandlungen wurden im Kontext unserer Prüfung des Abschlusses als Ganzes und bei der Erteilung des Testats zum Abschluss berücksichtigt. Wir erteilen zu diesen Sachverhalten kein gesondertes Testat. Hierbei handelt es sich nicht um eine erschöpfende Auflistung aller im Zuge unserer Prüfung ermittelten Risiken.

---

#### Besonders wichtiger Prüfungssachverhalt Prüfungssachverhalts bei der Prüfung

##### *Bewertung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte.*

Näheres ist Bilanzierungsgrundsatz 1(c) des Abschlusses zu entnehmen. Die in der Bilanz der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2023 ausgewiesenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte werden gemäß dem Financial Reporting Standard 102 mit dem beizulegenden Zeitwert bewertet. Dies gilt als besonders wichtiger Prüfungssachverhalt, da es das zentrale Element im Abschluss darstellt.

---

#### Berücksichtigung des besonders wichtigen

Wir haben das Anlageportfolio jedes Teilfonds überprüft, indem wir die Bewertung der Anlagen unabhängig mit von Dritten bezogenen Werten abgestimmt haben. Es wurden keine wesentlichen Sachverhalte im Zusammenhang mit der Durchführung dieser Verfahren festgestellt.

---

##### *Bestand von ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten*

Näheres ist Bilanzierungsgrundsatz 1(c) des Abschlusses der ICAV zu entnehmen. Die in der Bilanz der einzelnen Teilfonds ausgewiesenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte werden zum 30. Juni 2023 im Namen des Teilfonds gehalten. Dies gilt als besonders wichtiger Prüfungssachverhalt, da es das zentrale Element im Abschluss darstellt.

Wir haben von der Verwahrstelle und den Gegenparteien des zum 30. Juni 2023 gehaltenen Anlageportfolios eines jeden Teilfonds unabhängige Bestätigungen eingeholt und die Bestätigungen der Verwahrstelle und der Gegenparteien mit den Geschäftsbüchern abgeglichen. Es wurden keine wesentlichen Sachverhalte im Zusammenhang mit der Durchführung dieser Verfahren festgestellt.

### *Festlegung des Prüfungsumfangs*

Wir haben den Umfang unserer Prüfung so festgelegt, dass ausreichende Prüfungshandlungen durchgeführt wurden, um ein Testat zum Abschluss als Ganzes zu erteilen, wobei der Aufbau der ICAV, ihre Rechnungslegungsprozesse und -kontrollen sowie die Branche, in der sie tätig ist, berücksichtigt wurden.

Der Verwaltungsrat führt die Geschäfte der ICAV und ist zuständig für die übergreifende Anlagepolitik, die von ihm festgelegt wird. Die ICAV beauftragt die Verwaltungsgesellschaft, bestimmte Aufgaben und Pflichten im Hinblick auf die tägliche Verwaltung der ICAV zu übernehmen. Die Verwaltungsgesellschaft hat bestimmte Verantwortlichkeiten an Franklin Advisers, Inc, Franklin Templeton Institutional, LLC, Franklin Templeton Investment Management Limited und Franklin Advisory Services LLC (die „Anlageverwalter“) und an State Street Fund Services (Ireland) Limited (der „Verwalter“) delegiert. Der Abschluss, für den der Verwaltungsrat zuständig bleibt, wird in seinem Auftrag vom Verwalter aufgestellt. Die ICAV hat die State Street Custodial Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) beauftragt, als Verwahrstelle für die Vermögenswerte der ICAV zu fungieren. Bei der Festlegung unseres übergreifenden Prüfungsansatzes haben wir das Risiko wesentlicher Falschangaben auf Teilfondsebene beurteilt und dabei die Art, Wahrscheinlichkeit und potenzielle Größenordnung von Falschangaben berücksichtigt. Im Rahmen unserer Risikobeurteilung haben wir die Interaktion der ICAV mit dem Verwalter geprüft und das beim Verwalter vorliegende Kontrollumfeld bewertet.

### *Wesentlichkeit*

Der Umfang unserer Prüfung wurde durch unsere Wesentlichkeitsbeurteilung beeinflusst. Als Kriterien für die Wesentlichkeit legten wir bestimmte quantitative Schwellen fest. In Kombination mit qualitativen Erwägungen haben diese zur Festlegung des Prüfungsumfangs und der Art, des zeitlichen Ablaufs und des Umfangs unserer Prüfungshandlungen bezüglich einzelner Abschlussposten und Angaben und bei der Bewertung der Auswirkungen von Falschangaben im Einzelfall und insgesamt auf den Abschluss als Ganzes beigetragen.

Auf der Grundlage unseres fachlichen Ermessens haben wir die Wesentlichkeit für den Abschluss der einzelnen Teilfonds der ICAV wie folgt festgelegt:

<b>Die Wesentlichkeit für den Abschluss als Ganzes und ihre Ermittlung</b>	50 Basispunkte (2022: 50 Basispunkte) des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 30. Juni 2023 (2022: 30. Juni 2022) für jeden Teilfonds der ICAV.
<b>Grund für den herangezogenen Referenzindex</b>	Wir haben diesen Referenzindex herangezogen, weil das Hauptziel der ICAV darin besteht, den Anlegern eine Gesamtrendite auf Teilfondsebene unter Berücksichtigung der Kapital- und Ertragsrendite zu bieten.

Wir nutzen die Toleranzwesentlichkeit, um die Wahrscheinlichkeit, dass die Summe aus den nicht korrigierten und nicht aufgedeckten Falschangaben die Wesentlichkeitsgrenze überschreitet, auf ein angemessen niedriges Maß zu reduzieren. Insbesondere nutzen wir die Toleranzwesentlichkeit bei der Festlegung unseres Prüfungsumfangs sowie von Art und Ausmaß unserer Prüfung von Kontensalden, Transaktionsklassen und Offenlegungen, beispielsweise bei der Festlegung von Auswahlgrößen. Unsere Toleranzwesentlichkeit betrug 75 % der Wesentlichkeit insgesamt.

Bei der Festlegung der Toleranzwesentlichkeit haben wir mehrere Faktoren berücksichtigt – bisherige Falschangaben, die Risikobeurteilung und Risikoaggregation sowie die Effektivität von Kontrollen – und kamen zu dem Schluss, dass ein Wert im oberen Bereich unserer normalen Spanne angemessen war.

Wir haben mit dem Verwaltungsrat vereinbart, dass wir über etwaige im Zuge unserer Prüfungstätigkeit ermittelte Falschangaben, die hinsichtlich NIW-relevanter Auswirkungen mehr als 5 Basispunkte des NIW des einzelnen Teilfonds ausmachen (2022: 5 Basispunkte des NIW des einzelnen Teilfonds hinsichtlich NIW-relevanter Auswirkungen) sowie über falsche Angaben unterhalb dessen, die jedoch unserer Meinung nach aus qualitativen Gründen mitgeteilt werden sollten, Bericht erstatten würden.

---

### **Schlussfolgerungen in Bezug auf die Fortführung der Geschäfte**

Mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, für den bei der Bilanzierung nicht von der Fortführung der Geschäfte ausgegangen wurde, wie im vorstehenden Klarstellungsvermerk – Aufstellung von Abschlüssen unter anderer Annahme als der der Unternehmensfortführung – dargelegt, umfasste unsere Beurteilung der Einschätzung des Verwaltungsrats bezüglich der Fähigkeit der Teilfonds, weiterhin auf der Grundlage der Fortführung der Geschäfte zu bilanzieren:

- Wir verschafften uns Einblick in die wichtigen Indikatoren, die in Bezug auf die Unternehmensfortführung überwacht werden, und die Zukunftspläne des Managements für die ICAV und die Teilfonds über den Zeitraum der Unternehmensfortführung (d. h. 12 Monate ab dem Datum der Genehmigung des Abschlusses).
- Wir überprüften verfügbare Protokolle von Verwaltungsratssitzungen im Prüfzeitraum sowie diejenigen, bis zum Datum dieses Berichts verfügbaren Protokolle.
- Wir prüften Kapitalbewegungen nach dem Bilanzstichtag durch Einsicht in die zugrunde liegenden Geschäftsbücher.
- Wir tätigten Nachfragen beim Management in Bezug auf geplante wesentliche Rücknahmen, von denen sie informiert wurden; und

- wir überprüfen die Techniken des Liquiditätsrisikomanagements, die der ICAV und den Teilfonds zur Verfügung stehen.

Mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, für den bei der Bilanzierung nicht von der Fortführung der Geschäfte ausgegangen wurde, wie im vorstehenden Klarstellungsvermerk – Aufstellung von Abschlüssen unter anderer Annahme als der der Unternehmensfortführung – dargelegt, haben wir auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeiten keine wesentlichen Unsicherheiten im Zusammenhang mit Ereignissen oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Teilfonds wecken könnten, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum, an dem die Herausgabe des Abschlusses genehmigt wird, auch weiterhin auf der Grundlage der Fortführung der Geschäfte zu bilanzieren.

Mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, für den bei der Bilanzierung nicht von der Fortführung der Geschäfte ausgegangen wurde, wie im vorstehenden Klarstellungsvermerk – Aufstellung von Abschlüssen unter anderer Annahme als der der Unternehmensfortführung – dargelegt, sind wir bei der Prüfung des Jahresabschlusses zu dem Schluss gekommen, dass die Anwendung des Fortführungsprinzips durch den Verwaltungsrat als Grundlage für die Erstellung des Abschlusses angemessen ist.

Da aber nicht alle künftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhersehbar sind, ist diese Feststellung keine Garantie für die Fähigkeit der Teilfonds, ihre Geschäfte weiterhin fortzuführen.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats in Bezug auf die Unternehmensfortführung werden in den jeweiligen Abschnitten dieses Berichts erläutert.

---

## Bericht über sonstige Informationen

Zu den sonstigen Angaben zählen alle anderen Informationen im Jahresbericht neben dem Jahresabschluss und unserem Bericht der Abschlussprüfer darüber. Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen zuständig. Unser Testat zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Informationen. Entsprechend erteilen wir dazu, soweit in diesem Bericht nicht ausdrücklich anders angegeben, kein Testat und geben auch keinerlei Urteil mit Prüfungssicherheit ab. Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung ist es unsere Aufgabe, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu berücksichtigen, ob die sonstigen Informationen in wesentlichem Widerspruch zum Abschluss oder zu unseren im Zuge der Prüfung gewonnenen Erkenntnissen stehen oder ansonsten wesentliche Falschangaben zu enthalten scheinen. Stellen wir wesentlichen Widersprüche oder wesentliche Falschangaben fest, müssen wir Prüfungshandlungen vornehmen, um zu bestimmen, ob wesentliche Falschangaben im Abschluss oder wesentliche Falschangaben in den sonstigen Informationen vorliegen. Gelangen wir aufgrund unserer durchgeführten Prüfungshandlungen zu dem Ergebnis, dass diese sonstigen Informationen wesentliche Falschangaben enthalten, müssen wir darüber Bericht erstatten. Wir haben auf der Grundlage dieser Pflichten nichts zu berichten.

Auf der Grundlage unserer vorstehend beschriebenen Pflichten und unserer im Zuge der Prüfung vorgenommenen Prüfungshandlungen schreibt uns der Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 vor, auch die folgende Stellungnahme abzugeben:

### *Bericht des Verwaltungsrats*

- Nach unserer Auffassung auf der Grundlage der im Zuge unserer Prüfung durchgeführten Prüfungshandlungen stimmen die Angaben im Bericht des Verwaltungsrats für das Jahr zum 30. Juni 2023 mit dem Abschluss überein.

---

## Verantwortung für den Jahresabschluss und die Prüfung

### *Zuständigkeiten des Verwaltungsrats für den Abschluss*

Gemäß ausführlicherer Erläuterung in den Zuständigkeiten der Mitglieder des Verwaltungsrats auf den Seiten 9 und 10 ist der Verwaltungsrat für die Aufstellung von Jahresabschlüssen gemäß dem anwendbaren Rahmen verantwortlich und muss sich vergewissern, dass diese ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermitteln.

Der Verwaltungsrat ist auch für die internen Kontrollen zuständig, die nach seinem Ermessen nötig sind, um die Aufstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen Falschangaben aufgrund von Betrug oder Fehlern sind.

Bei der Aufstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat zuständig für die Bewertung der Fähigkeit der Teilfonds zur Fortführung der Geschäfte und muss gegebenenfalls Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung der Geschäfte und der Bilanzierung auf der Grundlage der Fortführung der Geschäfte angeben, sofern der Verwaltungsrat die ICAV nicht entweder zu liquidieren oder den Betrieb einzustellen beabsichtigt oder keine realistische Alternative dazu hat.

### *Zuständigkeiten der Abschlussprüfer für die Abschlussprüfung*

Unser Ziel ist, angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresabschluss insgesamt frei von wesentlichen Falschangaben aufgrund von Betrug oder Fehlern ist, und einen Bericht des Abschlussprüfers herauszugeben, der unser Testat enthält. Angemessene Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie, dass eine gemäß ISAs (Irland) durchgeführte Prüfung in jedem Fall bestehende wesentliche Falschangaben aufdeckt. Falsche Angaben können aufgrund von Betrug oder Fehlern entstehen und gelten als wesentlich, wenn davon ausgegangen werden kann, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen der Adressaten beeinflussen.

Unregelmäßigkeiten einschließlich Betrug stellen Verstöße gegen Gesetze und Vorschriften dar. Wir konzipieren gemäß unseren Aufgaben wie vorstehend beschrieben Prüfungshandlungen, um wesentliche Falschangaben hinsichtlich Unregelmäßigkeiten

einschließlich Betrug aufzudecken. Inwieweit unsere Prüfungshandlungen Unregelmäßigkeiten einschließlich Betrug aufdecken können, ist nachstehend ausgeführt.

Basierend auf unserem Verständnis der ICAV und der Branche haben wir ermittelt, dass sich die wesentlichen Risiken einer Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften auf Verstöße gegen den Irish Collective Asset-Management Vehicles Act 2015 und die Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in ihrer jeweils gültigen Fassung) bezogen, und wir prüften, inwieweit sich eine Nichteinhaltung wesentlich auf den Abschluss auswirken könnte. Wir berücksichtigten auch diejenigen Gesetze und Vorschriften, die eine direkte Auswirkung auf die Aufstellung des Abschlusses haben, wie der Irish Collective Asset-Management Vehicles Act 2015 und die Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in ihrer jeweils gültigen Fassung). Wir beurteilten die Anreize des Managements und Gelegenheiten für eine betrügerische Manipulation des Abschlusses (einschließlich des Risikos der Hinwegsetzung über Kontrollen) und kamen zu dem Schluss, dass sich die wesentlichen Risiken auf das Betrugsrisiko infolgedessen, dass sich das Management über Kontrollen hinwegsetzt, bezogen.

Zu den vom Auftragsteam durchgeführten Prüfungshandlungen gehörten:

- Nachfragen beim Management, um Fälle der Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften zu ermitteln;
- Ermittlung und Überprüfung von Journaleinträgen, die unsere speziellen risikobasierten Kriterien erfüllen;
- Prüfung von rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und Beurteilungen sowie Berücksichtigung von Vorurteilen des Managements;
- Konzipieren von Prüfungshandlungen, um Unberechenbarkeit im Zusammenhang mit der Art, dem Timing oder dem Umfang unserer Prüfung einzubeziehen; und
- Überprüfung von Protokollen der Sitzungen des Verwaltungsrats

Es bestehen inhärente Beschränkungen bei den oben beschriebenen Prüfungshandlungen. Es ist weniger wahrscheinlich, dass wir Fälle von Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften erkennen, die in keiner engen Beziehung zu im Abschluss ausgewiesenen Ereignissen und Transaktionen stehen. Außerdem ist das Risiko, eine sich aus Betrug ergebende wesentliche Falschangabe nicht zu erkennen, höher als das Risiko, eine aus einem Fehler resultierende wesentliche Falschangabe zu entdecken, da Betrug vorsätzliche Täuschung beispielsweise durch Fälschung oder absichtliche Falschdarstellungen oder geheime Absprachen beinhalten kann.

Zu unserer Abschlussprüfung kann die Überprüfung des kompletten Bestands bestimmter Transaktionen und Salden gehören, eventuell durch den Einsatz von Datenprüfungstechniken. Dies geht jedoch in der Regel mit der Auswahl einer begrenzten Anzahl von Posten statt einer Überprüfung des kompletten Bestands einher. Oftmals versuchen wir, bestimmte Posten aufgrund ihrer Größe oder Risikomerkmale zur Überprüfung zum Ziel zu nehmen. In anderen Fällen verwenden wir eine Stichprobenprüfung, damit wir Schlussfolgerungen bezüglich des Bestands, aus dem die Stichprobe ausgewählt wurde, ziehen können.

Eine ausführlichere Beschreibung unserer Zuständigkeiten für die Abschlussprüfung ist der Website der IAASA zu entnehmen unter:

[https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description\\_of\\_auditors\\_responsibilities\\_for\\_audit.pdf](https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf).

Diese Beschreibung ist Bestandteil unsere Berichts des Abschlussprüfers.

### *Verwendung dieses Berichts*

Dieser Bericht, einschließlich des Testats und der Stellungnahmen, wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Teilfonds als Gremium gemäß Section 120 des Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 und zu keinem anderen Zweck erstellt. Wir akzeptieren oder übernehmen durch die Erteilung dieses Testats keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht vorgelegt wird oder in deren Hände dieser Bericht gelangen mag, außer in Fällen, in denen von uns ausdrücklich eine vorherige schriftliche Zustimmung erteilt wurde.

---

## **Sonstige vorgeschriebene Angaben**

---

### **Gemäß dem Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 zu meldende Ausnahmen**

#### *Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder*

Gemäß dem Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 sind wir dazu verpflichtet, Ihnen Bericht zu erstatten, wenn nach unserer Auffassung die von Section 117 dieses Gesetzes vorgeschriebenen Angaben zur Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder nicht erfolgt sind. Bezüglich dieser Pflicht haben wir keine Ausnahmen zu berichten.

---

## **Bestellung**

Wir wurden vom Verwaltungsrat am 11. Juli 2017 mit der Prüfung des Abschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2018 und anschließende Berichtszeiträume beauftragt. Der Zeitraum der gesamten ununterbrochenen Beauftragung beträgt 6 Jahre und umfasst die Jahre bis zum 30. Juni 2018 und 30. Juni 2023.

Andrew O'Callaghan

Für und im Namen von PricewaterhouseCoopers,  
Chartered Accountants & Statutory Audit Firm,  
Dublin  
Oktober 2023

# BILANZ

Zum 30. Juni 2023

	Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
<b>Umlaufvermögen</b>								
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:								
Wertpapiere .....	1(c)	32.029.116	259.813.958	267.054.868	447.748.053	4.618.673	250.176.823	481.726.301
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) .....	1(c)	-	25.907	19.825	-	30	97.912	526.875
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	-	-	-	2.124	-
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente .....	1(d), 7	315.402	622.915	701.721	776.466	16.911	6.435.436	22.630.896
Bei Maklern gehaltene Zahlungsmittel .....		-	-	-	-	-	278.000	-
Sonstige Forderungen .....	8	491.524	5.708.267	7.525.052	1.242.778	58.325	4.140.688	6.654.675
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>32.836.042</b>	<b>266.171.047</b>	<b>275.301.466</b>	<b>449.767.297</b>	<b>4.693.939</b>	<b>261.130.983</b>	<b>511.538.747</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	1(c)	(914)	(32.948)	-	(8.585)	-	(19.950)	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	-	-	-	(250.303)	-
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuer n .....		-	-	(3.108.936)	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(93.144)	(4.406.151)	(6.938.830)	(34.505)	(14.115)	(2.032.943)	(30.470)
<b>Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen .....</b>		<b>(94.058)</b>	<b>(4.439.099)</b>	<b>(10.047.766)</b>	<b>(43.090)</b>	<b>(14.115)</b>	<b>(2.303.196)</b>	<b>(30.470)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>32.741.984</b>	<b>261.731.948</b>	<b>265.253.700</b>	<b>449.724.207</b>	<b>4.679.824</b>	<b>258.827.787</b>	<b>511.508.277</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD
<b>Umlaufvermögen</b>							
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:							
Wertpapiere .....	1(c)	9.208.438	10.300.374	37.832.830	46.032.550	5.008.754	47.522.583
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) .....	1(c)	-	-	-	2.200	-	-
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente .....	1(d), 7	37.178	51.714	26.385	36.037	4.490	-
Sonstige Forderungen .....	8	96.613	152.918	525.216	470.109	28.000	108.830
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>9.342.229</b>	<b>10.505.006</b>	<b>38.384.431</b>	<b>46.540.896</b>	<b>5.041.244</b>	<b>47.631.413</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>							
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) ...	1(c)	-	(1.370)	(3.480)	-	(102)	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	(2)	-	-	-
Überziehungskredit .....		-	-	-	-	-	(21.983)
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuer n .....		-	(28.996)	(111.467)	-	-	(12.161)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(3.105)	(3.466)	(24.255)	(9.867)	(7.065)	(18.483)
<b>Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen .....</b>		<b>(3.105)</b>	<b>(33.832)</b>	<b>(139.204)</b>	<b>(9.867)</b>	<b>(7.167)</b>	<b>(52.627)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>9.339.124</b>	<b>10.471.174</b>	<b>38.245.227</b>	<b>46.531.029</b>	<b>5.034.077</b>	<b>47.578.786</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Metaverse UCITS ETF* USD
<b>Umlaufvermögen</b>								
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:								
Wertpapiere .....	1(c)	28.127.826	128.432.379	30.224.706	155.539.117	16.130.868	56.888.680	2.905.321
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) .....	1(c)	227	2.139	-	7.283	-	-	-
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente .....	1(d), 7	47.212	42.941	19.113	633.591	36.466	4.503.540	2.651
Sonstige Forderungen .....	8	109.832	140.520	38.308	28.860.370	42.186	766.665	3.331
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>28.285.097</b>	<b>128.617.979</b>	<b>30.282.127</b>	<b>185.040.361</b>	<b>16.209.520</b>	<b>62.158.885</b>	<b>2.911.303</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) ...	1(c)	-	-	(204)	-	(415)	-	-
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuer n .....		(4.435)	-	-	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(18.748)	(27.263)	(3.702)	(29.252.583)	(3.019)	(20.792)	(1.832)
<b>Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen .....</b>		<b>(23.183)</b>	<b>(27.263)</b>	<b>(3.906)</b>	<b>(29.252.583)</b>	<b>(3.434)</b>	<b>(20.792)</b>	<b>(1.832)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>28.261.914</b>	<b>128.590.716</b>	<b>30.278.221</b>	<b>155.787.778</b>	<b>16.206.086</b>	<b>62.138.093</b>	<b>2.909.471</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
<b>Umlaufvermögen</b>		
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:		
Wertpapiere .....	1(c)	5.074.736
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente .....	1(d), 7	8.153
Sonstige Forderungen .....	8	18.888
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>5.101.777</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>		
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	1(c)	-
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....		(18.250)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(5.403)
<b>Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen .....</b>		<b>(23.653)</b>
 <b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“)</b>		 <b>5.078.124</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Joseph Keane

Fionnuala Doris

Verwaltungsratsmitglied

Verwaltungsratsmitglied

-----  
Datum: 17. Oktober 2023

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

	Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
<b>Umlaufvermögen</b>								
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:								
Wertpapiere .....	1(c)	26.595.719	238.976.268	122.404.499	290.304.928	2.054.278	73.941.052	596.918.148
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) .....	1(c)	-	33.190	-	-	-	63.407	434.546
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	-	-	-	211.894	-
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente .....	1(d), 7	373.076	704.745	103.706	249.027	316	6.687.702	72.151.903
Sonstige Forderungen .....	8	423.332	1.514.449	805.585	765.609	28.711	3.057.311	3.367.124
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>27.392.127</b>	<b>241.228.652</b>	<b>123.313.790</b>	<b>291.319.564</b>	<b>2.083.305</b>	<b>83.961.366</b>	<b>672.871.721</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) ...	1(c)	(56.096)	-	-	(32.781)	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	-	-	-	(6.783)	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(53.045)	(63.633)	(897.372)	(25.258)	(351)	(18.580)	(26.670)
<b>Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen .....</b>		<b>(109.141)</b>	<b>(63.633)</b>	<b>(897.372)</b>	<b>(58.039)</b>	<b>(351)</b>	<b>(25.363)</b>	<b>(26.670)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>27.282.986</b>	<b>241.165.019</b>	<b>122.416.418</b>	<b>291.261.525</b>	<b>2.082.954</b>	<b>83.936.003</b>	<b>672.845.051</b>

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
<b>Umlaufvermögen</b>								
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:								
Wertpapiere .....	1(c)	12.631.912	5.089.860	31.193.088	30.885.281	5.813.624	40.321.780	25.088.331
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente .....	1(d), 7	363.884	7.957	102.279	-	6.365	-	73.234
Sonstige Forderungen .....	8	113.923	85.926	506.969	194.780	38.880	94.734	76.990
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>13.109.719</b>	<b>5.183.743</b>	<b>31.802.336</b>	<b>31.080.061</b>	<b>5.858.869</b>	<b>40.416.514</b>	<b>25.238.555</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) ...	1(c)	-	(1.055)	(3.280)	(1.890)	(435)	-	(1.053)
Überziehungskredit .....		-	-	-	(37.514)	-	(65.886)	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(3.801)	(37.710)	(270.733)	(6.370)	(18.866)	(16.455)	(15.259)
<b>Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen .....</b>		<b>(3.801)</b>	<b>(38.765)</b>	<b>(274.013)</b>	<b>(45.774)</b>	<b>(19.301)</b>	<b>(82.341)</b>	<b>(16.312)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>13.105.918</b>	<b>5.144.978</b>	<b>31.528.323</b>	<b>31.034.287</b>	<b>5.839.568</b>	<b>40.334.173</b>	<b>25.222.243</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* USD
<b>Umlaufvermögen</b>						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere .....	1(c)	93.867.900	14.223.125	109.119.212	2.561.446	28.426.550
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures) .....	1(c)	-	235	-	-	-
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente .....	1(d), 7	98.110	1.997	627.655	4.324	9.479.627
Sonstige Forderungen .....	8	112.209	19.757	13.377.207	12.539	407.567
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>94.078.219</b>	<b>14.245.114</b>	<b>123.124.074</b>	<b>2.578.309</b>	<b>38.313.744</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>						
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) ...	1(c)	(9.126)	-	(8.751)	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(19.803)	(2.082)	(13.740.875)	(242)	(8.462.155)
<b>Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen .....</b>		<b>(28.929)</b>	<b>(2.082)</b>	<b>(13.749.626)</b>	<b>(242)</b>	<b>(8.462.155)</b>
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>94.049.290</b>	<b>14.243.032</b>	<b>109.374.448</b>	<b>2.578.067</b>	<b>29.851.589</b>

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Erträge:								
Dividenerträge .....	1(f)	3.004.108	5.556.539	2.964.235	9.475.963	132.738	-	-
Zinserträge .....	1(f)	-	10.520	34.558	4.834	5	3.405.761	6.966.909
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	1(b), 1(c), 4	5.026.228	(44.114.659)	21.186.342	34.983.105	139.640	(7.453.004)	(188.962)
<b>Gesamtanlageerträge/(-verluste) .....</b>		<b>8.030.336</b>	<b>(38.547.600)</b>	<b>24.185.135</b>	<b>44.463.902</b>	<b>272.383</b>	<b>(4.047.243)</b>	<b>6.777.947</b>
Aufwendungen:								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(52.815)	(470.907)	(350.592)	(344.553)	(4.257)	(458.295)	(298.113)
<b>Nettoertrag/(-verlust) .....</b>		<b>7.977.521</b>	<b>(39.018.507)</b>	<b>23.834.543</b>	<b>44.119.349</b>	<b>268.126</b>	<b>(4.505.538)</b>	<b>6.479.834</b>
Finanzierungskosten:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile .....	12	-	-	-	-	-	-	(6.320.080)
Zinsaufwendungen .....	1(f)	(1.470)	(188)	(6.331)	(308)	-	(37.238)	(261.117)
Besteuerung:								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(164.931)	(412.735)	(609.336)	(1.436.603)	(28.505)	-	2.934
Kapitalertragsteuer .....	2	-	-	(2.861.646)	-	-	-	-
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....</b>		<b>7.811.120</b>	<b>(39.431.430)</b>	<b>20.357.230</b>	<b>42.682.438</b>	<b>239.621</b>	<b>(4.542.776)</b>	<b>(98.429)</b>

Die Gewinne und Verluste entstanden ausschließlich aus der Anlagetätigkeit und aus dem laufenden Geschäft. Hiervon ausgenommen war nur der Franklin European Equity UCITS ETF. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen waren keine Gewinne oder Verluste angefallen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
<b>Erträge:</b>								
Dividendenerträge .....	1(f)	-	494.878	2.414.409	2.551.286	275.818	1.763.698	1.004.844
Zinserträge .....	1(f)	433.054	884	12.140	849	-	1.635	862
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	1(b), 1(c), 4	(288.726)	(108.628)	74.835	(1.004.181)	619.992	1.682.500	2.980.990
<b>Gesamtanlage(verluste)/-erträge .....</b>		<b>144.329</b>	<b>(100.713)</b>	<b>2.501.384</b>	<b>1.547.954</b>	<b>895.810</b>	<b>3.447.833</b>	<b>3.986.696</b>
<b>Aufwendungen:</b>								
Betriebliche Aufwendungen .....	4	(44.622)	(30.497)	(154.750)	(96.450)	(13.432)	(204.306)	(115.663)
<b>Netto(verlust)/-ertrag .....</b>		<b>99.707</b>	<b>356.637</b>	<b>2.346.634</b>	<b>1.451.504</b>	<b>882.378</b>	<b>3.243.527</b>	<b>3.871.033</b>
<b>Finanzierungskosten:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile .....		(329.385)	-	-	(2.103.855)	-	(1.358.120)	-
Zinsaufwendungen .....		-	(215)	(1.251)	(1.179)	(714)	(811)	(347)
<b>Besteuerung:</b>								
Quellensteuer .....	2	-	(65.549)	(289.658)	(140.673)	(25.581)	(231.584)	(140.600)
Kapitalertragsteuer .....	2	-	(11.621)	(38.947)	-	-	(12.845)	(7.647)
<b>(Abnahme)/Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....</b>		<b>(229.678)</b>	<b>279.252</b>	<b>2.016.778</b>	<b>(794.203)</b>	<b>856.083</b>	<b>1.640.167</b>	<b>3.722.439</b>

Die Gewinne und Verluste entstanden ausschließlich aus der Anlagetätigkeit und aus dem laufenden Geschäft. Hiervon ausgenommen war nur der Franklin European Equity UCITS ETF. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen waren keine Gewinne oder Verluste angefallen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Metaverse UCITS ETF* USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
Erträge:								
Dividenderträge .....	1(f)	2.976.332	694.124	1.765.245	133.353	-	10.605	60.856
Zinserträge .....	1(f)	2.355	398	2.483	1.222	2.909.819	6	(48)
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	1(b), 1(c), 4	13.331.590	2.949.848	22.289.093	(1.812.551)	2.831.424	520.224	83.097
<b>Gesamtanlageerträge/(-verluste) .....</b>		<b>16.310.277</b>	<b>3.644.370</b>	<b>24.056.821</b>	<b>(1.677.976)</b>	<b>5.741.243</b>	<b>530.835</b>	<b>143.905</b>
Aufwendungen:								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(291.112)	(31.819)	(78.973)	(12.776)	(202.841)	(5.822)	(2.790)
<b>Nettoertrag/(-verlust) .....</b>		<b>16.019.165</b>	<b>3.612.551</b>	<b>23.977.848</b>	<b>(1.690.752)</b>	<b>5.538.402</b>	<b>525.013</b>	<b>141.115</b>
Finanzierungskosten:								
Zinsaufwendungen .....	1(f)	-	(63)	(807)	(1.174)	(232)	-	(48)
Besteuerung:								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(452.924)	(75.281)	(275.502)	(7.875)	(175)	(908)	(7.264)
Kapitalertragsteuer .....	2	-	-	-	-	-	-	(18.342)
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....</b>		<b>15.566.241</b>	<b>3.537.207</b>	<b>23.701.539</b>	<b>(1.699.801)</b>	<b>5.537.995</b>	<b>524.105</b>	<b>115.461</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die Gewinne und Verluste entstanden ausschließlich aus der Anlagetätigkeit und aus dem laufenden Geschäft. Hiervon ausgenommen war nur der Franklin European Equity UCITS ETF. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen waren keine Gewinne oder Verluste angefallen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Erträge:								
Dividendenerträge .....	1(f)	2.678.903	4.201.291	1.557.916	9.297.064	30.712	-	-
Zinserträge .....	1(f)	74	292.044	14.504	815	-	726.050	2.029.120
Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	1(b), 1(c), 4	(9.045.108)	(82.566.226)	(10.066.563)	(218.992.454)	(499.645)	(15.680.366)	(4.599.004)
<b>Gesamtanlageverlust .....</b>		<b>(6.366.131)</b>	<b>(78.072.891)</b>	<b>(8.494.143)</b>	<b>(209.694.575)</b>	<b>(468.933)</b>	<b>(14.954.316)</b>	<b>(2.569.884)</b>
Aufwendungen:								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(51.543)	(406.309)	(192.247)	(402.391)	(1.245)	(323.918)	(134.535)
<b>Nettoverlust .....</b>		<b>(6.417.674)</b>	<b>(78.479.200)</b>	<b>(8.686.390)</b>	<b>(210.096.966)</b>	<b>(470.178)</b>	<b>(15.278.234)</b>	<b>(2.704.419)</b>
Finanzierungskosten:								
Zinsaufwendungen .....	1(f)	(335)	(1.113)	(2.235)	(2.120)	-	(12.034)	(364.158)
Besteuerung:								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(101.868)	(306.621)	(322.160)	(1.473.398)	(6.244)	-	-
Kapitalertragsteuer .....	2	329.932	-	811.979	-	-	-	-
<b>Abnahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....</b>		<b>(6.189.945)</b>	<b>(78.786.934)</b>	<b>(8.198.806)</b>	<b>(211.572.484)</b>	<b>(476.422)</b>	<b>(15.290.268)</b>	<b>(3.068.577)</b>

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die Gewinne und Verluste entstanden ausschließlich aus der Anlagetätigkeit. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen waren keine Gewinne oder Verluste angefallen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
<b>Erträge:</b>								
Dividendenerträge .....	1(f)	-	262.692	2.142.989	1.558.283	308.295	1.878.724	682.646
Zinserträge .....	1(f)	387.283	-	2.544	-	-	-	14
Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	1(b), 1(c), 4	(2.511.606)	(929.245)	(9.925.045)	(1.009.078)	(846.740)	(8.366.586)	(4.701.024)
<b>Gesamtanlage(verluste)/-erträge .....</b>		<b>(2.124.323)</b>	<b>(666.553)</b>	<b>(7.779.512)</b>	<b>549.205</b>	<b>(538.445)</b>	<b>(6.487.862)</b>	<b>(4.018.364)</b>
<b>Aufwendungen:</b>								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(52.943)	(22.548)	(169.918)	(61.591)	(21.919)	(216.002)	(95.283)
<b>Netto(verlust)/-ertrag .....</b>		<b>(2.177.266)</b>	<b>(689.101)</b>	<b>(7.949.430)</b>	<b>487.614</b>	<b>(560.364)</b>	<b>(6.703.864)</b>	<b>(4.113.647)</b>
<b>Finanzierungskosten:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile .....	12	(345.045)	-	-	(1.456.730)	-	(1.302.600)	-
Zinsaufwendungen .....	1(f)	-	(129)	(261)	(840)	(39)	(1.308)	(13)
<b>Besteuerung:</b>								
Quellensteuer .....	1(j), 2	-	(32.818)	(243.992)	(81.866)	(25.258)	(218.126)	(85.912)
Kapitalertragsteuer .....	2	-	4.889	24.474	-	-	(187)	4.500
<b>Abnahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....</b>		<b>(2.522.311)</b>	<b>(717.159)</b>	<b>(8.169.209)</b>	<b>(1.051.822)</b>	<b>(585.661)</b>	<b>(8.226.085)</b>	<b>(4.195.072)</b>

Die Gewinne und Verluste entstanden ausschließlich aus der Anlagetätigkeit. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen waren keine Gewinne oder Verluste angefallen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* USD
Erträge/(Verluste)						
Dividendenerträge .....	1(f)	2.217.305	469.497	1.211.551	14.670	-
Zinserträge .....	1(f)	420	31	457	-	7.670
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	1(b), 1(c), 4	(6.260.215)	(2.399.916)	(23.503.480)	144.842	(453.954)
<b>Gesamtanlage(verluste)/-erträge .....</b>		<b>(4.042.490)</b>	<b>(1.930.388)</b>	<b>(22.291.472)</b>	<b>159.512</b>	<b>(446.284)</b>
Aufwendungen:						
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(267.459)	(21.658)	(65.862)	(242)	(2.127)
<b>Netto(-verlust)/-ertrag .....</b>		<b>(4.309.949)</b>	<b>(1.952.046)</b>	<b>(22.357.334)</b>	<b>159.270</b>	<b>(448.411)</b>
Finanzierungskosten:						
Zinsaufwendungen .....	1(f)	(44)	(297)	(218)	-	-
Besteuerung:						
Quellensteuer .....	1(j), 2	(320.258)	(51.900)	(182.798)	(1.120)	-
Kapitalertragsteuer .....	2	-	-	-	-	-
<b>(Abnahme)/Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagstätigkeit .....</b>		<b>(4.630.251)</b>	<b>(2.004.243)</b>	<b>(22.540.350)</b>	<b>158.150</b>	<b>(448.411)</b>

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die Gewinne und Verluste entstanden ausschließlich aus der Anlagstätigkeit. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen waren keine Gewinne oder Verluste angefallen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres .....		27.282.986	241.165.019	122.416.418	291.261.525	2.082.954	83.936.003	672.845.051
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....		7.811.120	(39.431.430)	20.357.230	42.682.438	239.621	(4.542.776)	(98.429)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	6.298.521	107.267.570	125.823.559	124.570.167	2.357.249	209.508.367	230.390.905
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	(8.650.643)	(47.269.211)	(3.343.507)	(8.789.923)	-	(30.073.807)	(391.629.250)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen .....		(2.352.122)	59.998.359	122.480.052	115.780.244	2.357.249	179.434.560	(161.238.345)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres .....</b>		<b>32.741.984</b>	<b>261.731.948</b>	<b>265.253.700</b>	<b>449.724.207</b>	<b>4.679.824</b>	<b>258.827.787</b>	<b>511.508.277</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

		Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
	Erl.							
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres .....		13.105.918	5.144.978	31.528.323	31.034.287	5.839.568	40.334.173	25.222.243
(Abnahme)/Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....		(229.678)	279.252	2.016.778	(794.203)	856.083	1.640.167	3.722.439
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	-	5.046.944	4.700.126	18.829.312	1.556.647	11.580.847	12.758.923
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	(3.537.116)	-	-	(2.538.367)	(3.218.221)	(5.976.401)	(13.441.691)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen .....		(3.537.116)	5.046.944	4.700.126	16.290.945	(1.661.574)	5.604.446	(682.768)
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres .....</b>		<b>9.339.124</b>	<b>10.471.174</b>	<b>38.245.227</b>	<b>46.531.029</b>	<b>5.034.077</b>	<b>47.578.786</b>	<b>28.261.914</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD		Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR		Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD		Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD		Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD		Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	
		UCITS	ETF	UCITS	ETF	UCITS	ETF	UCITS	ETF	UCITS	ETF	UCITS	ETF*
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres .....		94.049.290		14.243.032		109.374.448		2.578.067		29.851.589		-	
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....		15.566.241		3.537.207		23.701.539		(1.699.801)		5.537.995		524.105	115.461
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	39.525.865		12.497.982		67.841.349		15.327.820		42.482.473		2.385.366	4.962.663
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	(20.550.680)		-		(45.129.558)		-		(15.733.964)		-	-
Zunahme des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen .....		18.975.185		12.497.982		22.711.791		15.327.820		26.748.509		2.385.366	4.962.663
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres .....</b>		<b>128.590.716</b>		<b>30.278.221</b>		<b>155.787.778</b>		<b>16.206.086</b>		<b>62.138.093</b>		<b>2.909.471</b>	<b>5.078.124</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

	Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres .....		23.126.963	194.635.130	71.655.374	686.930.045	-	107.825.739	59.822.188
Abnahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....		(6.189.945)	(78.786.934)	(8.198.806)	(211.572.484)	(476.422)	(15.290.268)	(3.068.577)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	18.922.112	158.463.210	58.959.850	28.153.790	2.559.376	43.005.516	616.091.440
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	(8.576.144)	(33.146.387)	-	(212.249.826)	-	(51.604.984)	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen .....		10.345.968	125.316.823	58.959.850	(184.096.036)	2.559.376	(8.599.468)	616.091.440
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres .....</b>		<b>27.282.986</b>	<b>241.165.019</b>	<b>122.416.418</b>	<b>291.261.525</b>	<b>2.082.954</b>	<b>83.936.003</b>	<b>672.845.051</b>

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

		Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
	Erl.							
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres .....		17.096.172	5.862.137	39.697.532	22.956.014	9.495.587	37.888.805	22.355.251
(Abnahme)/Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....		(2.522.311)	(717.159)	(8.169.209)	(1.051.822)	(585.661)	(8.226.085)	(4.195.072)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	5.636.533	-	-	14.325.318	-	74.124.771	7.062.064
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	(7.104.476)	-	-	(5.195.223)	(3.070.358)	(63.453.318)	-
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen .....		(1.467.943)	-	-	9.130.095	(3.070.358)	10.671.453	7.062.064
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres .....</b>		<b>13.105.918</b>	<b>5.144.978</b>	<b>31.528.323</b>	<b>31.034.287</b>	<b>5.839.568</b>	<b>40.334.173</b>	<b>25.222.243</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

		Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres .....	Erl.	105.561.917	9.308.029	46.167.543	-	-
(Abnahme)/Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit .....		(4.630.251)	(2.004.243)	(22.540.350)	158.150	(448.411)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	20.311.209	9.755.364	102.998.326	2.419.917	30.300.000
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	(27.193.585)	(2.816.118)	(17.251.071)	-	-
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen .....		(6.882.376)	6.939.246	85.747.255	2.419.917	30.300.000
<b>Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres .....</b>		<b>94.049.290</b>	<b>14.243.032</b>	<b>109.374.448</b>	<b>2.578.067</b>	<b>29.851.589</b>

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023

## 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

Die Grundsätze wurden, sofern nicht anders angegeben, konsistent auf alle dargestellten Geschäftsjahre angewendet. Die wichtigsten Bilanzierungsgrundsätze und Schätzmethoden, die bei der Aufstellung dieses Abschlusses angewendet wurden, sind im Folgenden dargelegt. Einzelheiten zur Struktur der ICAV sind dem Abschnitt Allgemeine Informationen des Abschlusses zu entnehmen.

Dieser geprüfte Abschluss für die ICAV wurde für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 erstellt.

### a) Grundlage der Aufstellung

Der Abschluss der ICAV wurde gemäß Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), irischem Recht einschließlich des Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 (in seiner jeweils gültigen Fassung) (das „ICAV-Gesetz“) und den OGAW-Vorschriften aufgestellt.

Der Abschluss wurde nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die Neubewertung von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten.

Bei der Aufstellung eines FRS-102-konformen Abschlusses muss die ICAV bestimmte rechnungslegungsrelevante Schätzungen und Annahmen vornehmen. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen und Annahmen abweichen. Der Verwaltungsrat ist überzeugt, dass die zur Aufstellung dieses Abschlusses vorgenommenen Schätzungen angemessen und umsichtig sind. Kritische rechnungslegungsrelevante Schätzungen sind solche, die die komplexesten oder subjektivsten Beurteilungen oder Bewertungen erfordern. Die Tätigkeitsbereiche der ICAV, die in aller Regel solche Schätzungen erfordern, sind die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.

Zuvor ausgewiesene Beträge wurden in bestimmten Fällen umgegliedert, um der Darstellung im laufenden Berichtszeitraum zu entsprechen. Dies hatte jedoch keine Auswirkungen auf das ausgewiesene Nettovermögen.

Der Abschluss wurde für alle Teilfonds mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF auf Basis der Unternehmensfortführung erstellt, da der Verwaltungsrat davon ausgeht, dass die ICAV für zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Abschlusses (der „Bewertungszeitraum“) ihre operative Tätigkeit fortsetzen kann. Der Abschluss für den Franklin European Equity UCITS ETF wurde nicht auf Basis der Unternehmensfortführung erstellt, da dieser Teilfonds am 16. November 2023 den Handel einstellt.

Die ICAV hat von der für offene Investmentfonds nach FRS 102 geltenden Befreiung Gebrauch gemacht und legt keine Kapitalflussrechnung vor.

### Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten

FRS 102, der im Vereinigten Königreich und Irland geltende Rechnungslegungsstandard, schreibt vor, dass ein berichtendes Unternehmen im Rahmen der Bilanzierung seiner Finanzinstrumente entweder a) die vollständigen Vorschriften von Section 11 „Basis Financial Instruments“ (Basis-Finanzinstrumente) und Section 12 „Other Financial Instruments“ (Sonstige Finanzinstrumente) von FRS 102, b) die Ansatz- und Bewertungsvorschriften von IAS 39 „Financial Instruments: Recognition and Measurement“ (Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung) und lediglich die Offenlegungsanforderungen von Section 11 und Section 12 von FRS 102; oder c) die Ansatz- und Bewertungsvorschriften vom International Financial Reporting Standard („IFRS“) 9 „Financial Instruments“ (Finanzinstrumente) und/oder IAS 39 (in der nach Veröffentlichung von IFRS 9 geänderten Fassung) und lediglich die Offenlegungsanforderungen aus Section 11 und Section 12 von FRS 102 anwenden muss. Die ICAV hat sich entschieden, die Ansatz- und Bewertungsvorschriften von IAS 39 und lediglich die Offenlegungsanforderungen aus Section 11 und Section 12 anzuwenden.

### b) Funktionale Währung und Darstellungswährung

Die in den Abschlüssen der einzelnen Teilfonds ausgewiesenen Posten werden in der Währung des primären wirtschaftlichen Umfelds bewertet, in dem der betreffende Teilfonds tätig ist (die „funktionale Währung“). Die funktionale Währung oder Basiswährung der einzelnen Teilfonds ist im Abschnitt Allgemeine Informationen angegeben. Die ICAV verwendet diese funktionalen Währungen auch als Darstellungswährung für die einzelnen Teilfonds.

Transaktionen in Fremdwährungen werden zu dem am Transaktionstag geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zum Bilanzstichtag auf Fremdwährungen lauten, werden zu dem an diesem Tag geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung des Teilfonds umgerechnet.

Auf Fremdwährungen lautende nicht monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden, werden zu dem an dem Tag geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung des Teilfonds umgerechnet, an dem der beizulegende Zeitwert bestimmt wurde.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

### b) Funktionale Währung und Darstellungswährung (Fortsetzung)

Währungsdifferenzen aus der Umrechnung werden in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus der Anlagetätigkeit erfasst, einschließlich der aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Finanzinstrumenten („FVTPL“) entstehenden, die als Komponente des erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert erfassten Nettogewinns/(-verlusts) aus der Anlagetätigkeit ausgewiesen werden.

### c) Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

#### Einstufung

Die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind in zwei Unterkategorien unterteilt: zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten und vom Management beim erstmaligen Ansatz erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesene.

Alle Instrumente in den Vermögensaufstellungen der Teilfonds sind als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet eingestuft. Gewinne und Verluste aus Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der FVTPL-Kategorie werden in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten erfasst.

#### Ansatz und Ausbuchung

##### Ansatz und Erstbewertung

Anlagenkäufe und -verkäufe werden zu dem Tag ausgewiesen, an dem die Transaktion stattgefunden hat (Handelstag), also dem Tag, an dem sich der Teilfonds zum Kauf oder Verkauf des Vermögenswerts verpflichtet. Sonstige finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden zu dem Datum ausgewiesen, zu dem sie entstehen. Anlagen werden beim Erstansatz zum beizulegenden Zeitwert erfasst, und die Transaktionskosten für alle erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert geführten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten werden zum Zeitpunkt ihrer Entstehung erfolgswirksam erfasst. Nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten werden beim Erstansatz zum beizulegenden Zeitwert zuzüglich der Transaktionskosten erfasst, die unmittelbar ihrem Erwerb oder ihrer Ausgabe zuzurechnen sind.

##### Ausbuchung

Anlagen werden ausgebucht, wenn die Rechte auf Erhalt von Zahlungsströmen aus den Anlagen erloschen sind oder der betreffende Teilfonds in Wesentlichen alle Risiken und Chancen, die mit dem Eigentum verbunden sind, übertragen hat. Bei Ausbuchung eines finanziellen Vermögenswerts wird die Differenz zwischen dem Buchwert des Vermögenswerts und des vereinnahmten Gegenwerts in der Gesamtergebnisrechnung mithilfe der Durchschnittskostenmethode verbucht. Finanzielle Verbindlichkeiten werden ausgebucht, wenn die vertraglichen Verpflichtungen abgelöst, aufgehoben oder ausgelaufen sind.

#### Erwartete Kreditverluste

Zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 werden sämtliche Forderungen/Zahlungsmittel bei gut kapitalisierten Gegenparteien gehalten und sind zur Abwicklung innerhalb eines Jahres fällig. Das Management erachtete die Ausfallwahrscheinlichkeit als nahe Null. Demzufolge wurden keine Wertberichtigungen basierend auf den im Zwölfmonatszeitraum erwarteten Kreditverlusten ausgewiesen, da eine derartige Wertminderung für die ICAV gänzlich unbedeutend wäre.

#### Bewertung zum beizulegenden Zeitwert

Der beizulegende Zeitwert ist der Preis, der bei einer ordnungsgemäßen Transaktion zwischen Marktteilnehmern zum Bewertungsdatum auf dem primären oder andernfalls dem günstigsten Markt, zu dem der jeweilige Teilfonds zu diesem Datum Zugang hat, beim Verkauf eines Vermögenswerts erzielt oder bei der Übertragung einer Verbindlichkeit gezahlt würde.

##### i) Wertpapiere

Sofern verfügbar, bewerten die Teilfonds den beizulegenden Zeitwert einer Anlage anhand des notierten Preises auf einem aktiven Markt für das betreffende Instrument. Ein Markt gilt als ‚aktiv‘, wenn Transaktionen in dem Vermögenswert oder der Verbindlichkeit in ausreichender Häufigkeit und ausreichendem Volumen stattfinden, um fortlaufend Preisinformationen bereitzustellen. Die Teilfonds bewerten Instrumente, die an einem aktiven Markt notiert sind, zu dem zuletzt gehandelten Kurs (im Falle von Aktieninstrumenten) und zu mittleren Marktpreisen (im Falle von Unternehmens- und Staatsanleihen), weil diese einen angemessenen Näherungswert für den Veräußerungspreis darstellen.

Liegt kein notierter Preis auf einem aktiven Markt vor, setzt der Teilfonds Bewertungsmethoden ein, die im höchstmöglichen Umfang einschlägige beobachtbare Parameter nutzen und im geringstmöglichen Umfang nicht beobachtbare Parameter. Die gewählte Bewertungsmethode bezieht sämtliche Faktoren ein, die Marktteilnehmer bei der Preisermittlung einer Transaktion berücksichtigen würden. Der Teilfonds verbucht Übertragungen zwischen den Ebenen der Zeitwerthierarchie am Ende des Berichtsjahres, in dem die Veränderung stattgefunden hat.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

### c) Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

#### Bewertung zum beizulegenden Zeitwert (Fortsetzung)

##### ii) Devisenterminkontrakte

Ein Teilfonds kann Devisenterminkontrakte abschließen, um sich gegen Währungsrisiken abzusichern oder im Fall aktiv gemanagter Teilfonds Währungspositionen einzugehen, aus denen die Ansichten der Portfoliomanager hervorgehen. Ein Devisenterminkontrakt ermöglicht den Teilfonds, eine bestimmte Währung an einem künftigen Termin für einen bei Abschluss des Kontrakts festgelegten Kurs zu kaufen oder zu verkaufen. Die Wertentwicklung kann stark von der Wechselkursentwicklung beeinflusst werden, da von einem Teilfonds gehaltene Währungspositionen nicht unbedingt der Währung der Wertpapiere entsprechen, in die er investiert.

Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust aus Devisenterminkontrakten wird aus der Differenz zwischen dem Kontraktpreis und dem Kassakurs am Ende des Berichtszeitraums berechnet. Sämtliche Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts werden in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten erfasst. Realisierte Gewinne und Verluste bei der Fälligkeit von Devisenterminkontrakten werden auf der Grundlage der Kontraktbasis der Anlage in Lokalwährung berechnet und unter den Nettogewinnen/(-verlusten) aus der Anlagetätigkeit erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet in der Gesamtergebnisrechnung erfasst.

##### iii) Terminkontrakte (Futures)

Terminkontrakte (Futures) sind Verpflichtungen zum Kauf oder Verkauf eines bestimmten Finanzinstruments, einer Währung, einer Ware oder eines Index an einem festgesetzten künftigen Termin zu einem festgesetzten Preis und können in bar oder durch einen anderen finanziellen Vermögenswert abgerechnet werden. Terminkontrakte (Futures) sind standardisierte börsengehandelte Kontrakte. Die erforderlichen Einschusszahlungen für Terminkontrakte (Futures) werden in bar oder in anderen Instrumenten geleistet und Wertänderungen von Terminkontrakten täglich abgerechnet.

Tägliche Wertschwankungen eines Terminkontrakts (Futures) werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen, wenn die Position geschlossen wird. Realisierte Gewinne und Verluste werden nach der First-In-First-Out („FIFO“)-Kostenrechnungsmethode verbucht. Sämtliche Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts werden in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten erfasst.

### d) Fortgeführte Anschaffungskosten

Abgesehen von den erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten werden finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten zu fortgeführten Anschaffungskosten gehalten. Die fortgeführten Anschaffungskosten des finanziellen Vermögenswerts oder der finanziellen Verbindlichkeit sind der Betrag, zu dem der finanzielle Vermögenswert oder die finanzielle Verbindlichkeit beim Erstansatz bewertet wurde, abzüglich Tilgungszahlungen zuzüglich bzw. abzüglich der aufgelaufenen Abschreibungen eventueller Differenzen zwischen dem beim Erstansatz verbuchten Betrag und dem Betrag bei Fälligkeit anhand der Effektivzinsmethode abzüglich eventueller Berichtigungen für Wertminderungen.

##### i) Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, Überziehungskredite und Bareinschüsse

Zu den Zahlungsmitteln gehören alle Kontokorrentguthaben bei Banken und Überziehungskredite. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente sind kurzfristige, hoch liquide Anlagen mit einer Laufzeit von höchstens drei Monaten, die leicht in bekannte Barbeträge konvertierbar sind, einem unwesentlichen Wertänderungsrisiko unterliegen und nicht zu Anlagezwecken oder anderen Zwecken, sondern zur Begleichung kurzfristiger Barverpflichtungen gehalten werden. Die Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente werden bei der State Street Custodial Services (Ireland) Limited gehalten und zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Zum 30. Juni 2023 werden Bareinschussalden bei J.P. Morgan gehalten (zum 30. Juni 2022: Bareinschussalden wurden bei J.P. Morgan gehalten) und sind in Erläuterung 7 enthalten. Überziehungskredite werden bei der State Street Custodial Services (Ireland) Limited gehalten und mit ihrem Nennwert bewertet, zusammen mit gegebenenfalls aufgelaufenen Zinsen.

##### ii) Forderungen und Verbindlichkeiten

Der Ansatz von Forderungen erfolgt zum beizulegenden Zeitwert zuzüglich der Transaktionskosten, die unmittelbar ihrem Erwerb zuzurechnen sind. Der erstmalige Ansatz von Verbindlichkeiten erfolgt zum beizulegenden Zeitwert zuzüglich der Transaktionskosten, die unmittelbar ihrem Erwerb zuzurechnen sind. Anschließend werden sie zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

### e) Saldierungsrecht

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten werden nur dann in der Bilanz saldiert und der Nettobetrag bilanziell erfasst, wenn die ICAV oder die Teilfonds gesetzlich zur Saldierung der Beträge berechtigt sind und entweder beabsichtigen, einen Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder mit der Veräußerung des Vermögenswerts gleichzeitig die Verbindlichkeit abzulösen. Erträge und Aufwendungen werden für Gewinne und Verluste aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Finanzinstrumenten und Währungsgewinne und -verluste auf Nettobasis ausgewiesen. Die finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der ICAV sind nicht Gegenstand von saldierenden durchsetzbaren Master-Netting-Vereinbarungen und ähnlichen Vereinbarungen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

### f) Anlageerträge

Die ICAV erhält Anlageerträge aus den gehaltenen Vermögenswerten und Anlagen. Die Bewertung und Darstellung der Ertragsart ist im Folgenden dargestellt:

#### i) Dividendenerträge

Dividendenerträge aus den zugrunde liegenden Aktienanlagen der ICAV werden zum Ex-Dividendendatum als Ertrag des jeweiligen Teilfonds erfasst. Erträge werden vor Abzug nicht erstattungsfähiger Quellensteuern, die in der Gesamtergebnisrechnung separat ausgewiesen werden, und abzüglich etwaiger Steuergutschriften ausgewiesen.

#### ii) Zinserträge/Zinsaufwendungen

Zinserträge/-aufwendungen, die eine etwaige Aufzinsung und Amortisation von Aufgeldern einschließen, werden als Erträge/Aufwendungen des betreffenden Teilfonds der ICAV den vertraglichen Bestimmungen entsprechend in der Gesamtergebnisrechnung auf Effektivzinsbasis ausgewiesen.

### g) Aufwendungen

Alle Aufwendungen werden periodengerecht in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Erläuterung 5 sind zusätzliche Einzelheiten zu den Gebühren und Aufwendungen der Teilfonds zu entnehmen.

Aufwendungen aus der Veräußerung von Anlagen werden von den Veräußerungserlösen abgezogen.

### h) Realisierte Gewinne und Verluste

Realisierte Gewinne und Verluste aus der Veräußerung von Anlagen werden auf der Grundlage der durchschnittlichen Buchwerte der Anlagen in Lokalwährung berechnet und unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten in der Gesamtergebnisrechnung erfasst.

### i) Nicht realisierte Gewinne und Verluste

Nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen stellen die Differenz zwischen den ursprünglichen Kosten der Anlagen und ihrem Wert am Ende des Berichtszeitraums dar und sind unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten in der Gesamtergebnisrechnung erfasst.

### j) Besteuerung

Von den Teilfonds vereinnahmte Dividenden- und Zinserträge können einer im Ursprungsland erhobenen Quellensteuer unterliegen. Anlageerträge werden vor Abzug derartiger Steuern verbucht und die entsprechende Quellensteuer als Steueraufwand ausgewiesen. Forderungen aus Quellensteuerrückforderungen werden in der Bilanz als sonstige Forderungen ausgewiesen.

Viele dieser ausländischen Länder, in denen die Teilfonds anlegen, haben Steuergesetze, die darauf hinweisen, dass Kapitalertragssteuern auf Nichtansässige wie beispielsweise die ICAV anwendbar sein können. Jeder betreffende Teilfonds realisiert Veräußerungsgewinne oder -verluste, wenn er Wertpapiere verkauft. Im Fall von Veräußerungsgewinnen kann der Teilfonds auf diesem zugrunde liegenden Markt einer Kapitalertragssteuer unterliegen.

### k) Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile

Die ICAV gibt rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile in den einzelnen Teilfonds aus, die auf Wunsch des Inhabers zurückgegeben werden können und als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert sind. Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile können gemäß dem Prospekt jederzeit gegen eine Leistung in Form von Barzahlungen, Wertpapieren oder einer Mischung aus Barzahlung und Wertpapieren entsprechend einem proportionalen Anteil des Nettoinventarwertes des Teilfonds an den betreffenden Teilfonds zurückgegeben werden.

Der Nettoinventarwert pro Anteil des Teilfonds wird durch die Division des Nettovermögens, das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, durch die Gesamtzahl der umlaufenden rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile berechnet. Die Bewertung der Anlagepositionen erfolgt nach der im Prospekt festgelegten Bewertungsmethode zur Bestimmung des Nettoinventarwertes pro Anteil für Zeichnungen und Rücknahmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

### l) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind als die Zusatzkosten definiert, die direkt dem Erwerb, der Ausgabe oder Veräußerung eines finanziellen Vermögenswerts oder einer finanziellen Verbindlichkeit zuzurechnen sind. Zusatzkosten sind Kosten, die nicht entstanden wären, wenn das Unternehmen das Finanzinstrument nicht erworben, ausgegeben oder veräußert hätte. Wenn ein finanzieller Vermögenswert oder eine finanzielle Verbindlichkeit erstmalig erfasst wird, bewertet ein Unternehmen sie erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zuzüglich Transaktionskosten, die direkt dem Erwerb oder der Ausgabe des finanziellen Vermögenswertes oder der finanziellen Verbindlichkeit zuzurechnen sind. Die Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe von Wertpapieren und anderen Kapitalanlagen sind in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten enthalten. Separat identifizierbare Transaktionskosten der Verwahrstelle werden von der Verwaltungsgesellschaft über die Gesamtkostenquote (TER) der Teilfonds der ICAV getragen, wie in Erläuterung 5 beschrieben.

### m) Ausschüttungspolitik

Die ICAV kann sowohl ausschüttende Anteilklassen als auch thesaurierende Anteilklassen ausgeben. Der Verwaltungsrat kann für Anteile einer ausschüttenden Klasse Dividenden aus dem Nettoertrag (einschließlich Dividenden- und Zinserträgen) und/oder dem Überschuss realisierter und nicht realisierter Veräußerungsgewinne über realisierte und nicht realisierte Verluste für Anlagen des Teilfonds festsetzen. Für Teilfonds mit thesaurierenden Anteilklassen hat der Verwaltungsrat beschlossen, alle Nettoerträge (einschließlich Dividenden- und Zinserträge) und/oder den Überschuss realisierter und nicht realisierter Veräußerungsgewinne über realisierte und nicht realisierte Verluste für Anlagen des Teilfonds, die solchen thesaurierenden Klassen zuzurechnen sind, zu thesaurieren und daher keine Dividenden für Anteile solcher Klassen festzusetzen.

### n) Wesentliche rechnungslegungsrelevante Schätzungen und Beurteilungen

Kritische rechnungslegungsrelevante Schätzungen sind solche, die die komplexesten oder subjektivsten Beurteilungen oder Bewertungen erfordern. Die Tätigkeitsbereiche der ICAV, die in aller Regel solche Schätzungen erfordern, sind die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts finanzieller Vermögenswerte und finanzieller Verbindlichkeiten wie in Erläuterung 1(a) beschrieben. Bei der Aufstellung dieses Abschlusses vorgenommene Einschätzungen beziehen sich auf die Bestimmung der Unternehmensfortführung, wie in Erläuterung 1 (a) beschrieben, als die Grundlage für die Aufstellung, die funktionale Währung und die Darstellungswährung, wie in Erläuterung 1 (b) beschrieben, Rückstellungen für Kapitalertragssteuern, wie in Erläuterung 1 (j) und Erläuterung 2 angesprochen, und erwartete Kreditverluste, wie in Erläuterung 1 (c) beschrieben.

Bei der Aufstellung dieses Abschlusses angewandte wesentliche rechnungslegungsrelevante Schätzungen beziehen sich auf die beizulegenden Zeitwerte von Anlagen. Einzelheiten zu speziellen, in diesem Abschluss angewandten Schätzungen sind in Erläuterung 6 (f) enthalten. Rechnungslegungsrelevante Schätzungen und zugrunde liegende Annahmen werden fortlaufend überprüft. Berichtigungen von Schätzungen für die Rechnungslegung werden in der Periode erfasst, in der die Schätzung berichtigt wird, sofern sich die Berichtigung nur auf diese Periode auswirkt, oder in der Periode der Berichtigung und künftigen Perioden, sofern sich die Berichtigung sowohl auf die aktuelle als auch auf zukünftige Perioden auswirkt.

### Bewertung zum beizulegenden Zeitwert von Derivaten und nicht an einem aktiven Markt notierten Anlagen

Die Teilfonds halten Anlagen, die nicht an aktiven Märkten notiert sind, einschließlich derivativer Finanzinstrumente. Der beizulegende Zeitwert solcher Instrumente wird anhand von Bewertungstechniken ermittelt und kann anhand seriöser Preisquellen (wie Preisbildungsstellen) oder indikativer Preise von Marktmachern (Market Makers) bestimmt werden. Preisnotierungen von Maklern, wie sie von den Preisquellen bezogen werden, sind unter Umständen exemplarisch und weder ausführbar noch verbindlich. Wenn keine Marktdaten verfügbar sind, kann die ICAV Positionen anhand ihrer eigenen Modelle bewerten, die in der Regel auf als Standard in der Branche allgemein anerkannten Bewertungsmethoden und -techniken basieren. Die zur Ermittlung von beizulegenden Zeitwerten angewandten Modelle werden von erfahrenen Mitarbeitern der Anlageverwalter validiert und regelmäßig überprüft, unabhängig von der Partei, die sie entwickelt hat.

Modelle verwenden, soweit praktikabel, nachvollziehbare Daten. Bereiche wie Kreditrisiko (sowohl das eigene als auch das von Gegenparteien), Volatilitäten und Korrelationen erfordern jedoch, dass die Anlageverwalter Schätzungen vornehmen. Änderungen in den Annahmen zu diesen Faktoren könnten die ausgewiesenen beizulegenden Zeitwerte von Anlagen beeinflussen. Die Teilfonds erachten als beobachtbare Daten Marktdaten, die jederzeit verfügbar sind, regelmäßig veröffentlicht und aktualisiert werden, verlässlich und überprüfbar und nicht geschützt sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt werden, die aktiv mit dem betreffenden Markt beschäftigt sind.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

### o) Ertragsausgleich

Ertragsausgleichsbestimmungen gelten für jeden Teilfonds. Die Bestimmungen sollen gewährleisten, dass der Ertrag je Anteil, der hinsichtlich des Ausschüttungszeitraums ausgeschüttet wird, nicht durch die im Geschäftsjahr im Umlauf befindliche Anzahl von Anteilen beeinträchtigt wird. Die Bestimmungen haben keine Auswirkungen auf den NIW von Anteilklassen. Die Berechnung des Ausgleichs erfolgt auf Grundlage des insgesamt aufgelaufenen, nicht ausgeschütteten Nettoertrags. Der Ertragsausgleich ist in den Erlösen aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile und Zahlungen für die Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile in der Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens enthalten.

## 2. Besteuerung

Die ICAV ist eine Investmentgesellschaft im Sinne von Section 739B des Taxes Consolidation Act (Steuerkonsolidierungsgesetz) von 1997 in seiner jeweils gültigen Fassung (das „TCA“). Auf dieser Grundlage ist die ICAV in Irland für ihre Erträge und Gewinne nicht steuerpflichtig, sofern die ICAV im steuerlichen Sinn in Irland ansässig ist. Die ICAV gilt als im steuerlichen Sinn in Irland ansässig, sofern sie von der irischen Zentralbank zugelassen ist und in Irland zentral verwaltet und gesteuert wird.

Eine irische Steuer kann jedoch bei Eintritt eines „steuerpflichtigen Ereignisses“ in der ICAV anfallen. Ein steuerpflichtiges Ereignis tritt bei einer Ausschüttung oder bei Rücknahme, Rückkauf, Annullierung oder Übertragung von Anteilen oder am Ende eines „maßgeblichen Zeitraums“ ein. Der Begriff „maßgeblicher Zeitraum“ bezeichnet einen achtjährigen Zeitraum, der mit dem Erwerb eines Anteils durch einen Anteilinhaber beginnt, und jeden Folgezeitraum von acht Jahren, der unmittelbar nach dem vorherigen maßgeblichen Zeitraum beginnt. Ein steuerpflichtiges Ereignis beinhaltet nicht:

- (i) Transaktionen in Bezug auf Anteile, die in einem anerkannten Clearing-System gehalten werden, das von den irischen Steuerbehörden anerkannt wird; oder
- (ii) einen Austausch von Anteilen, die einen Teilfonds repräsentieren, gegen einen anderen Teilfonds der ICAV; oder
- (iii) einen Austausch von Anteilen, der sich aus einem zulässigen Zusammenschluss oder einer zulässigen Umstrukturierung der ICAV mit einem anderen Fonds ergibt; oder
- (iv) bestimmte Austausche von Anteilen zwischen Ehepartnern und ehemaligen Ehepartnern.

Keine irische Steuer fällt an für steuerpflichtige Ereignisse für einen Anteilinhaber, bei dem es sich um einen steuerbefreiten irischen Anleger (wie in Section 739D TCA definiert) handelt oder für einen Anteilinhaber, der zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses weder in Irland ansässig ist noch seinen gewöhnlichen Aufenthalt in Irland hat, vorausgesetzt, dass eine maßgebliche Erklärung (gemäß Schedule 2B des TCA) vorliegt und sich die ICAV nicht im Besitz von Informationen befindet, die nach billigem Ermessen vermuten lassen, dass die darin enthaltenen Angaben im Wesentlichen nicht mehr zutreffen.

Liegt keine ordnungsgemäße Erklärung vor, ist die ICAV bei Eintritt eines steuerpflichtigen Ereignisses in Irland steuerpflichtig. Die ICAV behält sich das Recht vor, solche Steuern von den betreffenden Anteilhabern einzubehalten. Im Berichtszeitraum gab es keine steuerpflichtigen Ereignisse.

Die ICAV ist verpflichtet, eine Steuerschuld anzusetzen, wenn es wahrscheinlich ist, dass die Steuergesetze anderer Länder eine Steuerschuld auf die Kapitalerträge des Teilfonds aus solch einem Land erheben, sofern die zuständigen Steuerbehörden alle Tatsachen und Umstände vollständig kennen. Die Steuerschuld wird dann zu dem Betrag bewertet, der voraussichtlich an die zuständigen Steuerbehörden gezahlt wird. Dabei werden die Steuergesetze und -sätze zugrunde gelegt, die bis zum Ende des Berichtszeitraums gelten oder in Kürze gelten werden. Die Anwendung des geltenden Steuerrechts auf Offshore-Investmentfonds ist bisweilen unklar. Dies führt zu Unsicherheit darüber, ob eine Steuerschuld letztendlich vom Fonds bezahlt wird oder nicht. Daher berücksichtigt das Management bei der Bewertung ungewisser Steuerverbindlichkeiten alle zum Zeitpunkt der Feststellung verfügbaren relevanten Fakten und Umstände, die die Wahrscheinlichkeit einer Zahlung beeinflussen könnten, einschließlich aller formellen oder informellen Praktiken der zuständigen Steuerbehörden.

(Gegebenenfalls) erzielte Dividenden, Zinsen und Veräußerungsgewinne aus Anlagen der ICAV können in den Ländern, in denen die Anlageerträge/Gewinne erzielt werden, Quellensteuern unterliegen. Die ICAV und ihre Anteilinhaber haben möglicherweise keinen Anspruch auf Erstattung dieser Steuern. Quellensteuern und für Dividenden erfolgte Erstattungen werden am Ex-Tag verbucht. Dividendenforderungen werden gegebenenfalls abzüglich zahlbarer Quellensteuern in der Bilanz ausgewiesen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 2. Besteuerung (Fortsetzung)

Die ICAV kann Steuern unterliegen, die von bestimmten anderen Ländern, in denen die ICAV investiert, auf realisierte und nicht realisierte Gewinne aus Wertpapieren erhoben werden. Anlageerträge/Gewinne werden vereinnahmt, und die ICAV oder ihre Anteilinhaber haben möglicherweise keinen Anspruch auf Erstattung dieser Steuern. Viele dieser Länder haben Steuergesetze, nach denen Kapitalertragsteuern auf Nichtansässige, wie z. B. die ICAV, anwendbar sein können. Typischerweise sind diese Kapitalertragsteuern auf der Grundlage der Selbstveranlagung zu ermitteln. Aus diesem Grund dürfen diese Steuern vom Makler der ICAV nicht auf der Grundlage der „Einbehaltung“ abgezogen werden. Der ausländische Steueraufwand wird gegebenenfalls periodengerecht ausgewiesen und unter „Kapitalertragsteuern“ in der Gesamtergebnisrechnung erfasst. Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 bzw. zum 30. Juni 2022 fielen Kapitalertragsteuern für Gewinne in Bezug auf den FTSE Brazil UCITS ETF, den FTSE India UCITS ETF, den Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF, den Franklin Emerging Markets UCITS ETF, den Franklin Global Dividend UCITS ETF und den Franklin Global Equity SRI UCITS ETF an. Der im Ausland geschuldete Steuerbetrag wird gegebenenfalls unter „Verbindlichkeiten aus Kapitalertragssteuern“ in der verkürzten Bilanz erfasst. Veräußerungsgewinne, Dividenden und Zinsen, die vereinnahmt werden, können im Ursprungsland Quellensteuern unterliegen. Die ICAV oder ihre Anteilinhaber haben möglicherweise keinen Anspruch auf Erstattung dieser Steuern. Die Quellensteuerbelastung auf Dividenden für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 ist in der Gesamtergebnisrechnung angegeben. Die für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 zu zahlende Kapitalertragsteuer auf nicht realisierte Gewinne ist in der Bilanz dargestellt.

Die ICAV betrachtet Zinsen und Strafen für mit ihnen zusammenhängende Steuerverbindlichkeiten als untrennbares Element der Steuerschuld und bilanziert Zinsen und Strafen. Diese Beträge würden in der Gesamtergebnisrechnung in der Steuerzeile und die etwaigen Verbindlichkeit in der Einkommenssteuerverbindlichkeit in der Bilanz enthalten sein.

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 bzw. zum 30. Juni 2022 hat die ICAV ungewisse Steuerverbindlichkeiten und damit verbundene Zinsen und Strafen in Bezug auf ausländische Kapitalertragsteuern mit null bewertet. Dies stellt die bestmögliche Schätzung des Managements dar, doch kann der geschätzte Wert erheblich von dem letztlich zu zahlenden Betrag abweichen.

### Status als meldepflichtiger Fonds

Die ICAV hat eine Bestätigung von der britischen Steuer- und Zollbehörde (HM Revenue & Customs (HMRC)) erhalten, dass ihr mit Wirkung ab den Auflegungsdaten aller Teilfonds im Sinne des britischen Steuerrechts in Großbritannien der Status als meldepflichtiger Fonds (UK Reporting Fund Status) zuerkannt wurde.

## 3. Anteilkapital und Nettoinventarwert pro Anteil

### Genehmigt

Das genehmigte Anteilkapital der ICAV besteht aus 500.000.000.002 nennwertlosen Anteilen, unterteilt in 2 nennwertlose Zeichneranteile und 500.000.000.000 nennwertlose rückkaufbare, gewinnberechtigende Anteile. Der Verwaltungsrat kann alle Anteile der ICAV zu den von ihm als angemessen erachteten Bedingungen ausgeben.

### Zeichneranteile

Die ICAV hat die 2 nennwertlosen Zeichneranteile zu jeweils 1 EUR zum Zweck der Registrierung der ICAV ausgegeben. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zur Teilnahme an und Stimmabgabe auf Generalversammlungen der ICAV, berechtigen die Inhaber jedoch nicht zur Beteiligung an Gewinnen oder Vermögenswerten der ICAV, es sei denn, es handelt sich um eine Kapitalrückzahlung bei einer Abwicklung. Die Anteile sind nicht Teil des Nettoinventarwerts der ICAV und werden im Abschluss nur in dieser Erläuterung erwähnt.

### Rückkaufbare, gewinnberechtigende Anteile

Jeder Anteil berechtigt den Inhaber zur Teilnahme an und Stimmabgabe auf Generalversammlungen der ICAV sowie zur Beteiligung an den Gewinnen und Vermögenswerten des Teilfonds in gleichem Umfang, auf den sich die Anteile beziehen, vorbehaltlich etwaiger Unterschiede bei Gebühren, Kosten und Aufwendungen, die für unterschiedliche Klassen gelten. Jeder Anteilinhaber hat für jeden ganzen von ihm gehaltenen Anteil eine Stimme. Die Haftung der Anteilinhaber beschränkt sich gegebenenfalls auf den für jeweils von ihnen gehaltene Anteile nicht eingezahlten Betrag, und die Anteilinhaber haften nicht für die Schulden des Teilfonds. Die Mindestbeträge für die Begebung und Rücknahme sind im jeweiligen Prospektnachtrag für die einzelnen Teilfonds angegeben.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2023 wie folgt dar:

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE China UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE India UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF* EUR Thesaurierende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	1.400.000	9.000.000	4.050.000	10.200.000	100.000	3.740.000	-
Ausgegebene Anteile .....	300.000	4.600.000	3.800.000	4.200.000	100.000	9.530.000	2.005.887
Zurückgenommene Anteile .....	(400.000)	(1.800.000)	(100.000)	(300.000)	-	(1.380.000)	(88.871)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	1.300.000	11.800.000	7.750.000	14.100.000	200.000	11.890.000	1.917.016
Nettoinventarwert .....	32.741.984	261.731.948	265.253.700	449.724.207	4.679.824	258.827.787	47.956.609
Nettoinventarwert pro Anteil .....	25,19	22,18	34,22	31,90	23,40	21,77	25,02
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	6.298.521	107.267.570	125.823.559	124.570.167	2.357.249	209.508.367	50.703.225
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	(8.650.643)	(47.269.211)	(3.343.507)	(8.789.923)	-	(30.073.807)	(2.246.477)

\* Die Anteilklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten vorliegen. Das Auflegungsdatum dieser Anteilklasse ist Erläuterung 15 zu entnehmen.



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2023 wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin European Equity UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	26.920.000	550.000	250.000	1.400.000	1.250.000	200.000	1.400.000
Ausgegebene Anteile .....	7.170.000	-	250.000	200.000	750.000	50.000	400.000
Zurückgenommene Anteile .....	(15.560.000)	(150.000)	-	-	(100.000)	(100.000)	(200.000)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	18.530.000	400.000	500.000	1.600.000	1.900.000	150.000	1.600.000
Nettoinventarwert .....	463.551.668	9.339.124	10.471.174	38.245.227	46.531.029	5.034.077	47.578.786
Nettoinventarwert pro Anteil.....	25,02	23,35	20,94	23,90	24,49	33,56	29,74
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	179.687.680	-	5.046.944	4.700.126	18.829.312	1.556.647	11.580.847
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	(389.382.773)	(3.537.116)	-	-	(2.538.367)	(3.218.221)	(5.976.401)

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2023 wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Metaverse UCITS ETF** USD Thesaurierende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	800.000	2.250.000	500.000	3.700.000	100.000	1.200.000	-
Ausgegebene Anteile .....	400.000	900.000	400.000	2.150.000	700.000	1.750.000	100.000
Zurückgenommene Anteile .....	(400.000)	(450.000)	-	(1.500.000)	-	(600.000)	-
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	800.000	2.700.000	900.000	4.350.000	800.000	2.350.000	100.000
Nettoinventarwert .....	28.261.914	128.590.716	30.278.221	155.787.778	16.206.086	62.138.093	2.909.471
Nettoinventarwert pro Anteil.....	35,33	47,63	33,64	35,81	20,26	26,44	29,09
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	12.758.923	39.525.865	12.497.982	67.841.349	15.327.820	42.482.473	2.385.366
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	(13.441.691)	(20.550.680)	-	(45.129.558)	-	(15.733.964)	-

\*\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilsklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2023 wie folgt dar: (Fortsetzung)

	<b>Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF** USD Thesaurierende Anteile</b>
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	-
Ausgegebene Anteile .....	200.000
Zurückgenommene Anteile .....	-
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	200.000
Nettoinventarwert .....	5.078.124
Nettoinventarwert pro Anteil.....	<u>25,39</u>
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	4.962.663
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	-

\*\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2022 wie folgt dar:

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE China UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE India UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	900.000	5.000.000	2.250.000	14.900.000	-	4.060.000	2.390.000
Ausgegebene Anteile .....	900.000	5.200.000	1.800.000	700.000	100.000	1.720.000	24.530.000
Zurückgenommene Anteile .....	(400.000)	(1.200.000)	-	(5.400.000)	-	(2.040.000)	-
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	1.400.000	9.000.000	4.050.000	10.200.000	100.000	3.740.000	26.920.000
Nettoinventarwert .....	27.282.986	241.165.019	122.416.418	291.261.525	2.082.954	83.936.003	672.845.051
Nettoinventarwert pro Anteil.....	19,49	26,80	30,23	28,56	20,83	22,44	24,99
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	18.922.112	158.463.210	58.959.850	28.153.790	2.559.376	43.005.516	616.091.440
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	(8.576.144)	(33.146.387)	-	(212.249.826)	-	(51.604.984)	-

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2022 wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin European Equity UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	600.000	250.000	1.400.000	900.000	300.000	1.200.000	600.000
Ausgegebene Anteile .....	200.000	-	-	550.000	-	2.200.000	200.000
Zurückgenommene Anteile .....	(250.000)	-	-	(200.000)	(100.000)	(2.000.000)	-
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	550.000	250.000	1.400.000	1.250.000	200.000	1.400.000	800.000
Nettoinventarwert .....	13.105.918	5.144.978	31.528.323	31.034.287	5.839.568	40.334.173	25.222.243
Nettoinventarwert pro Anteil.....	23,83	20,58	22,52	24,83	29,20	28,81	31,53
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	5.636.533	-	-	14.325.318	-	74.124.771	7.062.064
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	(7.104.476)	-	-	(5.195.223)	(3.070.358)	(63.453.318)	-

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2022 wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	2.400.000	300.000	1.350.000	-	-
Ausgegebene Anteile .....	450.000	300.000	2.850.000	100.000	1.200.000
Zurückgenommene Anteile .....	(600.000)	(100.000)	(500.000)	-	-
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	2.250.000	500.000	3.700.000	100.000	1.200.000
Nettoinventarwert .....	94.049.290	14.243.032	109.374.448	2.578.067	29.851.589
Nettoinventarwert pro Anteil.....	41,80	28,49	29,56	25,78	24,88
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	20.311.209	9.755.364	102.998.326	2.419.917	30.300.000
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	(27.193.585)	(2.816.118)	(17.251.071)	-	-

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2021 wie folgt dar:

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE China UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE India UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	600.000	800.000	450.000	5.700.000	960.000	1.340.000	650.000
Ausgegebene Anteile .....	300.000	4.200.000	1.800.000	13.800.000	3.170.000	1.140.000	200.000
Zurückgenommene Anteile .....	-	-	-	(4.600.000)	(70.000)	(90.000)	(250.000)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	900.000	5.000.000	2.250.000	14.900.000	4.060.000	2.390.000	600.000
Nettoinventarwert .....	23.126.963	194.635.130	71.655.374	686.930.045	107.825.739	59.822.188	17.096.172
Nettoinventarwert pro Anteil.....	25,70	38,93	31,85	46,10	26,56	25,03	28,49
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	6.272.451	167.713.150	53.442.066	508.809.729	84.797.541	28.532.972	5.751.510
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	-	-	-	(206.713.372)	(1.858.049)	(2.248.444)	(7.227.750)

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2021 wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin European Equity UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	250.000	1.800.000	500.000	300.000	1.000.000	600.000	1.450.000
Ausgegebene Anteile .....	-	-	1.000.000	-	600.000	200.000	1.600.000
Zurückgenommene Anteile .....	-	(400.000)	(600.000)	-	(400.000)	(200.000)	(650.000)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	250.000	1.400.000	900.000	300.000	1.200.000	600.000	2.400.000
Nettoinventarwert .....	5.862.137	39.697.532	22.956.014	9.495.587	37.888.805	22.355.251	105.561.917
Nettoinventarwert pro Anteil.....	23,45	28,36	25,51	31,65	31,57	37,26	43,98
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	-	-	23.233.545	-	17.405.696	6.517.769	60.895.919
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	-	(10.846.203)	(14.984.457)	-	(11.483.081)	(6.107.111)	(24.639.894)



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2021 wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF* EUR Thesaurierende Anteile	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	-	-
Ausgegebene Anteile .....	300.000	2.050.000
Zurückgenommene Anteile .....	-	(700.000)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile .....	300.000	1.350.000
Nettoinventarwert .....	9.308.029	46.167.543
Nettoinventarwert pro Anteil.....	<u>31,03</u>	<u>34,20</u>
Begebungen während des Geschäftsjahres .....	8.083.673	61.250.388
Rücknahmen während des Geschäftsjahres .....	-	(21.141.027)

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2020 aufgelegt.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 4. Nettogewinn/(-verlust) aus der Anlagetätigkeit

<b>Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023</b>	<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin FTSE China UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin FTSE India UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR</b>	<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR</b>
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	(1.212.954)	(15.184.902)	151.271	(5.647.764)	(1.418)	(3.517.589)	(230.952)
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	6.239.182	(28.929.757)	21.035.071	40.630.869	141.058	(3.935.415)	41.990
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	5.026.228	(44.114.659)	21.186.342	34.983.105	139.640	(7.453.004)	(188.962)

<b>Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023</b>	<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin European Dividend UCITS ETF EUR</b>	<b>Franklin European Equity UCITS ETF EUR</b>	<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF USD</b>	<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD</b>
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	(1.420.636)	(337.438)	(1.348.022)	(333.567)	347.000	(1.163.256)	337.495
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	1.131.911	228.810	1.422.857	(670.614)	272.992	2.845.756	2.643.495
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	(288.725)	(108.628)	74.835	(1.004.181)	619.992	1.682.500	2.980.990

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 4. Nettogewinn/(-verlust) aus der Anlagetätigkeit (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Metaverse UCITS ETF* USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	2.710.423	(178.495)	(10.671.448)	(221.586)	515.828	128.279	14.905
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	10.621.167	3.128.343	32.960.541	(1.590.965)	2.315.596	391.945	68.192
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	13.331.590	2.949.848	22.289.093	(1.812.551)	2.831.424	520.224	83.097

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 4. Nettogewinn/(-verlust) aus der Anlagetätigkeit (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	(206.293)	(20.002.620)	804.475	22.399.606	(1.501)	(2.824.359)	2.932.504
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	(8.838.815)	(62.563.606)	(10.871.038)	(241.392.060)	(498.144)	(12.856.007)	(7.531.508)
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	(9.045.108)	(82.566.226)	(10.066.563)	(218.992.454)	(499.645)	(15.680.366)	(4.599.004)

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	111.048	53.518	933.784	1.096.943	696.385	1.499.622	177.861
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	(2.622.654)	(982.763)	(10.858.829)	(2.106.021)	(1.543.125)	(9.866.208)	(4.878.885)
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	(2.511.606)	(929.245)	(9.925.045)	(1.009.078)	(846.740)	(8.366.586)	(4.701.024)

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 4. Nettogewinn/(-verlust) aus der Anlagetätigkeit (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*
Gewinn/(Verlust) aus:					
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	6.937.412	(246.272)	2.910.283	5.265	(133.115)
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) aus Anlagen und Fremdwährungen .....	(13.197.627)	(2.153.644)	(26.413.763)	139.577	(320.839)
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	(6.260.215)	(2.399.916)	(23.503.480)	144.842	(453.954)

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 5. Betriebliche Aufwendungen

### a) Gesamtkostenquote („TER“)

Alle im Zusammenhang mit einem Teilfonds zahlbaren Gebühren und Aufwendungen werden als Pauschalgebühr gezahlt. Diese wird als Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, „TER“) bezeichnet. Aus der TER werden folgende Gebühren und Aufwendungen bestritten:

- die Gebühren und Aufwendungen der Verwaltungsgesellschaft, des Abschlussprüfers, des Anlageverwalters (einschließlich der Kosten und Aufwendungen für einen vom Anlageverwalter bestellten Anlageberater), der Rechtsberater, des Gesellschaftssekretärs, der Verwaltungsratsmitglieder (siehe Seite 85 für Einzelheiten zu den gezahlten Honoraren), des Verwalters und der Verwahrstelle;
- die Kosten für die Registrierung eines Teilfonds zum Vertrieb in einer Rechtsordnung sowie der Zulassung und der Aufrechterhaltung der Zulassung von Anteilen zur Notierung an einer Börse;
- Kosten für das Einberufen und Abhalten von Versammlungen des Verwaltungsrats und der Anteilinhaber;
- Honorare und Ausgaben für Rechtsberatung und anderweitige Beratungsdienste;
- die Kosten und Aufwendungen für die Erstellung, den Druck, die Veröffentlichung und das Verteilen der Prospekte, Prospektnachträge, Jahres- und Halbjahresberichte und aller anderen Dokumente an aktuelle und potenzielle Anleger;
- die Kosten und Aufwendungen für die Lizenzierung oder andere zahlbare Gebühren an einen Indexanbieter oder anderen Lizenzgeber von geistigem Eigentum, Handels- oder Dienstleistungsmarken zur Nutzung durch die ICAV;
- die Gebühren lokaler Zahl-, Zentralisierungs-, Register- oder sonstiger Stellen (die handelsüblichen Sätzen entsprechen müssen);
- sämtliche Gründungskosten des Fonds und der Teilfonds sowie
- die sonstigen Kosten und Aufwendungen (ohne einmalige und außerordentliche Kosten und Aufwendungen), die von Zeit zu Zeit anfallen können und die durch den Verwaltungsrat als für den fortgesetzten Betrieb der ICAV oder eines Teilfonds als notwendig oder angemessen genehmigt wurden.

Die TER umfasst keine außerordentlichen Kosten und auch nicht bestimmte Transaktionskosten (insbesondere Transaktionsgebühren, Stempelsteuern oder sonstige Steuern auf die Anlagen des Fonds einschließlich der Abgaben und Kosten für die Neugewichtung des Portfolios, Quellensteuern, Provisionen und Maklergebühren, die im Zusammenhang mit den Anlagen des Fonds entstehen, Zinsen auf Kredite und anfallende Bankgebühren für die Verhandlung, Ausarbeitung oder Änderung der Bedingungen für diese Kredite, aller Provisionen von Finanzintermediären im Zusammenhang mit einer Anlage in den Teilfonds und (gegebenenfalls) der außerordentlichen oder außergewöhnlichen Kosten und Aufwendungen, die jeweils entstehen können, etwa durch wesentliche Rechtsstreitigkeiten im Zusammenhang mit einem Teilfonds, die jeweils separat aus dem Vermögen des jeweiligen Teilfonds bezahlt werden). Vorbehaltlich geltender Gesetze und Vorschriften kann die Verwaltungsgesellschaft oder der Anlageverwalter einen Teil oder alle ihrer/seiner Gebühren an jede Person zahlen, die in die ICAV oder in einen Teilfonds investiert oder dieser/diesem Dienstleistungen erbringt.

Die TER wird täglich aus dem Nettoinventarwert der einzelnen Teilfonds berechnet und abgegrenzt und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die TER der einzelnen Teilfonds der ICAV ist im betreffenden Prospektnachtrag angegeben. Überschreiten die Kosten eines Teilfonds die TER im Zusammenhang mit dem Betrieb des betreffenden Teilfonds, so begleicht die Verwaltungsgesellschaft alle Fehlbeträge aus ihrem eigenen Vermögen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 5. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

### a) Gesamtkostenquote („TER“) (Fortsetzung)

Die für die einzelnen Teilfonds zahlbare TER ist nachstehend aufgeführt.

Teilfonds	Anteilklasse	TER	TER
		(% des NIW) 30. Juni 2023	(% des NIW) 30. Juni 2022
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,19 %	0,19 %
Franklin FTSE China UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,19 %	0,19 %
Franklin FTSE India UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,19 %	0,19 %
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,09 %	0,09 %
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,19 %	0,19 %
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	Anteile EUR Accumulating	0,18 %	0,30 %
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	Anteile EUR Distributing *	0,05 %	-
	Anteile EUR Distributing	0,05 %	0,05 %
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Anteile USD Distributing	0,35 %	0,35 %
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,40 %	0,40 %
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,45 %	0,45 %
Franklin European Dividend UCITS ETF	Anteile EUR Distributing	0,25 %	0,25 %
Franklin European Equity UCITS ETF	Anteile EUR Accumulating	0,25 %	0,25 %
Franklin Global Dividend UCITS ETF	Anteile USD Distributing	0,45 %	0,45 %
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,40 %	0,40 %
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,25 %	0,25 %
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Anteile EUR Accumulating	0,15 %	0,15 %
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,07 %	0,07 %
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,22 %	0,22 %
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	Anteile USD Accumulating	0,35 %	0,35 %
Franklin Metaverse UCITS ETF**	Anteile USD Accumulating	0,30 %	-
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF**	Anteile USD Accumulating	0,18 %	-

\* Die Anteilklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten vorliegen. Das Auflegungsdatum dieser Anteilklasse ist Erläuterung 15 zu entnehmen.

\*\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

### Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 erhielten die Verwaltungsratsmitglieder Honorare in Höhe von 88.293 EUR (30. Juni 2022: 75.000 EUR). Diese Honorare wurden gezahlt. Die Franklin Templeton Gruppe stellt Mitarbeitende zur Verfügung, die als Verwaltungsratsmitglieder der ICAV tätig sind (diese Verwaltungsratsmitglieder erhalten kein Honorar). Die Gesamtvergütung der Verwaltungsratsmitglieder übersteigt nicht 100.000 EUR pro Jahr und Verwaltungsratsmitglied (oder einen entsprechenden Betrag) (oder eine andere Summe, die der Verwaltungsrat bisweilen festlegen und den Anteilhabern mitteilen kann).

### Vergütung des unabhängigen Abschlussprüfers

Die Vergütung für alle seitens der Wirtschaftsprüfungsgesellschaft für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2023 bzw. 30. Juni 2022 durchgeführten Arbeiten beträgt:

	30. Juni 2023 EUR	30. Juni 2022 EUR
Gesetzlich vorgeschriebene Abschlussprüfung	175.780	163.600
Insgesamt	175.780	163.600

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 5. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

### Vergütung des unabhängigen Abschlussprüfers (Fortsetzung)

Die in vorstehender Tabelle angegebenen Gebühren für die gesetzlich vorgeschriebene Abschlussprüfung verstehen sich ohne Mehrwertsteuer und einschließlich Auslagen und Spesen. Die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen Prüfungsgebühren verstehen sich einschließlich Mehrwertsteuer. Für das aktuelle oder das vorherige Geschäftsjahr wurden keine Gebühren für sonstige Prüfungsleistungen oder sonstige prüfungsunabhängige Leistungen berechnet.

### Transaktionskosten

Transaktionskosten sind alle Kosten und Aufwendungen, die für den Kauf und Verkauf der von den Teilfonds gehaltenen Anlagen anfallen, z. B. Maklerkosten und Provisionen und Korrespondenzgebühren für die Übertragung von Wertpapieren, Anlagen oder anderen Beteiligungen, sofern in den jeweiligen Prospektnachträgen nicht anders angegeben.

Transaktionskosten beim Kauf und Verkauf von Aktienanlagen und Terminkontrakten während des Geschäftsjahres werden erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten ausgewiesen. Transaktionskosten beim Kauf und Verkauf von Unternehmensanleihen und Staatsanleihen sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Sie können in der Praxis nicht zuverlässig erfasst werden, da sie in die Anlagekosten eingebettet sind, und sie können nicht gesondert überprüft oder ausgewiesen werden. Separat identifizierbare Transaktionskosten der Verwahrstelle werden von der Verwaltungsgesellschaft über die Gesamtkostenquote (TER) der Teilfonds der ICAV getragen.

Den Teilfonds sind im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 insgesamt die folgenden Transaktionskosten angefallen:

Teilfonds	Währung	30. Juni 2023 Kosten	30. Juni 2022 Kosten
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	6.794	10.496
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	36.689	61.662
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	31.170	16.200
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	42.087	71.186
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	681	652
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	1.550	1.161
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	12.863	9.829
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	-	-
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	USD	1.836	789
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	8.013	8.252
Franklin European Dividend UCITS ETF	EUR	2.296	2.518
Franklin European Equity UCITS ETF	EUR	666	738
Franklin Global Dividend UCITS ETF	USD	4.327	27.611
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	3.964	2.107
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	2.665	4.470
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	1.564	1.862
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	6.817	10.613
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	3.813	677
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	-	-
Franklin Metaverse UCITS ETF*	USD	597	-
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*	USD	3.369	-

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement

### Einleitung und Überblick

Jeder Teilfonds der Franklin Templeton ICAV ist bei der Verfolgung seines erklärten Anlageziels und seiner Anlagepolitik einer Vielzahl finanzieller Risiken ausgesetzt, wie z. B.: Kredit- und Gegenparteiisiko, Liquiditätsrisiko und Marktrisiko (das wiederum das Währungsrisiko, Zinsrisiko und Preisrisiko beinhaltet). Die ICAV geht bestimmte dieser Risiken ein, um Anlageerträge aus ihrem Portfolio zu erzielen, obwohl diese Risiken auch zu einer Verringerung des Nettovermögens der ICAV führen können. Der Anlageverwalter bemüht sich nach besten Kräften, potenziell nachteilige Effekte dieser Risiken auf die Wertentwicklung der ICAV möglichst gering zu halten und die Anlagen der ICAV dabei dennoch so zu verwalten, wie es den Anlagezielen und der Anlagepolitik der ICAV entspricht.

Die Fähigkeit eines indexnachbildenden Teilfonds (die Palette der Teilfonds Franklin und Franklin FTSE), eine wesentliche Korrelation zwischen seiner Wertentwicklung und dem Index, den er nachbildet, zu erzielen, kann durch Veränderungen auf den Wertpapiermärkten, Veränderungen in der Zusammensetzung des Index, Zuflüsse in und Abflüsse aus dem Teilfonds und die Gebühren und Aufwendungen des Teilfonds beeinflusst werden. Der Teilfonds wird ungeachtet der aktuellen oder erwarteten Wertentwicklung des Index oder der Wertpapiere, die den Index bilden, versuchen, die Indexrenditen nachzubilden. Infolgedessen kann die Wertentwicklung des Teilfonds geringer sein als die eines anhand einer aktiven Anlagestrategie verwalteten Portfolios. Die Struktur und Zusammensetzung des Index wird sich auf die Wertentwicklung, die Volatilität und das Risiko des Index (auf absoluter Basis und im Vergleich mit anderen Indizes) und damit auf die Wertentwicklung, die Volatilität und das Risiko des Teilfonds auswirken.

Für Teilfonds mit aktiv gemanagten Anlagen (gemäß Angabe im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ auf Seite 6) setzt der Anlageverwalter einen Investmentansatz ein, der in aller Regel Research wie fundamentale Analysen, mikro- und makroökonomische Analysen und/oder technische Analysen beinhaltet und nicht auf das Erzielen der Wertentwicklung eines Index ausgerichtet ist, weil er davon ausgeht, dass mit der aktiven Auswahl von Anlagen bessere Ergebnisse zu erzielen sind als durch ein marktbreites Engagement. Solche Teilfonds können Verluste erleiden, wenn sich das Urteil des Anlageverwalters über Märkte, künftige Volatilität, Zinsen, Branchen, Sektoren und Regionen oder die Attraktivität, die relativen Werte, die Liquidität, die Effektivität oder die potenzielle Wertsteigerung bestimmter Anlagen, die für einen Teilfonds vorgenommen werden, als falsch erweist.

Risikominderungstechniken, die auf indexnachbildende Teilfonds angewandt werden, können sich von denjenigen unterscheiden, die traditionell für aktiv gemanagte Teilfonds eingesetzt werden. Solche Teilfonds streben nach einer Rendite, die dem Ertrag eines Index oder einer spezifischen Benchmark entspricht oder diesen nachbildet. Indexnachbildende Teilfonds werden nicht aktiv gemanagt und sind unter keinen Marktbedingungen darauf ausgerichtet, defensive Positionen einzunehmen. Ein indexnachbildender Teilfonds wird daher von einem allgemeinen Rückgang der in seinem Index erfassten Wertpapiere und Anlageklassen negativ beeinflusst. Auch das Währungs- und Zinsrisiko richtet sich nach dem Index. Die Wertentwicklung solcher Teilfonds kann daher geringer ausfallen als bei Fonds, die ihre Portfolioanlagen aktiv umschichten können, um von Marktchancen zu profitieren oder die Auswirkungen eines Marktrückgangs oder eines Wertrückgangs bei einem oder mehreren Emittenten zu verringern.

### a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko ist definiert als das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments beziehungsweise seine künftigen Kapitalflüsse aufgrund von Veränderungen der Marktpreise schwanken. Jeder Teilfonds, der Aktienanlagen hält, wird unmittelbar von Bewegungen der Marktpreise beeinflusst.

Das Marktrisikomanagement erfolgt durch eine Asset-Allokation und Diversifizierung auf der Grundlage des Anlageziels des Teilfonds sowie des vom Anlageverwalter entwickelten Anlageverfahrens. Für die aktiv gemanagten Teilfonds beinhaltet dies ein detailliertes Research sowie monatliche Analysen der Portfoliounternehmen und makroökonomischen Rahmenbedingungen der Anlagebereiche. Bei passiv gemanagten Teilfonds kann dies faktorbasierte oder Regeln zur Gewichtung oder Diversifizierung beinhalten, die in dem angepassten Index, der nachgebildet wird, integriert sind.

Das maximale Risiko, das aus einer Anlage in einem Finanzinstrument entstehen kann, richtet sich nach dem beizulegenden Zeitwert der Finanzinstrumente. Dies gilt nicht für Short-Positionen in Derivaten und Wertpapieren, deren Verluste potenziell unbegrenzt sind. Das Marktpreisrisiko, dem die Teilfonds zum 30. Juni 2023 und 2022 ausgesetzt sind, beläuft sich auf den beizulegenden Zeitwert der Anlagen, wie in der Vermögensaufstellung des betreffenden Teilfonds angegeben.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### Preissensitivitätsanalyse

Eine Erhöhung des Preises aller von den Teilfonds zum 30. Juni 2023 gehaltenen Aktien um jeweils 5 % (30. Juni 2022: 5 %), hätte, wenn alle übrigen Variablen konstant bleiben, eine Zunahme des Nettovermögens der Teilfonds zur Folge gehabt wie in nachstehender Tabelle angegeben. Ein Rückgang um 5 % hätte einen gegenläufigen Effekt in gleicher Höhe auf den Wert der Teilfonds.

Teilfonds	Währung	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	1.601.456	1.329.786
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	12.990.698	11.948.813
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	13.352.743	6.120.225
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	22.387.403	14.515.246
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	230.934	102.714
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	12.508.841	3.697.053
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	24.086.315	29.845.907
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	460.422	631.596
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	USD	515.019	254.493
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	1.891.642	1.559.654
Franklin European Dividend UCITS ETF	EUR	2.301.628	1.544.264
Franklin European Equity UCITS ETF	EUR	250.438	290.681
Franklin Global Dividend UCITS ETF	USD	2.376.129	2.016.089
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	1.406.391	1.254.417
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	6.421.619	4.693.395
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	1.511.235	711.156
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	7.776.956	5.455.961
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	806.543	128.072
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	2.844.434	1.421.328
Franklin Metaverse UCITS ETF*	USD	145.266	-
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*	USD	253.737	-

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

### b) Währungsrisiko

Das Währungsrisiko ist definiert als das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments beziehungsweise seine künftigen Kapitalflüsse aufgrund von Veränderungen der Wechselkurse schwanken. Alle Teilfonds sind Währungsrisiken ausgesetzt, da ihre monetären Vermögenswerte und Verbindlichkeiten auf eine andere als ihre funktionale Währung lauten können.

Die Wechselkursschwankungen zwischen der Währung, auf die der Vermögenswert oder die Verbindlichkeit lautet, und der funktionalen Währung könnten zu einer Steigerung beziehungsweise Minderung des beizulegenden Zeitwerts des Vermögenswerts oder der Verbindlichkeit führen.

Für die aktiv gemanagten Teilfonds überwacht der Anlageverwalter das Währungsrisiko der einzelnen Teilfonds regelmäßig und kann versuchen, dieses Risiko durch den Einsatz derivativer Finanzinstrumente („DFI“) zu mindern.

Bei passiven Strategien werden die Fremdwährungsengagements und das damit einhergehende Risiko durch Zuordnungsberichte beobachtet. Da die Strategien passiv sind, kann keine Risikominderung erfolgen. Das Währungsrisiko wird von Managern und Anteilhabern akzeptiert.

Ein Teilfonds kann DFI für eine bestimmte Klasse einsetzen, um das Währungsrisiko dieser Klasse vollständig oder teilweise abzusichern. Ein Teilfonds, der das Währungsrisiko einer Klasse absichert, kann Devisenterminkontrakte abschließen, um das Währungsrisiko der betreffenden Klasse vollständig oder teilweise abzusichern. Soweit die Absicherung erfolgreich ist, dürfte die Wertentwicklung der betreffenden Klasse der Wertentwicklung der Basiswerte entsprechen. Der Einsatz abgesicherter Währungsklassen kann die Möglichkeit, dass Anteilhaber der betreffenden Klassen profitieren, wenn die Währung einer dieser Klassen gegenüber der Basiswährung und/oder der Währung, auf welche die Vermögenswerte des Teilfonds lauten, an Wert verliert, erheblich einschränken.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Die Währungsrisikoeexposition und Währungssensitivitätsanalyse, die den ungefähren Anstieg oder Rückgang des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens jedes relevanten Teilfonds angeben, wenn der Wechselkurs der Basiswährung zum 30. Juni 2023 und 2022 für jeden Teilfonds um 5 % gegenüber der Nicht-Basiswährung gestiegen oder gesunken ist, sind in den nachstehenden Tabellen für diejenigen Teilfonds mit einem wesentlichen Risiko aufgeführt.

<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Brasilianischer Real .....	240.886	19.200.288	19.441.174	972.059
Euro .....	109	-	109	5
	<u>240.995</u>	<u>19.200.288</u>	<u>19.441.283</u>	<u>972.064</u>

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Chinesischer Yuan Renminbi .....	(1.878.610)	47.667.460	45.788.850	2.289.443
Chinesischer Yuan Renminbi (Offshore) .....	1.188.300	-	1.188.300	59.415
Hongkong-Dollar .....	(1.824.653)	198.429.058	196.604.405	9.830.220
Singapur-Dollar .....	(6.555)	507.557	501.002	25.050
	<u>(2.521.518)</u>	<u>246.604.075</u>	<u>244.082.557</u>	<u>12.204.128</u>

<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Euro .....	199	-	199	10
Indische Rupie .....	(8.853.016)	267.054.868	258.201.852	12.910.093
	<u>(8.852.817)</u>	<u>267.054.868</u>	<u>258.202.051</u>	<u>12.910.103</u>

<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Euro .....	62.683	-	62.683	3.134
Südkoreanischer Won .....	1.648.939	447.748.053	449.396.992	22.469.850
	<u>1.711.622</u>	<u>447.748.053</u>	<u>449.459.675</u>	<u>22.472.984</u>

<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Taiwan-Dollar .....	58.607	4.618.673	4.677.280	233.864
	<u>58.607</u>	<u>4.618.673</u>	<u>4.677.280</u>	<u>233.864</u>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	<b>Monetär EUR</b>	<b>Nicht monetär EUR</b>	<b>Devisentermin- kontrakte EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensitivität EUR</b>
Britisches Pfund .....	10.292.505	-	(10.381.502)	(88.997)	(4.450)
	10.292.505	-	(10.381.502)	(88.997)	(4.450)

<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Chinesischer Yuan Renminbi .....	8.193	991.705	999.898	49.995
Euro .....	248	-	248	12
Hongkong-Dollar .....	78.397	3.249.410	3.327.807	166.390
Indische Rupie .....	(15.564)	1.479.194	1.463.630	73.182
Indonesische Rupiah .....	12.126	835.696	847.822	42.391
Malaysischer Ringgit .....	913	156.419	157.332	7.867
Philippinischer Peso .....	286	47.763	48.049	2.402
Singapur-Dollar .....	35	115.451	115.486	5.774
Südkoreanischer Won .....	14.694	1.327.999	1.342.693	67.135
Taiwan-Dollar .....	71.496	1.716.178	1.787.674	89.384
Thailändischer Baht .....	1.385	305.647	307.032	15.352
	172.209	10.225.462	10.397.671	519.884

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Devisentermin- kontrakte USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Brasilianischer Real					
..	54.744	2.429.230	-	2.483.974	124.199
Chilenischer Peso	-	605.574	-	605.574	30.279
Chinesischer Yuan Renminbi	35.877	2.775.812	-	2.811.689	140.584
Tschechische Krone	27.801	203.005	-	230.806	11.540
Ägyptisches Pfund	17	37.382	-	37.399	1.870
Euro	12.130	458.007	-	470.137	23.507
Hongkong-Dollar	131.313	7.765.425	-	7.896.738	394.837
Ungarische Forint	119	242.515	-	242.634	12.132
Indische Rupie	(73.477)	4.004.640	-	3.931.163	196.558
Indonesische Rupiah	12.805	1.180.517	-	1.193.322	59.666
Kuwaitischer Dinar	232	101.958	-	102.190	5.110
Malaysischer Ringgit	1.238	274.442	-	275.680	13.784
Mexikanischer Peso	176	959.655	-	959.831	47.992
Neue Türkische Lira	(1.462)	1.173.896	-	1.172.434	58.622
Philippinischer Peso	-	162.521	-	162.521	8.126
Polnischer Złoty	7.071	355.868	-	362.939	18.147
Katar-Riyal	140	447.671	-	447.811	22.391
Russischer Rubel	138	-	-	138	7
Saudi-arabischer Riyal	967	1.740.424	5.252	1.746.643	87.332
Südafrikanischer Rand	1.380	1.738.192	-	1.739.572	86.979
Südkoreanischer Won	20.643	3.492.354	-	3.512.997	175.650
Taiwan-Dollar	194.508	5.064.200	-	5.258.708	262.935
Thailändischer Baht	356	830.955	-	831.311	41.566
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	115	668.532	-	668.647	33.432
	426.831	36.712.775	5.252	37.144.858	1.857.243

<b>Franklin European Dividend UCITS ETF</b>	<b>Monetär EUR</b>	<b>Nicht monetär EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensitivität EUR</b>
Britisches Pfund	27.537	10.812.753	10.840.290	542.015
Dänische Krone	48.786	2.781.268	2.830.054	141.503
Norwegische Krone	109.606	2.413.174	2.522.780	126.139
Schwedische Krone	115	1.302.416	1.302.531	65.127
Schweizer Franken	17	4.357.456	4.357.473	217.874
	186.061	21.667.067	21.853.128	1.092.656

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>	<b>Monetär EUR</b>	<b>Nicht monetär EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensitivität EUR</b>
Britisches Pfund .....	1.958	1.340.256	1.342.214	67.111
Dänische Krone .....	4.568	236.526	241.094	12.055
Norwegische Krone .....	8.275	215.861	224.136	11.207
Schwedische Krone .....	33	153.167	153.200	7.660
Schweizer Franken .....	40	461.889	461.929	23.096
US-Dollar .....	103	-	103	5
	<b>14.977</b>	<b>2.407.699</b>	<b>2.422.676</b>	<b>121.134</b>

<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Australischer Dollar .....	3.555	3.158.981	3.162.536	158.127
Britisches Pfund .....	10.360	2.441.996	2.452.356	122.618
Kanadischer Dollar .....	712	2.598.925	2.599.637	129.982
Chinesischer Yuan Renminbi .....	528	115.357	115.885	5.794
Dänische Krone .....	5.141	203.535	208.676	10.434
Euro .....	19.832	2.037.740	2.057.572	102.879
Hongkong-Dollar .....	7	242.352	242.359	12.118
Indische Rupie .....	(7.246)	373.187	365.941	18.297
Japanischer Yen .....	1.970	4.290.811	4.292.781	214.639
Kuwaitischer Dinar .....	13	-	13	1
Malaysischer Ringgit .....	549	57.247	57.796	2.890
Neue Türkische Lira .....	-	64.453	64.453	3.223
Neuseeländischer Dollar .....	1	168.293	168.294	8.415
Norwegische Krone .....	3.985	100.521	104.506	5.225
Katar-Riyal .....	-	234.735	234.735	11.737
Saudi-arabischer Riyal .....	746	1.293.058	1.293.804	64.690
Singapur-Dollar .....	-	69.564	69.564	3.478
Südafrikanischer Rand .....	-	71.959	71.959	3.598
Schweizer Franken .....	-	4.306.228	4.306.228	215.311
Taiwan-Dollar .....	3.772	1.683.783	1.687.555	84.378
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	-	460.353	460.353	23.018
	<b>43.925</b>	<b>23.973.078</b>	<b>24.017.003</b>	<b>1.200.850</b>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Australischer Dollar .....	3.862	1.122.693	1.126.555	56.328
Brasilianischer Real .....	5.908	173.144	179.052	8.953
Britisches Pfund .....	10.865	1.594.071	1.604.936	80.247
Kanadischer Dollar .....	(3.896)	2.602.433	2.598.537	129.927
Chilenischer Peso .....	-	181.313	181.313	9.066
Chinesischer Yuan Renminbi .....	119	4.517	4.636	232
Tschechische Krone .....	63	12.488	12.551	628
Dänische Krone .....	8.633	567.182	575.815	28.791
Euro .....	17.541	2.680.671	2.698.212	134.911
Hongkong-Dollar .....	4.661	746.640	751.301	37.565
Ungarische Forint .....	1.112	23.643	24.755	1.238
Indische Rupie .....	(2.058)	436.475	434.417	21.721
Indonesische Rupiah .....	523	32.379	32.902	1.645
Japanischer Yen .....	10.658	2.619.300	2.629.958	131.498
Kuwaitischer Dinar .....	13	-	13	1
Malaysischer Ringgit .....	117	159.726	159.843	7.992
Mexikanischer Peso .....	3.806	248.729	252.535	12.627
Neuer israelischer Schekel .....	33	-	33	2
Neue Türkische Lira .....	10	13.455	13.465	673
Neuseeländischer Dollar .....	1	-	1	0
Norwegische Krone .....	7.279	154.816	162.095	8.105
Philippinischer Peso .....	19	-	19	1
Katar-Riyal .....	213	32.430	32.643	1.632
Saudi-arabischer Riyal .....	31	-	31	2
Singapur-Dollar .....	22	-	22	1
Südafrikanischer Rand .....	1.441	583.612	585.053	29.253
Südkoreanischer Won .....	6.300	560.732	567.032	28.352
Schwedische Krone .....	19	132.378	132.397	6.620
Schweizer Franken .....	3	645.546	645.549	32.277
Taiwan-Dollar .....	35.501	775.648	811.149	40.557
Thailändischer Baht .....	3	254.841	254.844	12.742
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	1.047	-	1.047	52
	113.849	16.358.862	16.472.711	823.636

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Monetär EUR</b>	<b>Nicht monetär EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensitivität EUR</b>
Britisches Pfund .....	14.847	5.469.006	5.483.853	274.193
Dänische Krone .....	1.737	2.246.000	2.247.737	112.387
Norwegische Krone .....	3.090	117.110	120.200	6.010
Polnischer Złoty .....	14	19.544	19.558	978
Schwedische Krone .....	123	773.990	774.113	38.706
Schweizer Franken .....	74	4.554.036	4.554.110	227.706
US-Dollar .....	1.787	-	1.787	89
	<b>21.672</b>	<b>13.179.686</b>	<b>13.201.358</b>	<b>660.068</b>

<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Chinesischer Yuan Renminbi .....	(536.956)	4.981.683	4.444.727	222.236
Chinesischer Yuan Renminbi (Offshore) .....	540.538	-	540.538	27.027
Hongkong-Dollar .....	50.034	10.143.015	10.193.049	509.652
	<b>53.616</b>	<b>15.124.698</b>	<b>15.178.314</b>	<b>758.916</b>

<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Euro .....	23.483.827	-	23.483.827	1.174.191
	<b>23.483.827</b>	<b>-</b>	<b>23.483.827</b>	<b>1.174.191</b>

<b>Franklin Metaverse UCITS ETF*</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Australischer Dollar .....	1	11.938	11.939	597
Britisches Pfund .....	39	13.799	13.838	692
Kanadischer Dollar .....	92	13.991	14.083	704
Euro .....	(93)	88.337	88.244	4.412
Hongkong-Dollar .....	242	85.482	85.724	4.286
Japanischer Yen .....	-	16.873	16.873	844
Norwegische Krone .....	-	18.824	18.824	941
Südkoreanischer Won .....	1.304	177.262	178.566	8.928
Schwedische Krone .....	2	21.511	21.513	1.076
Taiwan-Dollar .....	973	98.837	99.810	4.991
	<b>2.560</b>	<b>546.854</b>	<b>549.414</b>	<b>27.471</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*	Monetär USD	Nicht monetär USD	Devisenterminkontrakte USD	Insgesamt USD	Währungssensitivität USD
Brasilianischer Real .....	(1.698)	272.682	-	270.984	13.549
Chilenischer Peso .....	-	46.349	-	46.349	2.317
Chinesischer Yuan Renminbi .....	271	401.756	-	402.027	20.101
Kolumbianischer Peso .....	-	2.742	-	2.742	137
Tschechische Krone .....	96	10.664	-	10.760	538
Euro .....	524	49.896	-	50.420	2.521
Hongkong-Dollar .....	4.980	1.000.047	-	1.005.027	50.251
Ungarische Forint .....	42	16.864	-	16.906	845
Indische Rupie .....	(13.724)	852.422	-	838.698	41.935
Indonesische Rupiah .....	32	37.088	-	37.120	1.856
Kuwaitischer Dinar .....	132	7.254	-	7.386	369
Malaysischer Ringgit .....	192	41.140	-	41.332	2.067
Mexikanischer Peso .....	58	153.356	-	153.414	7.671
Neue Türkische Lira .....	3	10.486	-	10.489	524
Philippinischer Peso .....	28	5.236	-	5.264	263
Polnischer Złoty .....	67	83.056	-	83.123	4.156
Katar-Riyal .....	12	33.839	440	34.291	1.715
Saudi-arabischer Riyal .....	764	289.714	-	290.478	14.524
Südafrikanischer Rand .....	185	179.388	-	179.573	8.979
Südkoreanischer Won .....	768	545.695	-	546.463	27.323
Taiwan-Dollar .....	8.886	779.512	-	788.398	39.420
Thailändischer Baht .....	56	164.757	-	164.813	8.241
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	402	7.690	-	8.092	405
	2.076	4.991.633	440	4.994.149	249.707

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Der Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF, der Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF, der Franklin U.S. Equity UCITS ETF und der Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF weisen zum 30. Juni 2023 kein Währungsrisiko auf. Aus diesem Grund erfolgen für diese Fonds keine Angaben.

Die Teilfonds mit einer wesentlichen Währungsrisikoexposition zum 30. Juni 2022 sind in den nachstehenden Tabellen aufgeführt:

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungssensitivität USD
Brasilianischer Real .....	299.549	15.154.373	15.453.922	772.696
	299.549	15.154.373	15.453.922	772.696

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Chinesischer Yuan Renminbi .....	1.289.437	-	1.289.437	64.472
Chinesischer Yuan .....	(1.155.347)	46.043.234	44.887.887	2.244.394
Hongkong-Dollar .....	1.695.463	175.231.073	176.926.536	8.846.327
Singapur-Dollar .....	5	310.423	310.428	15.521
	<u>1.829.558</u>	<u>221.584.730</u>	<u>223.414.288</u>	<u>11.170.714</u>

<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Indische Rupie .....	(117.158)	122.404.499	122.287.341	6.114.367
	<u>(117.158)</u>	<u>122.404.499</u>	<u>122.287.341</u>	<u>6.114.367</u>

<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Koreanischer Won .....	882.379	290.304.928	291.187.307	14.559.365
	<u>882.379</u>	<u>290.304.928</u>	<u>291.187.307</u>	<u>14.559.365</u>

<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Neuer Taiwan-Dollar .....	28.738	2.054.278	2.083.016	104.151
	<u>28.738</u>	<u>2.054.278</u>	<u>2.083.016</u>	<u>104.151</u>

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	<b>Monetär EUR</b>	<b>Nicht monetär EUR</b>	<b>Devisentermin- kontrakte EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensitivität EUR</b>
Pfund Sterling .....	5.434.386	-	(6.289.663)	(855.277)	(42.764)
	<u>5.434.386</u>	<u>-</u>	<u>(6.289.663)</u>	<u>(855.277)</u>	<u>(42.764)</u>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs-sensitivität USD</b>
Chinesischer Yuan Renminbi .....	5.912	551.224	557.136	27.857
Euro .....	(1)	-	(1)	-
Hongkong-Dollar .....	39.936	1.780.753	1.820.689	91.034
Indonesische Rupiah .....	3.168	147.312	150.480	7.524
Indische Rupie .....	(16.874)	822.839	805.965	40.298
Koreanischer Won .....	2.565	485.209	487.774	24.389
Malaysischer Ringgit .....	913	107.038	107.951	5.398
Philippinischer Peso .....	178	29.074	29.252	1.463
Singapur-Dollar .....	31	172.614	172.645	8.632
Thailändischer Baht .....	59	125.153	125.212	6.261
Neuer Taiwan-Dollar .....	22.229	819.839	842.068	42.103
	<b>58.116</b>	<b>5.041.055</b>	<b>5.099.171</b>	<b>254.959</b>

<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs-sensitivität USD</b>
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	62	550.096	550.158	27.508
Brasilianischer Real .....	54.048	1.585.753	1.639.801	81.990
Chilenischer Peso .....	2.739	151.200	153.939	7.697
Chinesischer Yuan Renminbi .....	27.735	2.098.509	2.126.244	106.312
Kolumbianischer Peso .....	2.665	39.705	42.370	2.119
Tschechische Krone .....	28	189.326	189.354	9.468
Ägyptisches Pfund .....	-	25.872	25.872	1.294
Euro .....	-	175.495	175.495	8.775
Hongkong-Dollar .....	161.021	6.653.559	6.814.580	340.729
Ungarische Forint .....	4	140.090	140.094	7.005
Indonesische Rupiah .....	8.229	840.351	848.580	42.429
Indische Rupie .....	(59.763)	4.232.716	4.172.953	208.648
Koreanischer Won .....	12.501	2.529.908	2.542.409	127.120
Kuwaitischer Dinar .....	174	114.240	114.414	5.721
Mexikanischer Peso .....	78	768.122	768.200	38.410
Malaysischer Ringgit .....	472	621.644	622.116	31.106
Philippinischer Peso .....	70	201.349	201.419	10.071
Polnischer Złoty .....	3.920	325.745	329.665	16.483
Katar-Riyal .....	60	423.667	423.727	21.186
Neuer Russischer Rubel .....	225	-	225	11
Saudi-Riyal .....	27.550	1.688.040	1.715.590	85.780
Thailändischer Baht .....	227	592.063	592.290	29.615
Neue Türkische Lira .....	-	395.249	395.249	19.762
Neuer Taiwan-Dollar .....	116.221	4.157.973	4.274.194	213.710
Südafrikanischer Rand .....	8.172	1.917.495	1.925.667	96.283
	<b>366.438</b>	<b>30.418.167</b>	<b>30.784.605</b>	<b>1.539.232</b>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin European Dividend UCITS ETF</b>	<b>Monetär EUR</b>	<b>Nicht monetär EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensitivität EUR</b>
Dänische Krone .....	4.781	1.111.571	1.116.352	55.818
Norwegische Krone .....	17.542	1.567.956	1.585.498	79.275
Pfund Sterling .....	30.984	6.793.835	6.824.819	341.241
Schwedische Krone .....	7	1.088.968	1.088.975	54.449
Schweizer Franken .....	1	2.631.867	2.631.868	131.593
	53.315	13.194.197	13.247.512	662.376

<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>	<b>Monetär EUR</b>	<b>Nicht monetär EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensitivität EUR</b>
Dänische Krone .....	1.045	387.949	388.994	19.450
Norwegische Krone .....	2.425	230.495	232.920	11.646
Pfund Sterling .....	5.094	1.428.302	1.433.396	71.670
Schwedische Krone .....	299	351.103	351.402	17.570
Schweizer Franken .....	80	953.834	953.914	47.696
US-Dollar .....	236	-	236	12
	9.179	3.351.683	3.360.862	168.044

<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs- sensitivität USD</b>
Australischer Dollar .....	14.695	2.678.207	2.692.902	134.645
Kanadischer Dollar .....	6.466	3.087.057	3.093.523	154.676
Chinesischer Yuan Renminbi .....	-	140.173	140.173	7.009
Euro .....	17.017	1.863.629	1.880.646	94.032
Hongkong-Dollar .....	-	422.132	422.132	21.107
Indische Rupie .....	(187)	119.516	119.329	5.966
Japanischer Yen .....	19.937	3.531.656	3.551.593	177.580
Kuwaitischer Dinar .....	13	-	13	1
Malaysischer Ringgit .....	559	57.442	58.001	2.900
Neuer Taiwan-Dollar .....	9.965	1.208.052	1.218.017	60.901
Neue Türkische Lira .....	491	67.705	68.196	3.410
Neuseeländischer Dollar .....	1	147.364	147.365	7.368
Norwegische Krone .....	1.304	109.430	110.734	5.537
Philippinischer Peso .....	-	14.437	14.437	722
Pfund Sterling .....	7.610	3.055.088	3.062.698	153.135
Katar-Riyal .....	-	246.064	246.064	12.303
Saudi-Riyal .....	55	1.003.140	1.003.195	50.160
Singapur-Dollar .....	-	66.917	66.917	3.346
Südafrikanischer Rand .....	1.889	125.634	127.523	6.376
Schweizer Franken .....	72	3.201.706	3.201.778	160.089
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	66	484.808	484.874	24.244
	79.953	21.630.157	21.710.110	1.085.507

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs-sensitivität USD</b>
Australischer Dollar .....	2.644	1.246.525	1.249.169	62.458
Brasilianischer Real .....	7.031	115.371	122.402	6.120
Kanadischer Dollar .....	6.443	1.853.307	1.859.750	92.988
Chilenischer Peso .....	568	20.736	21.304	1.065
Chinesischer Yuan Renminbi .....	-	7.254	7.254	363
Tschechische Krone .....	-	7.447	7.447	372
Dänische Krone .....	979	681.726	682.705	34.135
Euro .....	13.780	1.645.255	1.659.035	82.952
Hongkong-Dollar .....	941	279.264	280.205	14.010
Indische Rupie .....	(95)	421.752	421.657	21.083
Indonesische Rupiah .....	4.385	161.492	165.877	8.294
Israelischer Schekel .....	620	90.717	91.337	4.567
Japanischer Yen .....	20.601	2.138.458	2.159.059	107.953
Koreanischer Won .....	1.640	372.535	374.175	18.709
Kuwaitischer Dinar .....	13	-	13	1
Malaysischer Ringgit .....	1.888	215.700	217.588	10.879
Mexikanischer Peso .....	-	22.493	22.493	1.125
Neuer Taiwan-Dollar .....	22.249	985.998	1.008.247	50.412
Neuseeländischer Dollar .....	1	-	1	-
Norwegische Krone .....	2.001	161.838	163.839	8.192
Philippinischer Peso .....	274	-	274	14
Pfund Sterling .....	18.986	1.559.276	1.578.262	78.913
Katar-Riyal .....	391	24.821	25.212	1.261
Saudi-Riyal .....	12	-	12	1
Singapur-Dollar .....	122	37.330	37.452	1.873
Südafrikanischer Rand .....	2.140	390.358	392.498	19.625
Schwedische Krone .....	25	155.022	155.047	7.752
Schweizer Franken .....	313	692.133	692.446	34.622
Thailändischer Baht .....	227	203.387	203.614	10.181
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	158	32.438	32.596	1.630
	<b>108.337</b>	<b>13.522.633</b>	<b>13.630.970</b>	<b>681.550</b>

<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Monetär EUR</b>	<b>Nicht monetär EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>	<b>Währungs-sensitivität EUR</b>
Dänische Krone .....	817	986.947	987.764	49.388
Norwegische Krone .....	606	82.324	82.930	4.147
Polnischer Zloty .....	58	13.644	13.702	685
Pfund Sterling .....	10.756	2.934.471	2.945.227	147.261
Schwedische Krone .....	234	369.436	369.670	18.484
Schweizer Franken .....	297	2.485.811	2.486.108	124.305
US-Dollar .....	2.480	-	2.480	124
	<b>15.248</b>	<b>6.872.633</b>	<b>6.887.881</b>	<b>344.394</b>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs-sensitivität USD</b>
Chinesischer Yuan Renminbi .....	596.670	-	596.670	29.834
Chinesischer Yuan .....	(593.802)	642.822	49.020	2.451
Hongkong-Dollar .....	10.085	1.706.221	1.716.306	85.815
	12.953	2.349.043	2.361.996	118.100

<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*</b>	<b>Monetär USD</b>	<b>Nicht monetär USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>	<b>Währungs-sensitivität USD</b>
Euro .....	9.710.138	-	9.710.138	485.507
	9.710.138	-	9.710.138	485.507

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Der Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF, der Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF, der Franklin U.S. Equity UCITS ETF und der Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETFF weisen zum 30. Juni 2022 kein Währungsrisiko auf. Aus diesem Grund erfolgen für diese Teilfonds keine Angaben.

In der nachfolgenden Tabelle werden die Devisenterminkontrakte des Teilfonds, die auf Bruttobasis abgerechnet werden, in Fälligkeitsgruppen unterteilt, die auf dem vom Bilanzstichtag bis zum vertraglich vereinbarten Fälligkeitsdatum verbleibenden Restzeitraum basieren.

**Zum 30. Juni 2023** **3 Monate bis 1 Jahr USD**

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	
Zuflüsse.....	9.885.143
Abflüsse .....	(10.133.322)

**Zum 30. Juni 2023** **Weniger als 1 Monat USD**

<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	
Zuflüsse.....	5.256
Abflüsse .....	(5.254)

**Zum 30. Juni 2023** **Weniger als 1 Monat USD**

<b>Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	
Zuflüsse.....	440
Abflüsse .....	(440)

**Zum 30. Juni 2022** **Weniger als 1 Monat EUR**

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	
Zuflüsse.....	7.873.901

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022

Weniger als 1 Monat  
EUR

#### Franklin Euro Green Bond UCITS ETF

Abflüsse ..... (7.668.790)

### c) Zinsrisiko

Das Zinsrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder die zukünftigen Cashflows eines Finanzinstruments aufgrund von Änderungen der Marktzinssätze schwanken.

Die ICAV ist durch Schuldtitel und Zahlungsmittel Zinsrisiken ausgesetzt und kann durch Anlagen in derivativen Finanzinstrumenten, bei denen der Wert des Basiswerts infolge von Zinsänderungen schwanken kann, indirekt Zinsrisiken unterliegen. Im Allgemeinen ändert sich der Wert von festverzinslichen Wertpapieren gegenläufig zu Änderungen der Zinssätze, und zwar umso mehr, je länger die Laufzeit des Wertpapiers ist. Bei den aktiv gemanagten Renten-Teilfonds wird das Zinsrisiko anhand eines Szenario-Stresstests gesteuert. Zu den berücksichtigten Maßstäben gehören die Ergebnisse einer Parallelverschiebung um +200 Basispunkte auf den Zinskurven sowie die Ergebnisse einer proportionalen Verschiebung um +100 % bei den Kreditspreads. Das Ergebnis dieser Stresstests und ihre Entwicklung werden monatlich beobachtet.

Da die passiv gemanagten Fonds Aktienindizes oder spezifische Benchmarks nachbilden, wird die Sensitivität dieser Fonds gegenüber dem Zinsänderungsrisiko als von begrenzter Bedeutung erachtet. Des Weiteren wird das Marktrisiko (Zinsrisiko inbegriffen) bei indexnachbildenden Teilfonds in der Regel nicht gemindert, da es durch die beabsichtigte Nachbildung eines Marktindex akzeptiert wird. Das Marktrisiko wird regelmäßig durch die Beobachtung von Stresstests überwacht, die in Bezug auf die Vermögensportfolios durchgeführt werden.

Das Zinsrisiko stellt sich für jeden Teilfonds zum 30. Juni 2023 wie folgt dar:

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	32.029.116	32.029.116
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	315.402	-	315.402
Sonstige Forderungen .....	-	-	491.524	491.524
<b>Gesamtvermögen .....</b>	<b>-</b>	<b>315.402</b>	<b>32.520.640</b>	<b>32.836.042</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente	-	-	(914)	(914)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(93.144)	(93.144)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(94.058)</b>	<b>(94.058)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>32.741.984</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				15.770

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	259.813.958	259.813.958
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	622.915	-	622.915
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	25.907	25.907
Sonstige Forderungen .....	-	-	5.708.267	5.708.267
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>622.915</b>	<b>265.548.132</b>	<b>266.171.047</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(32.948)	(32.948)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(4.406.151)	(4.406.151)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(4.439.099)</b>	<b>(4.439.099)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>261.731.948</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				31.146

Franklin FTSE India UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	267.054.868	267.054.868
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	701.721	-	701.721
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	19.825	19.825
Sonstige Forderungen .....	-	-	7.525.052	7.525.052
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>701.721</b>	<b>274.599.745</b>	<b>275.301.466</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(6.938.830)	(6.938.830)
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	-	-	(3.108.936)	(3.108.936)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(10.047.766)</b>	<b>(10.047.766)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>265.253.700</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				35.086



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin FTSE Korea UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	447.748.053	447.748.053
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	776.466	-	776.466
Sonstige Forderungen .....	-	-	1.242.778	1.242.778
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>776.466</b>	<b>448.990.831</b>	<b>449.767.297</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(8.585)	(8.585)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(34.505)	(34.505)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(43.090)</b>	<b>(43.090)</b>
<b>Gesamtnettvermögen .....</b>				<b>449.724.207</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				38.823
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	4.618.673	4.618.673
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	16.911	-	16.911
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	30	30
Sonstige Forderungen .....	-	-	58.325	58.325
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>16.911</b>	<b>4.677.028</b>	<b>4.693.939</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(14.115)	(14.115)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(14.115)</b>	<b>(14.115)</b>
<b>Gesamtnettvermögen .....</b>				<b>4.679.824</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				846

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	197.782.144	52.394.679	-	250.176.823
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	6.435.436	-	6.435.436
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	100.036	100.036
Sonstige Forderungen .....	-	-	4.140.688	4.140.688
Bei Maklern gehaltene Zahlungsmittel .....	-	278.000	-	278.000
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>197.782.144</b>	<b>59.108.115</b>	<b>4.240.724</b>	<b>261.130.983</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(270.253)	(270.253)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(2.032.943)	(2.032.943)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(2.303.196)</b>	<b>(2.303.196)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>258.827.787</b>
<b>*5 % Zinssensitivitätslücke.....</b>				<b>12.844.513</b>

<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	414.835.771	66.890.530	-	481.726.301
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	22.630.896	-	22.630.896
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	526.875	526.875
Sonstige Forderungen .....	-	-	6.654.675	6.654.675
<b>Gesamtvermögen .....</b>	<b>414.835.771</b>	<b>89.521.426</b>	<b>7.181.550</b>	<b>511.538.747</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(30.470)	(30.470)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(30.470)</b>	<b>(30.470)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>511.508.277</b>
<b>*5 % Zinssensitivitätslücke.....</b>				<b>25.217.860</b>

<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	7.423.605	1.784.833	-	9.208.438
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	37.178	-	37.178
Sonstige Forderungen .....	-	-	96.613	96.613
<b>Gesamtvermögen .....</b>	<b>7.423.605</b>	<b>1.822.011</b>	<b>96.613</b>	<b>9.342.229</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.105)	(3.105)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(3.105)</b>	<b>(3.105)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>9.339.124</b>
<b>*5 % Zinssensitivitätslücke.....</b>				<b>462.281</b>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>				
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	10.300.374	10.300.374
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	51.714	-	51.714
Sonstige Forderungen .....	-	-	152.918	152.918
Gesamtvermögen.....	-	51.714	10.453.292	10.505.006
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(1.370)	(1.370)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.466)	(3.466)
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	-	-	(28.996)	(28.996)
Gesamtverbindlichkeiten .....	-	-	(33.832)	(33.832)
Gesamtnettovermögen .....				10.471.174
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				2.586
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>				
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	37.832.830	37.832.830
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	26.385	-	26.385
Sonstige Forderungen .....	-	-	525.216	525.216
Gesamtvermögen.....	-	26.385	38.358.046	38.384.431
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(3.482)	(3.482)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(24.255)	(24.255)
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	-	-	(111.467)	(111.467)
Gesamtverbindlichkeiten .....	-	-	(139.204)	(139.204)
Gesamtnettovermögen .....				38.245.227
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				1.319

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin European Dividend UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	46.032.550	46.032.550
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	36.037	-	36.037
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	2.200	2.200
Sonstige Forderungen .....	-	-	470.109	470.109
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>36.037</b>	<b>46.504.859</b>	<b>46.540.896</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(9.867)	(9.867)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(9.867)</b>	<b>(9.867)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>46.531.029</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				1.802

<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	5.008.754	5.008.754
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	4.490	-	4.490
Sonstige Forderungen .....	-	-	28.000	28.000
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>4.490</b>	<b>5.036.754</b>	<b>5.041.244</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(102)	(102)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(7.065)	(7.065)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(7.167)</b>	<b>(7.167)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>5.034.077</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				225

<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	47.522.583	47.522.583
Sonstige Forderungen .....	-	-	108.830	108.830
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>47.631.413</b>	<b>47.631.413</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Überziehungskredit .....	-	(21.983)	-	(21.983)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(18.483)	(18.483)
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	-	-	(12.161)	(12.161)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>(21.983)</b>	<b>(30.644)</b>	<b>(52.627)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>47.578.786</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				(1.099)

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	28.127.826	28.127.826
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	47.212	-	47.212
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	227	227
Sonstige Forderungen .....	-	-	109.832	109.832
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>47.212</b>	<b>28.237.885</b>	<b>28.285.097</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(18.748)	(18.748)
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	-	-	(4.435)	(4.435)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(23.183)</b>	<b>(23.183)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>28.261.914</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				2.361

<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	128.432.379	128.432.379
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	42.941	-	42.941
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	2.139	2.139
Sonstige Forderungen .....	-	-	140.520	140.520
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>42.941</b>	<b>128.575.038</b>	<b>128.617.979</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(27.263)	(27.263)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(27.263)</b>	<b>(27.263)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>128.590.716</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				2.147

<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	30.224.706	30.224.706
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	19.113	-	19.113
Sonstige Forderungen .....	-	-	38.308	38.308
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>19.113</b>	<b>30.263.014</b>	<b>30.282.127</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(204)	(204)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.702)	(3.702)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(3.906)</b>	<b>(3.906)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>30.278.221</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				956

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	155.539.117	155.539.117
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	633.591	-	633.591
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	7.283	7.283
Sonstige Forderungen .....	-	-	28.860.370	28.860.370
Gesamtvermögen.....	-	633.591	184.406.770	185.040.361
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(29.252.583)	(29.252.583)
Gesamtverbindlichkeiten .....	-	-	(29.252.583)	(29.252.583)
Gesamtnettovermögen .....				155.787.778
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				31.680
<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	16.130.868	16.130.868
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	36.466	-	36.466
Sonstige Forderungen .....	-	-	42.186	42.186
Gesamtvermögen.....	-	36.466	16.173.054	16.209.520
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(415)	(415)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.019)	(3.019)
Gesamtverbindlichkeiten .....	-	-	(3.434)	(3.434)
Gesamtnettovermögen .....				16.206.086
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				1.823
<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>				
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	56.888.680	-	-	56.888.680
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente .....	-	4.503.540	-	4.503.540
Sonstige Forderungen .....	-	-	766.665	766.665
Gesamtvermögen.....	56.888.680	4.503.540	766.665	62.158.885
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(20.792)	(20.792)
Gesamtverbindlichkeiten .....	-	-	(20.792)	(20.792)
Gesamtnettovermögen .....				62.138.093
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				3.069.611

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Metaverse UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	2.905.321	2.905.321
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	2.651	-	2.651
Sonstige Forderungen .....	-	-	3.331	3.331
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>2.651</b>	<b>2.908.652</b>	<b>2.911.303</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(1.832)	(1.832)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(1.832)</b>	<b>(1.832)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>2.909.471</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				133

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	5.074.736	5.074.736
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	8.153	-	8.153
Sonstige Forderungen .....	-	-	18.888	18.888
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>8.153</b>	<b>5.093.624</b>	<b>5.101.777</b>
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(5.403)	(5.403)
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	-	-	(18.250)	(18.250)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(23.653)</b>	<b>(23.653)</b>
Gesamtnettovermögen .....				5.078.124
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				408

\* Die aufgeführte Sensitivitätslücke wird auf der Grundlage von 5 % des festen Zinssatzes und des variablen Zinssatzes berechnet.

Das Zinsrisiko stellt sich für jeden Teilfonds zum 30. Juni 2022 wie folgt dar:

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	26.595.719	26.595.719
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	373.076	-	373.076
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	20	20
Sonstige Forderungen .....	-	-	423.312	423.312
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>373.076</b>	<b>27.019.051</b>	<b>27.392.127</b>
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(56.096)	(56.096)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(53.045)	(53.045)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(109.141)</b>	<b>(109.141)</b>
Gesamtnettovermögen .....				27.282.986
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				18.654



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	238.976.268	238.976.268
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	704.745	-	704.745
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	33.190	33.190
Sonstige Forderungen .....	-	-	1.514.449	1.514.449
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>704.745</b>	<b>240.523.907</b>	<b>241.228.652</b>
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(63.633)	(63.633)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(63.633)</b>	<b>(63.633)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>241.165.019</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				35.237

<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	122.404.499	122.404.499
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	103.706	-	103.706
Sonstige Forderungen .....	-	-	805.585	805.585
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>103.706</b>	<b>123.210.084</b>	<b>123.313.790</b>
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(897.372)	(897.372)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(897.372)</b>	<b>(897.372)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>122.416.418</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				5.185

<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	290.304.928	290.304.928
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	249.027	-	249.027
Sonstige Forderungen .....	-	-	765.609	765.609
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>249.027</b>	<b>291.070.537</b>	<b>291.319.564</b>
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	(32.781)	(32.781)
Sonstige Verbindlichkeiten.....	-	-	(25.258)	(25.258)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(58.039)</b>	<b>(58.039)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>291.261.525</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				12.451

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	2.054.278	2.054.278
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	316	-	316
Sonstige Forderungen .....	-	-	28.711	28.711
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>316</b>	<b>2.082.989</b>	<b>2.083.305</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(351)	(351)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(351)</b>	<b>(351)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>2.082.954</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				16

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	58.489.620	15.451.432	-	73.941.052
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	6.687.702	-	6.687.702
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	275.301	275.301
Sonstige Forderungen .....	-	-	3.057.311	3.057.311
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>58.489.620</b>	<b>22.139.134</b>	<b>3.332.612</b>	<b>83.961.366</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(6.783)	(6.783)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(18.580)	(18.580)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(25.363)</b>	<b>(25.363)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>83.936.003</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				4.031.438

<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	524.944.639	71.973.509	-	596.918.148
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	72.151.903	-	72.151.903
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	434.546	434.546
Sonstige Forderungen .....	-	-	3.367.124	3.367.124
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>524.944.639</b>	<b>144.125.412</b>	<b>3.801.670</b>	<b>672.871.721</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(26.670)	(26.670)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(26.670)</b>	<b>(26.670)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>672.845.051</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				33.453.503

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	11.040.742	1.591.170	-	12.631.912
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	363.884	-	363.884
Sonstige Forderungen .....	-	-	113.923	113.923
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>11.040.742</b>	<b>1.955.054</b>	<b>113.923</b>	<b>13.109.719</b>
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.801)	(3.801)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(3.801)</b>	<b>(3.801)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>13.105.918</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				649.790

<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	5.089.860	5.089.860
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	7.957	-	7.957
Sonstige Forderungen .....	-	-	85.926	85.926
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>7.957</b>	<b>5.175.786</b>	<b>5.183.743</b>
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	(1.055)	(1.055)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(37.710)	(37.710)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(38.765)</b>	<b>(38.765)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>5.144.978</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				398

<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Vermögenswerte				
Wertpapiere .....	-	-	31.193.088	31.193.088
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	102.279	-	102.279
Sonstige Forderungen .....	-	-	506.969	506.969
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>102.279</b>	<b>31.700.057</b>	<b>31.802.336</b>
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(3.280)	(3.280)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(270.733)	(270.733)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(274.013)</b>	<b>(274.013)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>31.528.323</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				5.114

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin European Dividend UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	30.885.281	30.885.281
Sonstige Forderungen .....	-	-	194.780	194.780
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>(0)</b>	<b>31.080.061</b>	<b>31.080.061</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Überziehungskredit .....	-	(37.514)	-	(37.514)
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(1.890)	(1.890)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(6.370)	(6.370)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>(37.514)</b>	<b>(8.260)</b>	<b>(45.774)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>31.034.287</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				(0)

<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	5.813.624	5.813.624
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	6.365	-	6.365
Sonstige Forderungen .....	-	-	38.880	38.880
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>6.365</b>	<b>5.852.504</b>	<b>5.858.869</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	(435)	(435)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(18.866)	(18.866)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(19.301)</b>	<b>(19.301)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>5.839.568</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				318

<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	40.321.780	40.321.780
Sonstige Forderungen .....	-	-	94.734	94.734
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>(0)</b>	<b>40.416.514</b>	<b>40.416.514</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Überziehungskredit .....	-	(65.886)	-	(65.886)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(16.455)	(16.455)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>(65.886)</b>	<b>(16.455)</b>	<b>(82.341)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>40.334.173</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				(0)

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	25.088.331	25.088.331
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	73.234	-	73.234
Sonstige Forderungen .....	-	-	76.990	76.990
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>73.234</b>	<b>25.165.321</b>	<b>25.238.555</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(1.053)	(1.053)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(15.259)	(15.259)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(16.312)</b>	<b>(16.312)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>25.222.243</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				3.662

<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	93.867.900	93.867.900
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	98.110	-	98.110
Sonstige Forderungen .....	-	-	112.209	112.209
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>98.110</b>	<b>93.980.109</b>	<b>94.078.219</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(9.126)	(9.126)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(19.803)	(19.803)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(28.929)</b>	<b>(28.929)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>94.049.290</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				4.906

<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Unverzinslich EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	14.223.125	14.223.125
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	1.997	-	1.997
Derivative Finanzinstrumente .....	-	-	235	235
Sonstige Forderungen .....	-	-	19.757	19.757
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>1.997</b>	<b>14.243.117</b>	<b>14.245.114</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(2.082)	(2.082)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(2.082)</b>	<b>(2.082)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>14.243.032</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				100

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	109.119.212	109.119.212
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	627.655	-	627.655
Sonstige Forderungen .....	-	-	13.377.207	13.377.207
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>627.655</b>	<b>122.496.419</b>	<b>123.124.074</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzinstrumente.....	-	-	(8.751)	(8.751)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(13.740.875)	(13.740.875)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(13.749.626)</b>	<b>(13.749.626)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>109.374.448</b>
*5 % Zinssensitivitätslücke.....				31.383

<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF**</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	-	-	2.561.446	2.561.446
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	4.324	-	4.324
Sonstige Forderungen .....	-	-	12.539	12.539
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>-</b>	<b>4.324</b>	<b>2.573.985</b>	<b>2.578.309</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(242)	(242)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(242)</b>	<b>(242)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>2.578.067</b>
5 % Zinssensitivitätslücke .....				216

<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF**</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Unverzinslich USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapiere .....	28.426.550	-	-	28.426.550
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente.....	-	9.479.627	-	9.479.627
Sonstige Forderungen .....	-	-	407.567	407.567
<b>Gesamtvermögen.....</b>	<b>28.426.550</b>	<b>9.479.627</b>	<b>407.567</b>	<b>38.313.744</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(8.462.155)	(8.462.155)
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(8.462.155)</b>	<b>(8.462.155)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>29.851.589</b>
5 % Zinssensitivitätslücke .....				1.895.309

\* Die aufgeführte Sensitivitätslücke wird auf der Grundlage von 5 % des festen Zinssatzes und des variablen Zinssatzes berechnet.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### d) Kreditrisiko und Gegenparteirisiko

Das Kreditrisiko ist das wahrscheinliche Risiko eines Verlustes, der entsteht, wenn ein Kreditnehmer einen Kredit nicht zurückzahlt oder seine vertraglichen Verpflichtungen nicht erfüllt. Anlagen in Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren unterliegen keinem Kreditrisiko. Die Teilfonds sind durch gehaltene Schuldtitel einem Kreditrisiko ausgesetzt. Das Kreditrisiko umfasst in aller Regel das Ausfallrisiko, das Spreadrisiko, das Gegenparteirisiko und das Erfüllungsrisiko. Das Kreditrisiko der Schuldtitel der ICAV zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 wird vom Anlageverwalter überwacht.

Der Anlageverwalter kann Devisenterminkontrakte einsetzen, um sich gegen Währungsrisiken abzusichern. Sie weisen ein ähnliches Kredit- oder Ausfallrisiko auf wie ein herkömmliches Devisenkassageschäft. Devisenterminkontrakte werden außerbörslich („Over the Counter“) gehandelt und sind daher mit einem Gegenparteirisiko verbunden, das sich aus der potenziellen Nichterfüllung der Verpflichtungen der Gegenparteien aus dem Kontrakt oder Vertrag ergibt.

Das Gegenparteirisiko ist eine Unterkategorie des Kreditrisikos und stellt das Risiko für jede Partei eines Kontrakts dar, dass die Gegenpartei ihren vertraglichen Verpflichtungen nicht nachkommen wird. Die Teilfonds sind im Rahmen bilateraler Vereinbarungen dem Gegenparteirisiko ausgesetzt, z. B. bei außerbörslichen Derivategeschäften, bei denen beide Seiten einem Kreditrisiko ausgesetzt sind (etwa bei Devisenterminkontrakten).

Derivate, als Einschusszahlungen hinterlegte Zahlungsmittel oder ähnliche Anlagen/Gelder, die im Auftrag der Teilfonds bei einer Gegenpartei, einer Optionsbörse, einem Clearing-Broker oder anderen Parteien hinterlegt oder getätigt werden, werden nicht im Depotbanknetz von State Street gehalten. Die Verwahrstelle ist daher in keiner Weise für den Ausfall einer Gegenpartei haftbar.

Franklin Templeton Investment Management Limited als Anlageberater verfügt über ein Counterparty Credit Committee. Dieser Ausschuss tritt regelmäßig zusammen, um eine Liste zulässiger Gegenparteien zu prüfen und zu aktualisieren und Risikolimits sowie den Zulässigkeitsstatus von Gegenparteien zu verändern. Der Ausschuss hat die Befugnis, den Handel mit einer bestimmten Gegenpartei zu untersagen, sofern er der Überzeugung ist, dass die mit der betreffenden Gegenpartei verbundenen Risiken zu hoch sind. Das mit einzelnen Gegenparteien verbundene unternehmensweite Gesamtrisiko sowie deren Kreditrating, Credit Default Swap Spreads und Aktienkursentwicklungen werden ebenfalls überwacht und dem Handels- und Portfoliomanagementteam wöchentlich gemeldet.

Zum 30. Juni 2023 betrug das Kreditrating für Citibank NA A+ (30. Juni 2022: A+) und für JPMorgan Securities Inc betrug es A+ (30. Juni 2022: A+).

Die Verwahrstelle der ICAV ist die State Street Custodial Services (Ireland) Limited. Im Wesentlichen alle Vermögenswerte und Zahlungsmittel der Teilfonds werden im Depotbanknetz der Verwahrstelle gehalten. Ein Konkurs oder eine Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle oder ihrer Muttergesellschaft, der State Street Corporation, kann dazu führen, dass die Rechte der Teilfonds in Bezug auf ihre bei der Verwahrstelle gehaltenen Anlagen verzögert oder eingeschränkt werden. Das Kreditrating der State Street Corporation zum 30. Juni 2023 betrug A (30. Juni 2022: A).

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin Euro Green Bond UCITS ETF zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Rating*	%	%
Investment Grade .....	82,11	70,94
Unter Investment Grade .....	5,07	7,41
Ohne Rating .....	12,82	21,65
Insgesamt .....	100,00	100,00

\* Bei Nichtverfügbarkeit der herangezogenen Ratings von Moody's und von Fitch Ratings dient Standard & Poor's als Quelle für die Bonitätsbewertungen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### d) Kreditrisiko und Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Rating*	%	%
Investment Grade .....	79,19	65,61
Unter Investment Grade .....	1,14	1,91
Ohne Rating .....	19,67	32,48
Insgesamt .....	100,00	100,00

\* Bei Nichtverfügbarkeit der herangezogenen Ratings von Moody's und von Fitch Ratings dient Standard & Poor's als Quelle für die Bonitätsbewertungen.

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Rating*	%	%
Investment Grade .....	95,66	90,81
Unter Investment Grade .....	-	0,00
Ohne Rating .....	4,34	9,19
Insgesamt .....	100,00	100,00

\* Bei Nichtverfügbarkeit der herangezogenen Ratings von Moody's und von Fitch Ratings dient Standard & Poor's als Quelle für die Bonitätsbewertungen.

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Rating*	%	%
Investment Grade .....	66,10	66,48
Unter Investment Grade .....	33,90	31,20
Ohne Rating .....	-	2,32
Insgesamt .....	100,00	100,00

\* Bei Nichtverfügbarkeit der herangezogenen Ratings von Moody's und von Fitch Ratings dient Standard & Poor's als Quelle für die Bonitätsbewertungen.

### e) Liquiditätsrisiko

Das Vermögen der Teilfonds setzt sich in aller Regel aus hoch liquiden Schuldtiteln und Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren zusammen. Bei aktiv gemanagten Teilfonds ist die Liquidität ein Faktor, den der Anlageverwalter bei der Anlage in ein Finanzinstrument berücksichtigt. Bei indexnachbildenden Teilfonds richten sich die Finanzinstrumente, in die investiert wird, nach dem betreffenden nachgebildeten Index.

Die wichtigste finanzielle Verbindlichkeit der Teilfonds besteht in der Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile. Da es sich bei den Teilfonds um offene Fonds handelt, muss der jeweilige Teilfonds Anteile auf Wunsch der Anteilinhaber zu einem Preis zurücknehmen, der dem Nettoinventarwert pro Anteil entspricht, vorbehaltlich der im Prospekt dargelegten Abrechnungs- und Handelsbeschränkungen.



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Der Anlageverwalter steuert die Liquiditätsposition der einzelnen Teilfonds auf täglicher Basis. Ebenso ist der Anlageverwalter durch die Bestimmungen des Prospekts in der Lage, die Verarbeitung von Rücknahmen in erheblichem Umfang aufzuschieben, um eine ordentliche Veräußerung der Wertpapiere zu ermöglichen und so die Interessen der übrigen Anteilinhaber zu wahren. Die Höchstzahl rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile, die an einem bestimmten Tag zurückgenommen werden können, kann auf 10 % der Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile des betreffenden Teilfonds begrenzt werden. Lehnt der Fonds die Rücknahme von Anteilen aus diesem Grund ab, können die Rücknahmeanträge an diesem Tag anteilig reduziert werden, und die Rücknahmeanträge werden so behandelt, als wären sie an jedem nachfolgenden Handelstag eingegangen, bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezog, zurückgenommen worden sind, unter der Maßgabe, dass der Fonds nicht verpflichtet ist, an einem Handelstag mehr als 10 % der Anzahl der an einem bestimmten Handelstag im Umlauf befindlichen Anteile eines bestimmten Teilfonds zurückzunehmen, bis alle Anteile des Teilfonds, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezog, zurückgenommen worden sind.

Das Liquiditätsprofil der finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds stellt sich zum 30. Juni 2023 wie folgt dar:

<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	914	-	914
Sonstige Verbindlichkeiten .....	93.144	-	-	93.144
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	32.741.984	-	-	32.741.984
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>32.835.128</b>	<b>914</b>	<b>-</b>	<b>32.836.042</b>

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	32.948	-	32.948
Sonstige Verbindlichkeiten .....	4.406.151	-	-	4.406.151
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	261.731.948	-	-	261.731.948
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>266.138.099</b>	<b>32.948</b>	<b>-</b>	<b>266.171.047</b>

<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	6.938.830	-	-	6.938.830
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	3.108.936	-	-	3.108.936
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	265.253.700	-	-	265.253.700
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>275.301.466</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>275.301.466</b>

<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	8.585	-	8.585
Sonstige Verbindlichkeiten .....	34.505	-	-	34.505
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	449.724.207	-	-	449.724.207
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>449.758.712</b>	<b>8.585</b>	<b>-</b>	<b>449.767.297</b>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	14.115	-	-	14.115
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	4.679.824	-	-	4.679.824
Gesamtverbindlichkeiten .....	4.693.939	-	-	4.693.939

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat EUR</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr EUR</b>	<b>&gt; 1 Jahr EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	19.950	-	19.950
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten .....	250.303	-	-	250.303
Sonstige Verbindlichkeiten .....	2.032.943	-	-	2.032.943
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	258.827.787	-	-	258.827.787
Gesamtverbindlichkeiten .....	261.111.033	19.950	-	261.130.983

<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat EUR</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr EUR</b>	<b>&gt; 1 Jahr EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	30.470	-	-	30.470
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	511.508.277	-	-	511.508.277
Gesamtverbindlichkeiten .....	511.538.747	-	-	511.538.747

<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.105	-	-	3.105
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	9.339.124	-	-	9.339.124
Gesamtverbindlichkeiten .....	9.342.229	-	-	9.342.229

<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	1.370	-	1.370
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.466	-	-	3.466
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	28.996	-	-	28.996
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	10.471.174	-	-	10.471.174
Gesamtverbindlichkeiten .....	10.503.636	1.370	-	10.505.006

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	3.480	-	3.480
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten .....	2	-	-	2
Sonstige Verbindlichkeiten .....	24.255	-	-	24.255
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	111.467	-	-	111.467
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	38.245.227	-	-	38.245.227
Gesamtverbindlichkeiten .....	38.380.951	3.480	-	38.384.431

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis zu 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin European Dividend UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9.867	-	-	9.867
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	46.531.029	-	-	46.531.029
Gesamtverbindlichkeiten .....	46.540.896	-	-	46.540.896

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis zu 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	102	-	102
Sonstige Verbindlichkeiten .....	7.065	-	-	7.065
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	5.034.077	-	-	5.034.077
Gesamtverbindlichkeiten .....	5.041.142	102	-	5.041.244

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>				
Überziehungskredit .....	21.983	-	-	21.983
Sonstige Verbindlichkeiten .....	18.483	-	-	18.483
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	12.161	-	-	12.161
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	47.578.786	-	-	47.578.786
Gesamtverbindlichkeiten .....	47.631.413	-	-	47.631.413

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	18.748	-	-	18.748
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	4.435	-	-	4.435
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	28.261.914	-	-	28.261.914
Gesamtverbindlichkeiten .....	28.285.097	-	-	28.285.097

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	27.263	-	-	27.263
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	128.590.716	-	-	128.590.716
Gesamtverbindlichkeiten .....	128.617.979	-	-	128.617.979

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis zu 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	204	-	204
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.702	-	-	3.702
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	30.278.221	-	-	30.278.221
Gesamtverbindlichkeiten .....	30.281.923	204	-	30.282.127

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	29.252.583	-	-	29.252.583
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	155.787.778	-	-	155.787.778
Gesamtverbindlichkeiten .....	185.040.361	-	-	185.040.361

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	-	415	-	415
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.019	-	-	3.019
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	16.206.086	-	-	16.206.086
Gesamtverbindlichkeiten .....	16.209.105	415	-	16.209.520

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	20.792	-	-	20.792
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	62.138.093	-	-	62.138.093
Gesamtverbindlichkeiten .....	62.158.885	-	-	62.158.885

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Metaverse UCITS ETF*</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	1.832	-	-	1.832
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	2.909.471	-	-	2.909.471
Gesamtverbindlichkeiten .....	2.911.303	-	-	2.911.303

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	5.403	-	-	5.403
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	18.250	-	-	18.250
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	5.078.124	-	-	5.078.124
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>5.101.777</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5.101.777</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Das Liquiditätsprofil der finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds stellt sich zum 30. Juni 2022 wie folgt dar:

<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	56.096	-	-	56.096
Sonstige Verbindlichkeiten .....	53.045	-	-	53.045
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	27.282.986	-	-	27.282.986
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>27.392.127</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>27.392.127</b>

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	63.633	-	-	63.633
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	241.165.019	-	-	241.165.019
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>241.228.652</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>241.228.652</b>

<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	897.372	-	-	897.372
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	122.416.418	-	-	122.416.418
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>123.313.790</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>123.313.790</b>

<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	32.781	-	-	32.781
Sonstige Verbindlichkeiten .....	25.258	-	-	25.258
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	291.261.525	-	-	291.261.525
<b>Gesamtverbindlichkeiten .....</b>	<b>291.319.564</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>291.319.564</b>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	351	-	-	351
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	2.082.954	-	-	2.082.954
Gesamtverbindlichkeiten .....	2.083.305	-	-	2.083.305

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis zu 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten .....	6.783	-	-	6.783
Sonstige Verbindlichkeiten .....	18.580	-	-	18.580
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	83.936.003	-	-	83.936.003
Gesamtverbindlichkeiten .....	83.961.366	-	-	83.961.366

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis zu 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	26.670	-	-	26.670
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	672.845.051	-	-	672.845.051
Gesamtverbindlichkeiten .....	672.871.721	-	-	672.871.721

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.801	-	-	3.801
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	13.105.918	-	-	13.105.918
Gesamtverbindlichkeiten .....	13.109.719	-	-	13.109.719

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	1.055	-	-	1.055
Sonstige Verbindlichkeiten .....	37.710	-	-	37.710
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	5.144.978	-	-	5.144.978
Gesamtverbindlichkeiten .....	5.183.743	-	-	5.183.743

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	3.280	-	-	3.280
Sonstige Verbindlichkeiten .....	270.733	-	-	270.733
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	31.528.323	-	-	31.528.323
Gesamtverbindlichkeiten .....	31.802.336	-	-	31.802.336

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis zu 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin European Dividend UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	1.890	-	-	1.890
Überziehungskredit .....	37.514	-	-	37.514
Sonstige Verbindlichkeiten .....	6.370	-	-	6.370
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	31.034.287	-	-	31.034.287
Gesamtverbindlichkeiten .....	31.080.061	-	-	31.080.061

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis zu 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	435	-	-	435
Sonstige Verbindlichkeiten .....	18.866	-	-	18.866
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	5.839.568	-	-	5.839.568
Gesamtverbindlichkeiten .....	5.858.869	-	-	5.858.869

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>				
Überziehungskredit .....	65.886	-	-	65.886
Sonstige Verbindlichkeiten .....	16.455	-	-	16.455
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	40.334.173	-	-	40.334.173
Gesamtverbindlichkeiten .....	40.416.514	-	-	40.416.514

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis zu 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	1.053	-	-	1.053
Sonstige Verbindlichkeiten .....	15.259	-	-	15.259
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen .....	25.222.243	-	-	25.222.243
Gesamtverbindlichkeiten .....	25.238.555	-	-	25.238.555

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	9.126	-	-	9.126
Sonstige Verbindlichkeiten .....	19.803	-	-	19.803
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	94.049.290	-	-	94.049.290
Gesamtverbindlichkeiten .....	94.078.219	-	-	94.078.219

<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat EUR</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr EUR</b>	<b>&gt; 1 Jahr EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	2.082	-	-	2.082
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	14.243.032	-	-	14.243.032
Gesamtverbindlichkeiten .....	14.245.114	-	-	14.245.114

<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures) .....	8.751	-	-	8.751
Sonstige Verbindlichkeiten .....	13.740.875	-	-	13.740.875
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	109.374.448	-	-	109.374.448
Gesamtverbindlichkeiten .....	123.124.074	-	-	123.124.074

<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	242	-	-	242
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen.....	2.578.067	-	-	2.578.067
Gesamtverbindlichkeiten .....	2.578.309	-	-	2.578.309

<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*</b>	<b>Weniger als 1 Monat USD</b>	<b>1 Monat bis zu 1 Jahr USD</b>	<b>&gt; 1 Jahr USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
Sonstige Verbindlichkeiten .....	8.462.155	-	-	8.462.155
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare, gewinnberechtigter Anteile.....	29.851.589	-	-	29.851.589
Gesamtverbindlichkeiten .....	38.313.744	-	-	38.313.744

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

### f) Zeitwerthierarchie

Die ICAV muss bei der Klassifizierung im Rahmen der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert eine Zeitwerthierarchie anwenden, die die Bedeutung der für die Bewertung verwendeten Parameter widerspiegelt.



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

Der Standard schreibt einem Unternehmen eine quantitative und eine qualitative Analyse der zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesenen Instrumente anhand einer Bewertungshierarchie mit drei Ebenen vor. Die Zeitwerthierarchie hat folgende Ebenen:

- Ebene 1 – Auf aktiven Märkten für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten notierte Preise (unangepasst).
- Ebene 2 – Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (das heißt als Preise) oder indirekt (das heißt von Preisen abgeleitet) beobachtbar sind und die nicht der Ebene 1 angehören.
- Ebene 3 – Bewertungsparameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (das heißt nicht beobachtbare Parameter).

Darüber hinaus verlangt die Änderung für diejenigen Instrumente, die über wesentliche nicht beobachtbare Parameter verfügen (Ebene 3), Angaben zu den Übertragungen in und aus Ebene 3, eine Überleitung der Eröffnungs- und Abschlussalden, die Gesamtgewinne und -verluste für die Finanzjahraufteilung zwischen den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten und in der Aufstellung der insgesamt erfassten Gewinne und Verluste, Käufe, Verkäufe, Emissionen und Abrechnungen. Die Ebene in der Bewertungshierarchie, innerhalb der die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit eingeordnet wird, wird auf Grundlage der Daten der untersten Ebene ermittelt, die für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit bedeutend sind.

Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit der Parameter für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Wenn eine Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter verwendet, die auf der Basis nicht beobachtbarer Parameter erhebliche Anpassungen erfordern, so ist diese Art der Bewertung der Ebene 3 zuzuordnen. Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

Für die Definition, was als „beobachtbar“ gilt, ist eine sorgfältige Beurteilung von Seiten der Teilfonds erforderlich. Die Teilfonds erachten als beobachtbare Daten solche Marktdaten, die jederzeit verfügbar sind, regelmäßig veröffentlicht oder aktualisiert werden, verlässlich und überprüfbar und nicht geschützt sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt werden, die aktiv mit dem betreffenden Markt beschäftigt sind. Nicht zum beizulegenden Zeitwert geführte Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden zu fortgeführten Anschaffungskosten geführt, wobei der Buchwert einen angemessenen Näherungswert für den beizulegenden Zeitwert darstellt.

In den folgenden Tabellen wird die Zeitwerthierarchie der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. Juni 2023 analysiert.

<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	32.029.116	-	-	32.029.116
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) *	(914)	-	-	(914)
	<u>32.028.202</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>32.028.202</u>

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	259.716.056	-	97.902	259.813.958
Terminkontrakte (Futures) *	25.907	-	-	25.907
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) *	(32.948)	-	-	(32.948)
	<u>259.709.015</u>	<u>-</u>	<u>97.902</u>	<u>259.806.917</u>

<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	267.054.868	-	-	267.054.868
Terminkontrakte (Futures) *	19.825	-	-	19.825
	<u>267.074.693</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>267.074.693</u>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	447.748.053	-	-	447.748.053
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) *	(8.585)	-	-	(8.585)
	447.739.468	-	-	447.739.468

<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	4.618.673	-	-	4.618.673
Terminkontrakte (Futures) *	30	-	-	30
	4.618.703	-	-	4.618.703

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	143.145.302	-	143.145.302
Devisenterminkontrakte *	-	2.124	-	2.124
Terminkontrakte (Futures) *	97.912	-	-	97.912
Staatsanleihen .....	-	107.031.521	-	107.031.521
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte *	-	(250.303)	-	(250.303)
Terminkontrakte (Futures) *	(19.950)	-	-	(19.950)
	77.962	249.928.644	-	250.006.606

<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	261.847.621	-	261.847.621
Terminkontrakte (Futures) *	526.875	-	-	526.875
Staatsanleihen .....	-	214.322.479	-	214.322.479
Hypothekenbesicherte Wertpapiere .....	-	605.298	-	605.298
Kurzfristige Anlagen .....	-	4.950.903	-	4.950.903
	526.875	481.726.301	-	482.253.176

<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	8.808.380	-	8.808.380
Staatsanleihen .....	-	400.058	-	400.058
	-	9.208.438	-	9.208.438

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	10.300.374	-	-	10.300.374
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures)* .....	(1.370)	-	-	(1.370)
	10.299.004	-	-	10.299.004

<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	37.831.790	-	1.040	37.832.830
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte* .....	-	(2)	-	(2)
Terminkontrakte (Futures)* .....	(3.480)	-	-	(3.480)
	37.828.310	(2)	1.040	37.829.348

<b>Franklin European Dividend UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	46.032.550	-	-	46.032.550
Terminkontrakte (Futures) .....	2.200	-	-	2.200
	46.034.750	-	-	46.034.750

<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	5.008.754	-	-	5.008.754
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures)* .....	(102)	-	-	(102)
	5.008.652	-	-	5.008.652

<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	47.522.583	-	-	47.522.583
	47.522.583	-	-	47.522.583

<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	28.127.826	-	-	28.127.826
Terminkontrakte (Futures)* .....	227	-	-	227
	28.128.053	-	-	28.128.053

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	128.432.379	-	-	128.432.379
Terminkontrakte (Futures)* .....	2.139	-	-	2.139
	128.434.518	-	-	128.434.518
<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	30.224.706	-	-	30.224.706
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures)* .....	(204)	-	-	(204)
	30.224.502	-	-	30.224.502
<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	155.539.117	-	-	155.539.117
Terminkontrakte (Futures)* .....	7.283	-	-	7.283
	155.546.400	-	-	155.546.400
<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	16.130.868	-	-	16.130.868
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures)* .....	(415)	-	-	(415)
	16.130.453	-	-	16.130.453
<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Staatsanleihen .....	-	56.888.680	-	56.888.680
	-	56.888.680	-	56.888.680
<b>Franklin Metaverse UCITS ETF**</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	2.905.321	-	-	2.905.321
	2.905.321	-	-	2.905.321

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF**	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	5.074.736	-	-	5.074.736
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte * .....	-	-	-	-
	<u>5.074.736</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>5.074.736</u>

\* Repräsentiert den nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust).

\*\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Anlagen, deren Werte auf notierten Marktpreisen in aktiven Märkten basieren, werden in die Ebene 1 eingeordnet. Für die ICAV gehören dazu aktive börsennotierte Aktien und börsengehandelte Derivate.

Finanzinstrumente, die nicht börsennotiert sind, aber auf der Grundlage von notierten Marktpreisen, Händlernerotierungen oder alternativen Preisquellen bewertet werden, die durch beobachtbare Parameter gestützt werden, werden der Ebene 2 zugeordnet. Darunter fallen Anleihen.

Übertragungen zwischen den Ebenen der Zeitwerthierarchie gelten als am Ende des Geschäftsjahres erfolgt. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 gab es Übertragungen aus der Ebene 1 in die Ebene 2 (30. Juni 2022: keine). In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 gab es Übertragungen aus der Ebene 1 in die Ebene 3.

### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Im Franklin FTSE China UCITS ETF gab es fünf Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 97.902 USD, die zum 30. Juni 2023 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die Evergrande Property Services Group Ltd wurde am 4. Oktober 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die China Evergrande Group wurde am 4. Oktober 2021 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die CIFI Holdings Group Co Ltd wurde am 31. März 2023 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Shimao Group Holdings Ltd wurde am 1. April 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Yango Group Co Ltd wurde am 12. Juni 2023 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Im Franklin Emerging Markets UCITS ETF gab es 20 Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 1.040 USD, die zum 30. Juni 2023 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die Alrosa PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die PhosAgro PJSC GDR Reg S wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die United Co RUSAL International PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die PhosAgro PJSC GDR wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt. Die PhosAgro PJSC GDR Reg S wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt. Die Shimao Group Holdings Ltd wurde am 1. April 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polyus PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Tatneft PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Novolipetsk Steel PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Gazprom PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Lukoil OAO wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Rosneft Oil Co PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die MMC Norilsk Nickel PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Inter RAO UES PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Severstal PAO wurde am 1. März 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Surgutneftegas PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Surgutneftegas PJSC (preferred stock) wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polymetal International Plc wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die TCS Group Holding Plc GDR wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

Im Franklin Global Dividend UCITS ETF gab es zwei Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von null USD, die zum 30. Juni 2023 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die Tatneft PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel im Russian Trading System (RTS) Index ausgesetzt, und zum 31. Dezember 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polymetal International Plc wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polymetal International Plc wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Im Franklin Global Equity SRI UCITS ETF gab es fünf Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 0 USD, die zum 30. Juni 2023 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die PhosAgro PJSC GDR Reg S wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die PhosAgro PJSC GDR Reg S wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die PhosAgro PJSC GDR wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polyus PJSC wurde am 1. März 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polymetal International Plc wurde am 1. März 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2023 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

Nachstehende Tabellen geben Aufschluss über Veränderungen bezogen auf die Ebene 3 der Zeitwerthierarchie für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023:

	<b>30. Juni 2023 USD</b>
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	298.623
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(910.375)
Nicht realisierter Gewinn im Periodenergebnis	814.112
Käufe	20.850
Verkäufe	(99.963)
Übertragungen auf Ebene 3	2.655
Übertragungen aus Ebene 3	(28.000)
Am Ende des Geschäftsjahres	97.902

	<b>30. Juni 2023 USD</b>
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	17.960
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(65.654)
Nicht realisierter Gewinn im Periodenergebnis	58.516
Käufe	79.420
Verkäufe	(89.202)
Am Ende des Geschäftsjahres	1.040

	<b>30. Juni 2023 USD</b>
<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	4.167
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(13.110)
Nicht realisierter Gewinn im Periodenergebnis	10.553
Verkäufe	(1.610)
Am Ende des Geschäftsjahres	-

	<b>30. Juni 2023 USD</b>
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	-
Nicht realisierter Verlust im Periodenergebnis	(85)
Käufe	27.635
Verkäufe	(27.550)
Am Ende des Geschäftsjahres	-

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

In den folgenden Tabellen wird die Zeitwerthierarchie der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. Juni 2022 analysiert.

<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	26.595.719	-	-	26.595.719
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) *	(56.076)	-	-	(56.076)
	<u>26.539.643</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>26.539.643</u>

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	238.677.645	-	298.623	238.976.268
Terminkontrakte (Futures) *	33.190	-	-	33.190
	<u>238.710.835</u>	<u>-</u>	<u>298.623</u>	<u>239.009.458</u>

<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	122.404.499	-	-	122.404.499
	<u>122.404.499</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>122.404.499</u>

<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	290.304.928	-	-	290.304.928
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) *	(32.781)	-	-	(32.781)
	<u>290.272.147</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>290.272.147</u>

<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF**</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	2.054.278	-	-	2.054.278
	<u>2.054.278</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>2.054.278</u>



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

<b>Franklin Euro Green Bond UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	46.790.880	-	46.790.880
Devisenterminkontrakte .....	-	211.894	-	211.894
Terminkontrakte (Futures) * .....	63.407	-	-	63.407
Staatsanleihen .....	-	27.150.172	-	27.150.172
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte .....	-	(6.783)	-	(6.783)
	63.407	74.146.163	-	74.209.570

<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	302.084.000	-	302.084.000
Terminkontrakte (Futures) * .....	434.546	-	-	434.546
Staatsanleihen .....	-	292.150.814	-	292.150.814
Hypothekenbesicherte Wertpapiere .....	-	685.456	-	685.456
Kurzfristige Anlagen .....	-	1.997.878	-	1.997.878
	434.546	596.918.148	-	597.352.694

<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	12.231.446	-	12.231.446
Staatsanleihen .....	-	400.466	-	400.466
	-	12.631.912	-	12.631.912

<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	5.089.860	-	-	5.089.860
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) * .....	(1.055)	-	-	(1.055)
	5.088.805	-	-	5.088.805

<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	31.175.128	-	17.960	31.193.088
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) * .....	(3.280)	-	-	(3.280)
	31.171.848	-	17.960	31.189.808

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

<b>Franklin European Dividend UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	30.885.281	-	-	30.885.281
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) * .....	(1.890)	-	-	(1.890)
	<u>30.883.391</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>30.883.391</u>
<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	5.813.624	-	-	5.813.624
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) * .....	(435)	-	-	(435)
	<u>5.813.189</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>5.813.189</u>
<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	40.317.613	-	4.167	40.321.780
	<u>40.317.613</u>	<u>-</u>	<u>4.167</u>	<u>40.321.780</u>
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	25.088.331	-	-	25.088.331
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) * .....	(1.053)	-	-	(1.053)
	<u>25.087.278</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>25.087.278</u>
<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	93.867.900	-	-	93.867.900
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) * .....	(9.126)	-	-	(9.126)
	<u>93.858.774</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>93.858.774</u>
<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 EUR</b>	<b>Ebene 2 EUR</b>	<b>Ebene 3 EUR</b>	<b>Insgesamt EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	14.223.125	-	-	14.223.125
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) * .....	235	-	-	235
	<u>14.223.360</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>14.223.360</u>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	109.119.212	-	-	109.119.212
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Terminkontrakte (Futures) *	(8.751)	-	-	(8.751)
	109.110.461	-	-	109.110.461

<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF**</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	2.561.446	-	-	2.561.446
	2.561.446	-	-	2.561.446

<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF**</b>	<b>Ebene 1 USD</b>	<b>Ebene 2 USD</b>	<b>Ebene 3 USD</b>	<b>Insgesamt USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Staatsanleihen .....	-	28.426.550	-	28.426.550
	-	28.426.550	-	28.426.550

\* Repräsentiert den nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust).

\*\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

Nachstehende Tabellen geben Aufschluss über Veränderungen bezogen auf die Ebene 3 der Zeitwerthierarchie für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022:

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>30. Juni 2022 USD</b>
Zu Beginn des Geschäftsjahres	146.252
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(153.760)
Nicht realisierter Verlust im Periodenergebnis	(80.811)
Käufe	275.828
Verkäufe	(117.164)
Übertragungen auf Ebene 3	228.278
Am Ende des Geschäftsjahres	298.623

<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>	<b>30. Juni 2022 USD</b>
Zu Beginn des Geschäftsjahres	1.123.019
Realisierte Gewinne im Periodenergebnis	22.138
Nicht realisierter Verlust im Periodenergebnis	(585.806)
Käufe	465.604
Verkäufe	(808.712)
Übertragungen aus Ebene 3	(216.243)
Am Ende des Geschäftsjahres	-

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

### f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

<b>Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF</b>	<b>30. Juni 2022 USD</b>
Zu Beginn des Geschäftsjahres	11.280
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(9.771)
Nicht realisierter Gewinn im Periodenergebnis	6.168
Verkäufe	(7.677)
Am Ende des Geschäftsjahres	-

<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	<b>30. Juni 2022 USD</b>
Zu Beginn des Geschäftsjahres	63.169
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(55.586)
Nicht realisierter Verlust im Periodenergebnis	(125.975)
Käufe	179.342
Verkäufe	(42.990)
Am Ende des Geschäftsjahres	17.960

<b>Franklin Global Dividend UCITS ETF</b>	<b>30. Juni 2022 USD</b>
Zu Beginn des Geschäftsjahres	-
Übertragungen auf Ebene 3	4.167
Am Ende des Geschäftsjahres	4.167

### g) Gesamtrisiko und Hebelwirkung

Das Gesamtrisiko und die Hebelwirkung der Teilfonds werden anhand des Commitment-Ansatzes berechnet und betragen höchstens 100 % des Nettoinventarwerts. Der Commitment-Ansatz rechnet die Positionen der einzelnen Teilfonds in derivativen Finanzinstrumenten („DFI“) in entsprechende Positionen in den Basiswerten um und stellt möglichst sicher, dass das DFI-Risiko hinsichtlich künftiger Verpflichtungen, die für einen Teilfonds entstehen oder entstehen könnten, überwacht wird.

Eine aus dem Einsatz von DFI und Techniken des effizienten Portfoliomanagements entstehende Hebelwirkung muss den Anforderungen der Zentralbank entsprechen und darf 100 % des Nettoinventarwerts des betreffenden Teilfonds nicht überschreiten.

### 7. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Zum 30. Juni 2023 werden sämtliche Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente sowie Überziehungskredite bei der State Street Custodial Services (Ireland) Limited gehalten. Ausgenommen sind nachstehende Bareinschüsse. Das langfristige Kreditrating von State Street Corporation, der ultimativen Muttergesellschaft der Verwahrstelle, betrug zum 30. Juni 2023 A (30. Juni 2022: A). Sämtliche Bareinschussalden wurden bei J.P. Morgan gehalten, deren Kreditrating zum 30. Juni 2023 bei A+ lag (30. Juni 2022: A+).

Die folgenden zum 30. Juni 2023 Dezember und 30. Juni 2022 bei Maklern gehaltenen Bareinschussalden sind in der Bilanz unter Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente erfasst:

<b>Teilfonds</b>	<b>Währung</b>	<b>30. Juni 2023</b>	<b>30. Juni 2022</b>
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	131.006	187.207
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	181.336	218.505
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	38.875	-
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	145.438	89.394

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 7. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	30. Juni 2023	30. Juni 2022
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	3.070	-
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	360.560	105.974
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	345.489	910.641
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	-	-
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	USD	6.755	3.500
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	12.444	15.985
Franklin European Dividend UCITS ETF	EUR	26.264	12.046
Franklin European Equity UCITS ETF	EUR	2.007	2.163
Franklin Global Dividend UCITS ETF	USD	22	21
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	5.248	6.833
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	6.174	16.267
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	3.981	1.468
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	30.006	57.803
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	5.412	-
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	-	-
Franklin Metaverse UCITS ETF*	USD	-	-
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*	USD	-	-

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 8. Sonstige Forderungen

Zum 30. Juni 2023	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Dividendenforderungen .....	490.933	1.242.071	532.657	1.242.778	53.337	-	-
Zinsforderungen .....	-	-	-	-	-	1.430.745	2.798.515
Sonstige Forderungen .....	591	-	45.880	-	-	-	-
Forderungen für ausgegebene Anteile .....	-	4.441.866	6.869.498	-	-	-	-
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe .....	-	24.330	77.017	-	4.988	2.709.943	3.856.160
	491.524	5.708.267	7.525.052	1.242.778	58.325	4.140.688	6.654.675

Zum 30. Juni 2023	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
Dividendenforderungen .....	-	147.935	515.694	470.109	28.000	108.830	109.386
Zinsforderungen .....	96.613	-	-	-	-	-	-
Sonstige Forderungen .....	-	627	572	-	-	-	293
Forderungen für ausgegebene Anteile .....	-	-	-	-	-	-	-
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe .....	-	4.356	8.950	-	-	-	153
	96.613	152.918	525.216	470.109	28.000	108.830	109.832

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 8. Sonstige Forderungen (Fortsetzung)

	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Metaverse UCITS ETF* USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Dividendenforderungen .....	140.520	38.308	81.244	40.846	-	3.331	16.933
Zinsforderungen .....	-	-	-	-	766.665	-	-
Sonstige Forderungen .....	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen für ausgegebene Anteile .....	-	-	-	-	-	-	-
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe .....	-	-	28.779.126	1.340	-	-	1.955
	140.520	38.308	28.860.370	42.186	766.665	3.331	18.888

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 8. Sonstige Forderungen (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Dividendenforderungen .....	422.721	1.477.686	304.233	765.609	23.919	-	-
Zinsforderungen .....	-	-	-	-	-	362.874	2.616.922
Sonstige Forderungen .....	611	-	15.155	-	-	-	-
Forderungen für ausgegebene Anteile .....	-	1.053	-	-	-	2.694.437	750.202
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe .....	-	35.710	486.197	-	4.792	-	-
	423.332	1.514.449	805.585	765.609	28.711	3.057.311	3.367.124

Zum 30. Juni 2022	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
Dividendenforderungen .....	-	65.803	396.211	194.780	23.300	94.734	76.925
Zinsforderungen .....	113.923	-	-	-	-	-	-
Sonstige Forderungen .....	-	-	2.610	-	-	-	65
Forderungen für ausgegebene Anteile .....	-	-	-	-	-	-	-
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe .....	-	20.123	108.148	-	15.580	-	-
	113.923	85.926	506.969	194.780	38.880	94.734	76.990



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 8. Sonstige Forderungen (Fortsetzung)

	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* USD
<b>Zum 30. Juni 2022</b>					
Dividendenforderungen .....	112.209	19.748	76.174	12.403	-
Zinsforderungen .....	-	-	-	-	407.567
Sonstige Forderungen .....	-	-	-	-	-
Forderungen für ausgegebene Anteile .....	-	-	-	-	-
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe .....	-	9	13.301.033	136	-
	<u>112.209</u>	<u>19.757</u>	<u>13.377.207</u>	<u>12.539</u>	<u>407.567</u>

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 9. Sonstige Verbindlichkeiten

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Zinsaufwendungen .....	(81)	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren .....	(4.999)	(40.982)	(38.552)	(33.520)	(642)	(37.191)	(21.786)
Noch nicht abgerechnete Käufe .....	(87.888)	(4.364.813)	(6.900.235)	-	(13.473)	(1.995.752)	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	(176)	(356)	(43)	(985)	-	-	(8.684)
	<u>(93.144)</u>	<u>(4.406.151)</u>	<u>(6.938.830)</u>	<u>(34.505)</u>	<u>(14.115)</u>	<u>(2.032.943)</u>	<u>(30.470)</u>

	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Zinsaufwendungen .....	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren .....	(2.998)	(3.466)	(14.251)	(9.867)	(1.022)	(17.465)	(9.165)
Noch nicht abgerechnete Käufe .....	-	-	(10.004)	-	(6.043)	-	(9.583)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	(107)	-	-	-	-	(1.018)	-
	<u>(3.105)</u>	<u>(3.466)</u>	<u>(24.255)</u>	<u>(9.867)</u>	<u>(7.065)</u>	<u>(18.483)</u>	<u>(18.748)</u>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Metaverse UCITS ETF* USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Zinsaufwendungen .....	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren .....	(26.092)	(3.702)	(8.736)	(2.996)	(19.535)	(690)	(755)
Noch nicht abgerechnete Käufe .....	-	-	(29.239.443)	-	-	(1.052)	(4.450)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	(1.171)	-	(4.404)	(23)	(1.257)	(90)	(198)
	<u>(27.263)</u>	<u>(3.702)</u>	<u>(29.252.583)</u>	<u>(3.019)</u>	<u>(20.792)</u>	<u>(1.832)</u>	<u>(5.403)</u>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
<b>Zum 30. Juni 2022</b>							
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	(81)	-	(392.333)	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren .....	(4.842)	(35.687)	(18.842)	(25.258)	(351)	(18.580)	(26.670)
Noch nicht abgerechnete Käufe .....	(48.122)	(26.996)	(486.197)	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	(950)	-	-	-	-	-
	<u>(53.045)</u>	<u>(63.633)</u>	<u>(897.372)</u>	<u>(25.258)</u>	<u>(351)</u>	<u>(18.580)</u>	<u>(26.670)</u>

	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2022</b>							
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	-	(20.885)	(95.756)	-	-	(187)	(892)
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren .....	(3.801)	(1.741)	(12.207)	(6.370)	(1.235)	(15.438)	(8.532)
Noch nicht abgerechnete Käufe .....	-	(15.084)	(162.280)	-	(17.631)	-	(5.835)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(490)	-	-	(830)	-
	<u>(3.801)</u>	<u>(37.710)</u>	<u>(270.733)</u>	<u>(6.370)</u>	<u>(18.866)</u>	<u>(16.455)</u>	<u>(15.259)</u>

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* USD
<b>Zum 30. Juni 2022</b>					
Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern .....	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren .....	(19.803)	(2.082)	(6.461)	(242)	(1.152)
Noch nicht abgerechnete Käufe .....	-	-	(13.734.414)	-	(8.461.003)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	-	-	-
	<u>(19.803)</u>	<u>(2.082)</u>	<u>(13.740.875)</u>	<u>(242)</u>	<u>(8.462.155)</u>

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 10. Angaben zu nahe stehenden Unternehmen und Personen

Die auf Seite 3 aufgeführten Verwaltungsratsmitglieder, die Anlageverwalter, Franklin Advisers, Inc., Franklin Templeton Investment Management Limited, Franklin Templeton Institutional, LLC und Franklin Advisory Services LLC, die Verwaltungsgesellschaft, Franklin Templeton International Services S.à r.l., der Vertreter in der Schweiz, Franklin Templeton Switzerland Limited, und die Informationsstelle in Deutschland, Franklin Templeton Investment Services GmbH, gelten als nahe stehende Personen im Sinne der Rechnungslegungsstandards, denen die ICAV unterliegt. Im Geschäftsjahr vom Anlageverwalter vereinnahmte Beträge sind die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen betrieblichen Aufwendungen.

Vom Anlageverwalter im Geschäftsjahr vereinnahmte und zahlbare Beträge am Ende des Geschäftsjahres zum 30. Juni 2023 sind in der TER für die einzelnen Teilfonds enthalten und in Erläuterung 5 angegeben. Im Geschäftsjahr fielen bei der ICAV Gebühren von insgesamt 3.153.698 EUR an (30. Juni 2022: 2.288.232 EUR). Zum Ende des Geschäftsjahres waren Gebühren in Höhe von 278.333 EUR (30. Juni 2021: 202.583 EUR) noch nicht bezahlt und in den sonstigen Verbindlichkeiten enthalten.

### Geschäfte mit Führungskräften in Schlüsselpositionen

Die Beteiligungen von Verwaltungsratsmitgliedern an nahe stehenden Unternehmen oder Personen stellen sich wie folgt dar:

Joseph Carrier kam im Jahr 2008 zur Legg Mason, Inc., bevor er im Jahr 2023 bei Franklin Templeton Investments ausschied. Herr Carrier bekleidete mehrere leitende Posten, unter anderem als Senior Vice President, Enterprise Risk Management, für Franklin Templeton Investments und Chief Risk Officer und Chief Audit Executive für Legg Mason, Inc. Er ist US-amerikanischer Staatsbürger. Er wurde am 23. Februar 2023 in den Verwaltungsrat berufen.

Joseph Larocque kam im Jahr 2001 zur Legg Mason, Inc., bevor er im Jahr 2019 ausschied. Er war ehemaliger Managing Director, zuständig für Affiliate Strategic Initiatives bei Legg Mason. Er ist US-amerikanischer Staatsbürger. Er wurde am 23. Februar 2023 in den Verwaltungsrat berufen.

Jaspal Sagger ist Head of Global Product Strategy & Development bei Franklin Templeton und hatte eine ähnliche Funktion bei Legg Mason bis zu dessen Übernahme im August 2020 inne. Herr Sagger kam im Februar 2014 als Head of International Product Strategy zu Legg Mason und übernahm im Januar 2019 die Funktion des Global Head of Product Strategy & Development. Er ist britischer Staatsbürger. Er wurde am 23. Februar 2023 in den Verwaltungsrat berufen.

Jane Trust ist Senior Vice President – Fund Board Management bei Franklin Templeton. Sie beaufsichtigt auch die Unternehmensführungsstruktur und arbeitet bei Schwerpunktbereichen des Verwaltungsrats eng mit internen Gruppen, wie die Rechtsabteilung und das Rechnungswesen, zusammen. Frau Trust kam im Jahr 1987 zu Legg Mason und bekleidete mehrere führende Posten, unter anderem als Senior Managing Director bei der Legg Mason & Co., LLC. und als President und CEO von Legg Mason – Affiliated Funds. Sie ist US-amerikanische Staatsbürgerin. Er wurde am 24. Februar 2023 in den Verwaltungsrat berufen.

Die folgenden Verwaltungsratsmitglieder sind im Geschäftsjahr aus dem Verwaltungsrat ausgeschieden:

William Jackson ist Chief Administration Officer for Technology & Operations bei Franklin Templeton. Außerdem ist er Verwaltungsratsmitglied bei mehreren Franklin-Templeton-Unternehmen, unter anderem bei der Verwaltungsgesellschaft, sowie bei im Vereinigten Königreich und in Luxemburg ansässigen Fondsgesellschaften. Er ist britischer Staatsbürger. Am 17. Juli 2023 aus dem Verwaltungsrat ausgeschieden.

Gregory E. McGowan war von 1986 bis zu seinem Ausscheiden 2016 bei Franklin Templeton tätig und bekleidete mehrere leitende Posten, unter anderem als Executive Vice President, Director und General Counsel von Templeton International Inc. und Templeton Worldwide Inc. Er ist US-amerikanischer Staatsbürger. Am 23. Februar 2023 aus dem Verwaltungsrat ausgeschieden.

Patrick O'Connor ist Head of Global Exchange Traded Funds bei Franklin Templeton Investments. Er ist US-amerikanischer Staatsbürger. Am 23. Februar 2023 aus dem Verwaltungsrat ausgeschieden.

Caroline Baron ist Head of Exchange Traded Fund Sales - EMEA. Sie unterstützt die Markteinführung von Franklin Templetons Global Exchange Traded Funds in ganz Europa und bewirbt die Franklin Templeton ICAV-Palette in der Region. Sie ist französische Staatsbürgerin. Am 9. November 2022 aus dem Verwaltungsrat ausgeschieden.

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 war abgesehen von den vorstehenden Angaben kein Verwaltungsratsmitglied beziehungsweise keine verbundene Person eines Verwaltungsratsmitglieds als wirtschaftlicher Eigentümer oder anderweitig am Anteilskapital der ICAV oder maßgeblich an der ICAV selbst oder an einem Vertrag oder einer Vereinbarung mit der ICAV beteiligt.

Einzelheiten zu den gezahlten Verwaltungsrats honoraren sind Seite 85 zu entnehmen.

Alle vorstehend genannten Geschäfte mit nahe stehenden Parteien hielten dem Fremdvergleichsgrundsatz stand und erfolgten im normalen Geschäftsgang.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 10. Angaben zu nahe stehenden Unternehmen und Personen (Fortsetzung)

### Bedeutende Anteilinhaber

Den folgenden Tabellen sind die Zahl der Anteilinhaber mit wesentlichen Anteilbeständen (von mindestens 20 %) der einzelnen Teilfonds sowie der prozentuale Anteil des betreffenden Bestands zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 zu entnehmen. Die bedeutenden Anteilinhaber sind die autorisierten Teilnehmer, die zum Bilanzstichtag 100 % der Teilfonds im Register der Primäranteile halten, von denen die Mehrzahl auf dem Sekundärmarkt weiterverkauft wird. Das wirtschaftliche Eigentum dieser Anteile wird dann von den autorisierten Teilnehmern über den Handel der Anteile auf dem Sekundärmarkt weitergegeben.

<b>30. Juni 2023</b>	<b>Anzahl der autorisierten Teilnehmer</b>
<b>Teilfonds</b>	
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	3
Franklin FTSE China UCITS ETF	2
Franklin FTSE India UCITS ETF	2
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	2
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	2
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	2
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	2
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	2
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	2
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	2
Franklin European Dividend UCITS ETF	2
Franklin European Equity UCITS ETF	3
Franklin Global Dividend UCITS ETF	3
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	3
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	2
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	2
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	2
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	2
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	1
Franklin Metaverse UCITS ETF*	1
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*	1

\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt Allgemeine Informationen zu entnehmen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 10. Angaben zu nahe stehenden Unternehmen und Personen (Fortsetzung)

### Wesentliche Anteilinhaber (Fortsetzung)

Teilfonds	Anzahl der autorisierten Teilnehmer
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	3
Franklin FTSE China UCITS ETF	2
Franklin FTSE India UCITS ETF	3
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	3
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*	1
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	1
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	2
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	2
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	1
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	2
Franklin European Dividend UCITS ETF	2
Franklin European Equity UCITS ETF	2
Franklin Global Dividend UCITS ETF	3
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	2
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	2
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	1
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	3
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*	1
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*	1

## 11. Effizientes Portfoliomanagement

Die ICAV kann im Auftrag der einzelnen Teilfonds zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements – also zur Minderung von Risiken, unter anderem dem Risiko eines Tracking Error (Nachbildungsfehler) zwischen der Wertentwicklung eines Teilfonds und der Wertentwicklung des vom betreffenden passiven Teilfonds nachgebildeten Index, zur Verringerung der Kosten der Teilfonds, zur Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Teilfonds sowie zur Absicherung gegen Marktbewegungen, Währungs- oder Zinsrisiken – unter Berücksichtigung des Risikoprofils der einzelnen Teilfonds und der allgemeinen Bestimmungen der OGAW-Vorschriften Techniken und Instrumente wie derivative Finanzinstrumente, Pensions-/umgekehrte Pensionsgeschäfte und Aktienleihgeschäfte einsetzen. Solche Transaktionen können Devisengeschäfte umfassen, welche die Währungsmerkmale der von den einzelnen Teilfonds gehaltenen Wertpapiere verändern. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 oder im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 erfolgten keine Wertpapierleihgeschäfte.

## 12. Ausschüttungen

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 wurden von den Teilfonds die folgenden Ausschüttungen festgesetzt:

Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	Wert EUR	Pro Anteil EUR	Ex-Tag
Ausschüttende EUR-Anteile .....	6.320.080	0,31	12. Juni 2023
Insgesamt .....	<b>6.320.080</b>		

Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Wert USD	Pro Anteil USD	Ex-Tag
Ausschüttende USD-Anteile .....	182.985	0,33	12. Dez. 2022
Ausschüttende USD-Anteile .....	146.400	0,37	12. Juni 2023
Insgesamt .....	<b>329.385</b>		



# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 12. Ausschüttungen (Fortsetzung)

Franklin European Dividend UCITS ETF	Wert EUR	Pro Anteil EUR	Ex-Tag
Ausschüttende EUR-Anteile .....	259.750	0,21	12. Sept. 2022
Ausschüttende EUR-Anteile .....	266.895	0,2	12. Dez. 2022
Ausschüttende EUR-Anteile .....	221.940	0,12	10. Mrz. 2023
Ausschüttende EUR-Anteile .....	1.355.270	0,71	12. Juni 2023
<b>Insgesamt .....</b>	<b>2.103.855</b>		

Franklin Global Dividend UCITS ETF	Wert USD	Pro Anteil USD	Ex-Tag
Ausschüttende USD-Anteile .....	306.180	0,22	12. Sept. 2022
Ausschüttende USD-Anteile .....	240.600	0,16	12. Dez. 2022
Ausschüttende USD-Anteile .....	181.900	0,11	10. Mrz. 2023
Ausschüttende USD-Anteile .....	629.440	0,39	12. Juni 2023
<b>Insgesamt .....</b>	<b>1.358.120</b>		

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 wurden von den Teilfonds die folgenden Ausschüttungen festgesetzt:

Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Wert USD	Pro Anteil USD	Ex-Tag
Anteile USD Distributing .....	176.580	0,29	10. Dez. 2021
Anteile USD Distributing .....	168.465	0,31	10. Juni 2022
<b>Insgesamt .....</b>	<b>345.045</b>		

Franklin European Dividend UCITS ETF	Wert EUR	Pro Anteil EUR	Ex-Tag
Anteile EUR Distributing .....	196.420	0,28	10. Sept. 2021
Anteile EUR Distributing .....	218.610	0,24	10. Dez. 2021
Anteile EUR Distributing .....	129.700	0,13	10. Mrz. 2022
Anteile EUR Distributing .....	912.000	0,76	10. Juni 2022
<b>Insgesamt .....</b>	<b>1.456.730</b>		

Franklin Global Dividend UCITS ETF	Wert USD	Pro Anteil USD	Ex-Tag
Anteile USD Distributing .....	205.080	0,17	10. Sept. 2021
Anteile USD Distributing .....	209.640	0,17	10. Dez. 2021
Anteile USD Distributing .....	351.120	0,13	10. Mrz. 2022
Anteile USD Distributing .....	536.760	0,38	10. Juni 2022
<b>Insgesamt .....</b>	<b>1.302.600</b>		

## 13. Soft Commissions und Directed-Brokerage-Dienste

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 traf der Anlageverwalter für die Teilfonds keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions) oder Directed-Brokerage-Dienste.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 14. Wechselkurse

Zum 30. Juni 2023 galten die folgenden Wechselkurse:

1 USD =	Währung	Wechselkurs	1 EUR =	Währung	Wechselkurs
	AED	3,6731		CHF	0,9761
	AUD	1,5023		DKK	7,4459
	BRL	4,8240		GBP	0,8581
	CAD	1,3233		NOK	11,6885
	CHF	0,8947		PLN	4,4327
	CLP	802,1500		SEK	11,7842
	CNH	7,2748		USD	1,0910
	CNY	7,2641			
	COP	4.175,7750			
	CZK	21,7769			
	DKK	6,8249			
	EGP	30,9000			
	EUR	0,9166			
	GBP	0,7866			
	HKD	7,8366			
	HUF	341,8882			
	IDR	14.992,5000			
	ILS	3,7110			
	INR	82,0363			
	JPY	144,5350			
	KRW	1.317,6500			
	KWD	0,3074			
	MXN	17,1505			
	MYR	4,6675			
	NOK	10,7136			
	NZD	1,6323			
	PHP	55,1995			
	PLN	4,0630			
	QAR	3,6400			
	RUB	89,5000			
	SAR	3,7507			
	SEK	10,8013			
	SGD	1,3534			
	THB	35,4550			
	TRY	26,0700			
	TWD	31,1445			
	ZAR	18,8913			

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 14. Wechselkurse (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022 galten die folgenden Wechselkurse:

1 USD =	Währung	Wechselkurs	1 EUR =	Währung	Wechselkurs
	AED	3,6731		CHF	1,0009
	AUD	1,4542		DKK	7,4367
	BRL	5,2295		GBP	0,8608
	CAD	1,2900		NOK	10,3288
	CHF	0,9574		PLN	4,7002
	CLP	936,8650		SEK	10,7131
	CNH	6,7042		USD	1,0454
	CNY	6,6943			
	COP	4.161,1000			
	CZK	23,6602			
	DKK	7,1134			
	EGP	18,8000			
	EUR	0,9565			
	GBP	0,8234			
	HKD	7,8470			
	HUF	379,5400			
	IDR	14.897,5000			
	ILS	3,5022			
	INR	78,9725			
	JPY	135,8550			
	KRW	1.298,4000			
	KWD	0,3069			
	MXN	20,1758			
	MYR	4,4075			
	NOK	9,8798			
	NZD	1,6084			
	PHP	54,9850			
	PLN	4,4959			
	QAR	3,6418			
	RUB	54,7500			
	SAR	3,7521			
	SEK	10,2474			
	SGD	1,3917			
	THB	35,3550			
	TRY	16,6965			
	TWD	29,7335			
	ZAR	16,3825			

## 15. Wesentliche Ereignisse im Geschäftsjahr

Am 24. Februar 2022 begann Russland seine militärische Operation im Hoheitsgebiet der Ukraine. Die derzeitige politische und finanzielle Unsicherheit im Zusammenhang mit Russland und der Ukraine erhöhte die Marktvolatilität und das wirtschaftliche Risiko einer Anlage in Wertpapieren in diesen und anderen betroffenen Ländern in der Region. Von Teilfonds gehaltene Wertpapiere russischer Emittenten bleiben in der Ebene 3, dies ist in der Vermögensaufstellung des jeweiligen Fonds vermerkt. Aufgrund der Sanktionen, der Maßnahmen von Regierungen, der Entwicklungen in der Ukraine selbst und anderer Umstände hat die Verwaltungsgesellschaft die Auswirkungen auf die Bewertung der betroffenen Wertpapiere geprüft und hat diese Bewertungen falls für notwendig erachtet angepasst. Die Verwaltungsgesellschaft wird die Auswirkungen auf die Bewertung und Liquidität weiterhin prüfen und gegebenenfalls erforderliche Maßnahmen gemäß der Bewertungspolitik und -verfahren der Teilfonds ergreifen.

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## 15. Wesentliche Ereignisse im Geschäftsjahr (Fortsetzung)

Mit Wirkung vom 30. September 2022 kündigte die ICAV ihren Vertrag mit der Zahlstelle in Österreich.

Mit Wirkung vom 9. November 2022 trat Caroline Baron als Verwaltungsratsmitglied zurück.

Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 wurden die nachstehenden Teilfonds im Sinne der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) von Artikel-9-Fonds in Artikel-8-Fonds umklassifiziert:

- Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF
- Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Mit Wirkung vom 1. Dezember änderten sich die Namen der ICAV und verschiedener Teilfonds folgendermaßen:

<b>Alter Name des Teilfonds</b>	<b>Neuer Name des Teilfonds</b>
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	Franklin Emerging Markets UCITS ETF
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	Franklin Euro Green Bond UCITS ETF
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	Franklin European Equity UCITS ETF
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	Franklin European Dividend UCITS ETF
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	Franklin Global Dividend UCITS ETF
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	Franklin U.S. Equity UCITS ETF
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

<b>Alter Name der ICAV</b>	<b>Neuer Name der ICAV</b>
Franklin LibertyShares ICAV	Franklin Templeton ICAV

Frank Ennis schied am 24. Januar 2023 als Verwaltungsratsmitglied aus.

Robert Burke, Gregory McGowan und Patrick O'Connor schieden am 23. Februar 2023 als Verwaltungsratsmitglieder aus.

Joseph Keane, Fionnuala Doris, Joseph Carrier, Joseph Larocque und Jaspal Sagger wurden am 23. Februar 2023 zu Verwaltungsratsmitgliedern ernannt.

Jane Trust wurde am 24. Februar 2023 zum Verwaltungsratsmitglied ernannt.

William Jackson schied am 17. Juli 2023 als Verwaltungsratsmitglied aus.

Craig Tyle wurde am 27. Juli 2023 zum Verwaltungsratsmitglied ernannt.

Am 24. April 2023 wurde die Anteilklasse EUR Thesaurierende Anteile im Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF aufgelegt.

Im Geschäftsjahr gab es keine weiteren wesentlichen Ereignisse, die eine Offenlegung im Abschluss der ICAV erfordern.

## 16. Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

Der Franklin Future of Food UCITS ETF wurde am 5. Juli 2023 aufgelegt.

Der Franklin Future of Health and Wellness UCITS ETF wurde am 5. Juli 2023 aufgelegt.

Mit Wirkung vom 1. August 2023 traten die folgenden Änderungen im Namen der Teilfonds in Kraft:

<b>Alter Name des Teilfonds</b>	<b>Neuer Name des Teilfonds</b>
Franklin European Dividend UCITS ETF	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF
Franklin Global Dividend UCITS ETF	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF

# ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## **16. Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres (Fortsetzung)**

Mit Wirkung vom 16. November 2023 stellt der Franklin European Equity UCITS ETF den Handel ein.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach dem Ende des Geschäftsjahres, die eine Offenlegung im Abschluss der ICAV erfordern würden.

## **17. Genehmigung des Abschlusses**

Der Abschluss wurde am 17. Oktober 2023 vom Verwaltungsrat genehmigt.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 97,82 % (30. Juni 2022: 97,49 %)</b>		
	<b>Aktien: 97,82 % (30. Juni 2022: 97,49 %)</b>		
	<b>Brasilien: 97,82 % (30. Juni 2022: 97,49 %)</b>		
18.200	Alpargatas SA .....	35.087	0,11
15.600	Ambev SA .....	49.833	0,15
319.241	Ambev SA ADR .....	1.015.186	3,10
40.300	Atacadao SA .....	93.566	0,29
27.300	Auren Energia SA .....	81.096	0,25
440.700	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	1.334.707	4,08
115.700	Banco Bradesco SA .....	351.129	1,07
23.400	Banco Bradesco SA (preferred stock) .....	79.795	0,24
375.050	Banco Bradesco SA ADR .....	1.297.673	3,96
88.400	Banco BTG Pactual SA .....	576.323	1,76
65.000	Banco do Brasil SA .....	665.630	2,03
28.600	Banco Santander Brasil SA .....	181.596	0,55
52.000	BB Seguridade Participacoes SA .....	331.683	1,01
2.600	Bradespar SA .....	11.270	0,03
19.500	Bradespar SA (preferred stock) .....	89.779	0,27
14.300	Braskem SA .....	82.587	0,25
61.100	BRF SA .....	112.853	0,35
33.800	Caixa Seguridade Participacoes S/A .....	72.168	0,22
85.800	CCR SA .....	249.894	0,76
101.400	Centrais Eletricas Brasileiras SA .....	835.541	2,55
20.800	Centrais Eletricas Brasileiras SA (preferred stock) .....	191.960	0,59
26.000	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo .....	304.896	0,93
14.300	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista .....	75.176	0,23
97.500	Cia Energetica de Minas Gerais .....	259.919	0,79
24.700	Cia Energetica de Minas Gerais .....	98.923	0,30
24.700	Cia Paranaense de Energia .....	42.140	0,13
101.400	Cia Paranaense de Energia (preferred stock) .....	174.255	0,53
48.100	Cia Siderurgica Nacional SA .....	120.948	0,37
87.100	Cielo SA .....	82.875	0,25
91.000	Cosan SA .....	336.911	1,03
14.300	CPFL Energia SA .....	101.944	0,31
40.300	CSN Mineracao SA .....	34.920	0,11
24.700	Dexco SA .....	42.754	0,13
6.500	Diagnosticos da America SA .....	15.940	0,05
20.800	EDP - Energias do Brasil SA .....	101.844	0,31
55.900	Embraer SA .....	214.840	0,66
22.800	Energisa S/A .....	237.264	0,72
93.600	Eneva SA .....	238.075	0,73
13.000	Engie Brasil Energia SA .....	123.128	0,38
65.318	Equatorial Energia SA .....	435.318	1,33
1.028	Equatorial Energia SA .....	6.815	0,02
83.200	Gerdau SA .....	432.385	1,32
32.500	GPS Participacoes e Empreendimentos SA .....	113.790	0,35
33.800	GRUPO DE MODA SOMA SA .....	84.080	0,26
29.900	Grupo Mateus SA .....	49.090	0,15
364.000	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A .....	330.498	1,01
31.200	Hypera SA .....	297.577	0,91
5.200	Intelbras SA Industria de Telecomunicacao Eletronica Brasileira .....	27.908	0,09
35.100	Itau Unibanco Holding SA .....	178.410	0,55
24.700	Itau Unibanco Holding SA (preferred stock) .....	145.517	0,44
345.488	Itau Unibanco Holding SA ADR .....	2.038.379	6,23
400.400	Itausa SA .....	800.136	2,44
27.300	JBS SA .....	98.810	0,30
38.116	JBS SA ADR .....	282.058	0,86
58.500	Klabin SA .....	264.002	0,81
64.200	Localiza Rent a Car SA .....	911.629	2,78
74.100	Lojas Renner SA .....	307.214	0,94

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 97,82 % (30. Juni 2022: 97,49 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 97,82 % (30. Juni 2022: 97,49 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Brasilien: 97,82 % (30. Juni 2022: 97,49 %) (Fortsetzung)</b>		
9.100	M Dias Branco SA .....	80.304	0,25
232.700	Magazine Luiza SA .....	162.562	0,50
23.400	Marfrig Global Foods SA .....	35.265	0,11
50.700	Metalurgica Gerdau SA .....	124.228	0,38
22.100	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA .....	126.763	0,39
74.100	Natura & Co Holding SA .....	257.138	0,79
18.200	Neoenergia SA .....	80.097	0,24
52.000	Petro Rio SA .....	399.701	1,22
27.300	Petroleo Brasileiro SA .....	187.320	0,57
28.600	Petroleo Brasileiro SA (preferred stock) .....	175.074	0,54
128.466	Petroleo Brasileiro SA ADR .....	1.776.685	5,43
200.746	Petroleo Brasileiro SA ADR (preferred stock) .....	2.483.228	7,58
15.600	Petroleconcavo SA .....	61.993	0,19
14.300	Porto Seguro SA .....	83.357	0,25
85.800	Raia Drogasil SA .....	526.468	1,61
58.500	Rede D'Or Sao Luiz SA .....	399.216	1,22
96.200	Rumo SA .....	442.711	1,35
13.000	Sao Martinho SA .....	92.029	0,28
102.700	Sendas Distribuidora SA .....	292.729	0,89
8.140	SLC Agricola SA .....	64.492	0,20
9.100	Smartfit Escola de Ginastica e Danca SA .....	40.558	0,12
53.300	Suzano SA .....	488.583	1,49
2.600	Telefonica Brasil SA .....	23.321	0,07
30.953	Telefonica Brasil SA ADR .....	282.601	0,86
62.400	TIM SA .....	189.114	0,58
33.800	TOTVS SA .....	210.059	0,64
16.900	Transmissora Alianca de Energia Eletrica S/A .....	131.865	0,40
63.700	Ultrapar Participacoes SA .....	249.439	0,76
3.900	Unipar Carbocloro SA .....	63.981	0,20
13.000	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas .....	19.646	0,06
35.100	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas (preferred stock) .....	51.442	0,16
26.000	Vale SA .....	346.128	1,06
272.207	Vale SA ADR .....	3.653.018	11,16
24.700	Vamos Locacao de Caminhoes Maquinas e Equipamentos SA .....	62.006	0,19
85.800	Vibra Energia SA .....	321.039	0,98
114.400	WEG SA .....	895.232	2,73
		<b>32.029.116</b>	<b>97,82</b>
	<b>Aktien insgesamt .....</b>	<b>32.029.116</b>	<b>97,82</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt .....</b>	<b>32.029.116</b>	<b>97,82</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) % (30. Juni 2022: (0,21) %)

Terminkontrakte (Futures): (0,00) % (30. Juni 2022: (0,21) %)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnittlicher Anschaffungskurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
621.899	24.876	25 of Bovespa Index Long Futures Contracts Expiring August 2023 .....	(713)	(0,00)
134.402	24.889	27 of Mini Bovespa Long Futures Contracts Expiring August 2023.....	(201)	(0,00)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures) .....</b>	<b>(914)</b>	<b>(0,00)</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt .....</b>	<b>(914)</b>	<b>(0,00)</b>
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	32.028.202	97,82
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	713.782	2,18
		<b>Nettovermögen</b>	<b>32.741.984</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		97,54
		Sonstiges Umlaufvermögen .....		2,46
		Gesamtvermögen.....		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 131.006 USD.



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,96 % (30. Juni 2022: 1,04 %)</b>		
708.000	Alibaba Health Information Technology Ltd .....	425.538	0,16
1.770.000	Alibaba Pictures Group Ltd .....	92.606	0,04
590.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd .....	140.039	0,05
389.400	China Gas Holdings Ltd .....	445.730	0,17
115.100	China Resources Gas Group Ltd .....	393.635	0,15
472.000	China Ruyi Holdings Ltd .....	110.827	0,04
118.000	COSCO SHIPPING Ports Ltd .....	70.170	0,03
127.782	Hopson Development Holdings Ltd .....	90.663	0,04
472.000	Kunlun Energy Co Ltd .....	371.028	0,14
265.500	Luye Pharma Group Ltd .....	112.144	0,04
177.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd .....	109.095	0,04
177.000	Shenzhen International Holdings Ltd .....	155.850	0,06
		<b>2.517.325</b>	<b>0,96</b>
	<b>Kaimaninseln: 51,59 % (30. Juni 2022: 52,80 %)</b>		
14.455	360 DigiTech Inc ADR .....	249.783	0,10
206.500	3SBio Inc .....	207.386	0,08
236.000	Agile Group Holdings Ltd .....	37.344	0,01
59.000	Akeso Inc .....	266.149	0,10
2.179.460	Alibaba Group Holding Ltd .....	22.583.371	8,63
5.000	Angelalign Technology Inc .....	46.608	0,02
156.400	ANTA Sports Products Ltd .....	1.597.651	0,61
7.552	Autohome Inc ADR .....	220.217	0,08
283.200	Baidu Inc .....	4.799.270	1,83
76.700	BeiGene Ltd .....	1.051.196	0,40
29.500	Bilibili Inc .....	439.316	0,17
118.000	Blue Moon Group Holdings Ltd .....	58.726	0,02
472.000	Bosideng International Holdings Ltd .....	198.765	0,08
59.000	C&D International Investment Group Ltd .....	133.715	0,05
206.500	China Conch Venture Holdings Ltd .....	268.785	0,10
59.000	China East Education Holdings Ltd .....	22.662	0,01
336.000	China Evergrande Group .....	30.674	0,01
472.000	China Feihe Ltd .....	262.611	0,10
266.500	China Hongqiao Group Ltd .....	216.291	0,08
118.000	China Lesso Group Holdings Ltd .....	77.398	0,03
47.200	China Literature Ltd .....	198.464	0,08
177.000	China Medical System Holdings Ltd .....	288.209	0,11
44.000	China Meidong Auto Holdings Ltd .....	50.813	0,02
402.000	China Mengniu Dairy Co Ltd .....	1.513.319	0,58
236.000	China Resources Cement Holdings Ltd .....	97.274	0,04
354.000	China Resources Land Ltd .....	1.499.772	0,57
7.366	China Resources Microelectronics Ltd .....	53.067	0,02
70.800	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd .....	351.453	0,13
236.000	China State Construction International Holdings Ltd .....	268.935	0,10
464.080	CIFI Holdings Group Co Ltd .....	-	0,00
1.593.000	Country Garden Holdings Co Ltd .....	323.219	0,12
236.000	Country Garden Services Holdings Co Ltd .....	304.773	0,12
9.145	Dada Nexus Ltd ADR .....	48.560	0,02
265.500	Dali Foods Group Co Ltd .....	118.581	0,05
7.080	Daqo New Energy Corp ADR .....	281.077	0,11
59.000	East Buy Holding Ltd .....	191.989	0,07
94.400	ENN Energy Holdings Ltd .....	1.175.725	0,45
480.000	Evergrande Property Services Group Ltd .....	56.249	0,02
79.945	Full Truck Alliance Co Ltd ADR .....	497.259	0,19
2.655.000	GCL Technology Holdings Ltd .....	613.235	0,23
118.000	GDS Holdings Ltd .....	161.120	0,06
649.000	Geely Automobile Holdings Ltd .....	791.747	0,30

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Kaimaninseln: 51,59 % (30. Juni 2022: 52,80 %) (Fortsetzung)</b>		
118.000	Genscript Biotech Corp .....	265.020	0,10
118.000	Greentown China Holdings Ltd .....	118.205	0,05
26.845	H World Group Ltd ADR .....	1.041.052	0,40
177.000	Haidilao International Holding Ltd .....	389.399	0,15
72.000	Haitian International Holdings Ltd .....	167.954	0,06
118.000	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd .....	189.730	0,07
88.500	Hengan International Group Co Ltd .....	372.684	0,14
47.200	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd .....	255.383	0,10
177.000	Innovent Biologics Inc .....	668.573	0,26
56.994	iQIYI Inc ADR .....	304.349	0,12
129.800	JD Health International Inc .....	819.077	0,31
224.200	JD Logistics Inc .....	349.616	0,13
297.950	JD.com Inc .....	5.034.023	1,92
177.000	Jinxin Fertility Group Ltd .....	93.510	0,04
100.300	Jiumaojiu International Holdings Ltd .....	164.343	0,06
4.189	JOYY Inc ADR .....	128.645	0,05
39.117	Kanzhun Ltd ADR .....	588.713	0,22
80.712	KE Holdings Inc ADR .....	1.198.577	0,46
88.500	Kingboard Holdings Ltd .....	241.115	0,09
118.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd .....	110.977	0,04
297.000	Kingdee International Software Group Co Ltd .....	397.193	0,15
12.567	Kingsoft Cloud Holdings Ltd ADR .....	76.659	0,03
106.200	Kingsoft Corp Ltd .....	418.084	0,16
330.400	Kuaishou Technology .....	2.257.789	0,86
177.000	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd .....	58.726	0,02
131.560	Li Auto Inc .....	2.274.819	0,87
295.000	Li Ning Co Ltd .....	1.586.732	0,61
236.000	Longfor Group Holdings Ltd .....	573.407	0,22
86.612	Lufax Holding Ltd ADR .....	123.856	0,05
676.396	Meituan .....	10.556.290	4,03
123.900	Microport Scientific Corp .....	223.882	0,09
59.000	Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd .....	26.427	0,01
12.036	MINISO Group Holding Ltd ADR .....	204.492	0,08
118.000	Minth Group Ltd .....	323.746	0,12
230.100	NetEase Inc .....	4.480.794	1,71
171.100	New Oriental Education & Technology Group Inc .....	671.396	0,26
153.754	NIO Inc ADR .....	1.489.881	0,57
55.283	Pinduoduo Inc ADR .....	3.822.278	1,46
70.800	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd .....	171.119	0,07
82.600	Pop Mart International Group Ltd .....	183.617	0,07
104.371	RLX Technology Inc ADR .....	184.737	0,07
262.285	Seazen Group Ltd .....	51.209	0,02
1.947.000	SenseTime Group Inc .....	514.304	0,20
94.400	Shenzhen International Group Holdings Ltd .....	900.465	0,34
168.000	Shimao Group Holdings Ltd .....	8.324	0,00
101.000	Shimao Services Holdings Ltd .....	19.977	0,01
472.000	Shui On Land Ltd .....	53.606	0,02
1.239.000	Sino Biopharmaceutical Ltd .....	539.150	0,21
236.000	Smooore International Holdings Ltd .....	239.723	0,09
118.000	Sunac Services Holdings Ltd .....	33.278	0,01
82.600	Sunny Optical Technology Group Co Ltd .....	823.745	0,31
57.112	TAL Education Group ADR .....	340.389	0,13
790.600	Tencent Holdings Ltd .....	33.454.548	12,78
80.122	Tencent Music Entertainment Group ADR .....	591.302	0,23
236.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp .....	366.812	0,14
141.600	Tongcheng Travel Holdings Ltd .....	295.979	0,11
354.000	Topsports International Holdings Ltd .....	306.730	0,12

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Kaimaninseln: 51,59 % (30. Juni 2022: 52,80 %) (Fortsetzung)</b>		
177.000	Towngas Smart Energy Co Ltd .....	78.603	0,03
67.850	Trip.com Group Ltd .....	2.360.258	0,90
22.656	Tuya Inc ADR .....	42.820	0,02
118.000	Uni-President China Holdings Ltd .....	99.383	0,04
45.725	Vipshop Holdings Ltd ADR .....	754.465	0,29
9.086	Weibo Corp ADR .....	119.118	0,05
442.500	Wuxi Biologics Cayman Inc .....	2.120.348	0,81
1.852.600	Xiaomi Corp .....	2.534.313	0,97
571.215	Xinyi Solar Holdings Ltd .....	659.678	0,25
139.400	XPeng Inc .....	889.439	0,34
147.500	Xtep International Holdings Ltd .....	150.203	0,06
118.000	Yadea Group Holdings Ltd .....	268.333	0,10
46.197	Yatsen Holding Ltd ADR .....	46.659	0,02
59.000	Yihai International Holding Ltd .....	126.336	0,05
120.200	Zai Lab Ltd .....	322.112	0,12
88.500	Zhongsheng Group Holdings Ltd .....	338.239	0,13
53.100	ZTO Express Cayman Inc .....	1.331.499	0,51
		<b>135.040.974</b>	<b>51,59</b>
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %)</b>		
64.900	360 Security Technology Inc .....	111.872	0,04
17.700	37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd .....	84.865	0,03
17.700	ADAMA Ltd .....	20.535	0,01
17.700	Addsino Co Ltd .....	24.331	0,01
5.336	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China .....	114.755	0,04
11.800	AECC Aero-Engine Control Co Ltd .....	39.578	0,02
23.600	AECC Aviation Power Co Ltd .....	137.095	0,05
3.953.000	Agricultural Bank of China Ltd 'A' Shares .....	1.553.679	0,59
843.700	Agricultural Bank of China Ltd 'H' Shares .....	409.396	0,16
82.600	Aier Eye Hospital Group Co Ltd .....	210.623	0,08
82.600	Air China Ltd 'A' Shares .....	93.560	0,04
236.000	Air China Ltd 'H' Shares .....	168.047	0,06
88.500	A-Living Smart City Services Co Ltd .....	56.919	0,02
5.900	All Winner Technology Co Ltd .....	22.100	0,01
29.500	Alpha Group .....	40.470	0,02
118.000	Aluminum Corp of China Ltd 'A' Shares .....	89.050	0,03
472.000	Aluminum Corp of China Ltd 'H' Shares .....	202.981	0,08
2.783	Amlogic Shanghai Co Ltd .....	32.257	0,01
59.000	Angang Steel Co Ltd 'A' Shares .....	22.546	0,01
236.000	Angang Steel Co Ltd 'H' Shares .....	61.738	0,02
11.800	Angel Yeast Co Ltd .....	58.734	0,02
1.254	Anhui Anke Biotechnology Group Co Ltd (Shenzhen Stock Exchange traded) .....	1.724	0,00
	Anhui Anke Biotechnology Group Co Ltd (Shenzhen-Hong Kong Stock Connect traded) .....	24.331	0,01
147.500	Anhui Conch Cement Co Ltd .....	391.507	0,15
35.400	Anhui Conch Cement Co Ltd .....	115.522	0,04
5.900	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'A' Shares .....	200.631	0,08
11.800	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'B' Shares .....	203.278	0,08
2.300	Anjoy Foods Group Co Ltd .....	46.412	0,02
11.800	Apeloa Pharmaceutical Co Ltd .....	28.775	0,01
840	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd .....	13.609	0,01
5.900	Avary Holding Shenzhen Co Ltd .....	19.700	0,01
88.500	AVIC Industry-Finance Holdings Co Ltd .....	46.593	0,02
295.000	AviChina Industry & Technology Co Ltd .....	143.051	0,05
5.900	AVICOPTER Plc .....	32.295	0,01
324.500	BAIC Motor Corp Ltd .....	78.678	0,03
188.800	Bank of Beijing Co Ltd .....	120.161	0,05

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
29.500	Bank of Changsha Co Ltd .....	31.468	0,01
395.300	Bank of China Ltd 'A' Shares .....	212.464	0,08
9.617.000	Bank of China Ltd 'H' Shares .....	3.853.480	1,47
365.800	Bank of Communications Co Ltd 'A' Shares .....	291.644	0,11
885.000	Bank of Communications Co Ltd 'H' Shares .....	586.131	0,22
53.100	Bank of Hangzhou Co Ltd .....	85.766	0,03
53.100	Bank of Jiangsu Co Ltd .....	53.649	0,02
94.400	Bank of Nanjing Co Ltd .....	103.811	0,04
59.000	Bank of Ningbo Co Ltd .....	205.189	0,08
123.900	Bank of Shanghai Co Ltd .....	97.931	0,04
11.800	Bank of Suzhou Co Ltd .....	10.624	0,00
70.800	Bank of Zhengzhou Co Ltd .....	22.384	0,01
171.100	Baoshan Iron & Steel Co Ltd .....	132.180	0,05
123.900	BBMG Corp 'A' Shares .....	37.129	0,01
295.000	BBMG Corp 'H' Shares .....	32.375	0,01
41.300	Beijing Capital Development Co Ltd .....	22.141	0,01
88.500	Beijing Capital Eco-Environment Protection Group Co Ltd .....	35.036	0,01
236.000	Beijing Capital International Airport Co Ltd .....	152.688	0,06
47.200	Beijing Dabeinong Technology Group Co Ltd .....	42.822	0,02
5.900	Beijing Easpring Material Technology Co Ltd .....	40.819	0,02
5.900	Beijing E-Hualu Information Technology Co Ltd .....	26.950	0,01
35.400	Beijing Enlight Media Co Ltd .....	39.367	0,01
35.400	Beijing Haixin Energy Technology Co Ltd .....	16.642	0,01
29.500	Beijing Jetsen Technology Co Ltd .....	25.588	0,01
236.000	Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd .....	56.317	0,02
3.893	Beijing Kingsoft Office Software Inc .....	252.701	0,10
17.700	Beijing New Building Materials Plc .....	59.635	0,02
17.700	Beijing Orient National Communication Science & Technology Co Ltd .....	27.348	0,01
64.900	Beijing Originwater Technology Co Ltd .....	47.818	0,02
25.516	Beijing Shiji Information Technology Co Ltd .....	49.105	0,02
64.900	Beijing Shougang Co Ltd .....	31.224	0,01
17.700	Beijing Sinnet Technology Co Ltd .....	26.155	0,01
11.800	Beijing Tongrentang Co Ltd .....	93.365	0,04
8.510	Beijing United Information Technology Co Ltd .....	43.201	0,02
2.320	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd .....	21.294	0,01
29.500	Beijing Yanjing Brewery Co Ltd .....	50.567	0,02
17.700	Beijing Zhong Ke San Huan High-Tech Co Ltd .....	31.192	0,01
5.900	Bethel Automotive Safety Systems Co Ltd .....	64.282	0,02
2.204	Bloomage Biotechnology Corp Ltd .....	27.012	0,01
23.600	Bluefocus Intelligent Communications Group Co Ltd .....	31.370	0,01
17.700	Bluestar Adisseo Co .....	19.392	0,01
11.800	BOC International China Co Ltd .....	17.291	0,01
318.600	BOE Technology Group Co Ltd 'A' Shares .....	179.122	0,07
112.100	BOE Technology Group Co Ltd 'B' Shares .....	45.918	0,02
11.800	BTG Hotels Group Co Ltd .....	30.738	0,01
17.700	BYD Co Ltd 'A' Shares .....	628.388	0,24
122.288	BYD Co Ltd 'H' Shares .....	3.901.285	1,49
17.700	By-health Co Ltd .....	58.345	0,02
17.700	C&S Paper Co Ltd .....	27.129	0,01
41.300	Caitong Securities Co Ltd .....	41.103	0,02
17.700	Camel Group Co Ltd .....	22.579	0,01
479	CanSino Biologics Inc 'A' Shares .....	5.366	0,00
11.800	CanSino Biologics Inc 'H' Shares .....	39.377	0,02
29.500	CECEP Solar Energy Co Ltd .....	27.494	0,01
76.700	CECEP Wind-Power Corp .....	38.694	0,01
53.100	Central China Securities Co Ltd 'A' Shares .....	27.080	0,01
177.000	Central China Securities Co Ltd 'H' Shares .....	25.072	0,01

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
118.000	CGN Power Co Ltd 'A' Shares .....	50.446	0,02
1.475.000	CGN Power Co Ltd 'H' Shares .....	355.744	0,14
47.200	Changjiang Securities Co Ltd .....	37.631	0,01
17.700	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd .....	71.411	0,03
5.900	Chengxin Lithium Group Co Ltd .....	25.847	0,01
29.500	China Baoan Group Co Ltd .....	48.945	0,02
1.180.000	China Cinda Asset Management Co Ltd .....	117.452	0,04
1.121.000	China CITIC Bank Corp Ltd .....	526.426	0,20
88.500	China CITIC Bank Corp Ltd .....	72.749	0,03
236.000	China Coal Energy Co Ltd .....	175.275	0,07
53.100	China Coal Energy Co Ltd .....	61.605	0,02
354.000	China Communications Services Corp Ltd .....	174.371	0,07
100.300	China Construction Bank Corp 'A' Shares .....	86.309	0,03
11.800.000	China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	7.634.381	2,92
41.300	China CSSC Holdings Ltd .....	186.835	0,07
106.200	China Eastern Airlines Corp Ltd 'A' Shares .....	69.488	0,03
236.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H' Shares .....	79.807	0,03
295.000	China Energy Engineering Corp Ltd 'A' Shares .....	94.890	0,04
590.000	China Energy Engineering Corp Ltd 'H' Shares .....	72.278	0,03
413.000	China Everbright Bank Co Ltd 'A' Shares .....	174.289	0,07
354.000	China Everbright Bank Co Ltd 'H' Shares .....	101.641	0,04
472.000	China Galaxy Securities Co Ltd .....	251.769	0,10
29.500	China Galaxy Securities Co Ltd .....	47.080	0,02
29.500	China Great Wall Securities Co Ltd .....	32.968	0,01
29.500	China Greatwall Technology Group Co Ltd .....	56.082	0,02
17.700	China Green Electricity Investment of Tianjin Co Ltd .....	28.394	0,01
1.711.000	China Huarong Asset Management Co Ltd .....	78.603	0,03
5.900	China International Capital Corp Ltd 'A' Shares .....	28.808	0,01
188.800	China International Capital Corp Ltd 'H' Shares .....	331.034	0,13
23.600	China International Marine Containers Group Co Ltd 'A' Shares .....	22.352	0,01
88.500	China International Marine Containers Group Co Ltd 'H' Shares .....	51.385	0,02
35.400	China Jushi Co Ltd .....	68.904	0,03
944.000	China Life Insurance Co Ltd .....	1.573.255	0,60
413.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd .....	425.312	0,16
11.800	China Meheco Co Ltd .....	21.054	0,01
472.000	China Merchants Bank Co Ltd .....	2.144.252	0,82
182.900	China Merchants Bank Co Ltd .....	823.642	0,31
76.700	China Merchants Energy Shipping Co Ltd .....	61.046	0,02
23.600	China Merchants Expressway Network & Technology Holdings Co Ltd .....	31.143	0,01
11.800	China Merchants Property Operation & Service Co Ltd .....	24.412	0,01
64.900	China Merchants Securities Co Ltd 'A' Shares .....	121.061	0,05
59.000	China Merchants Securities Co Ltd 'H' Shares .....	55.564	0,02
64.900	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd .....	116.244	0,04
324.500	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A' Shares .....	167.273	0,06
796.500	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' Shares .....	294.759	0,11
5.900	China National Accord Medicines Corp Ltd 'A' Shares .....	35.369	0,01
15.280	China National Accord Medicines Corp Ltd 'B' Shares .....	29.091	0,01
590.000	China National Building Material Co Ltd .....	362.897	0,14
59.000	China National Chemical Engineering Co Ltd .....	67.153	0,03
135.700	China National Nuclear Power Co Ltd .....	131.507	0,05
7.640	China National Software & Service Co Ltd .....	49.234	0,02
35.400	China Nonferrous Metal Industry's Foreign Engineering and Construction Co Ltd .....	22.968	0,01
29.500	China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd .....	97.242	0,04
23.600	China Oilfield Services Ltd 'A' Shares .....	45.028	0,02
238.000	China Oilfield Services Ltd 'H' Shares .....	245.702	0,09
59.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A' Shares .....	210.704	0,08

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
330.400	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' Shares .....	853.786	0,33
300.900	China Petroleum & Chemical Corp 'A' Shares .....	263.063	0,10
3.186.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H' Shares .....	1.866.132	0,71
531.000	China Railway Group Ltd .....	350.323	0,13
188.800	China Railway Group Ltd .....	196.722	0,08
62.127	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'A' Shares .....	49.532	0,02
236.000	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'H' Shares .....	89.143	0,03
11.800	China Rare Earth Resources And Technology Co Ltd .....	48.013	0,02
1.062.000	China Reinsurance Group Corp .....	71.827	0,03
5.900	China Resources Boya Bio-pharmaceutical Group Co Ltd .....	29.424	0,01
5.900	China Resources Double Crane Pharmaceutical Co Ltd .....	14.128	0,01
11.800	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd .....	98.393	0,04
64.900	China Shenhua Energy Co Ltd 'A' Shares .....	274.328	0,10
413.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H' Shares .....	1.262.233	0,48
17.700	China South Publishing & Media Group Co Ltd .....	28.224	0,01
112.100	China Southern Airlines Co Ltd 'A' Shares .....	92.919	0,04
236.000	China Southern Airlines Co Ltd 'H' Shares .....	133.112	0,05
35.400	China Southern Power Grid Energy Efficiency&Clean Energy Co Ltd .....	34.647	0,01
401.200	China State Construction Engineering Corp Ltd .....	316.558	0,12
236.000	China Suntien Green Energy Corp Ltd .....	84.626	0,03
236.000	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd .....	174.208	0,07
17.700	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd .....	268.927	0,10
11.800	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd .....	159.614	0,06
5.900.000	China Tower Corp Ltd .....	655.021	0,25
11.800	China TransInfo Technology Co Ltd .....	22.125	0,01
241.900	China United Network Communications Ltd .....	159.609	0,06
88.500	China Vanke Co Ltd 'A' Shares .....	170.558	0,07
289.100	China Vanke Co Ltd 'H' Shares .....	388.104	0,15
17.700	China West Construction Group Co Ltd .....	17.372	0,01
200.600	China Yangtze Power Co Ltd .....	608.299	0,23
5.900	China Zhenhua Group Science & Technology Co Ltd .....	77.737	0,03
91.980	China Zheshang Bank Co Ltd .....	33.379	0,01
11.800	Chinalin Securities Co Ltd .....	22.190	0,01
11.800	Chinese Universe Publishing and Media Group Co Ltd .....	21.606	0,01
5.900	Chongqing Brewery Co Ltd .....	74.744	0,03
76.700	Chongqing Changan Automobile Co Ltd 'A' Shares .....	136.325	0,05
182.900	Chongqing Changan Automobile Co Ltd 'B' Shares .....	85.422	0,03
5.900	Chongqing Department Store Co Ltd .....	25.499	0,01
7.640	Chongqing Fuling Zhacai Group Co Ltd .....	19.229	0,01
295.000	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd .....	104.276	0,04
47.200	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd .....	23.293	0,01
17.700	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd .....	107.542	0,04
41.300	Citic Pacific Special Steel Group Co Ltd .....	89.926	0,03
112.100	CITIC Securities Co Ltd 'A' Shares .....	304.799	0,12
295.000	CITIC Securities Co Ltd 'H' Shares .....	534.557	0,20
94.400	CMOC Group Ltd 'A' Shares .....	69.164	0,03
531.000	CMOC Group Ltd 'H' Shares .....	277.819	0,11
64.900	CNOOC Energy Technology & Services Ltd .....	27.388	0,01
36.580	Contemporary Amperex Technology Co Ltd .....	1.150.434	0,44
88.500	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'A' Shares .....	30.048	0,01
531.000	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H' Shares .....	65.728	0,03
41.300	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'A' Shares .....	71.759	0,03
118.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H' Shares .....	118.356	0,05
123.900	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A' Shares .....	160.096	0,06
413.000	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' Shares .....	372.082	0,14
531.000	CRRC Corp Ltd .....	290.694	0,11
194.700	CRRC Corp Ltd .....	173.964	0,07

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
47.200	CSC Financial Co Ltd 'A' Shares .....	157.014	0,06
118.000	CSC Financial Co Ltd 'H' Shares .....	121.668	0,05
159.300	CSG Holding Co Ltd .....	52.446	0,02
11.800	Daan Gene Co Ltd .....	16.172	0,01
135.700	Daqin Railway Co Ltd .....	138.596	0,05
472.000	Datang International Power Generation Co Ltd .....	89.143	0,03
35.400	DHC Software Co Ltd .....	34.355	0,01
5.900	Dian Diagnostics Group Co Ltd .....	20.787	0,01
8.260	Do-Fluoride New Materials Co Ltd .....	22.550	0,01
5.900	Dong-E-E-Jiao Co Ltd .....	43.349	0,02
23.600	Dongfang Electric Corp Ltd 'A' Shares .....	60.502	0,02
47.200	Dongfang Electric Corp Ltd 'H' Shares .....	60.352	0,02
377.600	Dongfeng Motor Group Co Ltd .....	172.504	0,07
35.400	Dongxing Securities Co Ltd .....	39.026	0,01
17.700	East Group Co Ltd .....	16.302	0,01
141.600	East Money Information Co Ltd .....	276.397	0,11
23.600	Easyhome New Retail Group Co Ltd .....	12.360	0,00
5.900	Ecovacs Robotics Co Ltd .....	63.073	0,02
29.500	ENN Natural Gas Co Ltd .....	76.966	0,03
17.700	Eve Energy Co Ltd .....	147.201	0,06
35.400	Everbright Securities Co Ltd 'A' Shares .....	77.323	0,03
35.400	Everbright Securities Co Ltd 'H' Shares .....	24.304	0,01
41.300	Fangda Carbon New Material Co Ltd .....	35.198	0,01
29.500	FAW Jiefang Group Co Ltd .....	33.941	0,01
11.800	Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd .....	33.041	0,01
35.400	Financial Street Holdings Co Ltd .....	21.995	0,01
47.200	First Capital Securities Co Ltd .....	37.112	0,01
5.900	Flat Glass Group Co Ltd 'A' Shares .....	31.232	0,01
59.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H' Shares .....	201.400	0,08
129.800	Focus Media Information Technology Co Ltd .....	121.507	0,05
42.460	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd .....	273.445	0,10
112.100	Foxconn Industrial Internet Co Ltd .....	388.318	0,15
11.800	Fujian Sunner Development Co Ltd .....	31.062	0,01
17.700	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'A' Shares .....	87.225	0,03
70.800	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'H' Shares .....	292.727	0,11
15.400	Ganfeng Lithium Group Co Ltd 'A' Shares .....	129.046	0,05
47.200	Ganfeng Lithium Group Co Ltd 'H' Shares .....	307.785	0,12
64.900	GCL System Integration Technology Co Ltd .....	26.139	0,01
188.800	GD Power Development Co Ltd .....	99.399	0,04
53.100	GEM Co Ltd .....	50.438	0,02
41.300	Gemdale Corp .....	40.932	0,02
53.100	GF Securities Co Ltd 'A' Shares .....	107.371	0,04
129.800	GF Securities Co Ltd 'H' Shares .....	179.220	0,07
5.900	GigaDevice Semiconductor Inc .....	86.171	0,03
2.700	Ginlong Technologies Co Ltd .....	38.636	0,01
17.700	Glarun Technology Co Ltd .....	39.416	0,02
35.400	GoerTek Inc .....	86.374	0,03
1.044	GoodWe Technologies Co Ltd .....	23.946	0,01
17.700	Gotion High-tech Co Ltd .....	67.201	0,03
41.300	Grandjoy Holdings Group Co Ltd .....	20.778	0,01
23.600	Great Wall Motor Co Ltd 'A' Shares .....	81.654	0,03
295.000	Great Wall Motor Co Ltd 'H' Shares .....	337.675	0,13
17.700	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai .....	88.831	0,03
29.500	GRG Banking Equipment Co Ltd .....	47.526	0,02
118.000	Guangdong Electric Power Development Co Ltd .....	36.289	0,01
11.800	Guangdong Golden Dragon Development Inc .....	20.243	0,01
11.800	Guangdong Haid Group Co Ltd .....	75.977	0,03

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
41.300	Guangdong HEC Technology Holding Co Ltd .....	40.932	0,02
11.800	Guangdong Xinbao Electrical Appliances Holdings Co Ltd .....	29.245	0,01
59.000	Guanghui Energy Co Ltd .....	55.636	0,02
236.000	Guangshen Railway Co Ltd .....	74.687	0,03
29.500	Guangxi Liugong Machinery Co Ltd .....	32.035	0,01
35.400	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'A' Shares .....	50.705	0,02
354.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H' Shares .....	210.962	0,08
11.800	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'A' Shares .....	51.711	0,02
29.500	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H' Shares .....	89.030	0,03
5.900	Guangzhou Great Power Energy & Technology Co Ltd .....	38.962	0,01
5.900	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd .....	61.232	0,02
17.700	Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd .....	100.218	0,04
5.900	Guangzhou Wondfo Biotech Co Ltd .....	21.598	0,01
29.500	Guangzhou Yuexiu Capital Holdings Group Co Ltd .....	25.750	0,01
23.600	Guangzhou Zhujiang Brewery Co Ltd .....	28.580	0,01
35.400	Guizhou Xinbang Pharmaceutical Co Ltd .....	21.557	0,01
17.700	Guolian Securities Co Ltd .....	22.141	0,01
59.000	Guosen Securities Co Ltd .....	70.802	0,03
23.200	Guosheng Financial Holding Inc .....	28.000	0,01
64.900	Guotai Junan Securities Co Ltd 'A' Shares .....	124.808	0,05
94.400	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H' Shares .....	110.706	0,04
41.300	Guoyuan Securities Co Ltd .....	37.015	0,01
53.100	Haier Smart Home Co Ltd 'A' Shares .....	171.385	0,07
295.000	Haier Smart Home Co Ltd 'H' Shares .....	927.946	0,35
5.900	Haisco Pharmaceutical Group Co Ltd .....	19.140	0,01
448.400	Haitong Securities Co Ltd .....	274.657	0,10
82.600	Haitong Securities Co Ltd .....	104.687	0,04
11.800	Hang Zhou Great Star Industrial Co Ltd .....	35.490	0,01
5.900	Hangzhou Chang Chuan Technology Co Ltd .....	38.515	0,01
10.684	Hangzhou First Applied Material Co Ltd .....	54.619	0,02
5.900	Hangzhou Lion Electronics Co Ltd .....	29.789	0,01
5.900	Hangzhou Oxygen Plant Group Co Ltd .....	27.867	0,01
11.800	Hangzhou Robam Appliances Co Ltd .....	41.022	0,02
11.800	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd .....	49.099	0,02
5.900	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'A' Shares .....	52.343	0,02
17.700	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' Shares .....	100.851	0,04
5.900	Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd .....	21.249	0,01
5.900	Haohua Chemical Science & Technology Co Ltd .....	30.527	0,01
7.220	Hefei Meiya Optoelectronic Technology Inc .....	25.556	0,01
17.700	Heilongjiang Agriculture Co Ltd .....	32.433	0,01
17.700	Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd .....	31.630	0,01
29.500	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd .....	99.310	0,04
17.700	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd .....	44.306	0,02
29.500	Hengli Petrochemical Co Ltd .....	58.110	0,02
23.600	Hengtong Optic-electric Co Ltd .....	47.558	0,02
29.500	Hengyi Petrochemical Co Ltd .....	27.494	0,01
94.400	Hesteel Co Ltd .....	29.327	0,01
5.900	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd .....	142.156	0,05
41.300	Holitech Technology Co Ltd .....	20.040	0,01
5.900	Hongfa Technology Co Ltd .....	25.831	0,01
5.900	Hoshine Silicon Industry Co Ltd .....	56.788	0,02
64.900	Huadian Power International Corp Ltd 'A' Shares .....	59.683	0,02
236.000	Huadian Power International Corp Ltd 'H' Shares .....	123.174	0,05
17.700	Huadong Medicine Co Ltd .....	105.522	0,04
35.400	Huafon Chemical Co Ltd .....	33.382	0,01
11.800	Huagong Tech Co Ltd .....	61.654	0,02
23.600	Huaibei Mining Holdings Co Ltd .....	37.372	0,01



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
17.700	Hualan Biological Engineering Inc .....	54.525	0,02
64.900	Huaneng Lancang River Hydropower Inc .....	63.609	0,02
76.700	Huaneng Power International Inc 'A' Shares .....	97.631	0,04
472.000	Huaneng Power International Inc 'H' Shares .....	295.136	0,11
64.900	Huatai Securities Co Ltd 'A' Shares .....	122.846	0,05
165.200	Huatai Securities Co Ltd 'H' Shares .....	204.065	0,08
23.600	Huaxi Securities Co Ltd .....	26.958	0,01
135.700	Huaxia Bank Co Ltd .....	100.916	0,04
11.800	Huaxin Cement Co Ltd .....	20.032	0,01
38.800	Huaxin Cement Co Ltd .....	33.619	0,01
29.500	Huayu Automotive Systems Co Ltd .....	74.857	0,03
59.000	Hubei Biocause Pharmaceutical Co Ltd .....	24.331	0,01
82.600	Hubei Energy Group Co Ltd .....	51.776	0,02
5.900	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co Ltd .....	23.552	0,01
11.800	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd .....	36.042	0,01
5.900	Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd .....	126.365	0,05
17.700	Humanwell Healthcare Group Co Ltd .....	65.547	0,02
17.228	Hunan Changyuan Lico Co Ltd .....	26.689	0,01
11.800	Hunan Gold Corp Ltd .....	19.789	0,01
59.040	Hunan Valin Steel Co Ltd .....	38.712	0,01
14.800	Hundsun Technologies Inc .....	90.105	0,03
29.500	Hytera Communications Corp Ltd .....	23.560	0,01
17.700	Iflytek Co Ltd .....	165.351	0,06
1.600	Imeik Technology Development Co Ltd .....	97.861	0,04
672.600	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A' Shares .....	445.641	0,17
9.971.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares .....	5.318.619	2,03
182.900	Industrial Bank Co Ltd .....	393.468	0,15
82.600	Industrial Securities Co Ltd .....	69.488	0,03
5.900	Ingenic Semiconductor Co Ltd .....	71.621	0,03
11.800	Inmyshow Digital Technology Group Co Ltd .....	11.500	0,00
359.900	Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd .....	88.556	0,03
17.700	Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp Ltd .....	32.165	0,01
74.280	Inner Mongolia ERDOS Resources Co Ltd .....	81.708	0,03
70.800	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd .....	39.902	0,02
53.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd .....	206.713	0,08
129.800	Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd .....	177.437	0,07
17.700	Inspur Electronic Information Industry Co Ltd .....	118.004	0,05
5.900	Intco Medical Technology Co Ltd .....	17.843	0,01
29.500	JA Solar Technology Co Ltd .....	169.098	0,06
5.900	Jafron Biomedical Co Ltd .....	18.800	0,01
5.900	Jason Furniture Hangzhou Co Ltd .....	30.941	0,01
17.700	JCET Group Co Ltd .....	75.839	0,03
41.300	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd .....	67.104	0,03
150.000	Jiangsu Expressway Co Ltd .....	138.201	0,05
23.600	Jiangsu Expressway Co Ltd .....	31.889	0,01
11.800	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd .....	104.346	0,04
59.000	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd .....	388.480	0,15
11.800	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd .....	85.644	0,03
23.600	Jiangsu Phoenix Publishing & Media Corp Ltd .....	36.983	0,01
11.800	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd .....	213.056	0,08
5.900	Jiangsu Yoke Technology Co Ltd .....	59.107	0,02
11.800	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd .....	58.377	0,02
46.400	Jiangsu Zhongnan Construction Group Co Ltd .....	10.014	0,00
29.500	Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd .....	64.517	0,02
23.600	Jiangxi Copper Co Ltd 'A' Shares .....	61.573	0,02
177.000	Jiangxi Copper Co Ltd 'H' Shares .....	271.947	0,10
17.700	Jiangxi Special Electric Motor Co Ltd .....	29.002	0,01

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
11.800	Jilin Aodong Pharmaceutical Group Co Ltd .....	26.018	0,01
53.100	Jinke Properties Group Co Ltd .....	8.102	0,00
35.400	Jinke Smart Services Group Co Ltd .....	50.956	0,02
17.700	Joincare Pharmaceutical Group Industry Co Ltd .....	30.924	0,01
5.900	Joynn Laboratories China Co Ltd 'A' Shares .....	33.171	0,01
10.852	Joynn Laboratories China Co Ltd 'H' Shares .....	27.281	0,01
17.484	Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd .....	24.947	0,01
5.900	Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co Ltd .....	29.838	0,01
11.800	Joyoung Co Ltd .....	24.250	0,01
23.600	Juneyao Airlines Co Ltd .....	50.056	0,02
11.800	Kaishan Group Co Ltd .....	24.606	0,01
17.700	Keda Industrial Group Co Ltd .....	27.640	0,01
23.600	Kuang-Chi Technologies Co Ltd .....	49.505	0,02
11.800	Kunlun Tech Co Ltd .....	65.336	0,02
11.800	Kweichow Moutai Co Ltd .....	2.742.879	1,05
29.500	Lao Feng Xiang Co Ltd .....	108.590	0,04
23.600	LB Group Co Ltd .....	53.527	0,02
64.900	Legend Holdings Corp .....	60.126	0,02
41.300	Lens Technology Co Ltd .....	66.763	0,03
76.700	Leo Group Co Ltd .....	24.250	0,01
17.700	Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd .....	55.012	0,02
5.900	Levima Advanced Materials Corp .....	20.194	0,01
35.400	Leyard Optoelectronic Co Ltd .....	31.776	0,01
11.800	LianChuang Electronic Technology Co Ltd .....	15.750	0,01
5.900	Lianhe Chemical Technology Co Ltd .....	8.483	0,00
200.600	Liaoning Port Co Ltd .....	43.017	0,02
70.800	Lingyi iTech Guangdong Co .....	67.250	0,03
5.900	Livzon Pharmaceutical Group Inc 'A' Shares .....	31.557	0,01
23.600	Livzon Pharmaceutical Group Inc 'H' Shares .....	81.162	0,03
70.800	LONGi Green Energy Technology Co Ltd .....	279.024	0,11
11.800	Longshine Technology Group Co Ltd .....	37.761	0,01
17.700	Luxi Chemical Group Co Ltd .....	25.693	0,01
64.900	Luxshare Precision Industry Co Ltd .....	289.495	0,11
11.800	Luzhou Laojiao Co Ltd .....	339.932	0,13
118.000	Maanshan Iron & Steel Co Ltd .....	20.780	0,01
5.900	Maccura Biotechnology Co Ltd .....	12.263	0,00
17.700	Mango Excellent Media Co Ltd .....	83.235	0,03
5.900	Maxscend Microelectronics Co Ltd .....	78.369	0,03
29.500	Meihua Holdings Group Co Ltd .....	36.212	0,01
47.200	Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd .....	46.131	0,02
147.500	Metallurgical Corp of China Ltd 'A' Shares .....	80.494	0,03
413.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H' Shares .....	101.717	0,04
23.600	Ming Yang Smart Energy Group Ltd .....	54.760	0,02
8.700	Montage Technology Co Ltd .....	68.669	0,03
11.800	Montnets Cloud Technology Group Co Ltd .....	21.557	0,01
47.200	Muyuan Foods Co Ltd .....	273.477	0,10
29.500	NanJi E-Commerce Co Ltd .....	15.531	0,01
53.100	Nanjing Iron & Steel Co Ltd .....	24.598	0,01
7.280	Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co Ltd .....	13.510	0,01
77.860	NARI Technology Co Ltd .....	247.234	0,09
5.900	NAURA Technology Group Co Ltd .....	257.621	0,10
23.600	NavInfo Co Ltd .....	37.567	0,01
17.700	New China Life Insurance Co Ltd 'A' Shares .....	89.464	0,03
94.400	New China Life Insurance Co Ltd 'H' Shares .....	248.757	0,09
47.200	New Hope Liuhe Co Ltd .....	75.782	0,03
11.800	Newland Digital Technology Co Ltd .....	30.657	0,01
11.800	Ninestar Corp .....	55.555	0,02

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
2.880	Ningbo Deye Technology Co Ltd .....	59.205	0,02
17.700	Ningbo Joyson Electronic Corp .....	42.919	0,02
5.900	Ningbo Orient Wires & Cables Co Ltd .....	39.764	0,02
4.080	Ningbo Ronbay New Energy Technology Co Ltd .....	30.297	0,01
23.600	Ningbo Shanshan Co Ltd .....	49.116	0,02
11.800	Ningbo Tuopu Group Co Ltd.....	130.899	0,05
82.600	Ningbo Zhoushan Port Co Ltd .....	38.491	0,01
29.500	Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd .....	51.135	0,02
224.200	Nongfu Spring Co Ltd .....	1.237.387	0,47
11.800	North Industries Group Red Arrow Co Ltd .....	29.343	0,01
29.500	Northeast Securities Co Ltd .....	28.142	0,01
23.600	Offcn Education Technology Co Ltd .....	15.247	0,01
59.000	Offshore Oil Engineering Co Ltd .....	47.445	0,02
35.400	OFILM Group Co Ltd .....	27.250	0,01
5.900	Oppl Lighting Co Ltd .....	16.464	0,01
17.700	ORG Technology Co Ltd .....	10.973	0,00
70.800	Orient Securities Co Ltd 'A' Shares .....	94.403	0,04
118.000	Orient Securities Co Ltd 'H' Shares .....	64.599	0,02
23.600	Oriental Energy Co Ltd .....	28.061	0,01
35.400	Ourpalm Co Ltd .....	37.956	0,01
5.900	Ovctek China Inc .....	24.485	0,01
82.600	Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co Ltd .....	44.395	0,02
11.800	People.cn Co Ltd .....	47.364	0,02
100.300	People's Insurance Co Group of China Ltd 'A' Shares .....	80.518	0,03
1.062.000	People's Insurance Co Group of China Ltd 'H' Shares .....	384.881	0,15
11.800	Perfect World Co Ltd .....	27.396	0,01
230.100	PetroChina Co Ltd 'A' Shares .....	236.275	0,09
2.596.000	PetroChina Co Ltd 'H' Shares .....	1.795.510	0,69
23.600	Pharmaron Beijing Co Ltd .....	72.881	0,03
826.000	PICC Property & Casualty Co Ltd .....	918.083	0,35
165.200	Ping An Bank Co Ltd .....	255.018	0,10
94.400	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A' Shares .....	602.103	0,23
796.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' Shares .....	5.066.812	1,94
23.600	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co Ltd .....	24.460	0,01
106.200	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd .....	190.217	0,07
11.800	Poly Property Services Co Ltd .....	57.145	0,02
1.180.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd .....	725.793	0,28
194.700	Postal Savings Bank of China Co Ltd .....	130.875	0,05
159.300	Power Construction Corp of China Ltd .....	125.692	0,05
891	Pylon Technologies Co Ltd .....	24.281	0,01
11.800	Qingdao TGOOD Electric Co Ltd .....	33.706	0,01
47.200	Qinghai Salt Lake Industry Co Ltd .....	124.378	0,05
2.958	Raytron Technology Co Ltd .....	18.216	0,01
23.600	Red Star Macalline Group Corp Ltd 'A' Shares .....	15.539	0,01
82.600	Red Star Macalline Group Corp Ltd 'H' Shares .....	32.676	0,01
29.500	Remegen Co Ltd .....	128.934	0,05
53.100	RiseSun Real Estate Development Co Ltd .....	11.241	0,00
35.400	Rongsheng Petrochemical Co Ltd .....	56.642	0,02
70.800	SAIC Motor Corp Ltd .....	137.906	0,05
29.500	Sailun Group Co Ltd .....	46.188	0,02
29.500	Sansteel Minguang Co Ltd Fujian .....	17.113	0,01
82.600	Sany Heavy Industry Co Ltd .....	188.822	0,07
33.716	Satellite Chemical Co Ltd .....	69.334	0,03
76.700	Sealand Securities Co Ltd .....	35.320	0,01
23.600	Seazen Holdings Co Ltd .....	46.747	0,02
41.300	SF Holding Co Ltd .....	255.983	0,10
3.607	SG Micro Corp .....	40.722	0,02

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
88.500	Shaanxi Coal Industry Co Ltd .....	221.288	0,08
53.100	Shaanxi International Trust Co Ltd .....	22.263	0,01
35.400	Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co Ltd .....	38.491	0,01
135.700	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'B' Shares .....	33.767	0,01
88.500	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'H' Shares .....	28.572	0,01
11.800	Shandong Denghai Seeds Co Ltd .....	24.769	0,01
35.400	Shandong Gold Mining Co Ltd 'A' Shares .....	114.257	0,04
88.500	Shandong Gold Mining Co Ltd 'H' Shares .....	161.271	0,06
11.800	Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co Ltd .....	56.982	0,02
17.700	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd .....	74.525	0,03
11.800	Shandong Linglong Tyre Co Ltd .....	36.042	0,01
129.800	Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd .....	53.884	0,02
5.900	Shandong Pharmaceutical Glass Co Ltd .....	22.076	0,01
23.600	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd .....	34.679	0,01
306.800	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd .....	400.903	0,15
23.600	Shanghai Bailian Group Co Ltd .....	15.836	0,01
7.660	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd .....	38.275	0,01
8.716	Shanghai Baosight Software Co Ltd .....	60.876	0,02
76.700	Shanghai Baosight Software Co Ltd .....	202.489	0,08
76.700	Shanghai Construction Group Co Ltd .....	28.361	0,01
35.400	Shanghai Dazhong Public Utilities Group Co Ltd .....	16.156	0,01
112.100	Shanghai Electric Group Co Ltd 'A' Shares .....	70.421	0,03
354.000	Shanghai Electric Group Co Ltd 'H' Shares .....	82.668	0,03
35.400	Shanghai Electric Power Co Ltd .....	52.408	0,02
17.700	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'A' Shares .....	75.182	0,03
59.000	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'H' Shares .....	157.356	0,06
762	Shanghai Friendless Electronic Technology Corp Ltd .....	19.751	0,01
59.000	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd .....	145.008	0,06
41.300	Shanghai Huayi Group Co Ltd .....	17.470	0,01
23.600	Shanghai International Airport Co Ltd .....	147.347	0,06
94.400	Shanghai International Port Group Co Ltd .....	68.126	0,03
11.800	Shanghai Jinjiang International Hotels Co Ltd 'A' Shares .....	68.677	0,03
17.700	Shanghai Jinjiang International Hotels Co Ltd 'B' Shares .....	32.179	0,01
6.670	Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'A' Shares .....	35.336	0,01
23.600	Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'H' Shares .....	68.664	0,03
17.700	Shanghai Lingang Holdings Corp Ltd .....	29.075	0,01
159.300	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd .....	99.085	0,04
23.600	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd .....	32.019	0,01
5.900	Shanghai M&G Stationery Inc .....	36.204	0,01
35.400	Shanghai Mechanical and Electrical Industry Co Ltd .....	39.259	0,01
23.600	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'A' Shares .....	72.700	0,03
106.200	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H' Shares .....	210.330	0,08
271.400	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd .....	270.103	0,10
17.110	Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd .....	89.892	0,03
59.000	Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd .....	60.908	0,02
82.600	Shanghai Shibeil Hi-Tech Co Ltd .....	16.024	0,01
35.400	Shanghai Tunnel Engineering Co Ltd .....	29.245	0,01
11.800	Shanghai Waigaoqiao Free Trade Zone Group Co Ltd 'A' Shares .....	18.345	0,01
35.400	Shanghai Waigaoqiao Free Trade Zone Group Co Ltd 'B' Shares .....	29.665	0,01
35.400	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd .....	33.382	0,01
17.700	Shanghai Zhangjiang High-Tech Park Development Co Ltd .....	33.868	0,01
147.500	Shanghai Zhenhua Heavy Industries Co Ltd .....	35.253	0,01
41.300	Shanxi Coking Coal Energy Group Co Ltd .....	51.662	0,02
29.500	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd .....	66.179	0,03
41.300	Shanxi Meijin Energy Co Ltd .....	42.806	0,02
53.100	Shanxi Securities Co Ltd .....	40.730	0,02
53.100	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd .....	28.248	0,01

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
11.800	Shanxi Xinghuaacun Fen Wine Factory Co Ltd .....	300.192	0,11
76.700	Shanying International Holding Co Ltd .....	24.144	0,01
23.600	Shenghe Resources Holding Co Ltd .....	41.751	0,02
23.600	Shengyi Technology Co Ltd .....	46.066	0,02
200.600	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd 'A' Shares .....	127.395	0,05
283.200	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd 'H' Shares .....	54.209	0,02
35.400	Shenzhen Airport Co Ltd .....	33.820	0,01
9.420	Shenzhen Capchem Technology Co Ltd .....	67.192	0,03
1.728	Shenzhen Dynanonic Co Ltd .....	26.183	0,01
70.800	Shenzhen Energy Group Co Ltd .....	64.136	0,02
5.900	Shenzhen Everwin Precision Technology Co Ltd .....	9.659	0,00
118.000	Shenzhen Expressway Corp Ltd .....	100.587	0,04
23.600	Shenzhen Gas Corp Ltd .....	23.649	0,01
29.500	Shenzhen Hepalink Pharmaceutical Group Co Ltd .....	16.187	0,01
12.950	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd .....	114.302	0,04
17.700	Shenzhen Jinjia Group Co Ltd .....	14.647	0,01
11.800	Shenzhen Kaifa Technology Co Ltd .....	32.425	0,01
8.540	Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd .....	29.806	0,01
11.800	Shenzhen Kingdom Sci-Tech Co Ltd .....	23.585	0,01
11.800	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd .....	486.289	0,19
59.000	Shenzhen MTC Co Ltd .....	44.606	0,02
53.100	Shenzhen Neptunus Bioengineering Co Ltd .....	23.503	0,01
82.600	Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd .....	49.959	0,02
11.800	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd .....	50.592	0,02
11.800	Shenzhen Sunway Communication Co Ltd .....	32.571	0,01
7.192	Shenzhen Transsion Holdings Co Ltd .....	145.327	0,06
5.900	Shenzhen YUTO Packaging Technology Co Ltd .....	19.781	0,01
29.500	Shenzhen Zhongjin Lingnan Nonfemet Co Ltd .....	19.262	0,01
23.600	Shijiazhuang Changshan BeiMing Technology Co Ltd .....	26.245	0,01
17.700	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co Ltd .....	62.506	0,02
29.500	Siasun Robot & Automation Co Ltd .....	67.599	0,03
41.300	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd .....	85.441	0,03
82.600	Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd .....	27.591	0,01
17.700	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd .....	72.213	0,03
11.800	Sichuan New Energy Power Co Ltd .....	23.357	0,01
64.900	Sichuan Road and Bridge Group Co Ltd .....	87.517	0,03
5.900	Sichuan Swellfun Co Ltd .....	47.842	0,02
11.800	Sichuan Yahua Industrial Group Co Ltd .....	28.840	0,01
5.900	Sieyuan Electric Co Ltd .....	37.891	0,01
17.700	Sinoma International Engineering Co .....	31.022	0,01
17.700	Sinoma Science & Technology Co Ltd .....	49.927	0,02
8.220	Sinomine Resource Group Co Ltd .....	57.559	0,02
236.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd .....	105.105	0,04
354.000	Sinopec Oilfield Service Corp .....	23.942	0,01
472.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd .....	74.085	0,03
165.200	Sinopharm Group Co Ltd .....	516.488	0,20
59.000	Sinotrans Ltd 'A' Shares .....	37.794	0,01
295.000	Sinotrans Ltd 'H' Shares .....	105.029	0,04
2.320	Skshu Paint Co Ltd .....	20.863	0,01
29.500	Songcheng Performance Development Co Ltd .....	50.283	0,02
43.940	SooChow Securities Co Ltd .....	41.918	0,02
70.800	Southwest Securities Co Ltd .....	35.523	0,01
1.000	StarPower Semiconductor Ltd .....	29.582	0,01
17.700	STO Express Co Ltd .....	26.326	0,01
11.800	Sungrow Power Supply Co Ltd .....	189.179	0,07
35.400	Suning Universal Co Ltd .....	13.285	0,01
17.700	Sunwoda Electronic Co Ltd .....	39.708	0,02

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
11.800	Suzhou Anjie Technology Co Ltd .....	22.384	0,01
17.700	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd .....	63.016	0,02
41.300	Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co Ltd .....	25.604	0,01
2.080	Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd .....	48.429	0,02
4.466	Suzhou Nanomicro Technology Co Ltd .....	23.850	0,01
7.670	Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co Ltd .....	37.745	0,01
5.900	Taiji Computer Corp Ltd .....	33.390	0,01
29.500	Tangshan Jidong Cement Co Ltd .....	29.886	0,01
59.000	TangShan Port Group Co Ltd .....	28.629	0,01
35.400	TBEA Co Ltd .....	108.466	0,04
149.270	TCL Technology Group Corp .....	80.844	0,03
36.850	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd .....	168.173	0,06
5.900	Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co Ltd .....	24.501	0,01
35.400	Tianjin Chase Sun Pharmaceutical Co Ltd .....	26.374	0,01
29.500	Tianma Microelectronics Co Ltd .....	37.226	0,01
11.800	Tianqi Lithium Corp 'A' Shares .....	113.397	0,04
11.800	Tianqi Lithium Corp 'H' Shares .....	82.141	0,03
17.700	Tianshan Aluminum Group Co Ltd .....	14.574	0,01
29.500	Tianshui Huatian Technology Co Ltd .....	37.307	0,01
5.900	Tibet Summit Resources Co Ltd .....	14.809	0,01
23.600	Titan Wind Energy Suzhou Co Ltd .....	49.408	0,02
17.700	TongFu Microelectronics Co Ltd .....	54.987	0,02
23.600	Tongkun Group Co Ltd .....	42.984	0,02
94.400	Tongling Nonferrous Metals Group Co Ltd .....	37.502	0,01
41.300	Tongwei Co Ltd .....	194.783	0,07
11.800	Topsec Technologies Group Inc .....	15.734	0,01
23.600	Transfar Zhilian Co Ltd .....	17.259	0,01
118.000	TravelSky Technology Ltd .....	200.271	0,08
20.414	Trina Solar Co Ltd .....	119.570	0,05
5.900	Tsingtao Brewery Co Ltd 'A' Shares .....	84.046	0,03
79.375	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H' Shares .....	721.187	0,28
7.899	Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd .....	101.251	0,04
11.800	Unisplendour Corp Ltd .....	51.662	0,02
11.800	Universal Scientific Industrial Shanghai Co Ltd .....	24.266	0,01
5.900	Valiant Co Ltd .....	14.120	0,01
11.800	Visual China Group Co Ltd .....	29.829	0,01
17.700	Walvax Biotechnology Co Ltd .....	64.355	0,02
35.400	Wangsu Science & Technology Co Ltd .....	34.598	0,01
29.500	Wanhua Chemical Group Co Ltd .....	356.201	0,14
29.500	Wanxiang Qianchao Co Ltd .....	22.100	0,01
70.800	Weichai Power Co Ltd 'A' Shares .....	121.264	0,05
236.000	Weichai Power Co Ltd 'H' Shares .....	345.731	0,13
11.800	Weifu High-Technology Group Co Ltd 'A' Shares .....	25.547	0,01
23.600	Weifu High-Technology Group Co Ltd 'B' Shares .....	28.278	0,01
9.440	Weihai Guangwei Composites Co Ltd .....	40.032	0,02
17.700	Wens Foodstuffs Group Co Ltd .....	44.647	0,02
23.600	Western Mining Co Ltd .....	34.095	0,01
47.200	Western Securities Co Ltd .....	41.200	0,02
4.418	Western Superconducting Technologies Co Ltd .....	33.845	0,01
11.800	Westone Information Industry Inc .....	45.206	0,02
5.900	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai .....	79.513	0,03
11.800	Wingtech Technology Co Ltd .....	79.318	0,03
17.700	Winning Health Technology Group Co Ltd .....	26.326	0,01
17.700	Wolong Electric Group Co Ltd .....	35.547	0,01
11.800	Wonders Information Co Ltd .....	18.378	0,01
59.000	Wuchan Zhongda Group Co Ltd .....	40.065	0,02
38.300	Wuhan Guide Infrared Co Ltd .....	40.907	0,02

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
35.400	Wuliangye Yibin Co Ltd .....	795.954	0,30
23.200	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd .....	66.780	0,03
23.600	WuXi AppTec Co Ltd 'A' Shares .....	202.139	0,08
47.200	WuXi AppTec Co Ltd 'H' Shares .....	376.449	0,14
1.218	Wuxi Autowell Technology Co Ltd .....	31.543	0,01
5.900	Wuxi Shangji Automation Co Ltd .....	60.462	0,02
71.900	XCMG Construction Machinery Co Ltd .....	66.911	0,03
29.500	Xiamen C & D Inc .....	44.241	0,02
35.400	Xiamen ITG Group Corp Ltd .....	37.664	0,01
11.800	Xiamen Tungsten Co Ltd .....	30.868	0,01
5.900	Xinfengming Group Co Ltd .....	8.962	0,00
59.000	Xinhua Winshare Publishing and Media Co Ltd .....	43.141	0,02
6.961	Xinjiang Daqo New Energy Co Ltd .....	38.705	0,01
35.400	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'A' Shares .....	51.678	0,02
82.600	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H' Shares .....	56.603	0,02
17.700	Xinjiang Tianshan Cement Co Ltd .....	19.805	0,01
35.400	Xinjiang Zhongtai Chemical Co Ltd .....	31.387	0,01
11.800	Xuji Electric Co Ltd .....	37.388	0,01
52.200	Yango Group Co Ltd .....	2.655	0,00
29.500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co .....	44.797	0,02
5.900	Yangzhou Yangjie Electronic Technology Co Ltd .....	32.903	0,01
11.800	Yankuang Energy Group Co Ltd 'A' Shares .....	48.532	0,02
147.500	Yankuang Energy Group Co Ltd 'H' Shares .....	422.564	0,16
29.500	Yantai Changyu Pioneer Wine Co Ltd .....	41.296	0,02
11.800	Yantai Eddie Precision Machinery Co Ltd .....	33.284	0,01
11.800	Yantai Jereh Oilfield Services Group Co Ltd .....	40.762	0,02
5.900	Yealink Network Technology Corp Ltd .....	28.443	0,01
5.900	Yifan Pharmaceutical Co Ltd .....	11.841	0,00
8.220	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd .....	41.807	0,02
17.700	Yihai Kerry Arawana Holdings Co Ltd .....	97.298	0,04
23.700	Yintai Gold Co Ltd .....	38.117	0,01
5.900	Yixintang Pharmaceutical Group Co Ltd .....	21.411	0,01
1.770	YongXing Special Materials Technology Co Ltd .....	15.233	0,01
29.500	Yonyou Network Technology Co Ltd .....	83.130	0,03
47.200	Youngor Group Co Ltd .....	40.940	0,02
29.500	YTO Express Group Co Ltd .....	59.042	0,02
11.800	Yuan Longping High-tech Agriculture Co Ltd .....	24.898	0,01
11.800	Yunda Holding Co Ltd .....	15.507	0,01
29.500	Yunnan Aluminium Co Ltd .....	51.622	0,02
15.240	Yunnan Baiyao Group Co Ltd .....	109.941	0,04
11.800	Yunnan Copper Co Ltd .....	17.924	0,01
5.970	Yunnan Energy New Material Co Ltd .....	79.069	0,03
17.700	Yunnan Tin Co Ltd .....	37.834	0,01
17.700	Yunnan Yuntianhua Co Ltd .....	41.532	0,02
11.800	Zangge Mining Co Ltd .....	36.610	0,01
5.900	Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co Ltd .....	232.244	0,09
118.000	Zhaojin Mining Industry Co Ltd .....	147.267	0,06
70.800	Zhefu Holding Group Co Ltd .....	40.194	0,02
82.600	Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd .....	86.179	0,03
53.100	Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd .....	62.262	0,02
11.800	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd .....	44.850	0,02
17.700	Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd .....	29.051	0,01
29.500	Zhejiang Dahua Technology Co Ltd .....	80.089	0,03
5.900	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd .....	45.425	0,02
118.000	Zhejiang Expressway Co Ltd .....	89.595	0,03
17.700	Zhejiang Hailiang Co Ltd .....	29.221	0,01
3.197	Zhejiang HangKe Technology Inc Co .....	13.390	0,01

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,38 % (30. Juni 2022: 41,98 %) (Fortsetzung)</b>		
29.500	Zhejiang Hisoar Pharmaceutical Co Ltd .....	34.833	0,01
23.600	Zhejiang Huace Film & Television Co Ltd .....	23.001	0,01
11.800	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd .....	29.862	0,01
14.440	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd .....	91.129	0,03
11.800	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd .....	115.003	0,04
5.900	Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co Ltd .....	22.206	0,01
23.600	Zhejiang Juhua Co Ltd .....	44.704	0,02
5.900	Zhejiang Medicine Co Ltd .....	8.881	0,00
27.120	Zhejiang NHU Co Ltd .....	57.410	0,02
17.700	Zhejiang Runtu Co Ltd .....	16.229	0,01
11.800	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd .....	49.083	0,02
5.333	Zhejiang Supcon Technology Co Ltd .....	46.023	0,02
5.900	Zhejiang Supor Co Ltd .....	40.551	0,02
17.700	Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Co Ltd .....	16.861	0,01
11.800	Zhejiang Wanliyang Co Ltd .....	14.517	0,01
17.700	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd .....	49.975	0,02
5.900	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd .....	27.275	0,01
11.800	Zhejiang Yongtai Technology Co Ltd .....	24.801	0,01
11.800	Zheshang Securities Co Ltd .....	16.026	0,01
94.400	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd .....	256.588	0,10
5.900	Zhongji Innolight Co Ltd .....	119.585	0,05
41.300	Zhongshan Broad Ocean Motor Co Ltd .....	32.360	0,01
23.600	Zhongtai Securities Co Ltd .....	22.417	0,01
29.500	Zhuhai Huafa Properties Co Ltd .....	39.943	0,02
4.002	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'A' Shares .....	23.028	0,01
70.800	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H' Shares .....	263.815	0,10
5.900	Zhuzhou Hongda Electronics Corp Ltd .....	36.269	0,01
17.700	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd .....	20.973	0,01
182.900	Zijin Mining Group Co Ltd 'A' Shares .....	285.861	0,11
708.000	Zijin Mining Group Co Ltd 'H' Shares .....	1.038.999	0,40
76.700	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'A' Shares .....	71.167	0,03
200.600	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' Shares .....	103.674	0,04
35.400	ZTE Corp 'A' Shares .....	221.604	0,08
94.400	ZTE Corp 'H' Shares .....	378.256	0,14
		<b>110.915.178</b>	<b>42,38</b>
	<b>Hongkong: 3,06 % (30. Juni 2022: 3,15 %)</b>		
59.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd .....	213.446	0,08
88.500	BYD Electronic International Co Ltd .....	267.655	0,10
472.000	China Everbright Environment Group Ltd .....	186.116	0,07
118.000	China Everbright Ltd .....	70.622	0,03
826.000	China Jinmao Holdings Group Ltd .....	121.216	0,05
203.040	China Merchants Port Holdings Co Ltd .....	286.563	0,11
501.500	China Overseas Land & Investment Ltd .....	1.093.057	0,42
590.000	China Power International Development Ltd .....	216.835	0,08
199.479	China Resources Beer Holdings Co Ltd .....	1.313.502	0,50
206.500	China Resources Pharmaceutical Group Ltd .....	179.717	0,07
236.000	China Resources Power Holdings Co Ltd .....	533.052	0,20
177.000	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd .....	183.858	0,07
354.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd .....	164.885	0,06
590.000	CITIC Ltd .....	703.959	0,27
1.062.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd .....	922.902	0,35
177.000	Far East Horizon Ltd .....	140.039	0,05
295.000	Fosun International Ltd .....	202.529	0,08
383.500	Guangdong Investment Ltd .....	330.823	0,13
59.000	Hua Hong Semiconductor Ltd .....	192.742	0,07
59.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd .....	85.529	0,03



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,10 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,26 % (30. Juni 2022: 99,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Hongkong: 3,06 % (30. Juni 2022: 3,15 %) (Fortsetzung)</b>		
354.000	Shenzhen Investment Ltd .....	63.243	0,03
236.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd .....	59.328	0,02
383.500	Sino-Ocean Group Holding Ltd .....	21.533	0,01
88.500	Sinotruk Hong Kong Ltd .....	171.887	0,07
295.000	Sun Art Retail Group Ltd .....	76.043	0,03
177.000	Yuexiu Property Co Ltd .....	205.767	0,08
		<b>8.006.848</b>	<b>3,06</b>
	<b>Singapur: 0,19 % (30. Juni 2022: 0,13 %)</b>		
271.400	Yangzijiang Financial Holding Ltd .....	68.184	0,03
342.200	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd .....	379.285	0,14
106.300	Yanlord Land Group Ltd .....	60.088	0,02
		<b>507.557</b>	<b>0,19</b>
	<b>Vereinigte Staaten: 1,08 % (30. Juni 2022: null)</b>		
50.150	Yum China Holdings Inc .....	2.826.076	1,08
		<b>2.826.076</b>	<b>1,08</b>
	<b>Aktien insgesamt.....</b>	<b>259.813.958</b>	<b>99,26</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt .....</b>	<b>259.813.958</b>	<b>99,26</b>

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) % (30. Juni 2022: 0,01 %)

Terminkontrakte (Futures): (0,00) % (30. Juni 2022: 0,01 %)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnitt- licher An- schaffungskurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
463.793	464	20 of MSCI China Long Futures Contracts Expiring August 2023 .....	25.907	0,01
1.598.648	470	3 of MSCI China Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	(32.948)	(0,01)
		Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures)	25.907	0,01
		<b>Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)</b>	<b>(32.948)</b>	<b>(0,01)</b>
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures) .....</b>	<b>(7.041)</b>	<b>(0,00)</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt.....</b>	<b>(7.041)</b>	<b>(0,00)</b>
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	259.806.917	99,26
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	1.925.031	0,74
		<b>Nettovermögen</b>	<b>261.731.948</b>	<b>100,00</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....	97,61
Börsengehandelte derivative Instrumente .....	0,01
Sonstiges Umlaufvermögen .....	<u>2,38</u>
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 181.336 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %)</b>		
	<b>Aktien: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %)</b>		
	<b>Indien: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %)</b>		
620	3M India Ltd .....	204.157	0,08
46.965	Aarti Industries Ltd .....	288.315	0,11
12.710	ABB India Ltd .....	685.284	0,26
19.220	ACC Ltd .....	424.935	0,16
83.235	Adani Enterprises Ltd .....	2.423.065	0,91
99.820	Adani Green Energy Ltd .....	1.150.995	0,43
199.640	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd .....	1.799.073	0,68
227.695	Adani Power Ltd .....	693.497	0,26
66.185	Adani Total Gas Ltd .....	528.117	0,20
74.865	Adani Transmission Ltd .....	700.209	0,26
39.215	Adani Wilmar Ltd .....	195.970	0,07
109.430	Aditya Birla Capital Ltd .....	261.852	0,10
5.735	Alkem Laboratories Ltd .....	245.585	0,09
174.375	Ambuja Cements Ltd .....	905.312	0,34
40.145	APL Apollo Tubes Ltd .....	638.801	0,24
23.715	Apollo Hospitals Enterprise Ltd .....	1.473.829	0,56
333.715	Ashok Leyland Ltd .....	680.984	0,26
107.105	Asian Paints Ltd .....	4.389.578	1,65
27.590	Astral Ltd .....	666.799	0,25
77.345	AU Small Finance Bank Ltd .....	710.594	0,27
62.775	Aurobindo Pharma Ltd .....	556.597	0,21
35.340	Avenue Supermarts Ltd .....	1.675.481	0,63
541.260	Axis Bank Ltd .....	6.515.176	2,46
15.965	Bajaj Auto Ltd .....	913.055	0,34
58.125	Bajaj Finance Ltd .....	5.073.659	1,91
90.520	Bajaj Finserv Ltd .....	1.686.068	0,64
6.200	Bajaj Holdings & Investment Ltd .....	529.402	0,20
19.220	Balkrishna Industries Ltd .....	555.376	0,21
186.620	Bandhan Bank Ltd .....	550.649	0,21
249.240	Bank of Baroda .....	578.333	0,22
184.295	Bank of India .....	165.344	0,06
14.880	Bata India Ltd .....	303.919	0,11
2.790	Bayer CropScience Ltd .....	149.001	0,06
57.815	Berger Paints India Ltd .....	477.905	0,18
852.035	Bharat Electronics Ltd .....	1.306.054	0,49
60.450	Bharat Forge Ltd .....	616.633	0,23
311.550	Bharat Heavy Electricals Ltd .....	332.881	0,13
238.235	Bharat Petroleum Corp Ltd .....	1.059.134	0,40
550.870	Bharti Airtel Ltd .....	5.900.941	2,22
36.735	Bharti Airtel Ltd (partly paid) .....	217.558	0,08
105.710	Biocon Ltd .....	342.125	0,13
2.015	Bosch Ltd .....	467.748	0,18
28.210	Britannia Industries Ltd .....	1.727.861	0,65
85.095	Canara Bank .....	313.112	0,12
110.980	Castrol India Ltd .....	163.425	0,06
164.300	CG Power & Industrial Solutions Ltd .....	758.075	0,29
94.860	Cholamandalam Investment and Finance Co Ltd .....	1.320.566	0,50
120.590	Cipla Ltd .....	1.491.981	0,56
535.215	Coal India Ltd .....	1.507.102	0,57
9.920	Coforge Ltd .....	569.723	0,21
31.000	Colgate-Palmolive India Ltd .....	637.933	0,24
65.720	Container Corp Of India Ltd .....	530.192	0,20
25.420	Coromandel International Ltd .....	293.884	0,11
32.240	Cummins India Ltd .....	763.659	0,29
138.260	Dabur India Ltd .....	965.646	0,36
19.530	Dalmia Bharat Ltd .....		0,19
17.360	Deepak Nitrite Ltd .....	460.009	0,17

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
30.380	Divi's Laboratories Ltd .....	1.327.157	0,50
8.525	Dixon Technologies India Ltd .....	456.066	0,17
148.335	DLF Ltd .....	887.024	0,33
8.680	Dr Lal PathLabs Ltd .....	239.066	0,09
28.675	Dr Reddy's Laboratories Ltd .....	1.803.547	0,68
33.015	Eicher Motors Ltd .....	1.440.839	0,54
49.290	Emami Ltd .....	255.175	0,10
144.150	Embassy Office Parks REIT .....	512.509	0,19
112.375	Exide Industries Ltd .....	324.250	0,12
366.420	Federal Bank Ltd .....	563.466	0,21
317.285	FSN E-Commerce Ventures Ltd .....	574.769	0,22
629.920	GAIL India Ltd .....	806.651	0,30
26.040	General Insurance Corp of India .....	57.980	0,02
10.075	GlaxoSmithKline Pharmaceuticals Ltd .....	175.025	0,07
35.340	Glenmark Pharmaceuticals Ltd .....	291.221	0,11
581.560	GMR Airports Infrastructure Ltd .....	309.803	0,12
86.645	Godrej Consumer Products Ltd .....	1.141.770	0,43
21.700	Godrej Industries Ltd .....	136.982	0,05
24.800	Godrej Properties Ltd .....	474.163	0,18
91.295	Grasim Industries Ltd .....	1.930.491	0,73
9.610	Gujarat Fluorochemicals Ltd .....	343.522	0,13
49.445	Gujarat Gas Ltd .....	280.305	0,11
56.420	Havells India Ltd .....	882.275	0,33
251.100	HCL Technologies Ltd .....	3.636.242	1,37
23.250	HDFC Asset Management Co Ltd .....	650.629	0,24
232.965	HDFC Life Insurance Co Ltd .....	1.849.336	0,70
31.155	Hero MotoCorp Ltd .....	1.105.208	0,42
334.645	Hindalco Industries Ltd .....	1.717.207	0,65
22.475	Hindustan Aeronautics Ltd .....	1.039.039	0,39
145.700	Hindustan Petroleum Corp Ltd .....	486.376	0,18
210.645	Hindustan Unilever Ltd .....	6.876.952	2,59
54.405	Hindustan Zinc Ltd .....	203.835	0,08
533	Honeywell Automation India Ltd .....	270.803	0,10
418.345	Housing Development Finance Corp Ltd .....	14.391.020	5,43
373.395	ICICI Bank Ltd .....	4.254.044	1,60
56.420	ICICI Lombard General Insurance Co Ltd .....	924.672	0,35
91.605	ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd .....	639.299	0,24
137.640	IDBI Bank Ltd .....	92.870	0,03
763.685	IDFC First Bank Ltd .....	739.168	0,28
47.895	Indian Bank .....	170.803	0,06
198.555	Indian Hotels Co Ltd .....	950.020	0,36
971.075	Indian Oil Corp Ltd .....	1.080.772	0,41
72.695	Indian Railway Catering & Tourism Corp Ltd .....	562.806	0,21
425.475	Indian Railway Finance Corp Ltd .....	169.605	0,06
83.390	Indraprastha Gas Ltd .....	481.177	0,18
198.400	Indus Towers Ltd .....	397.240	0,15
18.135	Info Edge India Ltd .....	991.192	0,37
832.505	Infosys Ltd .....	13.553.063	5,11
29.760	InterGlobe Aviation Ltd .....	952.993	0,36
33.170	Ipca Laboratories Ltd .....	300.369	0,11
706.490	ITC Ltd .....	3.889.278	1,47
92.225	Jindal Steel & Power Ltd .....	653.233	0,25
92.845	JSW Energy Ltd .....	308.704	0,12
237.305	JSW Steel Ltd .....	2.270.254	0,86
84.940	Jubilant Foodworks Ltd .....	519.002	0,20
32.550	Kansai Nerolac Paints Ltd .....	178.733	0,07
24.025	Kotak Mahindra Bank Ltd .....	540.801	0,20

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
199.330	L&T Finance Holdings Ltd .....	310.287	0,12
6.045	L&T Technology Services Ltd .....	290.048	0,11
163.680	Larsen & Toubro Ltd .....	4.939.399	1,86
92.535	Laurus Labs Ltd .....	413.590	0,16
72.230	LIC Housing Finance Ltd .....	345.329	0,13
5.270	Linde India Ltd .....	277.310	0,10
21.545	LTIMindtree Ltd .....	1.364.980	0,51
57.505	Lupin Ltd .....	632.833	0,24
53.010	Macrotech Developers Ltd .....	439.228	0,17
139.345	Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd .....	571.503	0,22
222.890	Mahindra & Mahindra Ltd .....	3.949.487	1,49
43.865	Mangalore Refinery & Petrochemicals Ltd .....	41.201	0,02
121.365	Marico Ltd .....	785.512	0,30
31.465	Maruti Suzuki India Ltd .....	3.754.722	1,42
57.815	Max Financial Services Ltd .....	571.478	0,22
177.165	Max Healthcare Institute Ltd .....	1.294.602	0,49
19.530	Mphasis Ltd .....	451.153	0,17
647	MRF Ltd .....	798.644	0,30
25.265	Muthoot Finance Ltd .....	381.794	0,14
8.525	Nestle India Ltd .....	2.379.194	0,90
540.640	NHPC Ltd .....	302.809	0,11
40.610	Nippon Life India Asset Management Ltd .....	142.650	0,05
272.645	NMDC Ltd .....	347.813	0,13
1.124.215	NTPC Ltd .....	2.592.173	0,98
27.435	Oberoi Realty Ltd .....	329.351	0,12
924.575	Oil & Natural Gas Corp Ltd .....	1.806.689	0,68
76.105	Oil India Ltd .....	227.250	0,09
42.780	One 97 Communications Ltd .....	452.570	0,17
5.425	Oracle Financial Services Software Ltd .....	255.181	0,10
1.395	Page Industries Ltd .....	640.199	0,24
16.740	Patanjali Foods Ltd .....	242.550	0,09
86.180	PB Fintech Ltd .....	732.036	0,28
11.935	Persistent Systems Ltd .....	729.054	0,27
175.460	Petronet LNG Ltd .....	476.325	0,18
19.065	PI Industries Ltd .....	911.439	0,34
35.960	Pidilite Industries Ltd .....	1.138.454	0,43
29.605	Piramal Enterprises Ltd .....	340.073	0,13
11.315	Polycab India Ltd .....	489.818	0,18
278.690	Power Finance Corp Ltd .....	733.463	0,28
746.480	Power Grid Corp of India Ltd .....	2.321.793	0,87
525.295	Punjab National Bank .....	330.738	0,12
31.930	Rajesh Exports Ltd .....	213.068	0,08
103.850	RBL Bank Ltd .....	230.333	0,09
295.275	REC Ltd .....	592.648	0,22
16.430	Relaxo Footwears Ltd .....	182.053	0,07
798.405	Reliance Industries Ltd .....	24.820.594	9,36
569.315	Samvardhana Motherson International Ltd .....	594.758	0,22
68.665	SBI Cards & Payment Services Ltd .....	709.133	0,27
100.440	SBI Life Insurance Co Ltd .....	1.600.138	0,60
9.455	Schaeffler India Ltd .....	357.015	0,13
3.255	Shree Cement Ltd .....	947.788	0,36
65.720	Shriram Finance Ltd .....	1.390.131	0,52
21.080	Siemens Ltd .....	967.860	0,36
5.735	Solar Industries India Ltd .....	261.486	0,10
85.250	Sona Blw Precision Forgings Ltd .....	536.077	0,20
33.790	SRF Ltd .....	943.034	0,36
55.025	Star Health & Allied Insurance Co Ltd .....	392.450	0,15

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 100,68 % (30. Juni 2022: 99,99 %) (Fortsetzung)</b>		
425.165	State Bank of India .....	2.968.982	1,12
345.960	Steel Authority of India Ltd .....	360.576	0,14
258.385	Sun Pharmaceutical Industries Ltd .....	3.312.275	1,25
22.630	Sun TV Network Ltd .....	121.174	0,05
15.345	Supreme Industries Ltd .....	598.141	0,23
26.660	Tata Communications Ltd .....	518.209	0,19
242.420	Tata Consultancy Services Ltd .....	9.758.621	3,68
145.080	Tata Consumer Products Ltd .....	1.522.538	0,57
8.215	Tata Elxsi Ltd .....	759.929	0,29
437.720	Tata Motors Ltd .....	3.177.779	1,20
88.350	Tata Motors Ltd 'A' Shares .....	336.078	0,13
394.785	Tata Power Co Ltd .....	1.067.636	0,40
1.936.570	Tata Steel Ltd .....	2.643.978	1,00
127.565	Tata Teleservices Maharashtra Ltd .....	110.641	0,04
143.685	Tech Mahindra Ltd .....	1.980.725	0,75
99.045	Titan Co Ltd .....	3.679.654	1,39
23.405	Torrent Pharmaceuticals Ltd .....	543.505	0,20
51.925	Torrent Power Ltd .....	389.433	0,15
42.935	Trent Ltd .....	923.332	0,35
24.025	Tube Investments of India Ltd .....	929.822	0,35
56.265	TVS Motor Co Ltd .....	909.235	0,34
27.125	UltraTech Cement Ltd .....	2.742.733	1,03
260.865	Union Bank of India Ltd .....	229.752	0,09
16.895	United Breweries Ltd .....	311.384	0,12
68.975	United Spirits Ltd .....	766.990	0,29
39.835	UNO Minda Ltd .....	282.519	0,11
125.085	UPL Ltd .....	1.048.375	0,39
110.360	Varun Beverages Ltd .....	1.079.675	0,41
14.260	Vedant Fashions Ltd .....	215.369	0,08
294.190	Vedanta Ltd .....	996.782	0,38
1.955.170	Vodafone Idea Ltd .....	177.564	0,07
54.095	Voltas Ltd .....	500.993	0,19
6.820	Whirlpool of India Ltd .....	122.556	0,05
352.160	Wipro Ltd .....	1.593.552	0,60
4.736.490	Yes Bank Ltd .....	938.265	0,35
194.060	Zee Entertainment Enterprises Ltd .....	419.545	0,16
1.295.335	Zomato Ltd .....	1.185.068	0,45
61.698	Zydus Lifesciences Ltd .....	438.514	0,16
		<u>267.054.868</u>	<u>100,68</u>
	<b>Aktien insgesamt</b>	<u>267.054.868</u>	<u>100,68</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b>	<u>267.054.868</u>	<u>100,68</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: 0,01 % (30. Juni 2022: null)

Terminkontrakte (Futures): 0,01 % (30. Juni 2022: null)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnittlicher Anschaffungskurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
944.125	18.883	25ofSgxNifty50Long Futures Contracts Expiring July 2023.....	19.825	0,01
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures) .....</b>	<b>19.825</b>	<b>0,01</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt .....</b>	<b>19.825</b>	<b>0,01</b>
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	267.074.693	100,69
		<b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>	(1.820.993)	(0,69)
		<b>Nettovermögen</b>	<b>265.253.700</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind.....		97,00
		Börsengehandelte derivative Instrumente.....		0,01
		Sonstiges Umlaufvermögen .....		2,99
		Gesamtvermögen.....		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 38.875 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %)</b>		
	<b>Südkorea: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %)</b>		
18.471	Alteogen Inc .....	602.079	0,13
16.356	Amorepacific Corp .....	1.211.510	0,27
5.781	Amorepacific Corp (preferred stock) .....	138.202	0,03
15.228	AMOREPACIFIC Group .....	304.525	0,07
4.512	BGF retail Co Ltd .....	598.906	0,13
155.100	BNK Financial Group Inc .....	815.727	0,18
55.413	Celltrion Healthcare Co Ltd .....	2.754.564	0,61
61.617	Celltrion Inc .....	7.150.032	1,59
11.280	Celltrion Pharm Inc .....	653.181	0,15
38.493	Cheil Worldwide Inc .....	529.638	0,12
4.371	CJ CheilJedang Corp .....	894.004	0,20
846	CJ CheilJedang Corp (preferred stock) .....	87.062	0,02
6.909	CJ Corp .....	358.126	0,08
5.499	CJ ENM Co Ltd .....	261.668	0,06
4.512	CJ Logistics Corp .....	261.615	0,06
31.020	Coway Co Ltd .....	1.034.667	0,23
111.954	Daewoo Engineering & Construction Co Ltd .....	345.382	0,08
26.226	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd .....	750.366	0,17
24.957	DB Insurance Co Ltd .....	1.412.964	0,31
81.075	DGB Financial Group Inc .....	447.323	0,10
16.638	DL E&C Co Ltd .....	438.789	0,10
6.345	DL Holdings Co Ltd .....	198.876	0,04
18.189	Dongsuh Co Inc .....	262.554	0,06
27.636	Doosan Bobcat Inc .....	1.231.156	0,27
236.598	Doosan Enerbility Co Ltd .....	3.251.842	0,72
25.521	Ecopro BM Co Ltd .....	4.822.775	1,07
10.857	E-MART Inc .....	633.631	0,14
8.883	F&F Co Ltd / New .....	806.289	0,18
28.764	Fila Holdings Corp .....	873.191	0,19
2.820	Green Cross Corp .....	245.692	0,05
35.673	GS Engineering & Construction Corp .....	504.644	0,11
25.662	GS Holdings Corp .....	713.780	0,16
21.855	GS Retail Co Ltd .....	379.827	0,08
161.163	Hana Financial Group Inc .....	4.794.589	1,07
17.766	Hanjin Kal Corp .....	631.683	0,14
41.172	Hankook Tire & Technology Co Ltd .....	1.074.881	0,24
4.230	Hanmi Pharm Co Ltd .....	990.365	0,22
13.254	Hanmi Science Co Ltd .....	333.450	0,07
90.099	Hanon Systems .....	625.664	0,14
19.317	Hanwha Aerospace Co Ltd .....	1.867.708	0,42
25.239	Hanwha Corp .....	573.679	0,13
12.972	Hanwha Corp (preferred stock) .....	146.491	0,03
64.415	Hanwha Galleria Corp .....	74.160	0,02
201.912	Hanwha Life Insurance Co Ltd .....	395.350	0,09
57.669	Hanwha Solutions Corp .....	1.851.325	0,41
23.970	HD Hyundai Co Ltd .....	1.089.670	0,24
15.933	Hite Jinro Co Ltd .....	261.187	0,06
18.189	HL Mando Co Ltd .....	744.042	0,17
56.964	HLB Inc .....	1.405.024	0,31
162.432	HMM Co Ltd .....	2.323.715	0,52
16.920	Hotel Shilla Co Ltd .....	942.533	0,21
10.152	HYBE Co Ltd .....	2.168.852	0,48
8.037	Hyundai Department Store Co Ltd .....	300.705	0,07
76.563	Hyundai Doosan Infracore Co Ltd .....	694.944	0,15
40.749	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd .....	1.178.262	0,26
10.293	Hyundai Glovis Co Ltd .....	1.544.360	0,34
10.575	Hyundai Heavy Industries Co Ltd .....	1.056.978	0,24



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %) (Fortsetzung)</b>		
31.866	Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd .....	750.912	0,17
10.998	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd .....	701.121	0,16
34.545	Hyundai Mobis Co Ltd .....	6.095.483	1,36
76.845	Hyundai Motor Co .....	12.043.025	2,68
12.408	Hyundai Motor Co (preferred stock) .....	1.024.544	0,23
19.458	Hyundai Motor Co (second preferred stock) .....	1.619.962	0,36
46.953	Hyundai Steel Co .....	1.202.644	0,27
9.024	Hyundai Wia Corp .....	458.853	0,10
11.562	Iljin Materials Co Ltd .....	422.941	0,09
152.280	Industrial Bank of Korea .....	1.194.987	0,27
169.200	Kakao Corp .....	6.304.952	1,40
22.560	Kakao Games Corp .....	562.438	0,13
119.427	KakaoBank Corp .....	2.152.614	0,48
11.421	Kakaopay Corp .....	407.382	0,09
58.374	Kangwon Land Inc .....	769.962	0,17
216.294	KB Financial Group Inc .....	7.838.226	1,74
2.256	KCC Corp .....	336.264	0,07
12.408	KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd .....	314.049	0,07
139.590	Kia Corp .....	9.375.566	2,08
39.339	Korea Aerospace Industries Ltd .....	1.591.294	0,35
142.410	Korea Electric Power Corp .....	2.226.423	0,50
14.241	Korea Gas Corp .....	277.762	0,06
20.445	Korea Investment Holdings Co Ltd .....	800.639	0,18
23.547	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd .....	2.081.908	0,46
5.640	Korea Zinc Co Ltd .....	2.086.669	0,46
103.071	Korean Air Lines Co Ltd .....	1.904.739	0,42
16.497	Krafton Inc .....	2.438.899	0,54
57.528	KT&G Corp .....	3.615.010	0,80
9.447	Kumho Petrochemical Co Ltd .....	951.404	0,21
13.818	L&F Co Ltd .....	2.548.305	0,57
26.367	LG Chem Ltd .....	13.347.087	2,97
4.230	LG Chem Ltd (preferred stock) .....	1.130.012	0,25
50.196	LG Corp .....	3.352.368	0,75
125.067	LG Display Co Ltd .....	1.495.887	0,33
60.066	LG Electronics Inc .....	5.775.708	1,28
9.588	LG Electronics Inc (preferred stock) .....	396.574	0,09
19.317	LG Energy Solution Ltd .....	8.107.085	1,80
5.217	LG H&H Co Ltd .....	1.817.329	0,40
1.128	LG H&H Co Ltd (preferred stock) .....	160.513	0,04
7.755	LG Innotek Co Ltd .....	1.821.555	0,41
113.505	LG Uplus Corp .....	924.304	0,21
10.152	Lotte Chemical Corp .....	1.191.135	0,26
1.692	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd .....	162.824	0,04
13.818	Lotte Corp .....	262.171	0,06
8.601	LOTTE Fine Chemical Co Ltd .....	453.011	0,10
6.486	Lotte Shopping Co Ltd .....	337.677	0,08
9.729	LS Corp .....	685.936	0,15
56.118	Meritz Financial Group Inc .....	1.767.463	0,39
144.807	Mirae Asset Securities Co Ltd .....	794.562	0,18
78.960	Mirae Asset Securities Co Ltd (preferred stock) .....	222.921	0,05
80.088	NAVER Corp .....	11.110.755	2,47
8.742	NCSOFT Corp .....	1.957.189	0,44
12.126	Netmarble Corp .....	451.855	0,10
72.051	NH Investment & Securities Co Ltd .....	522.208	0,12
9.024	NHN Corp .....	168.475	0,04
1.833	NongShim Co Ltd .....	553.663	0,12
6.768	OCI Co Ltd .....	581.956	0,13

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 99,56 % (30. Juni 2022: 99,67 %) (Fortsetzung)</b>		
3.102	OCI Co Ltd .....	287.211	0,06
12.126	Orion Corp .....	1.104.330	0,25
846	Ottogi Corp .....	252.005	0,06
135.783	Pan Ocean Co Ltd .....	533.796	0,12
23.688	Paradise Co Ltd .....	254.022	0,06
18.471	Pearl Abyss Corp .....	737.354	0,16
15.933	POSCO Chemical Co Ltd .....	4.268.470	0,95
41.736	POSCO Holdings Inc .....	12.289.734	2,73
25.662	Posco International Corp .....	776.102	0,17
10.152	S-1 Corp .....	410.657	0,09
9.870	Samsung Biologics Co Ltd .....	5.573.013	1,24
46.953	Samsung C&T Corp .....	3.766.503	0,84
16.497	Samsung Card Co Ltd .....	371.219	0,08
31.020	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd .....	3.401.806	0,76
2.207.919	Samsung Electronics Co Ltd .....	120.981.863	26,90
385.071	Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock) .....	17.388.324	3,87
87.843	Samsung Engineering Co Ltd .....	1.886.660	0,42
18.330	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd .....	3.199.560	0,71
1.551	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd (preferred stock) .....	201.754	0,04
362.652	Samsung Heavy Industries Co Ltd .....	1.835.760	0,41
41.595	Samsung Life Insurance Co Ltd .....	2.124.497	0,47
29.328	Samsung SDI Co Ltd .....	14.890.473	3,31
800	Samsung SDI Co Ltd (preferred stock) .....	194.892	0,04
20.304	Samsung SDS Co Ltd .....	1.893.797	0,42
35.391	Samsung Securities Co Ltd .....	966.931	0,22
17.766	SD Biosensor Inc .....	164.898	0,04
15.087	Seegene Inc .....	235.296	0,05
18.471	Shin Poong Pharmaceutical Co Ltd .....	222.888	0,05
268.605	Shinhan Financial Group Co Ltd .....	6.930.953	1,54
3.948	Shinsegae Inc .....	533.631	0,12
15.792	SK Biopharmaceuticals Co Ltd .....	969.584	0,22
13.254	SK Bioscience Co Ltd .....	799.676	0,18
5.358	SK Chemicals Co Ltd .....	285.456	0,06
301.317	SK Hynix Inc .....	26.343.656	5,86
14.382	SK IE Technology Co Ltd .....	1.056.561	0,24
19.317	SK Inc .....	2.179.970	0,48
29.328	SK Innovation Co Ltd .....	3.527.863	0,78
73.884	SK Networks Co Ltd .....	284.849	0,06
53.721	SK Square Co Ltd .....	1.804.086	0,40
10.293	SKC Co Ltd .....	762.416	0,17
22.983	S-Oil Corp .....	1.163.409	0,26
6.768	Solus Advanced Materials Co Ltd .....	190.304	0,04
57.105	SSANGYONG C&E Co Ltd .....	229.261	0,05
8.883	Wemade Co Ltd .....	263.257	0,06
352.782	Woori Financial Group Inc .....	3.156.604	0,70
29.610	Yuhan Corp .....	1.357.298	0,30
		<b>447.748.053</b>	<b>99,56</b>
	<b>Aktien insgesamt .....</b>	<b>447.748.053</b>	<b>99,56</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt .....</b>	<b>447.748.053</b>	<b>99,56</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) % (30. Juni 2022: (0,01) %)

Terminkontrakte (Futures): (0,00) % (30. Juni 2022: (0,01) %)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnittlicher Anschaffungskurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
1.688.283	-	26 of Kospi2 Index Long Futures Contracts Expiring September 2023.....	(8.585)	(0,00)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures) .....</b>	<b>(8.585)</b>	<b>(0,00)</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt.....</b>	<b>(8.585)</b>	<b>(0,00)</b>
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	447.739.468	99,56
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	1.984.739	0,44
		<b>Nettovermögen</b>	<b>449.724.207</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind.....		99,55
		Sonstiges Umlaufvermögen .....		0,45
		Gesamtvermögen .....		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 145.438 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,69 % (30. Juni 2022: 98,62 %)</b>		
	<b>Aktien: 98,69 % (30. Juni 2022: 98,62 %)</b>		
	<b>Kaimaninseln: 2,55 % (30. Juni 2022: 2,95 %)</b>		
120	Advanced Energy Solution Holding Co Ltd .....	3.132	0,07
800	Airtac International Group .....	26.329	0,56
7.000	Chailease Holding Co Ltd .....	45.851	0,98
362	Parade Technologies Ltd .....	12.495	0,27
1.680	Silergy Corp .....	20.768	0,44
3.160	Zhen Ding Technology Holding Ltd .....	10.654	0,23
		<b>119.229</b>	<b>2,55</b>
	<b>Taiwan: 96,14 % (30. Juni 2022: 95,67 %)</b>		
2.700	Accton Technology Corp .....	30.256	0,65
14.000	Acer Inc .....	14.092	0,30
2.120	Advantech Co Ltd .....	27.875	0,60
17.400	ASE Technology Holding Co Ltd .....	61.735	1,32
12.000	Asia Cement Corp .....	17.107	0,37
200	ASMedia Technology Inc .....	6.775	0,14
153	ASPEED Technology Inc .....	14.001	0,30
3.600	Asustek Computer Inc .....	36.353	0,78
36.000	AUO Corp .....	21.500	0,46
10.000	Capital Securities Corp .....	4.575	0,10
3.460	Catcher Technology Co Ltd .....	19.497	0,42
47.100	Cathay Financial Holding Co Ltd .....	65.256	1,39
34.000	Chang Hwa Commercial Bank Ltd .....	20.360	0,44
10.000	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd .....	12.891	0,28
3.100	Chicony Electronics Co Ltd .....	9.755	0,21
14.000	China Airlines Ltd .....	11.777	0,25
82.000	China Development Financial Holding Corp .....	32.648	0,70
1.360	China Motor Corp .....	4.061	0,09
62.000	China Steel Corp .....	58.527	1,25
19.300	Chunghwa Telecom Co Ltd .....	72.194	1,54
22.000	Compal Electronics Inc .....	20.662	0,44
92.000	CTBC Financial Holding Co Ltd .....	73.406	1,57
11.000	Delta Electronics Inc .....	121.675	2,60
4.480	E Ink Holdings Inc .....	32.365	0,69
72.000	E.Sun Financial Holding Co Ltd .....	60.222	1,29
1.020	Eclat Textile Co Ltd .....	16.359	0,35
354	eMemory Technology Inc .....	25.120	0,54
3.600	Ennostar Inc .....	6.011	0,13
4.675	Eternal Materials Co Ltd .....	4.848	0,10
12.000	Eva Airways Corp .....	15.335	0,33
5.120	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd .....	15.371	0,33
12.000	Far Eastern International Bank .....	4.585	0,10
19.756	Far Eastern New Century Corp .....	21.218	0,45
8.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd .....	20.190	0,43
2.260	Feng TAY Enterprise Co Ltd .....	14.259	0,30
54.000	First Financial Holding Co Ltd .....	47.941	1,02
17.400	Formosa Chemicals & Fibre Corp .....	37.488	0,80
6.900	Formosa Petrochemical Corp .....	18.676	0,40
19.000	Formosa Plastics Corp .....	52.282	1,12
300	Formosa Sumco Technology Corp .....	1.613	0,03
6.000	Formosa Taffeta Co Ltd .....	5.394	0,12
5.600	Foxconn Technology Co Ltd .....	9.997	0,21
37.655	Fubon Financial Holding Co Ltd .....	73.510	1,57
440	Genius Electronic Optical Co Ltd .....	5.595	0,12
1.607	Giant Manufacturing Co Ltd .....	11.868	0,25
1.085	Globalwafers Co Ltd .....	17.314	0,37
1.500	Hiwin Technologies Corp .....	11.439	0,24
60.800	Hon Hai Precision Industry Co Ltd .....	220.598	4,71

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 98,69 % (30. Juni 2022: 98,62 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,69 % (30. Juni 2022: 98,62 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Taiwan: 96,14 % (30. Juni 2022: 95,67 %) (Fortsetzung)</b>		
1.620	Hotai Motor Co Ltd .....	42.341	0,90
4.000	HTC Corp .....	7.334	0,16
52.000	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd .....	37.066	0,79
42.000	Innolux Corp .....	20.565	0,44
16.000	Inventec Corp .....	22.193	0,47
520	Largan Precision Co Ltd .....	35.563	0,76
10.800	Lite-On Technology Corp .....	35.891	0,77
7.580	MediaTek Inc .....	167.447	3,58
56.000	Mega Financial Holding Co Ltd .....	68.686	1,47
3.500	Micro-Star International Co Ltd .....	19.835	0,42
280	momo.com Inc .....	6.185	0,13
28.820	Nan Ya Plastics Corp .....	67.089	1,43
1.080	Nan Ya Printed Circuit Board Corp .....	9.155	0,20
4.000	Nanya Technology Corp .....	9.093	0,19
700	Nien Made Enterprise Co Ltd .....	7.698	0,16
2.940	Novatek Microelectronics Corp .....	40.261	0,86
1.766	Oneness Biotech Co Ltd .....	12.248	0,26
10.000	Pegatron Corp .....	24.017	0,51
14.000	Pou Chen Corp .....	14.160	0,30
16.000	Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp .....	15.900	0,34
3.600	Powertech Technology Inc .....	12.137	0,26
2.900	President Chain Store Corp .....	26.305	0,56
13.460	Quanta Computer Inc .....	65.691	1,40
2.422	Realtek Semiconductor Corp .....	30.134	0,64
12.000	Ruentex Development Co Ltd .....	13.852	0,30
19.000	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd .....	27.697	0,59
68.000	Shin Kong Financial Holding Co Ltd .....	19.432	0,42
2.680	Sino-American Silicon Products Inc .....	13.897	0,30
58.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd .....	32.311	0,69
6.800	Synnex Technology International Corp .....	12.664	0,27
58.000	Taishin Financial Holding Co Ltd .....	35.197	0,75
28.000	Taiwan Business Bank .....	12.811	0,27
32.000	Taiwan Cement Corp .....	39.095	0,84
51.820	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd .....	46.671	1,00
3.756	Taiwan Fertilizer Co Ltd .....	7.296	0,16
8.000	Taiwan Glass Industry Corp .....	4.958	0,11
10.000	Taiwan High Speed Rail Corp .....	10.323	0,22
8.820	Taiwan Mobile Co Ltd .....	27.074	0,58
1.480	Taiwan Secom Co Ltd .....	5.441	0,12
76.620	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	1.417.044	30,28
10.000	Teco Electric and Machinery Co Ltd .....	17.114	0,37
1.380	Transcend Information Inc .....	3.474	0,07
2.000	U-Ming Marine Transport Corp .....	3.037	0,06
6.660	Unimicron Technology Corp .....	37.636	0,80
24.400	Uni-President Enterprises Corp .....	59.777	1,28
60.000	United Microelectronics Corp .....	93.435	2,00
4.620	Vanguard International Semiconductor Corp .....	13.054	0,28
330	Voltronic Power Technology Corp .....	20.821	0,45
13.000	Walsin Lihwa Corp .....	17.114	0,37
2.500	Walsin Technology Corp .....	7.658	0,16
4.800	Wan Hai Lines Ltd .....	9.093	0,19
2.000	Win Semiconductors Corp .....	10.532	0,23
16.000	Winbond Electronics Corp .....	14.102	0,30
14.000	Wistron Corp .....	40.816	0,87
440	Wiwynn Corp .....	20.061	0,43
2.000	Yageo Corp .....	31.563	0,67
8.850	Yang Ming Marine Transport Corp .....	17.902	0,38

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,69 % (30. Juni 2022: 98,62 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,69 % (30. Juni 2022: 98,62 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Taiwan: 96,14 % (30. Juni 2022: 95,67 %) (Fortsetzung)</b>		
60.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd .....	44.502	0,95
2.931	Yulon Motor Co Ltd .....	7.773	0,17
100	Yulon Nissan Motor Co Ltd .....	647	0,01
		<u>4.499.444</u>	<u>96,14</u>
	<b>Aktien insgesamt</b> .....	<u>4.618.673</u>	<u>98,69</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<u>4.618.673</u>	<u>98,69</u>

Derivative Finanzinstrumente: 0,00 % (30. Juni 2022: null)

Terminkontrakte (Futures): 0,00 % (30. Juni 2022: null)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnittlicher Anschaffungskurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
57.750	1.444	1 of FTSE Taiwan Index Long Futures Contracts Expiring July 2023 .....	30	0,00
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures)</b> .....	30	0,00
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt</b> .....	30	0,00
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	4.618.703	98,69
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>61.121</u>	<u>1,31</u>
		<b>Nettovermögen</b>	<u>4.679.824</u>	<u>100,00</u>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		98,40
		Börsengehandelte derivative Instrumente.....		0,00
		Sonstiges Umlaufvermögen .....		<u>1,60</u>
		Gesamtvermögen.....		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 3.070 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Green Bond UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 96,66 % (30. Juni 2022: 88,09 %)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 55,31 % (30. Juni 2022: 55,75 %)</b>		
	<b>Österreich: 1,61 % (30. Juni 2022: 0,86 %)</b>		
	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische		
2.500.000	Postsparkasse AG 4.12% 18/01/2027 .....	2.456.830	0,95
2.500.000	Verbund AG 0.90% 01/04/2041 .....	1.722.100	0,66
		<u>4.178.930</u>	<u>1,61</u>
	<b>Belgien: 1,96 % (30. Juni 2022: 1,28 %)</b>		
2.600.000	Elia Transmission Belgium SA 3.63% 18/01/2033 .....	2.573.184	0,99
3.200.000	FLUVIUS System Operator CVBA 0.25% 02/12/2030 .....	2.497.968	0,97
		<u>5.071.152</u>	<u>1,96</u>
	<b>Dänemark: 1,53 % (30. Juni 2022: 1,81 %)</b>		
2.200.000	Danske Bank A/S 1.38% 17/02/2027 .....	2.009.819	0,77
2.302.000	Orsted AS 1.75% 09/12/3019 .....	1.964.490	0,76
		<u>3.974.309</u>	<u>1,53</u>
	<b>Finnland: 0,80 % (30. Juni 2022: null)</b>		
2.300.000	Nordea BankABP 1.13% 16/02/2027 .....	2.076.192	0,80
		<u>2.076.192</u>	<u>0,80</u>
	<b>Frankreich: 8,52 % (30. Juni 2022: 11,73 %)</b>		
3.600.000	AXA SA 1.37% 07/10/2041 .....	2.740.377	1,06
3.000.000	BPCE SA 0.13% 04/12/2024 .....	2.840.590	1,10
3.600.000	CNP Assurances 2.00% 27/07/2050 .....	2.875.962	1,11
1.800.000	Electricite de France SA 1.00% 13/10/2026 .....	1.647.148	0,64
2.000.000	Engie SA 1.50% 31/12/2099 .....	1.642.832	0,64
2.900.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034 .....	2.180.081	0,84
3.400.000	Societe Generale SA 0.87% 22/09/2028 .....	2.909.468	1,12
100.000	Societe Generale SA 0.88% 22/09/2028 .....	85.573	0,03
2.900.000	Suez SACA 2.37% 24/05/2030 .....	2.612.532	1,01
3.000.000	Vinci SA 0.00% 27/11/2028 .....	2.519.532	0,97
		<u>22.054.095</u>	<u>8,52</u>
	<b>Deutschland: 8,45 % (30. Juni 2022: 8,43 %)</b>		
2.000.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032 .....	2.012.276	0,78
2.700.000	Bayerische Landesbank 1.00% 23/09/2031 .....	2.213.966	0,85
2.000.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 1.60% 31/12/2099 .....	1.597.833	0,62
1.500.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 1.38% 16/04/2040 .....	1.089.515	0,42
3.100.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032 .....	2.500.331	0,96
12.500.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/06/2029 .....	10.474.968	4,05
2.600.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 1.25% 26/05/2041 .....	1.988.090	0,77
		<u>21.876.979</u>	<u>8,45</u>
	<b>Island: 1,12 % (30. Juni 2022: 1,51 %)</b>		
3.300.000	Arion Banki HF 0.38% 14/07/2025 .....	2.897.798	1,12
		<u>2.897.798</u>	<u>1,12</u>
	<b>Indien: 0,83 % (30. Juni 2022: 0,80 %)</b>		
2.600.000	Power Finance Corp Ltd 1.84% 21/09/2028 .....	2.155.078	0,83
		<u>2.155.078</u>	<u>0,83</u>
	<b>Irland: 1,49 % (30. Juni 2022: null)</b>		
1.900.000	AIB Group Plc 3.62% 04/07/2026 .....	1.855.530	0,72
2.000.000	Bank of Ireland Group Plc 5.00% 04/07/2031 .....	1.998.226	0,77
		<u>3.853.756</u>	<u>1,49</u>
	<b>Italien: 3,66 % (30. Juni 2022: 5,05 %)</b>		
2.100.000	Aeroporto di Roma SpA 1.62% 02/02/2029 .....	1.828.258	0,71
3.100.000	ERG SpA 0.87% 15/09/2031 .....	2.397.205	0,93

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 96,66 % (30. Juni 2022: 88,09 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 55,31 % (30. Juni 2022: 55,75 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Italien: 3,66 % (30. Juni 2022: 5,05 %) (Fortsetzung)</b>		
2.000.000	Intesa Sanpaolo SpA 6.50% 14/03/2029 .....	2.189.880	0,84
3.700.000	Iren SpA 0.88% 14/10/2029 .....	3.053.010	1,18
		<u>9.468.353</u>	<u>3,66</u>
	<b>Japan: 1,09 % (30. Juni 2022: null)</b>		
3.100.000	NTT Finance Corp 0.08% 13/12/2025 .....	2.826.568	1,09
		<u>2.826.568</u>	<u>1,09</u>
	<b>Luxemburg: 1,71 % (30. Juni 2022: 2,32 %)</b>		
2.900.000	Segro Capital Sarl 0.50% 22/09/2031 .....	2.075.260	0,80
3.000.000	SELP Finance Sarl 0.88% 27/05/2029 .....	2.346.075	0,91
		<u>4.421.335</u>	<u>1,71</u>
	<b>Niederlande: 11,13 % (30. Juni 2022: 13,33 %)</b>		
2.000.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025 .....	1.904.706	0,74
2.800.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032 .....	2.188.449	0,84
1.500.000	ING Groep NV 1.13% 07/12/2028 .....	1.370.551	0,53
2.500.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.25% 09/09/2029 .....	2.036.905	0,79
2.500.000	NN Group NV 6.00% 03/11/2043 .....	2.504.282	0,97
1.100.000	OI European Group BV 2.87% 15/02/2025 .....	1.074.563	0,41
2.200.000	PostNL NV 0.63% 23/09/2026 .....	1.974.634	0,76
2.700.000	Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026 .....	2.381.819	0,92
2.800.000	Stellantis NV 4.37% 14/03/2030 .....	2.805.004	1,08
1.400.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028 .....	1.182.516	0,46
2.000.000	Telefonica Europe BV 6.13% 31/12/2099 .....	1.934.364	0,75
3.350.000	TenneT Holding BV 1.50% 03/06/2039 .....	2.563.818	0,99
1.700.000	Vestas Wind Systems Finance BV 2.00% 15/06/2034 .....	1.397.026	0,54
3.000.000	Vesteda Finance BV 1.50% 24/05/2027 .....	2.707.692	1,05
1.000.000	VZ Vendor Financing II BV 2.87% 15/01/2029 .....	770.519	0,30
		<u>28.796.848</u>	<u>11,13</u>
	<b>Norwegen: 3,24 % (30. Juni 2022: null)</b>		
2.100.000	DNB Bank ASA 4.00% 14/03/2029 .....	2.098.272	0,81
2.200.000	Sparebank 1 Oestlandet 1.75% 27/04/2027 .....	2.019.565	0,78
2.500.000	SpareBank 1 SR-Bank ASA 2.88% 20/09/2025 .....	2.425.756	0,94
1.900.000	Statkraft AS 2.87% 13/09/2029 .....	1.834.883	0,71
		<u>8.378.476</u>	<u>3,24</u>
	<b>Portugal: 0,77 % (30. Juni 2022: 1,06 %)</b>		
2.000.000	EDP - Energias de Portugal SA 5.94% 23/04/2083 .....	1.985.218	0,77
		<u>1.985.218</u>	<u>0,77</u>
	<b>Rumänien: 0,28 % (30. Juni 2022: null)</b>		
700.000	Banca Comerciala Romana SA 7.62% 19/05/2027 .....	716.394	0,28
		<u>716.394</u>	<u>0,28</u>
	<b>Spanien: 3,09 % (30. Juni 2022: 3,43 %)</b>		
2.600.000	Abanca Corp Bancaria SA 0.50% 08/09/2027 .....	2.217.786	0,86
2.500.000	Banco de Sabadell SA 1.13% 11/03/2027 .....	2.266.272	0,87
2.200.000	CaixaBank SA 0.50% 09/02/2029 .....	1.827.884	0,71
2.000.000	Iberdrola Finanzas SA 1.57% 31/12/2099 .....	1.686.250	0,65
		<u>7.998.192</u>	<u>3,09</u>
	<b>Schweden: 3,51 % (30. Juni 2022: 2,66 %)</b>		
2.900.000	Swedbank AB 0.30% 20/05/2027 .....	2.555.277	0,99
1.750.000	Telia Co AB 1.38% 11/05/2081 .....	1.564.062	0,60
1.400.000	Vattenfall AB 2.50% 29/06/2083 .....	1.306.061	0,50
2.000.000	Vattenfall AB 6.87% 17/08/2083 .....	2.289.960	0,89
1.300.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027 .....	1.179.892	0,46
200.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027 .....	181.522	0,07
		<u>9.076.774</u>	<u>3,51</u>



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

h	Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
		<b>Wertpapiere: 96,66 % (30. Juni 2022: 88,09 %) (Fortsetzung)</b>		
		<b>Unternehmensanleihen: 55,31 % (30. Juni 2022: 55,75 %) (Fortsetzung)</b>		
		<b>Türkei: null (30. Juni 2022: 0,51 %)</b>		
		<b>Vereinigtes Königreich: 0,52 % (30. Juni 2022: 0,97 %)</b>		
1.500.000		Whitbread Group Plc 3.00% 31/05/2031 .....	1.338.855	0,52
			1.338.855	0,52
		<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>		
		.....	143.145.302	55,31
		<b>Staatsanleihen: 41,35 % (30. Juni 2022: 32,34 %)</b>		
		<b>Österreich: 2,31 % (30. Juni 2022: null)</b>		
6.000.000		Austria Treasury Bill 0.00% 24/08/2023 .....	5.970.028	2,31
			5.970.028	2,31
		<b>Belgien: 4,95 % (30. Juni 2022: 1,77 %)</b>		
7.900.000		Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 22/04/2033 .....	6.769.542	2,62
6.000.000		Region Wallonne Belgium 3.75% 22/04/2039 .....	6.042.930	2,33
			12.812.472	4,95
		<b>Chile: 0,93 % (30. Juni 2022: 1,59 %)</b>		
3.035.000		Chile Government International Bond 0.83% 02/07/2031 .....	2.394.827	0,93
			2.394.827	0,93
		<b>Frankreich: 5,35 % (30. Juni 2022: 6,58 %)</b>		
1.100.000		Bpifrance SACA 0.00% 25/05/2028 .....	941.168	0,36
6.400.000		French Republic Government Bond OAT 1.75% 25/06/2039 .....	5.313.600	2,05
3.900.000		Societe Du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030 .....	3.075.329	1,19
5.400.000		Societe Nationale SNCF SA 0.62% 17/04/2030 .....	4.516.161	1,75
			13.846.258	5,35
		<b>Deutschland: 16,55 % (30. Juni 2022: 8,54 %)</b>		
18.800.000		Bundesobligation 0.00% 10/10/2025 .....	17.579.377	6,79
17.600.000		Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030 .....	14.896.570	5,76
19.200.000		Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2050 .....	10.366.821	4,00
			42.842.768	16,55
		<b>Ungarn: null (30. Juni 2022: 1,61 %)</b>		
		<b>Irland: 3,38 % (30. Juni 2022: 3,22 %)</b>		
9.700.000		Ireland Government Bond 1.35% 18/03/2031 .....	8.757.005	3,38
			8.757.005	3,38
		<b>Niederlande: 3,46 % (30. Juni 2022: 4,77 %)</b>		
12.700.000		Netherlands Government Bond 0.50% 15/01/2040 .....	8.949.550	3,46
			8.949.550	3,46
		<b>Spanien: 3,78 % (30. Juni 2022: 3,43 %)</b>		
4.300.000		Autonomous Community of Madrid Spain 0.83% 30/07/2027 .....	3.869.235	1,49
9.400.000		Spain Government Bond 1.00% 30/07/2042 .....	5.921.003	2,29
			9.790.238	3,78
		<b>Vereinigtes Königreich: 0,64 % (30. Juni 2022: 0,83 %)</b>		
2.000.000		United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033 .....	1.668.375	0,64
			1.668.375	0,64
		<b>Staatsanleihen insgesamt</b> .....	107.031.521	41,35
		<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	250.176.823	96,66

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,07) % (30. Juni 2022: 0,32 %)

Terminkontrakte (Futures): 0,03 % (30. Juni 2022: 0,08 %)\*

Nominal- betrag EUR	Durchschnittlicher Anschaffungskurs EUR		Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
(9.192.232)	(135)	68 of Euro-Bund Short Futures Contracts Expiring September 2023 .....	97.912	0,04
(3.463.350)	(116)	30 of Euro-Btp Future Short Futures Contracts Expiring September 2023 .....	(19.950)	(0,01)
		Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures)	97.912	0,04
		<b>Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)</b>	<b>(19.950)</b>	<b>(0,01)</b>
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten (Futures).....</b>	<b>77.962</b>	<b>0,03</b>

Devisenterminkontrakte: (0,10) % (30. Juni 2022: 0,24 %)

Abrechnungs- datum	Betrag gekauft	Betrag verkauft	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
11.07.2023	6.326.779 EUR	5.590.000 GBP	Citibank	(185.396)	(0,07)
11.07.2023	450.100 EUR	400.000 GBP	Citibank	(15.888)	(0,01)
11.07.2023	567.394 EUR	500.000 GBP	Citibank	(15.090)	(0,01)
11.07.2023	2.470.753 EUR	2.150.000 GBP	Citibank	(33.929)	(0,01)
11.07.2023	318.297 EUR	271.400 GBP	Citibank	2.124	0,00
			<b>Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten</b>	<b>2.124</b>	<b>0,00</b>
			<b>Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten</b>	<b>(250.303)</b>	<b>(0,10)</b>
			<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten</b>	<b>(248.179)</b>	<b>(0,10)</b>
			<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt.....</b>	<b>(170.217)</b>	<b>(0,07)</b>
				<b>Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
			<b>Anlageportfolio</b>	250.006.606	96,59
			<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	8.821.181	3,41
			<b>Nettovermögen</b>	<b>258.827.787</b>	<b>100,00</b>
					<b>% des Gesamt- vermögens</b>
			<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
			Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind.....		95,91
			Börsengehandelte derivative Instrumente.....		0,04
			Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente.....		0,00
			Sonstiges Umlaufvermögen.....		4,05
			Gesamtvermögen.....		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 360.560 EUR.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 94,18 % (30. Juni 2022: 88,72 %)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 51,19 % (30. Juni 2022: 44,90 %)</b>		
	<b>Australien: null (30. Juni 2022: 1,19 %)</b>		
	<b>Österreich: 0,24 % (30. Juni 2022: 0,46 %)</b>		
1.300.000	BAWAG Group AG 2.38% 26/03/2029 .....	1.205.841	0,24
		<u>1.205.841</u>	<u>0,24</u>
	<b>Belgien: 1,40 % (30. Juni 2022: 0,18 %)</b>		
1.600.000	Belfius Bank SA 0.38% 24/10/2023 .....	1.584.179	0,31
6.000.000	European Union 0.00% 04/11/2025 .....	5.556.336	1,09
		<u>7.140.515</u>	<u>1,40</u>
	<b>Bermuda: null (30. Juni 2022: 0,33 %)</b>		
	<b>Kanada: 2,29 % (30. Juni 2022: 1,47 %)</b>		
3.200.000	Bank of Montreal 0.10% 20/10/2023 .....	3.167.437	0,62
1.000.000	Bank of Nova Scotia 0.45% 16/03/2026 .....	912.108	0,18
1.200.000	Royal Bank of Canada 0.25% 02/05/2024 .....	1.163.317	0,23
2.600.000	Toronto-Dominion Bank 1.71% 28/07/2025 .....	2.486.211	0,48
4.000.000	Toronto-Dominion Bank 3.65% 20/01/2025 .....	4.010.228	0,78
		<u>11.739.301</u>	<u>2,29</u>
	<b>Dänemark: 1,24 % (30. Juni 2022: 0,82 %)</b>		
4.000.000	Danske Bank A/S 1.62% 15/03/2024 .....	3.931.620	0,77
2.500.000	Danske Bank A/S 2.50% 21/06/2029 .....	2.413.458	0,47
		<u>6.345.078</u>	<u>1,24</u>
	<b>Finnland: 1,01 % (30. Juni 2022: 0,19 %)</b>		
5.200.000	CRH Finland Services OYJ 0.88% 05/11/2023 .....	5.147.641	1,01
		<u>5.147.641</u>	<u>1,01</u>
	<b>Frankreich: 11,22 % (30. Juni 2022: 6,60 %)</b>		
3.000.000	Abn Amro Bank Nv 0.00% 22/01/2024 .....	2.935.599	0,57
2.000.000	Arkea Home Loans SFH SA 0.38% 04/03/2024 .....	1.954.332	0,38
4.000.000	Autoroutes du Sud de la France SA 2.95% 17/01/2024 .....	3.981.788	0,78
4.000.000	AXA SA 5.12% 04/07/2043 .....	3.998.876	0,78
4.400.000	BNP Paribas SA 1.12% 10/10/2023 .....	4.369.275	0,86
2.500.000	BNP Paribas SA 1.00% 17/04/2024 .....	2.443.385	0,48
2.300.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023 .....	2.283.868	0,45
1.000.000	BPCE SA 0.88% 31/01/2024 .....	982.385	0,19
2.900.000	BPCE SFH SA 2.37% 29/11/2023 .....	2.884.917	0,56
2.000.000	Cie de Financement Foncier SA 0.33% 12/09/2023 .....	1.988.054	0,39
4.000.000	Credit Agricole SA 0.50% 24/06/2024 .....	3.867.648	0,76
2.500.000	Credit Agricole SA 1.00% 18/09/2025 .....	2.346.657	0,46
1.600.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.87% 05/10/2023 .....	1.588.214	0,31
2.300.000	Engie SA 0.87% 27/03/2024 .....	2.251.279	0,44
3.000.000	HSBC SFH France SA 2.00% 16/10/2023 .....	2.986.149	0,58
4.000.000	L'Oreal SA 0.38% 29/03/2024 .....	3.903.120	0,76
2.900.000	Pernod Ricard SA 0.00% 24/10/2023 .....	2.866.082	0,56
2.000.000	Sanofi 2.50% 14/11/2023 .....	1.990.442	0,39
3.900.000	Schneider Electric SE 3.37% 06/04/2025 .....	3.862.720	0,76
4.000.000	Societe Generale SA 1.50% 30/05/2025 .....	3.888.496	0,76
		<u>57.373.286</u>	<u>11,22</u>
	<b>Deutschland: 1,23 % (30. Juni 2022: 4,14 %)</b>		
2.000.000	Commerzbank AG 0.50% 13/09/2023 .....	1.987.598	0,39
500.000	DZ HYP AG 0.12% 01/03/2024 .....	488.281	0,10
1.000.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg 2.75% 18/10/2024 .....	988.056	0,19
3.000.000	Natixis Pfandbriefbank AG 0.50% 23/05/2025 .....	2.815.382	0,55
		<u>6.279.317</u>	<u>1,23</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 94,18 % (30. Juni 2022: 88,72 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 51,19 % (30. Juni 2022: 44,90 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Island: 0,50 % (30. Juni 2022: 0,58 %)</b>		
1.500.000	Arion Banki HF 0.38% 14/07/2025 .....	1.317.181	0,26
1.300.000	Landsbankinn HF 0.50% 20/05/2024 .....	1.235.267	0,24
		<u>2.552.448</u>	<u>0,50</u>
	<b>Irland: 1,76 % (30. Juni 2022: null)</b>		
2.000.000	AIB Group Plc 1.25% 28/05/2024 .....	1.947.908	0,38
2.600.000	Aquarius & Investments PLC for Zurich Insurance Co Ltd 4.25% 02/10/2043 ..	2.592.445	0,51
2.480.000	Bank of Ireland Group Plc 1.38% 29/08/2023 .....	2.470.960	0,48
2.000.000	Linde Plc 3.62% 12/06/2025 .....	1.993.740	0,39
		<u>9.005.053</u>	<u>1,76</u>
	<b>Italien: 1,45 % (30. Juni 2022: 2,39 %)</b>		
2.500.000	ASTM SpA 3.38% 13/02/2024 .....	2.487.538	0,48
4.000.000	Intesa Sanpaolo SpA 1.50% 10/04/2024 .....	3.922.296	0,77
1.000.000	Intesa Sanpaolo SpA 5.87% 04/03/2029 .....	1.004.845	0,20
		<u>7.414.679</u>	<u>1,45</u>
	<b>Japan: 0,71 % (30. Juni 2022: 1,04 %)</b>		
1.000.000	Asahi Group Holdings Ltd 0.16% 23/10/2024 .....	949.354	0,19
2.000.000	Asahi Group Holdings Ltd 0.01% 19/04/2024 .....	1.935.390	0,38
800.000	NTT Finance Corp 0.08% 13/12/2025 .....	729.437	0,14
		<u>3.614.181</u>	<u>0,71</u>
	<b>Luxemburg: 6,27 % (30. Juni 2022: 3,79 %)</b>		
1.500.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 2.00% 15/02/2024 .....	1.460.248	0,29
4.000.000	CNH Industrial Finance Europe SA 0.00% 01/04/2024 .....	3.880.872	0,76
5.643.000	European Investment Bank 2.13% 15/01/2024 .....	5.600.723	1,09
1.828.000	European Investment Bank 0.05% 24/05/2024 .....	1.771.509	0,35
10.000.000	European Union Bill 0.00% 08/12/2023 .....	9.844.623	1,92
500.000	John Deere Bank SA 2.50% 14/09/2026 .....	481.042	0,09
5.000.000	John Deere Cash Management SARL 0.50% 15/09/2023 .....	4.968.340	0,97
1.500.000	Logicor Financing Sarl 0.75% 15/07/2024 .....	1.429.962	0,28
1.000.000	Medtronic Global Holdings SCA 2.62% 15/10/2025 .....	968.488	0,19
1.500.000	Segro Capital Sarl 1.25% 23/03/2026 .....	1.359.818	0,27
400.000	Vivion Investments Sarl 3.00% 08/08/2024 .....	320.658	0,06
		<u>32.086.283</u>	<u>6,27</u>
	<b>Niederlande: 5,87 % (30. Juni 2022: 4,68 %)</b>		
2.000.000	ABB Finance BV 4.30% 31/03/2024 .....	2.007.708	0,39
2.500.000	ABN AMRO Bank NV 3.75% 20/04/2025 .....	2.478.738	0,48
1.500.000	American Medical Systems Europe BV 0.75% 08/03/2025 .....	1.420.026	0,28
2.200.000	ATF Netherlands BV 7.08% 29/12/2049 .....	953.484	0,19
200.000	ATF Netherlands BV 7.08% 29/12/2049 .....	86.680	0,02
800.000	Coca-Cola HBC Finance BV 2.75% 23/09/2025 .....	780.914	0,15
1.000.000	Enel Finance International NV 1.00% 16/09/2024 .....	964.690	0,19
750.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 1.25% 29/03/2026 .....	696.588	0,14
5.000.000	Heineken NV 3.87% 23/09/2024 .....	4.996.680	0,98
3.000.000	Nationale-Nederlanden Bank NV 0.25% 27/02/2024 .....	2.929.893	0,57
1.000.000	Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.75% 31/03/2025 .....	947.814	0,18
1.700.000	Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.00% 04/06/2024 .....	1.641.233	0,32
2.000.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.25% 05/06/2024 .....	1.934.638	0,38
800.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.25% 10/03/2025 .....	779.582	0,15
2.000.000	Stellantis NV 3.37% 07/07/2023 .....	2.000.056	0,39
500.000	Telefonica Europe BV 3.00% 31/12/2099 .....	495.852	0,10
5.000.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 0.00% 18/11/2023 .....	4.931.100	0,96
		<u>30.045.676</u>	<u>5,87</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 94,18 % (30. Juni 2022: 88,72 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 51,19 % (30. Juni 2022: 44,90 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Neuseeland: null (30. Juni 2022: 1,39 %)</b>		
	<b>Norwegen: 0,75 % (30. Juni 2022: 0,76 %)</b>		
2.000.000	DNB Bank ASA 1.63% 31/05/2026 .....	1.899.410	0,37
2.000.000	SpareBank 1 SMN 3.12% 22/12/2025 .....	1.941.980	0,38
		<u>3.841.390</u>	<u>0,75</u>
	<b>Portugal: null (30. Juni 2022: 0,15 %)</b>		
	<b>Rumänien: 0,30 % (30. Juni 2022: 0,00 %)</b>		
1.500.000	Banca Comerciala Romana SA 7.62% 19/05/2027 .....	1.535.130	0,30
		<u>1.535.130</u>	<u>0,30</u>
	<b>Singapur: null (30. Juni 2022: 0,43 %)</b>		
	<b>Spanien: 2,56 % (30. Juni 2022: 1,75 %)</b>		
600.000	Abertis Infraestructuras SA 3.13% 19/03/2024 .....	592.680	0,12
2.000.000	Banco de Sabadell SA 1.75% 10/05/2024 .....	1.952.154	0,38
1.700.000	Banco de Sabadell SA 5.37% 12/12/2028 .....	1.699.952	0,33
4.000.000	Banco Santander SA 0.10% 26/01/2025 .....	3.902.656	0,76
3.200.000	CaixaBank SA 2.75% 14/07/2028 .....	3.198.966	0,62
1.800.000	CaixaBank SA 3.75% 15/02/2029 .....	1.775.119	0,35
		<u>13.121.527</u>	<u>2,56</u>
	<b>Schweden: 2,17 % (30. Juni 2022: 2,12 %)</b>		
2.700.000	SBAB Bank AB 1.87% 10/12/2025 .....	2.565.735	0,50
1.600.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.38% 31/10/2028 .....	1.579.070	0,31
2.100.000	Swedbank AB 3.75% 14/11/2025 .....	2.073.777	0,41
1.000.000	Swedbank Hypotek AB 0.45% 23/08/2023 .....	995.825	0,19
1.000.000	Swedbank Hypotek AB 0.40% 08/05/2024 .....	971.025	0,19
3.000.000	Volvo Treasury AB 2.12% 01/09/2024 .....	2.934.827	0,57
		<u>11.120.259</u>	<u>2,17</u>
	<b>Schweiz: 0,76 % (30. Juni 2022: 1,19 %)</b>		
4.000.000	UBS Group AG 1.00% 21/03/2025 .....	3.878.820	0,76
		<u>3.878.820</u>	<u>0,76</u>
	<b>United Kingdom: 2,78 % (30. Juni 2022: 4,94 %)</b>		
4.000.000	HSBC Holdings Plc 1.50% 04/12/2024 .....	3.955.980	0,77
1.000.000	Lloyds Banking Group Plc 4.33% 21/06/2024 .....	1.004.407	0,20
1.000.000	Lloyds Banking Group Plc 4.50% 18/03/2030 .....	975.533	0,19
2.726.000	Nationwide Building Society 0.50% 23/02/2024 .....	2.667.219	0,52
3.000.000	Santander UK Plc 0.10% 12/05/2024 .....	2.902.029	0,57
1.800.000	Sky Ltd 1.87% 24/11/2023 .....	1.785.651	0,35
0	Thames Water Utilities Finance Plc 0.19% 23/10/2023 .....	-	0,00
1.000.000	Vodafone Group Plc 1.13% 20/11/2025 .....	936.063	0,18
		<u>14.226.882</u>	<u>2,78</u>
	<b>Vereinigte Staaten: 6,68 % (30. Juni 2022: 4,31 %)</b>		
4.000.000	AbbVie Inc 1.50% 15/11/2023 .....	3.965.148	0,77
3.000.000	Apple Inc 1.37% 17/01/2024 .....	2.967.069	0,58
4.000.000	AT&T Inc 1.95% 15/09/2023 .....	3.983.572	0,78
2.900.000	AT&T Inc 3.89% 06/03/2025 .....	2.903.596	0,57
3.800.000	Citigroup Inc 0.75% 26/10/2023 .....	3.763.980	0,74
2.500.000	Citigroup Inc 2.37% 22/05/2024 .....	2.465.600	0,48
5.600.000	Fiserv Inc 0.38% 07/01/2023 .....	5.600.000	1,09
400.000	Fiserv Inc 0.38% 07/01/2023 .....	400.000	0,08
1.500.000	Morgan Stanley 2.10% 08/05/2026 .....	1.432.178	0,28
1.400.000	National Grid North America Inc 0.41% 20/01/2026 .....	1.276.222	0,25

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 94,18 % (30. Juni 2022: 88,72 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 51,19 % (30. Juni 2022: 44,90 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 6,68 % (30. Juni 2022: 4,31 %) (Fortsetzung)</b>		
4.500.000	Stryker Corp 1.13% 30/11/2023 .....	4.447.570	0,87
1.000.000	Utah Acquisition Sub Inc 2.25% 22/11/2024 .....	969.379	0,19
		<u>34.174.314</u>	<u>6,68</u>
	<b>Unternehmensanleihen insgesamt.....</b>	<u>261.847.621</u>	<u>51,19</u>
	<b>Staatsanleihen: 41,90 % (30. Juni 2022: 43,42 %)</b>		
	<b>Österreich: 7,78 % (30. Juni 2022: null)</b>		
40.000.000	Austria Treasury Bill 0.00% 24/08/2023 .....	39.800.184	7,78
		<u>39.800.184</u>	<u>7,78</u>
	<b>Belgien: null (30. Juni 2022: 4,76 %)</b>		
	<b>Zypern: 0,08 % (30. Juni 2022: 0,06 %)</b>		
400.000	Cyprus Government International Bond 3.75% 26/07/2023 .....	400.812	0,08
		<u>400.812</u>	<u>0,08</u>
	<b>Dänemark: 4,82 % (30. Juni 2022: null)</b>		
25.000.000	Denmark Government International Bond 2.50% 18/11/2024 .....	24.672.675	4,82
		<u>24.672.675</u>	<u>4,82</u>
	<b>Frankreich: 1,17 % (30. Juni 2022: 8,15 %)</b>		
6.000.000	France Treasury Bill BTF 0.00% 26/07/2023 .....	5.988.326	1,17
		<u>5.988.326</u>	<u>1,17</u>
	<b>Deutschland: 15,10 % (30. Juni 2022: 11,55 %)</b>		
25.000.000	Bundesobligation 0.00% 10/10/2025 .....	23.376.831	4,57
40.000.000	German Treasury Bill 0.00% 22/11/2023 .....	39.453.124	7,71
10.000.000	German Treasury Bill 0.00% 15/05/2024 .....	9.690.824	1,90
5.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.25% 30/06/2025 .....	4.699.012	0,92
		<u>77.219.791</u>	<u>15,10</u>
	<b>Griechenland: null (30. Juni 2022: 0,21 %)</b>		
	<b>Island: null (30. Juni 2022: 0,07 %)</b>		
	<b>Indonesien: null (30. Juni 2022: 0,67 %)</b>		
	<b>Italien: 6,75 % (30. Juni 2022: 4,46 %)</b>		
35.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.00% 29/11/2023 .....	34.507.900	6,75
		<u>34.507.900</u>	<u>6,75</u>
	<b>Litauen: 0,98 % (30. Juni 2022: null)</b>		
5.000.000	Lithuania Government International Bond 3.38% 22/01/2024 .....	4.996.715	0,98
		<u>4.996.715</u>	<u>0,98</u>
	<b>Niederlande: 1,17 % (30. Juni 2022: 3,05 %)</b>		
6.000.000	Dutch Treasury Certificate 0.00% 28/07/2023 .....	5.987.546	1,17
		<u>5.987.546</u>	<u>1,17</u>
	<b>Polen: 0,19 % (30. Juni 2022: 0,15 %)</b>		
1.000.000	Republic of Poland Government International Bond 0.00% 07/07/2023 .....	999.572	0,19
		<u>999.572</u>	<u>0,19</u>
	<b>Rumänien: 1,06 % (30. Juni 2022: 0,67 %)</b>		
5.500.000	Romanian Government International Bond 2.88% 28/10/2024 .....	5.419.326	1,06
		<u>5.419.326</u>	<u>1,06</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 94,18 % (30. Juni 2022: 88,72 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 41,90 % (30. Juni 2022: 43,42 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Spanien: 2,80 % (30. Juni 2022: 9,62 %)</b>		
5.000.000	Autonomous Community of Madrid Spain 2.87% 17/07/2023 .....	4.998.460	0,98
10.000.000	Instituto de Credito Oficial 1.30% 31/10/2026 .....	9.331.172	1,82
		<u>14.329.632</u>	<u>2,80</u>
	<b>Staatsanleihen insgesamt</b> .....	<u>214.322.479</u>	<u>41,90</u>
	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere: 0,12 % (30. Juni 2022: 0,10 %)</b>		
	<b>Irland: 0,12 % (30. Juni 2022: 0,10 %)</b>		
609.550	Primrose Residential 2021-1 DAC 4.19% 24/03/2061 .....	605.298	0,12
		<u>605.298</u>	<u>0,12</u>
	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere insgesamt</b> .....	<u>605.298</u>	<u>0,12</u>
	<b>Kurzfristige Anlagen: 0,97 % (30. Juni 2022: 0,30 %)</b>		
	<b>Finnland: null (30. Juni 2022: 0,30 %)</b>		
	<b>Frankreich: 0,97 % (30. Juni 2022: null)</b>		
5.000.000	L'Oreal SA 0.00% 06/10/2023 .....	4.950.903	0,97
		<u>4.950.903</u>	<u>0,97</u>
	<b>Kurzfristige Anlagen insgesamt</b> .....	<u>4.950.903</u>	<u>0,97</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<u>481.726.301</u>	<u>94,18</u>

Derivative Finanzinstrumente: 0,10 % (30. Juni 2022: 0,06 %)

Terminkontrakte (Futures): 0,10 % (30. Juni 2022: 0,06 %)\*

Nominal- betrag EUR	Durchschnittlicher Anschaffungskurs EUR		Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
(92.270.625)	(105)	875 of Euro-Schatz Short Futures Contracts Expiring September 2023.....	526.875	0,10
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures)</b> .....	<u>526.875</u>	<u>0,10</u>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt</b> .....	<u>526.875</u>	<u>0,10</u>
			<b>Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	482.253.176	94,28
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>29.255.101</u>	<u>5,72</u>
		<b>Nettovermögen</b>	<u>511.508.277</u>	<u>100,00</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....	94,17
Börsengehandelte derivative Instrumente .....	0,11
Sonstiges Umlaufvermögen .....	5,72
Gesamtvermögen .....	100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 345.489 EUR.



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,60 % (30. Juni 2022: 96,38 %)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 94,32 % (30. Juni 2022: 93,32 %)</b>		
	<b>Österreich: 0,69 % (30. Juni 2022: 0,62 %)</b>		
75.000	Suzano Austria GmbH 3.75% 15/01/2031 .....	64.063	0,69
		<u>64.063</u>	<u>0,69</u>
	<b>Bermuda: 0,79 % (30. Juni 2022: null)</b>		
100.000	Arch Capital Group Ltd 3.63% 30/06/2050 .....	73.420	0,79
		<u>73.420</u>	<u>0,79</u>
	<b>Kanada: 1,48 % (30. Juni 2022: 1,41 %)</b>		
150.000	Toronto-Dominion Bank 1.15% 12/06/2025 .....	138.286	1,48
		<u>138.286</u>	<u>1,48</u>
	<b>Frankreich: 5,18 % (30. Juni 2022: 3,60 %)</b>		
200.000	BNP Paribas SA 3.37% 09/01/2025 .....	192.189	2,06
200.000	Electricite de France SA 5.70% 23/05/2028 .....	199.824	2,14
75.000	Orange SA 9.00% 01/03/2031 .....	92.147	0,98
		<u>484.160</u>	<u>5,18</u>
	<b>Irland: 1,44 % (30. Juni 2022: null)</b>		
150.000	AerCap Ireland Capital DAC 2.45% 29/10/2026 .....	134.088	1,44
		<u>134.088</u>	<u>1,44</u>
	<b>Italien: null (30. Juni 2022: 1,32 %)</b>		
	<b>Japan: 1,51 % (30. Juni 2022: 1,14 %)</b>		
200.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.18% 09/07/2050 .....	141.042	1,51
		<u>141.042</u>	<u>1,51</u>
	<b>Niederlande: 3,79 % (30. Juni 2022: 2,72 %)</b>		
200.000	EDP Finance BV 1.71% 24/01/2028 .....	171.186	1,83
200.000	Enel Finance International NV 3.50% 06/04/2028 .....	183.145	1,96
		<u>354.331</u>	<u>3,79</u>
	<b>Norwegen: 1,43 % (30. Juni 2022: 1,03 %)</b>		
150.000	Aker BP ASA 3.75% 15/01/2030 .....	133.448	1,43
		<u>133.448</u>	<u>1,43</u>
	<b>Singapur: 1,17 % (30. Juni 2022: null)</b>		
105.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.30% 19/05/2053 .....	109.249	1,17
		<u>109.249</u>	<u>1,17</u>
	<b>Spanien: 1,05 % (30. Juni 2022: 0,77 %)</b>		
90.000	Telefonica Emisiones SA 7.04% 20/06/2036 .....	98.208	1,05
		<u>98.208</u>	<u>1,05</u>
	<b>Schweiz: 1,83 % (30. Juni 2022: 1,69 %)</b>		
225.000	UBS Group AG 2.10% 11/02/2032 .....	170.563	1,83
		<u>170.563</u>	<u>1,83</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 3,61 % (30. Juni 2022: 4,44 %)</b>		
115.000	AstraZeneca Plc 4.37% 16/11/2045 .....	106.965	1,14
250.000	HSBC Holdings Plc 1.65% 18/04/2026 .....	230.396	2,47
		<u>337.361</u>	<u>3,61</u>
	<b>Vereinigte Staaten: 70,35 % (30. Juni 2022: 74,57 %)</b>		
75.000	AbbVie Inc 4.25% 21/11/2049 .....	64.783	0,69
100.000	Aflac Inc 4.75% 15/01/2049 .....	93.283	1,00
85.000	Albemarle Corp 5.05% 01/06/2032 .....	82.338	0,88
100.000	Alexandria Real Estate Equities Inc 2.95% 15/03/2034 .....	78.974	0,85
100.000	Allstate Corp 4.20% 15/12/2046 .....	82.017	0,88
150.000	American Express Co 3.30% 03/05/2027 .....	140.158	1,50
50.000	Amgen Inc 2.45% 21/02/2030 .....	42.895	0,46
30.000	Amgen Inc 5.60% 02/03/2043 .....	30.111	0,32
100.000	Anheuser-Busch Co LLC 4.70% 01/02/2036 .....	97.334	1,04

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 98,60 % (30. Juni 2022: 96,38 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 94,32 % (30. Juni 2022: 93,32 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 70,35 % (30. Juni 2022: 74,57 %) (Fortsetzung)</b>		
100.000	Apple Inc 2.70% 05/08/2051 .....	69.747	0,75
250.000	AT&T Inc 3.50% 01/06/2041 .....	192.163	2,06
100.000	Baker Hughes Holdings LLC 4.08% 15/12/2047 .....	80.852	0,87
100.000	Bank of New York Mellon Corp 4.95% 26/04/2027 .....	98.817	1,06
75.000	BP Capital Markets America Inc 4.81% 13/02/2033 .....	73.945	0,79
116.000	Bristol-Myers Squibb Co 5.00% 15/08/2045 .....	115.766	1,24
100.000	Brixmor Operating Partnership LP 4.12% 15/05/2029 .....	89.341	0,96
50.000	Carrier Global Corp 3.58% 05/04/2050 .....	37.008	0,40
50.000	Celanese US Holdings LLC 6.05% 15/03/2025 .....	49.821	0,53
70.000	Centene Corp 3.38% 15/02/2030 .....	60.224	0,65
120.000	Charter Communications Operating LLC 2.80% 01/04/2031 .....	96.604	1,03
50.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.87% 31/03/2025 .....	49.786	0,53
45.000	Church & Dwight Co Inc 5.60% 15/11/2032 .....	47.597	0,51
50.000	Cigna Corp 3.05% 15/10/2027 .....	46.138	0,49
200.000	Citigroup Inc 3.67% 24/07/2028 .....	187.118	2,00
175.000	Comcast Corp 4.65% 15/02/2033 .....	173.806	1,86
50.000	Conagra Brands Inc 5.40% 01/11/2048 .....	47.700	0,51
60.000	CSX Corp 3.25% 01/06/2027 .....	56.515	0,61
125.000	CVS Health Corp 5.30% 05/12/2043 .....	119.669	1,28
70.000	DuPont de Nemours Inc 5.42% 15/11/2048 .....	69.113	0,74
125.000	Elevance Health Inc 4.10% 01/03/2028 .....	120.090	1,29
50.000	Energy Transfer LP 5.15% 15/03/2045 .....	43.186	0,46
60.000	Enterprise Products Operating LLC 4.80% 01/02/2049 .....	54.980	0,59
50.000	ERP Operating LP 4.50% 01/07/2044 .....	43.722	0,47
50.000	Essex Portfolio LP 2.65% 15/03/2032 .....	40.266	0,43
100.000	FedEx Corp 4.75% 15/11/2045 .....	88.975	0,95
125.000	Fiserv Inc 3.20% 01/07/2026 .....	117.335	1,26
225.000	Ford Foundation 2.82% 01/06/2070 .....	139.296	1,49
50.000	Freeport-McMoRan Inc 5.45% 15/03/2043 .....	46.690	0,50
100.000	Goldman Sachs Group Inc 2.64% 24/02/2028 .....	90.811	0,97
75.000	Goldman Sachs Group Inc 3.10% 24/02/2033 .....	63.390	0,68
50.000	Goldman Sachs Group Inc 4.48% 23/08/2028 .....	48.373	0,52
75.000	Home Depot Inc 3.35% 15/04/2050 .....	57.299	0,61
200.000	JPMorgan Chase & Co 2.52% 22/04/2031 .....	169.278	1,81
150.000	JPMorgan Chase & Co 0.77% 09/08/2025 .....	141.331	1,51
90.000	Kaiser Foundation Hospitals 2.81% 01/06/2041 .....	66.195	0,71
75.000	Kraft Heinz Foods Co 4.25% 01/03/2031 .....	71.424	0,76
50.000	Lowe's Co Inc 5.62% 15/04/2053 .....	50.010	0,54
75.000	LYB International Finance III LLC 5.62% 15/05/2033 .....	75.094	0,80
60.000	MDC Holdings Inc 2.50% 15/01/2031 .....	47.203	0,51
75.000	MetLife Inc 6.40% 15/12/2036 .....	74.948	0,80
200.000	Morgan Stanley 3.59% 22/07/2028 .....	184.698	1,98
70.000	Motorola Solutions Inc 4.60% 23/05/2029 .....	67.815	0,73
120.000	MPLX LP 4.12% 01/03/2027 .....	114.893	1,23
50.000	Netflix Inc 5.75% 01/03/2024 .....	49.947	0,53
75.000	Northern Trust Corp 4.00% 10/05/2027 .....	72.320	0,77
75.000	Otis Worldwide Corp 2.57% 15/02/2030 .....	64.716	0,69
125.000	PepsiCo Inc 3.90% 18/07/2032 .....	120.298	1,29
175.000	Public Service Electric and Gas Co 3.10% 15/03/2032 .....	153.109	1,64
50.000	Public Service Electric and Gas Co 5.12% 15/03/2053 .....	50.484	0,54
75.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc 1.75% 15/09/2030 .....	59.819	0,64
100.000	RELX Capital Inc 3.00% 22/05/2030 .....	89.207	0,96
90.000	Roper Technologies Inc 1.75% 15/02/2031 .....	71.437	0,77
150.000	ServiceNow Inc 1.40% 01/09/2030 .....	118.854	1,27
55.000	Simon Property Group LP 3.38% 01/12/2027 .....	50.809	0,54
100.000	Southern California Gas Co 6.35% 15/11/2052 .....	110.959	1,19
50.000	Sysco Corp 6.60% 01/04/2050 .....	57.035	0,61

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,60 % (30. Juni 2022: 96,38 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 94,32 % (30. Juni 2022: 93,32 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 70,35 % (30. Juni 2022: 74,57 %) (Fortsetzung)</b>		
75.000	Target Corp 4.80% 15/01/2053 .....	71.850	0,77
150.000	Thermo Fisher Scientific Inc 1.22% 18/10/2024 .....	141.907	1,52
150.000	T-Mobile USA Inc 3.38% 15/04/2029 .....	135.592	1,45
175.000	Toyota Motor Credit Corp 2.15% 13/02/2030 .....	149.856	1,60
100.000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 7.85% 01/02/2026 .....	104.744	1,12
100.000	UnitedHealth Group Inc 3.05% 15/05/2041 .....	77.384	0,83
275.000	Verizon Communications Inc 2.85% 03/09/2041 .....	195.808	2,10
150.000	Warnermedia Holdings Inc 4.28% 15/03/2032 .....	133.101	1,43
		<b>6.570.161</b>	<b>70,35</b>
	<b>Unternehmensanleihen insgesamt</b> .....	<b>8.808.380</b>	<b>94,32</b>
	<b>Staatsanleihen: 4,28 % (30. Juni 2022: 3,06 %)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 4,28 % (30. Juni 2022: 3,06 %)</b>		
400.000	United States Treasury Floating Rate Note 5.24% 31/01/2024 .....	400.058	4,28
		<b>400.058</b>	<b>4,28</b>
	<b>Staatsanleihen insgesamt</b> .....	<b>400.058</b>	<b>4,28</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<b>9.208.438</b>	<b>98,60</b>
		<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlageportfolio</b>	9.208.438	98,60
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	130.686	1,40
	<b>Nettovermögen</b>	<b>9.339.124</b>	<b>100,00</b>
	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		98,57
	Sonstiges Umlaufvermögen .....		1,43
	<b>Gesamtvermögen</b> .....		<b>100,00</b>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %)</b>		
	<b>Aktien: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,51 % (30. Juni 2022: 0,85 %)</b>		
5.000	CK Infrastructure Holdings Ltd .....	26.446	0,25
2.000	Orient Overseas International Ltd .....	26.823	0,26
		<u>53.269</u>	<u>0,51</u>
	<b>Kaimaninseln: 6,22 % (30. Juni 2022: 8,88 %)</b>		
1.076	360 DigiTech Inc ADR .....	18.593	0,18
11.000	3SBio Inc .....	11.047	0,11
2.000	C&D International Investment Group Ltd .....	4.533	0,04
15.000	China Conch Venture Holdings Ltd .....	19.524	0,19
40.000	China Feihe Ltd .....	22.255	0,21
27.000	China Hongqiao Group Ltd .....	21.913	0,21
16.000	China Medical System Holdings Ltd .....	26.052	0,25
14.600	China Overseas Property Holdings Ltd .....	14.699	0,14
28.000	China Resources Cement Holdings Ltd .....	11.541	0,11
21.000	CK Asset Holdings Ltd .....	116.300	1,11
20.000	Dali Foods Group Co Ltd .....	8.932	0,08
648	Daqo New Energy Corp ADR .....	25.726	0,25
12.000	Dongyue Group Ltd .....	8.973	0,09
98.000	GCL Technology Holdings Ltd .....	22.635	0,22
6.000	Haitian International Holdings Ltd .....	13.996	0,13
6.000	Hengan International Group Co Ltd .....	25.266	0,24
8.000	Kingboard Holdings Ltd .....	21.795	0,21
12.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd .....	11.285	0,11
13.000	Longfor Group Holdings Ltd .....	31.585	0,30
22.000	SITC International Holdings Co Ltd .....	40.145	0,38
20.500	Tingyi Cayman Islands Holding Corp .....	31.862	0,30
20.000	Topsports International Holdings Ltd .....	17.329	0,16
12.000	Uni-President China Holdings Ltd .....	10.106	0,10
48.000	Want Want China Holdings Ltd .....	31.851	0,30
80.000	WH Group Ltd .....	42.365	0,40
18.000	Xinyi Glass Holdings Ltd .....	28.022	0,27
4.000	Zhen Ding Technology Holding Ltd .....	13.486	0,13
		<u>651.816</u>	<u>6,22</u>
	<b>China: 28,37 % (30. Juni 2022: 29,90 %)</b>		
1.800	37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd .....	8.630	0,08
318.000	Agricultural Bank of China Ltd 'A' Shares .....	124.983	1,19
51.800	Agricultural Bank of China Ltd 'H' Shares .....	25.135	0,24
200	AIMA Technology Group Co Ltd .....	886	0,01
15.000	Anhui Conch Cement Co Ltd .....	39.813	0,38
3.000	Anhui Conch Cement Co Ltd .....	9.790	0,09
200	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'A' Shares .....	6.801	0,07
1.000	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'B' Shares .....	17.227	0,16
200	Anhui Kouzi Distillery Co Ltd .....	1.357	0,01
200	Anhui Yingjia Distillery Co Ltd .....	1.754	0,02
400	Avary Holding Shenzhen Co Ltd .....	1.336	0,01
13.200	Bank of Beijing Co Ltd .....	8.401	0,08
12.400	Bank of China Ltd 'A' Shares .....	6.665	0,06
490.000	Bank of China Ltd 'H' Shares .....	196.335	1,88
24.600	Bank of Communications Co Ltd 'A' Shares .....	19.613	0,19
94.000	Bank of Communications Co Ltd 'H' Shares .....	62.254	0,59
8.890	Bank of Jiangsu Co Ltd .....	8.982	0,09
6.000	Bank of Nanjing Co Ltd .....	6.598	0,06
8.970	Bank of Shanghai Co Ltd .....	7.090	0,07
13.600	Baoshan Iron & Steel Co Ltd .....	10.506	0,10
600	Beijing New Building Materials Plc .....	2.021	0,02
560	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd .....	5.140	0,05
600	By-health Co Ltd .....	1.978	0,02

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 28,37 % (30. Juni 2022: 29,90 %) (Fortsetzung)</b>		
200	Changchun High & New Technology Industry Group Inc .....	3.747	0,04
200	Chengxin Lithium Group Co Ltd .....	876	0,01
86.000	China Cinda Asset Management Co Ltd .....	8.560	0,08
106.000	China CITIC Bank Corp Ltd .....	49.777	0,48
24.000	China Coal Energy Co Ltd .....	17.824	0,17
24.000	China Communications Services Corp Ltd .....	11.821	0,11
1.400	China Construction Bank Corp 'A' Shares .....	1.205	0,01
308.000	China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	199.265	1,90
26.600	China Everbright Bank Co Ltd 'A' Shares .....	11.225	0,11
34.000	China Everbright Bank Co Ltd 'H' Shares .....	9.762	0,09
24.000	China Galaxy Securities Co Ltd .....	12.801	0,12
1.600	China Jushi Co Ltd .....	3.114	0,03
20.400	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A' Shares .....	10.516	0,10
60.000	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' Shares .....	22.203	0,21
36.000	China National Building Material Co Ltd .....	22.142	0,21
19.800	China Petroleum & Chemical Corp 'A' Shares .....	17.310	0,17
276.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H' Shares .....	161.657	1,54
42.000	China Railway Group Ltd .....	27.708	0,27
9.600	China Railway Group Ltd .....	10.003	0,10
400	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd .....	3.335	0,03
5.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'A' Shares .....	21.135	0,20
47.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H' Shares .....	143.640	1,37
23.000	China State Construction Engineering Corp Ltd .....	18.148	0,17
9.600	China United Network Communications Ltd .....	6.334	0,06
13.200	China Yangtze Power Co Ltd .....	40.027	0,38
400	Chongqing Brewery Co Ltd .....	5.067	0,05
4.400	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd .....	2.171	0,02
1.200	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd .....	7.291	0,07
10.800	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A' Shares .....	13.955	0,13
46.000	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' Shares .....	41.441	0,40
36.000	CRRC Corp Ltd .....	19.708	0,19
1.052	Daan Gene Co Ltd .....	1.442	0,01
8.400	Daqin Railway Co Ltd .....	8.579	0,08
28.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd .....	12.791	0,12
11.200	Focus Media Information Technology Co Ltd .....	10.484	0,10
2.640	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd .....	17.002	0,16
2.800	Foxconn Industrial Internet Co Ltd .....	9.699	0,09
400	Ganfeng Lithium Group Co Ltd 'A' Shares .....	3.352	0,03
2.000	Ganfeng Lithium Group Co Ltd 'H' Shares .....	13.041	0,12
1.800	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai .....	9.034	0,09
4.600	Guanghui Energy Co Ltd .....	4.338	0,04
200	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd .....	2.076	0,02
400	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd .....	3.675	0,04
400	Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co Ltd .....	1.358	0,01
1.000	Heilongjiang Agriculture Co Ltd .....	1.832	0,02
1.400	Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd .....	2.502	0,02
2.400	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd .....	8.079	0,08
400	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd .....	9.638	0,09
200	Hoshine Silicon Industry Co Ltd .....	1.925	0,02
3.200	Huafon Chemical Co Ltd .....	3.018	0,03
1.400	Huaibei Mining Holdings Co Ltd .....	2.217	0,02
8.800	Huaxia Bank Co Ltd .....	6.544	0,06
600	Huaxin Cement Co Ltd .....	1.019	0,01
400	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co Ltd .....	1.597	0,02
600	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd .....	1.833	0,02
4.800	Hunan Valin Steel Co Ltd .....	3.147	0,03
22.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A' Shares .....	14.576	0,14

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 28,37 % (30. Juni 2022: 29,90 %) (Fortsetzung)</b>		
346.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares .....	184.555	1,76
1.200	Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp Ltd .....	2.181	0,02
5.000	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd .....	2.818	0,03
3.200	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd .....	12.457	0,12
12.600	Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd .....	17.224	0,16
400	Jafron Biomedical Co Ltd .....	1.275	0,01
260	Jason Furniture Hangzhou Co Ltd .....	1.363	0,01
12.000	Jiangsu Expressway Co Ltd .....	11.056	0,11
600	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd .....	5.306	0,05
600	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd .....	4.355	0,04
600	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd .....	10.833	0,10
200	JiuGui Liquor Co Ltd .....	2.478	0,02
2.800	Jizhong Energy Resources Co Ltd .....	2.456	0,02
775	Kweichow Moutai Co Ltd .....	180.146	1,72
1.000	LB Group Co Ltd .....	2.268	0,02
1.400	Luxi Chemical Group Co Ltd .....	2.032	0,02
800	Luzhou Laojiao Co Ltd .....	23.046	0,22
1.000	Meihua Holdings Group Co Ltd .....	1.228	0,01
8.800	New China Life Insurance Co Ltd 'H' Shares .....	23.189	0,22
200	Ningbo Deye Technology Co Ltd .....	4.111	0,04
3.800	Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd .....	6.587	0,06
17.600	Nongfu Spring Co Ltd .....	97.134	0,93
4.000	People's Insurance Co Group of China Ltd 'A' Shares .....	3.211	0,03
90.000	People's Insurance Co Group of China Ltd 'H' Shares .....	32.616	0,31
1.200	Perfect World Co Ltd .....	2.786	0,03
12.000	PetroChina Co Ltd 'A' Shares .....	12.322	0,12
252.000	PetroChina Co Ltd 'H' Shares .....	174.290	1,66
64.000	PICC Property & Casualty Co Ltd .....	71.133	0,68
1.800	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co Ltd .....	1.866	0,02
200	Porton Pharma Solutions Ltd .....	813	0,01
68.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd .....	41.824	0,40
2.600	Qinghai Salt Lake Industry Co Ltd .....	6.851	0,07
325	SG Micro Corp .....	3.669	0,04
8.800	Shaanxi Coal Industry Co Ltd .....	22.004	0,21
1.800	Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co Ltd .....	1.957	0,02
1.450	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd .....	6.105	0,06
1.600	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd .....	2.351	0,02
5.064	Shanghai Baosight Software Co Ltd .....	13.369	0,13
4.200	Shanghai International Port Group Co Ltd .....	3.031	0,03
16.800	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd .....	16.720	0,16
800	Shanxi Coal International Energy Group Co Ltd .....	1.591	0,02
3.000	Shanxi Coking Coal Energy Group Co Ltd .....	3.753	0,04
2.000	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd .....	4.487	0,04
4.400	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd .....	2.341	0,02
780	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd .....	19.843	0,19
200	Shenzhen Kstar Science And Technology Co Ltd .....	1.100	0,01
700	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd .....	28.848	0,28
400	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co Ltd .....	3.244	0,03
2.200	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd .....	4.551	0,04
4.800	Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd .....	1.603	0,02
1.960	Sichuan Road and Bridge Group Co Ltd .....	2.643	0,03
200	Sichuan Swellfun Co Ltd .....	1.622	0,02
400	Sichuan Yahua Industrial Group Co Ltd .....	978	0,01
280	Sinomine Resource Group Co Ltd .....	1.961	0,02
12.800	Sinopharm Group Co Ltd .....	40.017	0,38
560	Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co Ltd .....	2.756	0,03
1.600	TBEA Co Ltd .....	4.902	0,05

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 28,37 % (30. Juni 2022: 29,90 %) (Fortsetzung)</b>		
830	Toly Bread Co Ltd .....	1.155	0,01
2.000	Tongwei Co Ltd .....	9.433	0,09
1.600	Wanhua Chemical Group Co Ltd .....	19.319	0,18
1.600	Wuliangye Yibin Co Ltd .....	35.975	0,34
830	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd .....	2.389	0,02
200	Xiamen Faratronic Co Ltd .....	3.775	0,04
680	Xinjiang Daqo New Energy Co Ltd .....	3.781	0,04
1.600	Yankuang Energy Group Co Ltd 'A' Shares .....	6.581	0,06
20.000	Yankuang Energy Group Co Ltd 'H' Shares .....	57.295	0,55
840	Yealink Network Technology Corp Ltd .....	4.049	0,04
1.600	Yintai Gold Co Ltd .....	2.573	0,02
460	YongXing Special Materials Technology Co Ltd .....	3.959	0,04
1.600	Yunnan Aluminium Co Ltd .....	2.800	0,03
1.000	Yunnan Yuntianhua Co Ltd .....	2.346	0,02
1.000	Zangge Mining Co Ltd .....	3.102	0,03
200	Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co Ltd .....	7.873	0,08
1.864	Zhejiang NHU Co Ltd .....	3.946	0,04
200	Zhejiang Supor Co Ltd .....	1.375	0,01
800	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd .....	2.259	0,02
200	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd .....	925	0,01
1.800	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd .....	2.133	0,02
		<b>2.970.160</b>	<b>28,37</b>
	<b>Hongkong: 6,25 % (30. Juni 2022: 6,78 %)</b>		
5.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd .....	19.897	0,19
26.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd .....	79.461	0,76
12.000	China Merchants Port Holdings Co Ltd .....	16.936	0,16
10.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd .....	8.703	0,08
12.400	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd .....	12.880	0,12
54.000	CITIC Ltd .....	64.428	0,62
76.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd .....	66.044	0,63
35.000	HKT Trust & HKT Ltd .....	40.687	0,39
64.000	Lenovo Group Ltd .....	66.723	0,64
14.000	Power Assets Holdings Ltd .....	73.335	0,70
35.200	Sino Land Co Ltd .....	43.256	0,41
12.856	Sun Hung Kai Properties Ltd .....	161.918	1,55
		<b>654.268</b>	<b>6,25</b>
	<b>Indien: 14,13 % (30. Juni 2022: 15,99 %)</b>		
664	Bajaj Auto Ltd .....	37.973	0,36
1.168	Britannia Industries Ltd .....	71.538	0,68
21.326	Coal India Ltd .....	60.050	0,57
1.518	Colgate-Palmolive India Ltd .....	31.237	0,30
25.732	GAIL India Ltd .....	32.951	0,31
9.752	HCL Technologies Ltd .....	141.217	1,35
974	Hero MotoCorp Ltd .....	34.551	0,33
398	Hindustan Aeronautics Ltd .....	18.399	0,18
26.546	Indian Oil Corp Ltd .....	29.544	0,28
1.470	Indraprastha Gas Ltd .....	8.482	0,08
13.748	Infosys Ltd .....	223.809	2,14
34.390	ITC Ltd .....	189.313	1,81
4.926	Marico Ltd .....	31.882	0,30
378	Nestle India Ltd .....	105.490	1,01
30.378	Oil & Natural Gas Corp Ltd .....	59.359	0,57
56	Page Industries Ltd .....	25.699	0,25
8.174	Petronet LNG Ltd .....	22.190	0,21
5.414	Tata Consultancy Services Ltd .....	217.933	2,08
260	Tata Elxsi Ltd .....	24.050	0,23

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 14,13 % (30. Juni 2022: 15,99 %) (Fortsetzung)</b>		
49.626	Tata Steel Ltd .....	67.752	0,65
2.020	Varun Beverages Ltd .....	19.761	0,19
7.678	Vedanta Ltd .....	26.014	0,25
		<u>1.479.194</u>	<u>14,13</u>
	<b>Indonesien: 7,98 % (30. Juni 2022: 2,86 %)</b>		
220.400	Adaro Energy Indonesia Tbk PT .....	32.783	0,31
149.400	Astra International Tbk PT .....	67.513	0,65
350.800	Bank Central Asia Tbk PT .....	214.095	2,04
261.800	Bank Mandiri Persero Tbk PT .....	90.803	0,87
466.600	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT .....	168.838	1,61
39.200	Indofood Sukses Makmur Tbk PT .....	19.218	0,18
142.000	Kalbe Farma Tbk PT .....	19.416	0,19
117.800	Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT .....	20.272	0,19
533.600	Telkom Indonesia Persero Tbk PT .....	142.364	1,36
100.000	Unilever Indonesia Tbk PT .....	28.414	0,27
20.600	United Tractors Tbk PT .....	31.980	0,31
		<u>835.696</u>	<u>7,98</u>
	<b>Malaysia: 1,49 % (30. Juni 2022: 2,08 %)</b>		
32.800	Malayan Banking Bhd .....	60.646	0,58
800	Nestle Malaysia Bhd .....	22.453	0,21
23.200	Petronas Chemicals Group Bhd .....	29.823	0,28
7.800	Petronas Gas Bhd .....	27.908	0,27
13.400	RHB Bank Bhd .....	15.589	0,15
		<u>156.419</u>	<u>1,49</u>
	<b>Philippinen: 0,46 % (30. Juni 2022: 0,57 %)</b>		
8.860	International Container Terminal Services Inc .....	32.712	0,31
2.480	Manila Electric Co .....	15.051	0,15
		<u>47.763</u>	<u>0,46</u>
	<b>Singapur: 1,10 % (30. Juni 2022: 3,36 %)</b>		
600	Jardine Cycle & Carriage Ltd .....	15.428	0,15
9.800	Singapore Exchange Ltd .....	69.589	0,66
2.800	Venture Corp Ltd .....	30.434	0,29
		<u>115.451</u>	<u>1,10</u>
	<b>Südkorea: 12,68 % (30. Juni 2022: 9,43 %)</b>		
508	DB Insurance Co Ltd .....	28.761	0,28
166	F&F Co Ltd / New .....	15.067	0,14
3.424	Hana Financial Group Inc .....	101.864	0,97
2.950	HMM Co Ltd .....	42.202	0,40
80	Hyundai Glovis Co Ltd .....	12.003	0,12
108	Hyundai Motor Co (preferred stock) .....	8.918	0,09
178	Hyundai Motor Co (second preferred stock) .....	14.819	0,14
3.346	Industrial Bank of Korea .....	26.257	0,25
3.616	KB Financial Group Inc .....	131.039	1,25
2.008	Kia Corp .....	134.867	1,29
1.136	KT&G Corp .....	71.385	0,68
212	Kumho Petrochemical Co Ltd .....	21.350	0,20
110	LG Innotek Co Ltd .....	25.838	0,25
550	Meritz Financial Group Inc .....	17.322	0,17
1.718	NH Investment & Securities Co Ltd .....	12.452	0,12
120	Orion Corp .....	10.929	0,10
2.116	Pan Ocean Co Ltd .....	8.319	0,08
666	POSCO Holdings Inc .....	196.113	1,87
3.562	Samsung Electronics Co Ltd .....	195.178	1,86
626	Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock) .....	28.268	0,27



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,37 % (30. Juni 2022: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 12,68 % (30. Juni 2022: 9,43 %) (Fortsetzung)</b>		
144	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd .....	25.136	0,24
464	Samsung Securities Co Ltd .....	12.677	0,12
4.540	Shinhan Financial Group Co Ltd .....	117.148	1,12
324	S-Oil Corp .....	16.401	0,16
6.000	Woori Financial Group Inc .....	53.686	0,51
		<u>1.327.999</u>	<u>12,68</u>
	<b>Taiwan: 16,26 % (30. Juni 2022: 15,79 %)</b>		
2.000	Accton Technology Corp .....	22.412	0,21
14.000	ASE Technology Holding Co Ltd .....	49.672	0,47
6.600	Asustek Computer Inc .....	66.647	0,64
34.000	Chunghwa Telecom Co Ltd .....	127.181	1,21
1.000	Eclat Textile Co Ltd .....	16.038	0,15
530	eMemory Technology Inc .....	37.609	0,36
14.000	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd .....	42.030	0,40
12.000	Far Eastone Telecommunications Co Ltd .....	30.285	0,29
2.000	Feng TAY Enterprise Co Ltd .....	12.619	0,12
28.000	Formosa Plastics Corp .....	77.047	0,74
480	Largan Precision Co Ltd .....	32.828	0,31
20.000	Lite-On Technology Corp .....	66.464	0,64
9.320	MediaTek Inc .....	205.884	1,97
7.200	Micro-Star International Co Ltd .....	40.803	0,39
32.000	Nan Ya Plastics Corp .....	74.492	0,71
1.000	Nan Ya Printed Circuit Board Corp .....	8.477	0,08
1.880	Nien Made Enterprise Co Ltd .....	20.675	0,20
8.000	Novatek Microelectronics Corp .....	109.554	1,05
3.460	Realtek Semiconductor Corp .....	43.049	0,41
18.000	Ruentex Development Co Ltd .....	20.777	0,20
12.000	Synnex Technology International Corp .....	22.347	0,21
12.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	221.933	2,12
116.000	United Microelectronics Corp .....	180.642	1,73
10.000	Vanguard International Semiconductor Corp .....	28.255	0,27
340	Voltronic Power Technology Corp .....	21.452	0,21
10.037	Wan Hai Lines Ltd .....	19.014	0,18
12.000	Wistron Corp .....	34.985	0,33
460	Wiwynn Corp .....	20.973	0,20
24.000	Yang Ming Marine Transport Corp .....	48.548	0,46
		<u>1.702.692</u>	<u>16,26</u>
	<b>Thailand: 2,92 % (30. Juni 2022: 2,44 %)</b>		
12.000	Advanced Info Service PCL .....	72.430	0,69
48.000	Bangkok Dusit Medical Services PCL .....	37.569	0,36
22.800	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR .....	17.845	0,17
47.800	Banpu PCL NVDR .....	11.932	0,11
6.200	Bumrungrad Hospital PCL .....	39.521	0,38
12.800	Intouch Holdings PCL .....	26.716	0,26
31.600	Krung Thai Bank PCL .....	17.291	0,16
109.400	Land & Houses PCL .....	26.073	0,25
11.600	Osotspa PCL .....	9.733	0,09
3.400	PTT Exploration & Production PCL .....	14.384	0,14
7.600	PTT Exploration & Production PCL .....	32.153	0,31
		<u>305.647</u>	<u>2,92</u>
	<b>Aktien insgesamt.....</b>	<u>10.300.374</u>	<u>98,37</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt.....</b>	<u>10.300.374</u>	<u>98,37</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2022: (0,02) %)

Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2022: (0,02) %)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnittlicher Anschaffungskurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
151.055	1.007	4 of MSCI Emgmt Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	(1.370)	(0,01)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures) .....</b>	<b>(1.370)</b>	<b>(0,01)</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt.....</b>	<b>(1.370)</b>	<b>(0,01)</b>
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	10.299.004	98,36
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	172.170	1,64
		<b>Nettovermögen</b>	<b>10.471.174</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- Vermögensw erte</b>
		<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		98,05
		Sonstiges Umlaufvermögen .....		1,95
		Gesamtvermögen.....		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 6.755 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %)</b>		
	<b>Aktien: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,25 % (30. Juni 2022: 0,41 %)</b>		
7.200	Orient Overseas International Ltd .....	96.562	0,25
		<u>96.562</u>	<u>0,25</u>
	<b>Brasilien: 8,32 % (30. Juni 2022: 6,80 %)</b>		
132.800	Ambev SA ADR .....	422.304	1,10
142.400	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	431.274	1,13
32.000	Banco do Brasil SA .....	327.695	0,86
33.600	BB Seguridade Participacoes SA .....	214.318	0,56
51.200	Cia Energetica de Minas Gerais .....	136.491	0,36
8.000	CPFL Energia SA .....	57.032	0,15
6.400	Engie Brasil Energia SA .....	60.617	0,16
48.000	Gerdau SA .....	249.453	0,65
25.600	JBS SA .....	92.657	0,24
19.200	Petro Rio SA .....	147.582	0,39
30.400	Petroleo Brasileiro SA .....	208.590	0,54
40.000	Petroleo Brasileiro SA (preferred stock) .....	244.859	0,64
14.400	Telefonica Brasil SA .....	129.164	0,34
28.800	TIM SA .....	87.284	0,23
3.171	Vale SA .....	42.214	0,11
24.496	Vale SA ADR .....	328.736	0,86
		<u>3.180.270</u>	<u>8,32</u>
	<b>Kaimaninseln: 3,58 % (30. Juni 2022: 3,96 %)</b>		
3.744	360 DigiTech Inc ADR .....	64.696	0,17
10.000	C&D International Investment Group Ltd .....	22.663	0,06
48.000	China Conch Venture Holdings Ltd .....	62.476	0,16
128.000	China Feihe Ltd .....	71.215	0,19
88.000	China Hongqiao Group Ltd .....	71.419	0,19
48.000	China Medical System Holdings Ltd .....	78.156	0,20
51.400	China Overseas Property Holdings Ltd .....	51.750	0,14
96.000	China Resources Cement Holdings Ltd .....	39.568	0,10
72.000	Dali Foods Group Co Ltd .....	32.157	0,08
2.272	Daqo New Energy Corp ADR .....	90.198	0,24
48.000	Dongyue Group Ltd .....	35.893	0,09
352.000	GCL Technology Holdings Ltd .....	81.301	0,21
20.000	Haitian International Holdings Ltd .....	46.653	0,12
19.200	Hengan International Group Co Ltd .....	80.851	0,21
24.000	Kingboard Holdings Ltd .....	65.386	0,17
40.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd .....	37.618	0,10
48.000	Longfor Group Holdings Ltd .....	116.622	0,30
21.000	Shimao Group Holdings Ltd .....	1.040	0,00
56.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp .....	87.038	0,23
56.000	Topsports International Holdings Ltd .....	48.521	0,13
48.000	Uni-President China Holdings Ltd .....	40.426	0,11
160.000	Want Want China Holdings Ltd .....	106.169	0,28
11.040	Zhen Ding Technology Holding Ltd .....	37.220	0,10
		<u>1.369.036</u>	<u>3,58</u>
	<b>Chile: 1,58 % (30. Juni 2022: 0,48 %)</b>		
1.174.448	Banco de Chile .....	122.533	0,32
678.176	Cia Sud Americana de Vapores SA .....	46.035	0,12
10.704	Empresas Copec SA .....	79.397	0,21
4.912	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA .....	357.609	0,93
		<u>605.574</u>	<u>1,58</u>
	<b>China: 21,61 % (30. Juni 2022: 22,08 %)</b>		
4.800	37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd .....	23.014	0,06
800.000	Agricultural Bank of China Ltd 'A' Shares .....	314.422	0,82
126.400	Agricultural Bank of China Ltd 'H' Shares .....	61.334	0,16

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 21,61 % (30. Juni 2022: 22,08 %) (Fortsetzung)</b>		
48.000	Anhui Conch Cement Co Ltd .....	127.402	0,33
10.400	Anhui Conch Cement Co Ltd .....	33.939	0,09
400	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'A' Shares .....	13.602	0,04
3.200	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'B' Shares .....	55.126	0,14
1.600	Anhui Yingjia Distillery Co Ltd .....	14.032	0,04
1.600	Avary Holding Shenzhen Co Ltd .....	5.342	0,01
46.400	Bank of Beijing Co Ltd .....	29.531	0,08
6.400	Bank of Changsha Co Ltd .....	6.827	0,02
6.400	Bank of Chengdu Co Ltd .....	10.742	0,03
27.200	Bank of China Ltd 'A' Shares .....	14.619	0,04
896.000	Bank of China Ltd 'H' Shares .....	359.013	0,94
89.600	Bank of Communications Co Ltd 'A' Shares .....	71.436	0,19
352.000	Bank of Communications Co Ltd 'H' Shares .....	233.121	0,61
28.800	Bank of Jiangsu Co Ltd .....	29.098	0,08
19.200	Bank of Nanjing Co Ltd .....	21.114	0,05
32.000	Bank of Shanghai Co Ltd .....	25.293	0,07
48.000	Baoshan Iron & Steel Co Ltd .....	37.081	0,10
980	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd .....	8.995	0,02
3.200	By-health Co Ltd .....	10.548	0,03
1.600	Chengxin Lithium Group Co Ltd .....	7.009	0,02
336.000	China Cinda Asset Management Co Ltd .....	33.443	0,09
384.000	China CITIC Bank Corp Ltd .....	180.323	0,47
80.000	China Coal Energy Co Ltd .....	59.414	0,16
64.000	China Communications Services Corp Ltd .....	31.524	0,08
1.600	China Construction Bank Corp 'A' Shares .....	1.377	0,00
560.000	China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	362.300	0,95
96.000	China Everbright Bank Co Ltd 'A' Shares .....	40.512	0,11
128.000	China Everbright Bank Co Ltd 'H' Shares .....	36.751	0,10
96.000	China Galaxy Securities Co Ltd .....	51.206	0,13
208.000	China Life Insurance Co Ltd .....	346.640	0,91
78.400	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A' Shares .....	40.413	0,11
224.000	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' Shares .....	82.893	0,22
12.800	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A' Shares .....	45.712	0,12
86.400	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' Shares .....	223.260	0,58
38.400	China Petroleum & Chemical Corp 'A' Shares .....	33.571	0,09
532.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H' Shares .....	311.599	0,81
144.000	China Railway Group Ltd .....	95.000	0,25
1.600	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd .....	13.341	0,03
11.200	China Shenhua Energy Co Ltd 'A' Shares .....	47.342	0,12
96.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H' Shares .....	293.393	0,77
78.400	China State Construction Engineering Corp Ltd .....	61.860	0,16
33.600	China United Network Communications Ltd .....	22.170	0,06
41.600	China Yangtze Power Co Ltd .....	126.147	0,33
31.200	China Zheshang Bank Co Ltd .....	11.322	0,03
1.200	Chongqing Brewery Co Ltd .....	15.202	0,04
19.200	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd .....	9.475	0,02
3.200	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd .....	19.442	0,05
36.800	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A' Shares .....	47.550	0,12
160.000	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' Shares .....	144.144	0,38
64.000	CRRC Corp Ltd .....	35.036	0,09
4.800	Daan Gene Co Ltd .....	6.578	0,02
28.800	Daqin Railway Co Ltd .....	29.414	0,08
96.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd .....	43.856	0,11
36.800	Focus Media Information Technology Co Ltd .....	34.449	0,09
8.640	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd .....	55.642	0,15
9.600	Foxconn Industrial Internet Co Ltd .....	33.255	0,09
200	G-bits Network Technology Xiamen Co Ltd .....	13.502	0,04

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 21,61 % (30. Juni 2022: 22,08 %) (Fortsetzung)</b>		
4.800	Gemdale Corp .....	4.757	0,01
5.600	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai .....	28.105	0,07
14.400	Guanghui Energy Co Ltd .....	13.579	0,04
1.600	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd .....	14.701	0,04
89.600	Haitong Securities Co Ltd .....	54.881	0,14
1.600	Hebei Yangyuan Zihui Beverage Co Ltd .....	5.432	0,01
3.200	Heilongjiang Agriculture Co Ltd .....	5.864	0,02
4.800	Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd .....	8.578	0,02
8.000	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd .....	26.931	0,07
1.600	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd .....	38.551	0,10
1.600	Hoshine Silicon Industry Co Ltd .....	15.400	0,04
8.000	Huafo Chemical Co Ltd .....	7.544	0,02
4.800	Huaibei Mining Holdings Co Ltd .....	7.601	0,02
30.400	Huaxia Bank Co Ltd .....	22.607	0,06
3.200	Huaxin Cement Co Ltd .....	5.432	0,01
1.600	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co Ltd .....	6.387	0,02
1.600	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd .....	4.887	0,01
16.000	Hunan Valin Steel Co Ltd .....	10.491	0,03
38.400	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A' Shares .....	25.442	0,07
640.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares .....	341.373	0,89
3.200	Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp Ltd .....	5.815	0,01
17.600	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd .....	9.919	0,03
41.600	Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd .....	56.867	0,15
1.600	Jafron Biomedical Co Ltd .....	5.098	0,01
38.000	Jiangsu Expressway Co Ltd .....	35.010	0,09
1.600	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd .....	11.613	0,03
2.300	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd .....	41.528	0,11
6.400	Jizhong Energy Resources Co Ltd .....	5.613	0,01
1.600	Kweichow Moutai Co Ltd .....	371.914	0,97
3.200	LB Group Co Ltd .....	7.258	0,02
3.200	Luxi Chemical Group Co Ltd .....	4.645	0,01
2.200	Luzhou Laojiao Co Ltd .....	63.377	0,17
3.200	Meihua Holdings Group Co Ltd .....	3.928	0,01
3.200	New China Life Insurance Co Ltd 'A' Shares .....	16.174	0,04
33.600	New China Life Insurance Co Ltd 'H' Shares .....	88.538	0,23
360	Ningbo Deye Technology Co Ltd .....	7.401	0,02
11.200	Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd .....	19.414	0,05
54.400	Nongfu Spring Co Ltd .....	300.232	0,78
14.400	People's Insurance Co Group of China Ltd 'A' Shares .....	11.560	0,03
352.000	People's Insurance Co Group of China Ltd 'H' Shares .....	127.566	0,33
3.200	Perfect World Co Ltd .....	7.429	0,02
27.200	PetroChina Co Ltd 'A' Shares .....	27.930	0,07
512.000	PetroChina Co Ltd 'H' Shares .....	354.113	0,93
240.000	PICC Property & Casualty Co Ltd .....	266.748	0,70
3.200	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co Ltd .....	3.317	0,01
256.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd .....	157.456	0,41
9.600	Qinghai Salt Lake Industry Co Ltd .....	25.297	0,07
28.800	Shaanxi Coal Industry Co Ltd .....	72.012	0,19
4.800	Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co Ltd .....	5.219	0,01
4.800	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd .....	20.210	0,05
4.800	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd .....	7.053	0,02
64.000	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd .....	63.694	0,17
3.200	Shanxi Coal International Energy Group Co Ltd .....	6.365	0,02
9.600	Shanxi Coking Coal Energy Group Co Ltd .....	12.009	0,03
6.400	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd .....	14.358	0,04
14.400	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd .....	7.660	0,02
1.600	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd .....	40.704	0,11

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 21,61 % (30. Juni 2022: 22,08 %) (Fortsetzung)</b>		
1.600	Shenzhen Kstar Science And Technology Co Ltd .....	8.800	0,02
2.400	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd .....	98.906	0,26
1.600	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co Ltd .....	12.976	0,03
16.000	Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd .....	5.344	0,01
6.720	Sichuan Road and Bridge Group Co Ltd .....	9.062	0,02
1.200	Sichuan Swellfun Co Ltd .....	9.731	0,03
1.600	Sichuan Yahua Industrial Group Co Ltd .....	3.910	0,01
800	Sinomine Resource Group Co Ltd .....	5.602	0,01
25.600	Sinopharm Group Co Ltd .....	80.035	0,21
1.580	Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co Ltd .....	7.775	0,02
3.912	Toly Bread Co Ltd .....	5.442	0,01
6.400	Tongwei Co Ltd .....	30.184	0,08
4.800	Wanhua Chemical Group Co Ltd .....	57.958	0,15
3.800	Wuliangye Yibin Co Ltd .....	85.441	0,22
2.368	Xinjiang Daqo New Energy Co Ltd .....	13.167	0,03
4.800	Yankuang Energy Group Co Ltd 'A' Shares .....	19.742	0,05
72.000	Yankuang Energy Group Co Ltd 'H' Shares .....	206.263	0,54
2.240	Yealink Network Technology Corp Ltd .....	10.798	0,03
4.800	Yintai Gold Co Ltd .....	7.720	0,02
1.620	YongXing Special Materials Technology Co Ltd .....	13.942	0,04
4.800	Youngor Group Co Ltd .....	4.163	0,01
3.200	Yunnan Yuntianhua Co Ltd .....	7.509	0,02
3.200	Zangge Mining Co Ltd .....	9.928	0,03
600	Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co Ltd .....	23.618	0,06
6.540	Zhejiang NHU Co Ltd .....	13.844	0,04
1.600	Zhejiang Supor Co Ltd .....	10.997	0,03
3.200	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd .....	9.035	0,02
6.400	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd .....	7.583	0,02
		<u>8.264.760</u>	<u>21,61</u>
	<b>Kolumbien: null (30. Juni 2022: 0,13 %)</b>		
	<b>Zypern: null (30. Juni 2022: 0,00 %)</b>		
3.360	TCS Group Holding Plc GDR .....	-	0,00
		-	0,00
	<b>Tschechische Republik: 0,53 % (30. Juni 2022: 0,60 %)</b>		
4.912	CEZ AS .....	203.005	0,53
		<u>203.005</u>	<u>0,53</u>
	<b>Ägypten: 0,10 % (30. Juni 2022: 0,08 %)</b>		
54.128	Eastern Co SAE .....	37.382	0,10
		<u>37.382</u>	<u>0,10</u>
	<b>Griechenland: 1,20 % (30. Juni 2022: 0,56 %)</b>		
7.280	Hellenic Telecommunications Organization SA .....	124.776	0,33
4.592	JUMBO SA .....	126.249	0,33
1.568	Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA .....	39.688	0,10
1.840	Mytilineos SA .....	64.921	0,17
5.872	OPAP SA .....	102.373	0,27
		<u>458.007</u>	<u>1,20</u>
	<b>Hongkong: 2,77 % (30. Juni 2022: 1,94 %)</b>		
16.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd .....	57.882	0,15
45.700	China Merchants Port Holdings Co Ltd .....	64.498	0,17
96.000	China Overseas Land & Investment Ltd .....	209.233	0,55
54.400	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd .....	56.506	0,15
176.000	CITIC Ltd .....	209.989	0,55
256.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd .....	222.464	0,58

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Hongkong: 2,77 % (30. Juni 2022: 1,94 %) (Fortsetzung)</b>		
176.000	Lenovo Group Ltd .....	183.488	0,48
48.000	Yuexiu Property Co Ltd .....	55.800	0,14
		<u>1.059.860</u>	<u>2,77</u>
	<b>Ungarn: 0,63 % (30. Juni 2022: 0,44 %)</b>		
13.952	MOL Hungarian Oil & Gas Plc .....	121.936	0,32
4.896	Richter Gedeon Nyrt .....	120.579	0,31
		<u>242.515</u>	<u>0,63</u>
	<b>Indien: 10,47 % (30. Juni 2022: 13,43 %)</b>		
2.320	Bajaj Auto Ltd .....	132.678	0,35
4.128	Britannia Industries Ltd .....	252.831	0,66
71.856	Coal India Ltd .....	202.334	0,53
5.376	Colgate-Palmolive India Ltd .....	110.625	0,29
86.368	GAIL India Ltd .....	110.597	0,29
28.944	HCL Technologies Ltd .....	419.132	1,10
3.376	Hero MotoCorp Ltd .....	119.758	0,31
89.232	Indian Oil Corp Ltd .....	99.308	0,26
9.984	Indraprastha Gas Ltd .....	57.608	0,15
25.200	Infosys Ltd .....	410.241	1,07
75.616	ITC Ltd .....	416.257	1,09
17.280	Marico Ltd .....	111.839	0,29
1.328	Nestle India Ltd .....	370.612	0,97
103.568	Oil & Natural Gas Corp Ltd .....	202.373	0,53
208	Page Industries Ltd .....	95.453	0,25
28.368	Petronet LNG Ltd .....	77.009	0,20
9.920	Tata Consultancy Services Ltd .....	399.315	1,04
960	Tata Elxsi Ltd .....	88.802	0,23
174.000	Tata Steel Ltd .....	237.554	0,62
26.656	Vedanta Ltd .....	90.314	0,24
		<u>4.004.640</u>	<u>10,47</u>
	<b>Indonesien: 3,09 % (30. Juni 2022: 2,67 %)</b>		
760.000	Adaro Energy Indonesia Tbk PT .....	113.043	0,30
600.000	Astra International Tbk PT .....	271.136	0,71
134.400	Indofood Sukses Makmur Tbk PT .....	65.889	0,17
483.200	Kalbe Farma Tbk PT .....	66.070	0,17
408.000	Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT .....	70.211	0,18
1.440.000	Telkom Indonesia Persero Tbk PT .....	384.192	1,01
345.600	Unilever Indonesia Tbk PT .....	98.200	0,26
72.000	United Tractors Tbk PT .....	111.776	0,29
		<u>1.180.517</u>	<u>3,09</u>
	<b>Jersey: null (30. Juni 2022: 0,00 %)</b>		
13.552	Polymetal International Plc .....	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	<b>Kuwait: 0,27 % (30. Juni 2022: 0,36 %)</b>		
60.496	Mobile Telecommunications Co KSCP .....	101.958	0,27
		<u>101.958</u>	<u>0,27</u>
	<b>Malaysia: 0,72 % (30. Juni 2022: 1,97 %)</b>		
2.720	Nestle Malaysia Bhd .....	76.340	0,20
78.400	Petronas Chemicals Group Bhd .....	100.782	0,26
27.200	Petronas Gas Bhd .....	97.320	0,26
		<u>274.442</u>	<u>0,72</u>
	<b>Mexiko: 2,51 % (30. Juni 2022: 2,44 %)</b>		
14.592	Arca Continental SAB de CV .....	149.693	0,39
19.168	Banco del Bajío SA .....	58.139	0,15

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Mexiko: 2,51 % (30. Juni 2022: 2,44 %) (Fortsetzung)</b>		
15.072	Coca-Cola Femsa SAB de CV .....	125.740	0,33
72.368	Fibra Uno Administracion SA de CV .....	105.490	0,28
51.760	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV .....	114.895	0,30
3.024	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV .....	30.236	0,08
95.088	Wal-Mart de Mexico SAB de CV .....	375.462	0,98
		<u>959.655</u>	<u>2,51</u>
	<b>Philippinen: 0,43 % (30. Juni 2022: 0,64 %)</b>		
30.080	International Container Terminal Services Inc .....	111.057	0,29
8.480	Manila Electric Co .....	51.464	0,14
		<u>162.521</u>	<u>0,43</u>
	<b>Polen: 0,93 % (30. Juni 2022: 1,03 %)</b>		
22.448	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA .....	355.868	0,93
		<u>355.868</u>	<u>0,93</u>
	<b>Katar: 1,17 % (30. Juni 2022: 1,34 %)</b>		
31.984	Dukhan Bank .....	34.356	0,09
61.568	Industries Qatar QSC .....	189.947	0,50
125.696	Mesaieed Petrochemical Holding Co .....	65.611	0,17
14.000	Qatar Electricity & Water Co QSC .....	66.923	0,17
19.472	Qatar Fuel QSC .....	90.834	0,24
		<u>447.671</u>	<u>1,17</u>
	<b>Russland: 0,00 % (30. Juni 2022: 0,00 %)</b>		
102.144	Alrosa PJSC .....	-	0,00
83.636	Gazprom PJSC .....	-	0,00
1.511.510	Inter RAO UES PJSC .....	-	0,00
4.242	Lukoil OAO .....	-	0,00
1.302	MMC Norilsk Nickel PJSC .....	-	0,00
39.606	Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC .....	-	0,00
65.240	Novolipetsk Steel PJSC .....	-	0,00
39	Phosagro PJSC GDR .....	-	0,00
1.998	PhosAgro PJSC GDR Reg S .....	-	0,00
1	PhosAgro PJSC GDR Reg S .....	-	0,00
1.428	Polyus PJSC .....	-	0,00
37.254	Rosneft Oil Co PJSC .....	-	0,00
11.452	Severstal PAO .....	-	0,00
246.834	Surgutneftegas PJSC .....	-	0,00
303.786	Surgutneftegas PJSC (preferred stock) .....	-	0,00
55.916	Tatneft PJSC .....	-	0,00
44.856	United Co RUSAL International PJSC .....	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	<b>Saudi-Arabien: 4,55 % (30. Juni 2022: 5,35 %)</b>		
2.688	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co .....	205.110	0,54
400	Elm Co .....	62.069	0,16
25.120	Jarir Marketing Co .....	110.775	0,29
1.312	Mouwasat Medical Services Co .....	84.652	0,22
1.056	Nahdi Medical Co .....	47.863	0,12
10.800	SABIC Agri-Nutrients Co .....	373.178	0,98
10.288	Sahara International Petrochemical Co .....	101.078	0,26
44.035	Saudi Arabian Oil Co .....	378.630	0,99
32.512	Saudi Telecom Co .....	377.069	0,99
		<u>1.740.424</u>	<u>4,55</u>
	<b>Südafrika: 4,54 % (30. Juni 2022: 6,08 %)</b>		
5.488	African Rainbow Minerals Ltd .....	57.813	0,15
2.704	Anglo American Platinum Ltd .....	121.844	0,32
13.424	AngloGold Ashanti Ltd .....	282.660	0,74



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südafrika: 4,54 % (30. Juni 2022: 6,08 %) (Fortsetzung)</b>		
7.616	Clicks Group Ltd .....	105.339	0,27
12.928	Exxaro Resources Ltd .....	112.416	0,29
25.584	Gold Fields Ltd .....	354.333	0,93
15.376	Harmony Gold Mining Co Ltd .....	64.503	0,17
36.112	Impala Platinum Holdings Ltd .....	239.558	0,63
3.296	Kumba Iron Ore Ltd .....	77.211	0,20
8.624	Mr Price Group Ltd .....	65.829	0,17
10.000	Sasol Ltd .....	123.475	0,32
21.472	Vodacom Group Ltd .....	133.211	0,35
		<b>1.738.192</b>	<b>4,54</b>
	<b>Südkorea: 9,13 % (30. Juni 2022: 8,02 %)</b>		
1.424	DB Insurance Co Ltd .....	80.621	0,21
512	F&F Co Ltd / New .....	46.473	0,12
10.800	Hana Financial Group Inc .....	321.299	0,84
10.160	HMM Co Ltd .....	145.347	0,38
368	Hyundai Motor Co (preferred stock) .....	30.386	0,08
592	Hyundai Motor Co (second preferred stock) .....	49.287	0,13
10.672	Industrial Bank of Korea .....	83.746	0,22
10.352	KB Financial Group Inc .....	375.144	0,98
5.760	Kia Corp .....	386.871	1,01
3.872	KT&G Corp .....	243.313	0,64
736	Kumho Petrochemical Co Ltd .....	74.122	0,19
384	LG Innotek Co Ltd .....	90.197	0,24
1.776	Meritz Financial Group Inc .....	55.936	0,15
5.600	NH Investment & Securities Co Ltd .....	40.587	0,11
432	Orion Corp .....	39.343	0,10
7.328	Pan Ocean Co Ltd .....	28.808	0,07
1.408	POSCO Holdings Inc .....	414.605	1,08
6.496	Samsung Electronics Co Ltd .....	355.945	0,93
1.184	Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock) .....	53.465	0,14
1.088	Samsung Securities Co Ltd .....	29.726	0,08
14.496	Shinhan Financial Group Co Ltd .....	374.048	0,98
19.344	Woori Financial Group Inc .....	173.085	0,45
		<b>3.492.354</b>	<b>9,13</b>
	<b>Taiwan: 13,14 % (30. Juni 2022: 13,05 %)</b>		
8.320	Accton Technology Corp .....	93.233	0,24
48.000	ASE Technology Holding Co Ltd .....	170.303	0,45
22.400	Asustek Computer Inc .....	226.197	0,59
92.320	Chunghwa Telecom Co Ltd .....	345.335	0,90
3.200	Eclat Textile Co Ltd .....	51.322	0,13
2.008	eMemory Technology Inc .....	142.487	0,37
45.760	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd .....	137.378	0,36
40.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd .....	100.949	0,26
7.520	Feng TAY Enterprise Co Ltd .....	47.446	0,12
96.000	Formosa Plastics Corp .....	264.162	0,69
3.200	Largan Precision Co Ltd .....	218.851	0,57
66.800	Lite-On Technology Corp .....	221.991	0,58
16.960	MediaTek Inc .....	374.656	0,98
25.000	Micro-Star International Co Ltd .....	141.678	0,37
109.120	Nan Ya Plastics Corp .....	254.016	0,66
5.760	Nan Ya Printed Circuit Board Corp .....	48.825	0,13
6.080	Nien Made Enterprise Co Ltd .....	66.863	0,18
27.840	Novatek Microelectronics Corp .....	381.247	1,00
13.984	Realtek Semiconductor Corp .....	173.989	0,46
50.880	Taiwan Mobile Co Ltd .....	156.179	0,41
22.400	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	414.275	1,08

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,92 % (30. Juni 2022: 98,94 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Taiwan: 13,14 % (30. Juni 2022: 13,05 %) (Fortsetzung)</b>		
240.000	United Microelectronics Corp .....	373.742	0,98
32.000	Vanguard International Semiconductor Corp .....	90.417	0,24
1.280	Voltronic Power Technology Corp .....	80.759	0,21
32.000	Wan Hai Lines Ltd .....	60.621	0,16
48.000	Wistron Corp .....	139.941	0,37
1.600	Wiyynn Corp .....	72.950	0,19
87.584	Yang Ming Marine Transport Corp .....	177.168	0,46
		<u>5.026.980</u>	<u>13,14</u>
	<b>Thailand: 2,17 % (30. Juni 2022: 1,88 %)</b>		
41.600	Advanced Info Service PCL .....	251.090	0,66
161.600	Banpu PCL NVDR .....	40.337	0,10
20.800	Bumrungrad Hospital PCL .....	132.585	0,35
44.800	Intouch Holdings PCL .....	93.504	0,24
99.200	Krung Thai Bank PCL .....	54.280	0,14
134.400	Land & Houses PCL .....	32.032	0,08
44.800	Osotspa PCL .....	37.591	0,10
44.800	PTT Exploration & Production PCL .....	189.536	0,50
		<u>830.955</u>	<u>2,17</u>
	<b>Türkei: 3,07 % (30. Juni 2022: 1,25 %)</b>		
99.152	Akbank TAS .....	76.827	0,20
25.936	Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS .....	54.170	0,14
19.168	BIM Birlesik Magazalar AS .....	125.360	0,33
50.736	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS .....	71.462	0,19
3.200	Ford Otomotiv Sanayi AS .....	93.410	0,24
37.776	Haci Omer Sabanci Holding AS .....	66.684	0,18
22.416	KOC Holding AS .....	89.165	0,23
17.472	Koza Altin Isletmeleri AS .....	16.621	0,04
832	Pegasus Hava Tasimaciligi AS .....	19.691	0,05
25.136	Sasa Polyester Sanayi AS .....	54.910	0,14
3.104	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS .....	30.064	0,08
10.720	Turk Hava Yollari AO .....	79.650	0,21
52.688	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS .....	73.363	0,19
155.024	Turkiye Is Bankasi AS .....	83.607	0,22
34.560	Turkiye Petrol Rafinerileri AS .....	105.125	0,28
50.048	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS .....	85.352	0,22
97.280	Yapi ve Kredi Bankasi AS .....	48.435	0,13
		<u>1.173.896</u>	<u>3,07</u>
	<b>Vereinigte Arabische Emirate: 1,75 % (30. Juni 2022: 1,74 %)</b>		
119.760	Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC .....	127.160	0,33
108.976	Aldar Properties PJSC .....	151.016	0,40
49.504	Americana Restaurants International Plc .....	57.010	0,15
156.016	Emaar Properties PJSC .....	272.270	0,71
70.992	Multiply Group PJSC .....	61.076	0,16
		<u>668.532</u>	<u>1,75</u>
	<b>Vereinigte Staaten: 0,41 % (30. Juni 2022: 0,21 %)</b>		
2.192	Southern Copper Corp .....	157.254	0,41
		<u>157.254</u>	<u>0,41</u>
	<b>Aktien insgesamt</b> .....	<u>37.832.830</u>	<u>98,92</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<u>37.832.830</u>	<u>98,92</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2022: (0,01) %)

Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2022: (0,01) %)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnitt- licher An- schaffungskurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
252.955	1.012	4 of MSCI Emgmkt Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	(3.480)	(0,01)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures) .....</b>	<b>(3.480)</b>	<b>(0,01)</b>

Devisenterminkontrakte: (0,00) % (30. Juni 2022: null)

Abrechnungs- datum	Betrag gekauft	Betrag verkauft	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
03.07.2023	8.000 SAR	2.134 USD	State Street	(1)	(0,00)
03.07.2023	11.700 SAR	3.120 USD	State Street	(1)	(0,00)
			<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisenterminkontrakten .....</b>	<b>(2)</b>	<b>(0,00)</b>
			<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt .....</b>	<b>(3.482)</b>	<b>(0,01)</b>

	Zeitwert USD	Vermögensw erte
<b>Anlageportfolio</b>	37.829.348	98,91
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	415.879	1,09
<b>Nettovermögen</b>	<b>38.245.227</b>	<b>100,00</b>

### Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamt- vermögens
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....	98,56
Sonstiges Umlaufvermögen .....	1,44
<b>Gesamtvermögen .....</b>	<b>100,00</b>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 12.444 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin European Dividend UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,93 % (30. Juni 2022: 99,52 %)</b>		
	<b>Aktien: 98,93 % (30. Juni 2022: 99,52 %)</b>		
	<b>Belgien: 0,42 % (30. Juni 2022: 1,11 %)</b>		
28.576	Proximus SADP .....	195.003	0,42
		<u>195.003</u>	<u>0,42</u>
	<b>Dänemark: 5,98 % (30. Juni 2022: 3,58 %)</b>		
470	AP Moller - Maersk A/S .....	755.884	1,63
434	AP Moller - Maersk A/S .....	692.450	1,49
11.020	Scandinavian Tobacco Group A/S .....	167.981	0,36
58.748	Tryg A/S .....	1.164.953	2,50
		<u>2.781.268</u>	<u>5,98</u>
	<b>Finnland: 8,03 % (30. Juni 2022: 9,41 %)</b>		
25.802	Elisa OYJ .....	1.262.750	2,71
55.290	Kesko OYJ .....	953.753	2,05
24.320	Nokian Renkaat OYJ .....	194.122	0,42
48.678	UPM-Kymmene OYJ .....	1.327.449	2,85
		<u>3.738.074</u>	<u>8,03</u>
	<b>Frankreich: 9,98 % (30. Juni 2022: 10,66 %)</b>		
13.110	Gaztransport Et Technigaz SA .....	1.222.508	2,63
5.472	Nexity SA .....	101.232	0,22
13.452	Rubis SCA .....	299.172	0,64
14.060	Sanofi .....	1.380.692	2,97
5.776	Societe BIC SA .....	303.240	0,65
25.460	TotalEnergies SE .....	1.337.923	2,87
		<u>4.644.767</u>	<u>9,98</u>
	<b>Deutschland: 7,21 % (30. Juni 2022: 7,22 %)</b>		
6.726	Allianz SE .....	1.433.983	3,08
21.926	Freenet AG .....	503.859	1,08
7.296	Hannover Rueck SE .....	1.417.978	3,05
		<u>3.355.820</u>	<u>7,21</u>
	<b>Italien: 7,62 % (30. Juni 2022: 7,03 %)</b>		
75.202	Assicurazioni Generali SpA .....	1.400.261	3,01
40.508	Azimut Holding SpA .....	800.236	1,72
281.010	Snam SpA .....	1.345.195	2,89
		<u>3.545.692</u>	<u>7,62</u>
	<b>Luxemburg: 0,64 % (30. Juni 2022: 0,56 %)</b>		
10.450	APERAM SA .....	298.661	0,64
		<u>298.661</u>	<u>0,64</u>
	<b>Niederlande: 6,37 % (30. Juni 2022: 5,55 %)</b>		
15.352	BE Semiconductor Industries NV .....	1.524.454	3,28
439.736	Koninklijke KPN NV .....	1.437.497	3,09
		<u>2.961.951</u>	<u>6,37</u>
	<b>Norwegen: 5,19 % (30. Juni 2022: 5,05 %)</b>		
15.998	Atea ASA .....	213.517	0,46
32.186	Europris ASA .....	197.161	0,42
141.664	Telenor ASA .....	1.318.651	2,84
21.090	Yara International ASA .....	683.845	1,47
		<u>2.413.174</u>	<u>5,19</u>
	<b>Spanien: 12,09 % (30. Juni 2022: 15,47 %)</b>		
169.860	Bankinter SA .....	956.312	2,06
14.668	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA .....	362.006	0,78
69.464	Endesa SA .....	1.364.968	2,93
91.314	Faes Farma SA .....	290.379	0,62

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin European Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 98,93 % (30. Juni 2022: 99,52 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 98,93 % (30. Juni 2022: 99,52 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Spanien: 12,09 % (30. Juni 2022: 15,47 %) (Fortsetzung)</b>		
122.892	Iberdrola SA .....	1.468.559	3,16
76.912	Red Electrica Corp SA .....	1.183.291	2,54
		<u>5.625.515</u>	<u>12,09</u>
	<b>Schweden: 2,80 % (30. Juni 2022: 3,51 %)</b>		
29.488	Axfood AB .....	571.032	1,23
96.710	Tele2 AB .....	731.384	1,57
		<u>1.302.416</u>	<u>2,80</u>
	<b>Schweiz: 9,36 % (30. Juni 2022: 8,48 %)</b>		
6.992	Cembra Money Bank AG .....	531.529	1,14
13.186	Swiss Prime Site AG .....	1.049.002	2,25
2.382	Swisscom AG .....	1.361.264	2,93
3.252	Zurich Insurance Group AG .....	1.415.661	3,04
		<u>4.357.456</u>	<u>9,36</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 23,24 % (30. Juni 2022: 21,89 %)</b>		
52.592	Admiral Group Plc .....	1.275.971	2,74
52.744	Anglo American Plc .....	1.372.468	2,95
112.100	Ashmore Group Plc .....	271.712	0,58
125.780	BAE Systems Plc .....	1.358.726	2,92
87.058	GSK Plc .....	1.408.928	3,03
149.644	IG Group Holdings Plc .....	1.180.561	2,54
69.350	Imperial Tobacco Group Plc .....	1.404.953	3,02
156.142	Moneysupermarket.com Group Plc .....	492.730	1,06
25.042	Rio Tinto Plc .....	1.454.850	3,13
69.958	Tate & Lyle Plc .....	591.854	1,27
		<u>10.812.753</u>	<u>23,24</u>
	<b>Aktien insgesamt</b> .....	<u>46.032.550</u>	<u>98,93</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<u>46.032.550</u>	<u>98,93</u>

Derivative Finanzinstrumente: 0,00 % (30. Juni 2022: (0,01) %)

Terminkontrakte (Futures): 0,00 % (30. Juni 2022: (0,01) %)\*

Nominal- betrag EUR	Durchschnitt- licher An- schaffungskurs EUR		Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
507.980	462	22 of Stoxx Europe 600 Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	2.200	0,00
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures)</b> .....	2.200	0,00
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt</b> .....	<u>2.200</u>	<u>0,00</u>
			<u>Zeitwert EUR</u>	<u>% des Netto- vermögens</u>
		<b>Anlageportfolio</b>	46.034.750	98,93
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	496.279	1,07
		<b>Nettovermögen</b>	<u>46.531.029</u>	<u>100,00</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin European Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....	98,91
Börsengehandelte derivative Instrumente.....	0,00
Sonstiges Umlaufvermögen .....	1,09
Gesamtvermögen.....	100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 26.264 EUR.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,49 % (30. Juni 2022: 99,56 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,49 % (30. Juni 2022: 99,56 %)</b>		
	<b>Österreich: 1,10 % (30. Juni 2022: 0,50 %)</b>		
516	Erste Group Bank AG .....	16.558	0,33
546	OMV AG .....	21.207	0,42
111	Verbund AG .....	8.153	0,16
282	voestalpine AG .....	9.278	0,19
		<u>55.196</u>	<u>1,10</u>
	<b>Belgien: 0,14 % (30. Juni 2022: 0,31 %)</b>		
273	Warehouses De Pauw CVA .....	6.858	0,14
		<u>6.858</u>	<u>0,14</u>
	<b>Dänemark: 4,70 % (30. Juni 2022: 6,64 %)</b>		
26	AP Moller - Maersk A/S .....	41.815	0,83
14	AP Moller - Maersk A/S .....	22.337	0,44
408	Coloplast A/S .....	46.751	0,93
648	Novo Nordisk A/S .....	95.678	1,90
366	Pandora A/S .....	29.945	0,60
		<u>236.526</u>	<u>4,70</u>
	<b>Finnland: 0,80 % (30. Juni 2022: 2,16 %)</b>		
489	Elisa OYJ .....	23.931	0,47
435	Orion OYJ .....	16.539	0,33
		<u>40.470</u>	<u>0,80</u>
	<b>Frankreich: 10,67 % (30. Juni 2022: 8,56 %)</b>		
1.665	BNP Paribas SA .....	96.104	1,91
39	Dassault Aviation SA .....	7.153	0,14
50	Hermes International .....	99.500	1,98
132	Ipsen SA .....	14.546	0,29
744	Klepierre SA .....	16.904	0,34
300	La Francaise des Jeux SAEM .....	10.812	0,21
5.340	Orange SA .....	57.149	1,14
981	Sanofi .....	96.334	1,91
1.908	Societe Generale SA .....	45.410	0,90
1.776	TotalEnergies SE .....	93.329	1,85
		<u>537.241</u>	<u>10,67</u>
	<b>Deutschland: 9,79 % (30. Juni 2022: 6,54 %)</b>		
819	Bayerische Motoren Werke AG .....	92.154	1,83
153	Bayerische Motoren Werke AG (preferred stock) .....	15.943	0,32
2.487	Commerzbank AG .....	25.243	0,50
3.090	Deutsche Bank AG .....	29.720	0,59
2.361	Deutsche Post AG .....	105.607	2,10
228	HeidelbergCement AG .....	17.146	0,34
1.404	Mercedes-Benz Group AG .....	103.433	2,05
582	Porsche Automobil Holding SE .....	32.103	0,64
15	Rational AG .....	9.945	0,20
468	Volkswagen AG .....	57.536	1,14
30	Wacker Chemie AG .....	3.772	0,08
		<u>492.602</u>	<u>9,79</u>
	<b>Irland: 0,22 % (30. Juni 2022: null)</b>		
2.850	AIB Group Plc .....	10.972	0,22
		<u>10.972</u>	<u>0,22</u>
	<b>Italien: 5,91 % (30. Juni 2022: 3,02 %)</b>		
3.090	Assicurazioni Generali SpA .....	57.536	1,14
5.970	Eni SpA .....	78.697	1,56
627	Moncler SpA .....	39.714	0,79

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,49 % (30. Juni 2022: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,49 % (30. Juni 2022: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Italien: 5,91 % (30. Juni 2022: 3,02 %) (Fortsetzung)</b>		
318	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA .....	13.912	0,28
5.061	UniCredit SpA .....	107.622	2,14
		<u>297.481</u>	<u>5,91</u>
	<b>Jersey: 2,05 % (30. Juni 2022: 1,68 %)</b>		
19.929	Glencore Plc .....	103.228	2,05
		<u>103.228</u>	<u>2,05</u>
	<b>Luxemburg: 1,08 % (30. Juni 2022: 0,59 %)</b>		
1.503	ArcelorMittal SA .....	37.470	0,74
1.236	Tenaris SA .....	16.952	0,34
		<u>54.422</u>	<u>1,08</u>
	<b>Niederlande: 13,11 % (30. Juni 2022: 11,22 %)</b>		
1.044	ABN AMRO Bank NV .....	14.856	0,30
155	ASML Holding NV .....	102.765	2,04
363	Ferrari NV .....	108.719	2,16
3.156	Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	98.656	1,96
9.810	Koninklijke KPN NV .....	32.069	0,64
792	NN Group NV .....	26.857	0,53
372	OCI NV .....	8.173	0,16
342	Randstad NV .....	16.522	0,33
6.480	Stellantis NV .....	104.263	2,07
1.170	STMicroelectronics NV .....	53.311	1,06
807	Wolters Kluwer NV .....	93.854	1,86
		<u>660.045</u>	<u>13,11</u>
	<b>Norwegen: 4,29 % (30. Juni 2022: 3,95 %)</b>		
1.035	Aker BP ASA .....	22.297	0,44
3.885	Equinor ASA .....	103.735	2,06
4.128	Norsk Hydro ASA .....	22.532	0,45
2.361	Orkla ASA .....	15.574	0,31
147	Salmor ASA .....	5.444	0,11
2.610	Telenor ASA .....	24.295	0,48
678	Yara International ASA .....	21.984	0,44
		<u>215.861</u>	<u>4,29</u>
	<b>Portugal: 0,46 % (30. Juni 2022: 0,42 %)</b>		
921	Jeronimo Martins SGPS SA .....	23.246	0,46
		<u>23.246</u>	<u>0,46</u>
	<b>Spanien: 8,39 % (30. Juni 2022: 8,80 %)</b>		
9.708	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA .....	68.267	1,36
31.233	Banco Santander SA .....	105.724	2,10
729	Enagas SA .....	13.122	0,26
1.095	Endesa SA .....	21.517	0,43
3.186	Industria de Diseno Textil SA .....	112.976	2,24
417	Naturgy Energy Group SA .....	11.367	0,23
1.290	Red Electrica Corp SA .....	19.847	0,39
5.229	Repsol SA .....	69.702	1,38
		<u>422.522</u>	<u>8,39</u>
	<b>Schweden: 3,04 % (30. Juni 2022: 6,05 %)</b>		
4.755	Atlas Copco AB 'A' Shares .....	62.705	1,25
2.847	Atlas Copco AB 'B' Shares .....	32.434	0,64
993	Boliden AB .....	26.253	0,52
1.299	Swedbank AB .....	20.046	0,40
1.551	Tele2 AB .....	11.729	0,23
		<u>153.167</u>	<u>3,04</u>



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,49 % (30. Juni 2022: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,49 % (30. Juni 2022: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweiz: 9,17 % (30. Juni 2022: 16,33 %)</b>		
24	EMS-Chemie Holding AG .....	16.646	0,33
120	Geberit AG .....	57.550	1,14
222	Kuehne & Nagel International AG .....	60.204	1,19
1.071	Novartis AG .....	98.754	1,96
78	Partners Group Holding AG .....	67.255	1,34
324	Roche Holding AG (non-voting rights) .....	90.787	1,80
13	Roche Holding AG (voting rights) .....	3.910	0,08
89	Swisscom AG .....	50.862	1,01
42	VAT Group AG .....	15.921	0,32
		<b>461.889</b>	<b>9,17</b>
	<b>Vereinigtes Königreich: 24,57 % (30. Juni 2022: 22,79 %)</b>		
3.690	Anglo American Plc .....	96.019	1,91
3.450	Auto Trader Group Plc .....	24.540	0,49
8.106	BAE Systems Plc .....	87.566	1,74
23.646	Barclays Plc .....	42.264	0,84
3.249	Barratt Developments Plc .....	15.655	0,31
3.255	British American Tobacco Plc .....	98.926	1,96
2.040	British Land Co PLC .....	7.198	0,14
624	Burberry Group Plc .....	15.416	0,31
9.432	Centrica Plc .....	13.623	0,27
6.069	GSK Plc .....	98.219	1,95
1.293	Hargreaves Lansdown Plc .....	12.289	0,24
495	Hikma Pharmaceuticals Plc .....	10.905	0,22
14.199	HSBC Holdings Plc .....	102.870	2,04
3.732	Imperial Tobacco Group Plc .....	75.606	1,50
1.680	Land Securities Group Plc .....	11.241	0,22
750	Mondi Plc .....	10.479	0,21
465	Next Plc .....	37.389	0,74
1.146	Persimmon Plc .....	13.695	0,27
3.456	RELX Plc .....	105.556	2,10
1.755	Rio Tinto Plc .....	101.962	2,02
3.591	Shell Plc .....	98.025	1,95
6.114	Standard Chartered Plc .....	48.662	0,97
9.975	Taylor Wimpey Plc .....	11.944	0,24
2.031	Unilever Plc .....	96.979	1,93
		<b>1.237.028</b>	<b>24,57</b>
	<b>Aktien insgesamt.....</b>	<b>5.008.754</b>	<b>99,49</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt .....</b>	<b>5.008.754</b>	<b>99,49</b>

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) % (30. Juni 2022: (0,01) %)

Terminkontrakte (Futures): (0,00) % (30. Juni 2022: (0,01) %)\*

Nominal- betrag EUR	Durchschnitt- licher An- schaffungskurs EUR	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens	
23.292	466	2 of Stoxx Europe 600 Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	(102)	(0,00)
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures).....</b>	<b>(102)</b>	<b>(0,00)</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt .....</b>	<b>(102)</b>	<b>(0,00)</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Anlageportfolio</b>	5.008.652	99,49
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>25.425</u>	<u>0,51</u>
<b>Nettovermögen</b>	<u>5.034.077</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind.....	99,36
Sonstiges Umlaufvermögen .....	<u>0,64</u>
Gesamtvermögen.....	<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 2.007 EUR.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Dividend UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,97 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,97 %)</b>		
	<b>Australien: 6,64 % (30. Juni 2022: 6,64 %)</b>		
4.656	ASX Ltd .....	195.254	0,41
13.904	Commonwealth Bank of Australia .....	928.019	1,95
7.856	Macquarie Group Ltd .....	928.836	1,95
10.896	Rio Tinto Ltd .....	831.838	1,75
11.616	Sonic Healthcare Ltd .....	275.034	0,58
		<u>3.158.981</u>	<u>6,64</u>
	<b>Belgien: null (30. Juni 2022: 0,10 %)</b>		
	<b>Kanada: 5,46 % (30. Juni 2022: 7,65 %)</b>		
18.752	Bank of Nova Scotia .....	939.265	1,97
1.824	IGM Financial Inc .....	55.592	0,12
2.800	Imperial Oil Ltd .....	143.423	0,30
9.792	Royal Bank of Canada .....	936.243	1,97
10.048	Sun Life Financial Inc .....	524.402	1,10
		<u>2.598.925</u>	<u>5,46</u>
	<b>Kaimaninseln: 1,00 % (30. Juni 2022: 1,43 %)</b>		
35.360	Chailease Holding Co Ltd .....	231.612	0,49
32.000	China Medical System Holdings Ltd .....	52.104	0,11
40.000	Longfor Group Holdings Ltd .....	97.185	0,20
51.000	SITC International Holdings Co Ltd .....	93.063	0,20
		<u>473.964</u>	<u>1,00</u>
	<b>China: 0,24 % (30. Juni 2022: 0,35 %)</b>		
8.000	Bank of Nanjing Co Ltd .....	8.797	0,02
22.400	China Merchants Bank Co Ltd .....	100.872	0,21
4.800	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd .....	5.688	0,01
		<u>115.357</u>	<u>0,24</u>
	<b>Dänemark: 0,43 % (30. Juni 2022: null)</b>		
116	AP Moller - Maersk A/S .....	203.535	0,43
		<u>203.535</u>	<u>0,43</u>
	<b>Finnland: 1,17 % (30. Juni 2022: 1,46 %)</b>		
3.232	Elisa OYJ .....	172.568	0,36
7.328	Kone OYJ .....	382.394	0,81
		<u>554.962</u>	<u>1,17</u>
	<b>Deutschland: 2,70 % (30. Juni 2022: 2,61 %)</b>		
4.032	Allianz SE .....	937.848	1,97
1.248	Hannover Rueck SE .....	264.621	0,56
1.424	LEG Immobilien SE .....	81.781	0,17
		<u>1.284.250</u>	<u>2,70</u>
	<b>Griechenland: 0,17 % (30. Juni 2022: 0,12 %)</b>		
4.720	Hellenic Telecommunications Organization SA .....	80.899	0,17
		<u>80.899</u>	<u>0,17</u>
	<b>Hongkong: null (30. Juni 2022: 0,20 %)</b>		
	<b>Indien: 0,78 % (30. Juni 2022: 0,30 %)</b>		
67.792	ITC Ltd .....	373.187	0,78
		<u>373.187</u>	<u>0,78</u>
	<b>Irland: 2,84 % (30. Juni 2022: 3,07 %)</b>		
5.296	Eaton Corp Plc .....	1.065.025	2,24
4.640	Seagate Technology Holdings Plc .....	287.077	0,60
		<u>1.352.102</u>	<u>2,84</u>
	<b>Japan: 9,02 % (30. Juni 2022: 8,76 %)</b>		
2.453	Daito Trust Construction Co Ltd .....	247.532	0,52
13.600	Daiwa House Industry Co Ltd .....	356.808	0,75

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,97 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,97 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Japan: 9,02 % (30. Juni 2022: 8,76 %) (Fortsetzung)</b>		
10.400	Hulic Co Ltd .....	88.576	0,19
28.800	KDDI Corp .....	886.706	1,86
567.500	Nippon Telegraph & Telephone Corp .....	669.448	1,41
30.400	ORIX Corp .....	549.486	1,16
10.000	Sekisui House Ltd .....	201.024	0,42
6.930	Sompo Holdings Inc .....	309.689	0,65
40.500	Tokio Marine Holdings Inc .....	928.893	1,95
3.200	USS Co Ltd .....	52.649	0,11
		<u>4.290.811</u>	<u>9,02</u>
	<b>Jersey: 0,00 % (30. Juni 2022: 0,00 %)</b>		
19.136	Polymetal International Plc .....	-	0,00
		-	0,00
	<b>Malaysia: 0,12 % (30. Juni 2022: 0,14 %)</b>		
16.000	Petronas Gas Bhd .....	57.247	0,12
		<u>57.247</u>	<u>0,12</u>
	<b>Niederlande: 1,11 % (30. Juni 2022: 1,22 %)</b>		
5.776	LyondellBasell Industries NV .....	530.410	1,11
		<u>530.410</u>	<u>1,11</u>
	<b>Neuseeland: 0,35 % (30. Juni 2022: 0,37 %)</b>		
53.968	Spark New Zealand Ltd .....	168.293	0,35
		<u>168.293</u>	<u>0,35</u>
	<b>Norwegen: 0,21 % (30. Juni 2022: 0,27 %)</b>		
13.968	Orkla ASA .....	100.521	0,21
		<u>100.521</u>	<u>0,21</u>
	<b>Philippinen: null (30. Juni 2022: 0,04 %)</b>		
	<b>Katar: 0,49 % (30. Juni 2022: 0,61 %)</b>		
19.024	Qatar International Islamic Bank QSC .....	52.264	0,11
37.504	Qatar Islamic Bank SAQ .....	182.471	0,38
		<u>234.735</u>	<u>0,49</u>
	<b>Russland: 0,00 % (30. Juni 2022: 0,00 %)</b>		
61.664	Tatneft PJSC .....	-	0,00
		-	0,00
	<b>Saudi-Arabien: 2,72 % (30. Juni 2022: 2,49 %)</b>		
46.224	Al Rajhi Bank .....	899.659	1,89
33.920	Saudi Telecom Co .....	393.399	0,83
		<u>1.293.058</u>	<u>2,72</u>
	<b>Singapur: 0,15 % (30. Juni 2022: 0,17 %)</b>		
6.400	Venture Corp Ltd .....	69.564	0,15
		<u>69.564</u>	<u>0,15</u>
	<b>Südafrika: 0,15 % (30. Juni 2022: 0,31 %)</b>		
2.576	African Rainbow Minerals Ltd .....	27.137	0,06
5.872	Mr Price Group Ltd .....	44.822	0,09
		<u>71.959</u>	<u>0,15</u>
	<b>Spanien: 0,25 % (30. Juni 2022: 0,32 %)</b>		
7.008	Red Electrica Corp SA .....	117.629	0,25
		<u>117.629</u>	<u>0,25</u>
	<b>Schweiz: 9,99 % (30. Juni 2022: 9,03 %)</b>		
224	EMS-Chemie Holding AG .....	169.505	0,36
4.272	Garmin Ltd .....	445.527	0,94
9.200	Novartis AG .....	925.502	1,94

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,97 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,97 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweiz: 9,99 % (30. Juni 2022: 9,03 %) (Fortsetzung)</b>		
784	Partners Group Holding AG .....	737.511	1,55
2.768	Roche Holding AG (non-voting rights) .....	846.195	1,78
112	Roche Holding AG (voting rights) .....	36.755	0,08
3.750	SGS SA .....	354.440	0,74
496	Swisscom AG .....	309.248	0,65
1.952	Zurich Insurance Group AG .....	927.072	1,95
		<b>4.751.755</b>	<b>9,99</b>
	<b>Taiwan: 3,05 % (30. Juni 2022: 2,41 %)</b>		
4.120	Nien Made Enterprise Co Ltd .....	45.308	0,09
13.760	Novatek Microelectronics Corp .....	188.433	0,40
9.840	Realtek Semiconductor Corp .....	122.429	0,26
53.760	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	994.261	2,09
25.280	Vanguard International Semiconductor Corp .....	71.430	0,15
16.000	Wan Hai Lines Ltd .....	30.310	0,06
		<b>1.452.171</b>	<b>3,05</b>
	<b>Türkei: 0,14 % (30. Juni 2022: 0,17 %)</b>		
2.208	Ford Otomotiv Sanayi AS .....	64.453	0,14
		<b>64.453</b>	<b>0,14</b>
	<b>Vereinigte Arabische Emirate: 0,97 % (30. Juni 2022: 1,20 %)</b>		
49.984	Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC .....	53.072	0,11
66.784	Emirates Telecommunications Group Co PJSC .....	407.281	0,86
		<b>460.353</b>	<b>0,97</b>
	<b>Vereinigtes Königreich: 5,13 % (30. Juni 2022: 7,57 %)</b>		
111.264	Legal & General Group Plc .....	321.529	0,67
14.992	Rio Tinto Plc .....	950.241	2,00
16.240	Schroders Plc .....	90.288	0,19
12.640	St James's Place Plc .....	174.760	0,37
17.376	Unilever Plc .....	905.178	1,90
		<b>2.441.996</b>	<b>5,13</b>
	<b>Vereinigte Staaten: 44,60 % (30. Juni 2022: 40,96 %)</b>		
9.328	3M Co .....	933.640	1,96
4.128	Amgen Inc .....	916.499	1,93
1.344	Broadcom Inc .....	1.165.826	2,45
5.696	CF Industries Holdings Inc .....	395.416	0,83
18.800	Cisco Systems Inc .....	972.712	2,04
14.688	Coca-Cola Co .....	884.511	1,86
8.976	ConocoPhillips .....	930.003	1,95
2.832	Cummins Inc .....	694.293	1,46
11.200	Emerson Electric Co .....	1.012.368	2,13
8.240	Fidelity National Financial Inc .....	296.640	0,62
5.824	Johnson & Johnson .....	963.989	2,03
6.368	Kimberly-Clark Corp .....	879.166	1,85
2.032	Lockheed Martin Corp .....	935.492	1,97
8.000	Merck & Co Inc .....	923.120	1,94
4.768	NetApp Inc .....	364.275	0,77
6.640	Nucor Corp .....	1.088.827	2,29
2.192	Packaging Corp of America .....	289.695	0,61
8.544	Paychex Inc .....	955.817	2,01
25.104	Pfizer Inc .....	920.815	1,93
5.264	Principal Financial Group Inc .....	399.222	0,84
6.032	Procter & Gamble Co .....	915.296	1,92
8.720	QUALCOMM Inc .....	1.038.029	2,18
1.760	Southern Copper Corp .....	126.262	0,27
6.336	Synchrony Financial .....	214.917	0,45

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,97 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,97 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 44,60 % (30. Juni 2022: 40,96 %) (Fortsetzung)</b>		
7.872	T Rowe Price Group Inc .....	881.821	1,85
5.424	Texas Instruments Inc .....	976.429	2,05
5.408	United Parcel Service Inc .....	969.384	2,04
464	Watsco Inc .....	177.002	0,37
		<u>21.221.466</u>	<u>44,60</u>
	<b>Aktien insgesamt</b> .....	<u>47.522.583</u>	<u>99,88</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<u>47.522.583</u>	<u>99,88</u>
		<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlageportfolio</b>	47.522.583	99,88
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	56.203	0,12
	<b>Nettovermögen</b>	<u>47.578.786</u>	<u>100,00</u>
			<b>% des Gesamt- Vermögensw erte</b>
	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		99,77
	Sonstiges Umlaufvermögen .....		0,23
	<b>Gesamtvermögen</b> .....		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %)</b>		
	<b>Australien: 3,54 % (30. Juni 2022: 4,71 %)</b>		
19.864	Brambles Ltd .....	190.536	0,67
16.384	Coles Group Ltd .....	200.889	0,71
13.072	Dexus .....	67.871	0,24
3.504	IGO Ltd .....	35.453	0,13
39.792	Mirvac Group .....	59.862	0,21
9.832	Newcrest Mining Ltd .....	172.910	0,61
20.144	Pilbara Minerals Ltd .....	65.569	0,23
2.560	Sonic Healthcare Ltd .....	60.613	0,22
20.552	Stockland .....	55.132	0,20
10.120	Suncorp Group Ltd .....	90.874	0,32
		<b>999.709</b>	<b>3,54</b>
	<b>Österreich: 0,11 % (30. Juni 2022: null)</b>		
400	Verbund AG .....	32.054	0,11
		<b>32.054</b>	<b>0,11</b>
	<b>Bermuda: 0,27 % (30. Juni 2022: 0,22 %)</b>		
4.800	China Resources Gas Group Ltd .....	16.415	0,06
3.608	Invesco Ltd .....	60.651	0,21
		<b>77.066</b>	<b>0,27</b>
	<b>Brasilien: 0,61 % (30. Juni 2022: 0,46 %)</b>		
3.200	Banco Santander Brasil SA .....	20.318	0,07
20.800	Cia Energetica de Minas Gerais .....	55.449	0,20
4.000	Klabin SA .....	18.051	0,06
5.600	Telefonica Brasil SA .....	50.231	0,18
9.600	TIM SA .....	29.095	0,10
		<b>173.144</b>	<b>0,61</b>
	<b>Kanada: 9,21 % (30. Juni 2022: 7,35 %)</b>		
4.576	Agnico Eagle Mines Ltd .....	228.757	0,81
5.656	Bank of Nova Scotia .....	283.302	1,00
440	Canadian Apartment Properties REIT .....	16.912	0,06
2.336	Canadian National Railway Co .....	283.198	1,00
640	Canadian Tire Corp Ltd .....	87.600	0,31
1.648	Dollarama Inc .....	111.739	0,40
1.800	Gildan Activewear Inc .....	58.098	0,21
1.608	Intact Financial Corp .....	248.555	0,88
2.376	Metro Inc .....	134.345	0,48
4.496	Nutrien Ltd .....	265.734	0,94
1.504	Open Text Corp .....	62.626	0,22
5.416	Pembina Pipeline Corp .....	170.472	0,60
944	RB Global Inc .....	56.715	0,20
816	RioCan Real Estate Investment Trust .....	11.889	0,04
1.336	Saputo Inc .....	29.966	0,11
2.992	Sun Life Financial Inc .....	156.152	0,55
4.040	TELUS Corp .....	78.709	0,28
4.576	Toronto-Dominion Bank .....	283.949	1,00
392	West Fraser Timber Co Ltd .....	33.715	0,12
		<b>2.602.433</b>	<b>9,21</b>
	<b>Kaimaninseln: 1,11 % (30. Juni 2022: 0,47 %)</b>		
12.000	3SBio Inc .....	12.051	0,04
16.000	Bosideng International Holdings Ltd .....	6.738	0,02
8.000	China Conch Venture Holdings Ltd .....	10.413	0,04
24.000	China Feihe Ltd .....	13.353	0,05
8.000	China Lesso Group Holdings Ltd .....	5.247	0,02
10.000	NetEase Inc .....	194.727	0,69
2.032	Vipshop Holdings Ltd ADR .....	33.528	0,12

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Kaimaninseln: 1,11 % (30. Juni 2022: 0,47 %) (Fortsetzung)</b>		
32.000	Want Want China Holdings Ltd .....	21.234	0,07
7.200	Yadea Group Holdings Ltd .....	16.372	0,06
		<u>313.663</u>	<u>1,11</u>
	<b>Chile: 0,64 % (30. Juni 2022: 0,08 %)</b>		
2.096	Empresas Copec SA .....	15.547	0,05
225.376	Enel Americas SA .....	30.061	0,11
1.864	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA .....	135.705	0,48
		<u>181.313</u>	<u>0,64</u>
	<b>China: 0,22 % (30. Juni 2022: 0,07 %)</b>		
12.800	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd .....	16.726	0,06
4.800	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H' Shares .....	9.506	0,03
9.600	Sinopharm Group Co Ltd .....	30.013	0,11
1.600	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd .....	4.517	0,02
		<u>60.762</u>	<u>0,22</u>
	<b>Tschechische Republik: 0,04 % (30. Juni 2022: 0,03 %)</b>		
3.408	Moneta Money Bank AS .....	12.488	0,04
		<u>12.488</u>	<u>0,04</u>
	<b>Dänemark: 2,01 % (30. Juni 2022: 2,70 %)</b>		
1.456	Coloplast A/S .....	182.020	0,64
1.664	Novo Nordisk A/S .....	268.050	0,95
1.312	Pandora A/S .....	117.112	0,42
		<u>567.182</u>	<u>2,01</u>
	<b>Finnland: 1,11 % (30. Juni 2022: 1,09 %)</b>		
1.720	Elisa OYJ .....	91.837	0,32
1.448	Kesko OYJ .....	27.251	0,10
3.080	Stora Enso OYJ .....	35.703	0,13
5.336	UPM-Kymmene OYJ .....	158.754	0,56
		<u>313.545</u>	<u>1,11</u>
	<b>Frankreich: 3,00 % (30. Juni 2022: 1,80 %)</b>		
6.608	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA .....	195.084	0,69
7.696	Credit Agricole SA .....	91.285	0,32
128	Hermes International .....	277.900	0,99
608	L'Oreal SA .....	283.308	1,00
		<u>847.577</u>	<u>3,00</u>
	<b>Deutschland: 1,57 % (30. Juni 2022: 0,97 %)</b>		
5.976	Deutsche Post AG .....	291.631	1,03
576	Henkel AG & Co KGaA .....	40.533	0,14
920	Henkel AG & Co KGaA .....	73.533	0,26
456	LEG Immobilien SE .....	26.188	0,09
4.496	Telefonica Deutschland Holding AG .....	12.641	0,05
		<u>444.526</u>	<u>1,57</u>
	<b>Griechenland: 0,22 % (30. Juni 2022: 0,00 %)</b>		
1.248	Hellenic Telecommunications Organization SA .....	21.390	0,08
544	Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA .....	13.770	0,05
736	Mytilineos SA .....	25.968	0,09
		<u>61.128</u>	<u>0,22</u>
	<b>Hongkong: 1,39 % (30. Juni 2022: 0,92 %)</b>		
48.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd .....	146.696	0,52
40.000	China Everbright Environment Group Ltd .....	15.772	0,06
88.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd .....	76.472	0,27
4.000	Hang Seng Bank Ltd .....	56.913	0,20
26.000	Sino Land Co Ltd .....	31.950	0,11



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Hongkong: 1,39 % (30. Juni 2022: 0,92 %) (Fortsetzung)</b>		
4.000	Swire Pacific Ltd .....	30.651	0,11
14.400	Swire Properties Ltd .....	35.391	0,12
		<u>393.845</u>	<u>1,39</u>
	<b>Ungarn: 0,08 % (30. Juni 2022: null)</b>		
960	Richter Gedeon Nyrt .....	23.643	0,08
		<u>23.643</u>	<u>0,08</u>
	<b>Indien: 1,54 % (30. Juni 2022: 1,67 %)</b>		
760	Britannia Industries Ltd .....	46.548	0,16
5.992	Dabur India Ltd .....	41.849	0,15
1.240	Hero MotoCorp Ltd .....	43.987	0,16
8.184	Hindustan Unilever Ltd .....	267.174	0,94
5.704	Marico Ltd .....	36.917	0,13
		<u>436.475</u>	<u>1,54</u>
	<b>Indonesien: 0,11 % (30. Juni 2022: 0,64 %)</b>		
236.800	Kalbe Farma Tbk PT .....	32.379	0,11
		<u>32.379</u>	<u>0,11</u>
	<b>Irland: 0,44 % (30. Juni 2022: 0,23 %)</b>		
4.648	James Hardie Industries Plc .....	122.984	0,44
		<u>122.984</u>	<u>0,44</u>
	<b>Israel: null (30. Juni 2022: 0,36 %)</b>		
	<b>Italien: 0,82 % (30. Juni 2022: null)</b>		
5.544	Assicurazioni Generali SpA .....	112.623	0,40
3.400	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA .....	40.655	0,14
1.136	Moncler SpA .....	78.502	0,28
		<u>231.780</u>	<u>0,82</u>
	<b>Japan: 9,27 % (30. Juni 2022: 8,48 %)</b>		
1.200	Advantest Corp .....	158.993	0,56
4.500	Ajinomoto Co Inc .....	178.213	0,63
12.000	Asahi Kasei Corp .....	80.700	0,29
16.800	Astellas Pharma Inc .....	249.789	0,89
1.600	Brother Industries Ltd .....	23.241	0,08
7.200	Daiwa Securities Group Inc .....	36.878	0,13
8.800	KDDI Corp .....	270.938	0,96
800	MatsukiyoCocokara & Co .....	44.706	0,16
800	Mitsui Chemicals Inc .....	23.407	0,08
1.700	Nitto Denko Corp .....	125.029	0,44
3.200	Nomura Research Institute Ltd .....	87.696	0,31
2.400	Ono Pharmaceutical Co Ltd .....	43.273	0,15
13.600	ORIX Corp .....	245.823	0,87
6.400	Renesas Electronics Corp .....	119.622	0,42
1.600	Seiko Epson Corp .....	24.786	0,09
3.200	SG Holdings Co Ltd .....	45.332	0,16
25.600	SoftBank Corp .....	272.764	0,97
3.200	Sompo Holdings Inc .....	143.002	0,51
1.600	Sumitomo Metal Mining Co Ltd .....	51.265	0,18
6.900	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc .....	294.026	1,04
3.500	Yamaha Motor Co Ltd .....	99.817	0,35
		<u>2.619.300</u>	<u>9,27</u>
	<b>Jersey: 0,61 % (30. Juni 2022: 0,92 %)</b>		
1.104	Ferguson Plc .....	173.670	0,61
3.654	Polymetal International Plc .....	-	0,00
		<u>173.670</u>	<u>0,61</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Malaysia: 0,57 % (30. Juni 2022: 0,86 %)</b>		
43.200	Malayan Banking Bhd .....	79.875	0,28
800	Nestle Malaysia Bhd .....	22.453	0,08
3.200	Petronas Dagangan Bhd .....	15.220	0,06
3.200	PPB Group Bhd .....	10.791	0,04
15.200	RHB Bank Bhd .....	17.683	0,06
31.200	Sime Darby Bhd .....	13.704	0,05
		<u>159.726</u>	<u>0,57</u>
	<b>Mexiko: 0,88 % (30. Juni 2022: 0,09 %)</b>		
5.104	Arca Continental SAB de CV .....	52.360	0,18
1.080	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV .....	30.051	0,11
20.200	Grupo Financiero Banorte SAB de CV .....	166.318	0,59
		<u>248.729</u>	<u>0,88</u>
	<b>Niederlande: 2,37 % (30. Juni 2022: 1,37 %)</b>		
400	ASML Holding NV .....	289.333	1,03
4.104	STMicroelectronics NV .....	204.016	0,72
1.384	Wolters Kluwer NV .....	175.607	0,62
		<u>668.956</u>	<u>2,37</u>
	<b>Norwegen: 0,55 % (30. Juni 2022: 0,64 %)</b>		
8.880	Orkla ASA .....	63.905	0,23
8.952	Telenor ASA .....	90.911	0,32
		<u>154.816</u>	<u>0,55</u>
	<b>Katar: 0,12 % (30. Juni 2022: 0,10 %)</b>		
6.952	Qatar Fuel QSC .....	32.430	0,12
		<u>32.430</u>	<u>0,12</u>
	<b>Russland: 0,00 % (30. Juni 2022: 0,00 %)</b>		
9	Phosagro PJSC GDR .....	-	0,00
447	PhosAgro PJSC GDR Reg S .....	-	0,00
1	PhosAgro PJSC GDR Reg S .....	-	0,00
357	Polyus PJSC .....	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	<b>Singapur: null (30. Juni 2022: 0,15 %)</b>		
	<b>Südafrika: 2,07 % (30. Juni 2022: 1,55 %)</b>		
4.552	Absa Group Ltd .....	40.459	0,14
808	Anglo American Platinum Ltd .....	36.409	0,13
2.544	Clicks Group Ltd .....	35.187	0,12
11.192	Gold Fields Ltd .....	155.007	0,55
33.712	Growthpoint Properties Ltd .....	20.808	0,07
12.352	Impala Platinum Holdings Ltd .....	81.940	0,29
1.160	Kumba Iron Ore Ltd .....	27.174	0,10
14.208	MTN Group Ltd .....	103.902	0,37
26.136	Old Mutual Ltd .....	16.768	0,06
7.544	Vodacom Group Ltd .....	46.802	0,17
5.072	Woolworths Holdings Ltd .....	19.156	0,07
		<u>583.612</u>	<u>2,07</u>
	<b>Südkorea: 1,98 % (30. Juni 2022: 1,48 %)</b>		
560	Coway Co Ltd .....	18.679	0,07
3.416	Hana Financial Group Inc .....	101.626	0,36
3.896	KB Financial Group Inc .....	141.186	0,50
1.088	LG Corp .....	72.663	0,26
440	Samsung Securities Co Ltd .....	12.021	0,04
5.312	Shinhan Financial Group Co Ltd .....	137.068	0,48

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 1,98 % (30. Juni 2022: 1,48 %) (Fortsetzung)</b>		
408	S-Oil Corp .....	20.653	0,07
6.352	Woori Financial Group Inc .....	56.836	0,20
		<u>560.732</u>	<u>1,98</u>
	<b>Spanien: 0,29 % (30. Juni 2022: 1,28 %)</b>		
4.832	Red Electrica Corp SA .....	81.105	0,29
		<u>81.105</u>	<u>0,29</u>
	<b>Schweden: 0,47 % (30. Juni 2022: 0,61 %)</b>		
3.816	Boliden AB .....	110.068	0,39
2.704	Tele2 AB .....	22.310	0,08
		<u>132.378</u>	<u>0,47</u>
	<b>Schweiz: 2,28 % (30. Juni 2022: 2,74 %)</b>		
776	Kuehne & Nagel International AG .....	229.595	0,81
1.496	SGS SA .....	141.398	0,50
2.728	Swiss Re AG .....	274.553	0,97
		<u>645.546</u>	<u>2,28</u>
	<b>Taiwan: 2,74 % (30. Juni 2022: 3,59 %)</b>		
24.000	Acer Inc .....	24.158	0,08
42.320	Chunghwa Telecom Co Ltd .....	158.303	0,56
16.000	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd .....	48.034	0,17
16.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd .....	40.380	0,14
68.000	Fubon Financial Holding Co Ltd .....	132.749	0,47
80.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd .....	44.566	0,16
16.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	295.911	1,05
500	Voltronic Power Technology Corp .....	31.547	0,11
		<u>775.648</u>	<u>2,74</u>
	<b>Thailand: 0,90 % (30. Juni 2022: 0,81 %)</b>		
14.400	Advanced Info Service PCL .....	86.916	0,31
53.600	Bangkok Dusit Medical Services PCL .....	41.952	0,15
35.200	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR .....	27.550	0,10
12.800	Central Pattana PCL NVDR .....	23.647	0,08
59.200	Home Product Center PCL .....	23.376	0,08
15.200	Intouch Holdings PCL .....	31.725	0,11
3.200	Kasikornbank PCL NVDR .....	11.688	0,04
6.400	Thai Oil PCL NVDR .....	7.987	0,03
		<u>254.841</u>	<u>0,90</u>
	<b>Türkei: 0,05 % (30. Juni 2022: null)</b>		
27.024	Yapi ve Kredi Bankasi AS .....	13.455	0,05
		<u>13.455</u>	<u>0,05</u>
	<b>Vereinigte Arabische Emirate: null (30. Juni 2022: 0,13 %)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 5,64 % (30. Juni 2022: 5,27 %)</b>		
10.576	abrdn Plc .....	29.339	0,10
1.248	Admiral Group Plc .....	33.034	0,12
6.552	Auto Trader Group Plc .....	50.846	0,18
14.752	Barratt Developments Plc .....	77.552	0,27
1.152	Berkeley Group Holdings Plc .....	57.456	0,20
79.072	BT Group Plc .....	122.996	0,44
3.536	Burberry Group Plc .....	95.304	0,34
816	Intertek Group Plc .....	44.246	0,16
8.368	J Sainsbury Plc .....	28.618	0,10
1.944	Johnson Matthey Plc .....	43.152	0,15
23.256	Kingfisher Plc .....	68.506	0,24
6.088	Mondi Plc .....	92.802	0,33
5.064	Pearson Plc .....	52.921	0,19

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 5,64 % (30. Juni 2022: 5,27 %) (Fortsetzung)</b>		
8.920	RELX Plc .....	297.233	1,05
7.944	Schroders Plc .....	44.166	0,16
5.696	SSE Plc .....	133.318	0,47
38.616	Taylor Wimpey Plc .....	50.445	0,18
5.224	Unilever Plc .....	272.137	0,96
		<b>1.594.071</b>	<b>5,64</b>
	<b>Vereinigte Staaten: 40,70 % (30. Juni 2022: 45,63 %)</b>		
1.240	Amgen Inc .....	275.305	0,97
2.648	Annaly Capital Management Inc .....	52.986	0,19
6.784	Bank of New York Mellon Corp .....	302.024	1,07
2.464	Best Buy Co Inc .....	201.925	0,71
896	Biogen Inc .....	255.226	0,90
1.032	Builders FirstSource Inc .....	140.352	0,50
1.344	CH Robinson Worldwide Inc .....	126.806	0,45
1.344	Clorox Co .....	213.750	0,76
4.416	Coca-Cola Co .....	265.931	0,94
4.696	Conagra Brands Inc .....	158.349	0,56
2.912	Consolidated Edison Inc .....	263.245	0,93
1.280	Cummins Inc .....	313.805	1,11
136	Deckers Outdoor Corp .....	71.762	0,25
2.208	Electronic Arts Inc .....	286.378	1,01
1.952	Expeditors International of Washington Inc .....	236.446	0,84
392	FactSet Research Systems Inc .....	157.055	0,56
5.040	Fastenal Co .....	297.310	1,05
672	Fortune Brands Innovations Inc .....	48.350	0,17
1.632	Fox Corp .....	55.488	0,20
808	Fox Corp .....	25.767	0,09
3.168	General Mills Inc .....	242.986	0,86
3.520	Gilead Sciences Inc .....	271.286	0,96
944	Graco Inc .....	81.514	0,29
984	HCA Healthcare Inc .....	298.624	1,06
2.464	Hologic Inc .....	199.510	0,71
952	Home Depot Inc .....	295.729	1,05
1.216	Illinois Tool Works Inc .....	304.194	1,08
2.112	International Paper Co .....	67.183	0,24
3.688	Interpublic Group of Co Inc .....	142.283	0,50
1.664	Iron Mountain Inc .....	94.548	0,34
600	J M Smucker Co .....	88.602	0,31
440	JB Hunt Transport Services Inc .....	79.653	0,28
2.864	Kellogg Co .....	193.034	0,68
1.584	Knight-Swift Transportation Holdings Inc .....	88.007	0,31
816	Laboratory Corp of America Holdings .....	196.925	0,70
2.384	LKQ Corp .....	138.916	0,49
216	MarketAxess Holdings Inc .....	56.467	0,20
1.536	Marsh & McLennan Co Inc .....	288.891	1,02
200	Mettler-Toledo International Inc .....	262.328	0,93
872	Microsoft Corp .....	296.951	1,05
880	Moody's Corp .....	305.994	1,08
6.352	Newmont Corp .....	270.976	0,96
920	Old Dominion Freight Line Inc .....	340.170	1,20
1.000	Owens Corning .....	130.500	0,46
1.448	PepsiCo Inc .....	268.199	0,95
2.920	Phillips 66 .....	278.510	0,99
1.328	Quest Diagnostics Inc .....	186.664	0,66
1.352	Robert Half International Inc .....	101.697	0,36
2.600	T Rowe Price Group Inc .....	291.252	1,03

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,47 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 40,70 % (30. Juni 2022: 45,63 %) (Fortsetzung)</b>		
1.632	Texas Instruments Inc .....	293.793	1,04
1.064	Tractor Supply Co .....	235.250	0,83
1.512	Travelers Co Inc .....	262.574	0,93
1.816	UGI Corp .....	48.977	0,17
2.496	Valero Energy Corp .....	292.781	1,04
7.696	Verizon Communications Inc .....	286.214	1,01
392	West Pharmaceutical Services Inc .....	149.928	0,53
408	WW Grainger Inc .....	321.745	1,14
		<u>11.501.115</u>	<u>40,70</u>
	<b>Aktien insgesamt</b> .....	<u>28.127.826</u>	<u>99,53</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<u>28.127.826</u>	<u>99,53</u>

Derivative Finanzinstrumente: 0,00 % (30. Juni 2022: (0,01) %)

Terminkontrakte (Futures): 0,00 % (30. Juni 2022: (0,01) %)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnittlicher Anschaffungskurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
72.923	365	2 of MSCI Acwi Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	227	0,00
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures)</b> .....	<u>227</u>	<u>0,00</u>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt</b> .....	<u>227</u>	<u>0,00</u>
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>Vermögensw erte</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	28.128.053	99,53
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>133.861</u>	<u>0,47</u>
		<b>Nettovermögen</b>	<u>28.261.914</u>	<u>100,00</u>
				<b>% des Gesamt- Vermögensw erte</b>
		<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		99,44
		Börsengehandelte derivative Instrumente .....		0,00
		Sonstiges Umlaufvermögen .....		<u>0,56</u>
		Gesamtvermögen .....		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 5.248 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,12 % (30. Juni 2022: 0,31 %)</b>		
8.154	Invesco Ltd .....	137.069	0,11
15	White Mountains Insurance Group Ltd .....	20.833	0,01
		<u>157.902</u>	<u>0,12</u>
	<b>Guernsey: 0,25 % (30. Juni 2022: 0,22 %)</b>		
3.186	Amdocs Ltd .....	314.936	0,25
		<u>314.936</u>	<u>0,25</u>
	<b>Irland: 1,71 % (30. Juni 2022: 1,12 %)</b>		
3.942	Accenture Plc .....	1.216.422	0,95
1.782	Allegion Plc .....	213.876	0,17
2.214	Aon Plc .....	764.273	0,59
		<u>2.194.571</u>	<u>1,71</u>
	<b>Jersey: 0,20 % (30. Juni 2022: 0,20 %)</b>		
25.380	Ancor Plc .....	253.293	0,20
		<u>253.293</u>	<u>0,20</u>
	<b>Niederlande: 0,55 % (30. Juni 2022: 0,55 %)</b>		
7.722	LyondellBasell Industries NV .....	709.111	0,55
		<u>709.111</u>	<u>0,55</u>
	<b>Vereinigte Staaten: 97,05 % (30. Juni 2022: 97,41 %)</b>		
11.232	3M Co .....	1.124.211	0,87
2.592	A O Smith Corp .....	188.646	0,15
8.748	AbbVie Inc .....	1.178.618	0,92
15.066	Activision Blizzard Inc .....	1.270.064	0,99
378	Advance Auto Parts Inc .....	26.573	0,02
540	Agree Realty Corp .....	35.311	0,03
4.482	Air Products and Chemicals Inc .....	1.342.493	1,04
2.808	Albertsons Co Inc .....	61.271	0,05
2.322	Allison Transmission Holdings Inc .....	131.100	0,10
4.536	Alphabet Inc .....	548.720	0,43
5.238	Alphabet Inc .....	626.989	0,49
27.216	Altria Group Inc .....	1.232.885	0,96
7.128	American International Group Inc .....	410.145	0,32
5.454	Amgen Inc .....	1.210.897	0,94
2.916	Antero Resources Corp .....	67.155	0,05
4.158	APA Corp .....	142.079	0,11
6.804	Apple Inc .....	1.319.772	1,03
9.072	Applied Materials Inc .....	1.311.267	1,02
9.882	Archer-Daniels-Midland Co .....	746.684	0,58
77.004	AT&T Inc .....	1.228.214	0,96
5.778	Automatic Data Processing Inc .....	1.269.947	0,99
756	AutoNation Inc .....	124.445	0,10
486	AutoZone Inc .....	1.211.773	0,94
1.728	AvalonBay Communities Inc .....	327.059	0,25
5.886	Best Buy Co Inc .....	482.358	0,38
1.350	Biogen Inc .....	384.547	0,30
1.728	BJ's Wholesale Club Holdings Inc .....	108.881	0,08
1.188	BorgWarner Inc .....	58.105	0,05
18.738	Bristol-Myers Squibb Co .....	1.198.295	0,93
1.512	Broadcom Inc .....	1.311.554	1,02
432	Brown-Forman Corp .....	29.406	0,02
1.296	Brunswick Corp .....	112.285	0,09
2.106	Builders FirstSource Inc .....	286.416	0,22
864	BWX Technologies Inc .....	61.836	0,05
4.158	Cadence Design Systems Inc .....	975.134	0,76
3.996	Campbell Soup Co .....	182.657	0,14

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,05 % (30. Juni 2022: 97,41 %) (Fortsetzung)</b>		
1.404	Cardinal Health Inc .....	132.776	0,10
864	Carter's Inc .....	62.726	0,05
864	Casey's General Stores Inc .....	210.712	0,16
3.348	CF Industries Holdings Inc .....	232.418	0,18
3.186	CH Robinson Worldwide Inc .....	300.599	0,23
378	Chemed Corp .....	204.751	0,16
1.566	Chesapeake Energy Corp .....	131.043	0,10
8.046	Chevron Corp .....	1.266.038	0,98
142	Chipotle Mexican Grill Inc .....	303.738	0,24
5.832	Church & Dwight Co Inc .....	584.541	0,45
2.808	Cigna Corp .....	787.925	0,61
1.998	Cintas Corp .....	993.166	0,77
24.300	Cisco Systems Inc .....	1.257.282	0,98
19.440	Citigroup Inc .....	895.018	0,70
2.538	Citizens Financial Group Inc .....	66.191	0,05
648	Clorox Co .....	103.058	0,08
20.196	Coca-Cola Co .....	1.216.203	0,95
11.772	Cognizant Technology Solutions Corp .....	768.476	0,60
8.046	Colgate-Palmolive Co .....	619.864	0,48
8.478	Conagra Brands Inc .....	285.878	0,22
12.150	ConocoPhillips .....	1.258.861	0,98
8.046	Consolidated Edison Inc .....	727.358	0,57
2.322	Copart Inc .....	211.790	0,16
17.820	Coterra Energy Inc .....	450.846	0,35
270	Crane NXT Co .....	15.239	0,01
3.618	Cummins Inc .....	886.989	0,69
16.362	CVS Health Corp .....	1.131.105	0,88
648	Darden Restaurants Inc .....	108.268	0,08
162	Deckers Outdoor Corp .....	85.481	0,07
10.638	Devon Energy Corp .....	514.241	0,40
2.646	Diamondback Energy Inc .....	347.579	0,27
1.188	Dick's Sporting Goods Inc .....	157.042	0,12
324	Domino's Pizza Inc .....	109.185	0,09
13.608	Dow Inc .....	724.762	0,56
6.858	DR Horton Inc .....	834.550	0,65
648	Eagle Materials Inc .....	120.800	0,09
5.346	Electronic Arts Inc .....	693.376	0,54
2.808	Eli Lilly & Co .....	1.316.896	1,02
270	EMCOR Group Inc .....	49.891	0,04
13.608	Emerson Electric Co .....	1.230.027	0,96
8.856	EOG Resources Inc .....	1.013.481	0,79
810	EPR Properties .....	37.908	0,03
3.726	EQT Corp .....	153.250	0,12
756	Evercore Inc .....	93.434	0,07
4.212	Expeditors International of Washington Inc .....	510.200	0,40
11.826	Exxon Mobil Corp .....	1.268.338	0,99
918	FactSet Research Systems Inc .....	367.797	0,29
540	Fair Isaac Corp .....	436.973	0,34
14.958	Fastenal Co .....	882.372	0,69
54	First Citizens BancShares Inc .....	69.306	0,05
702	First Industrial Realty Trust Inc .....	36.953	0,03
4.482	Flowers Foods Inc .....	111.512	0,09
4.698	FNB Corp .....	53.745	0,04
3.834	Fortinet Inc .....	289.812	0,23
648	Fortune Brands Innovations Inc .....	46.624	0,04
5.130	Fox Corp .....	174.420	0,14
648	FTI Consulting Inc .....	123.250	0,10

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,05 % (30. Juni 2022: 97,41 %) (Fortsetzung)</b>		
3.618	Gaming and Leisure Properties Inc .....	175.328	0,14
4.320	General Dynamics Corp .....	929.448	0,72
14.364	General Mills Inc .....	1.101.719	0,86
5.832	Gentex Corp .....	170.644	0,13
3.996	Graco Inc .....	345.055	0,27
702	Grand Canyon Education Inc .....	72.453	0,06
1.404	H&R Block Inc .....	44.745	0,04
4.158	Hershey Co .....	1.038.253	0,81
22.302	Hewlett Packard Enterprise Co .....	374.674	0,29
1.620	HF Sinclair Corp .....	72.268	0,06
3.780	Hologic Inc .....	306.067	0,24
4.266	Home Depot Inc .....	1.325.190	1,03
6.858	Hormel Foods Corp .....	275.829	0,21
30.078	HP Inc .....	923.695	0,72
1.026	Hubbell Inc .....	340.181	0,26
972	Huntington Ingalls Industries Inc .....	221.227	0,17
3.888	Huntsman Corp .....	105.054	0,08
1.674	IDEXX Laboratories Inc .....	840.733	0,65
5.508	Illinois Tool Works Inc .....	1.377.881	1,07
1.620	Ingredion Inc .....	171.639	0,13
9.396	International Business Machines Corp .....	1.257.279	0,98
7.452	International Paper Co .....	237.048	0,18
9.126	Interpublic Group of Co Inc .....	352.081	0,27
2.430	J M Smucker Co .....	358.838	0,28
1.836	Jack Henry & Associates Inc .....	307.218	0,24
2.052	JB Hunt Transport Services Inc .....	371.474	0,29
4.158	Jefferies Financial Group Inc .....	137.921	0,11
7.830	Johnson & Johnson .....	1.296.022	1,01
648	Kilroy Realty Corp .....	19.498	0,02
6.426	Kimberly-Clark Corp .....	887.173	0,69
2.754	KLA Corp .....	1.335.745	1,04
2.376	Knight-Swift Transportation Holdings Inc .....	132.011	0,10
16.416	Kroger Co .....	771.552	0,60
1.944	Lam Research Corp .....	1.249.720	0,97
810	Lamb Weston Holdings Inc .....	93.109	0,07
972	Landstar System Inc .....	187.149	0,15
4.644	Lennar Corp .....	581.940	0,45
108	Lennar Corp .....	12.202	0,01
702	Lennox International Inc .....	228.901	0,18
1.134	Lincoln Electric Holdings Inc .....	225.246	0,18
2.700	Lockheed Martin Corp .....	1.243.026	0,97
6.048	Lowe's Co Inc .....	1.365.034	1,06
432	LPL Financial Holdings Inc .....	93.930	0,07
4.050	Macy's Inc .....	65.002	0,05
1.026	Manhattan Associates Inc .....	205.077	0,16
9.450	Marathon Oil Corp .....	217.539	0,17
7.182	Marathon Petroleum Corp .....	837.421	0,65
1.620	Maravai LifeSciences Holdings Inc .....	20.137	0,02
216	MarketAxess Holdings Inc .....	56.467	0,04
3.294	Mastercard Inc .....	1.295.530	1,01
4.266	McDonald's Corp .....	1.273.017	0,99
108	Medpace Holdings Inc .....	25.938	0,02
10.962	Merck & Co Inc .....	1.264.905	0,98
4.590	Meta Platforms Inc .....	1.317.238	1,02
4.536	MGIC Investment Corp .....	71.623	0,06
2.862	Microchip Technology Inc .....	256.407	0,20
3.672	Microsoft Corp .....	1.250.463	0,97



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,05 % (30. Juni 2022: 97,41 %) (Fortsetzung)</b>		
17.280	Monster Beverage Corp .....	992.563	0,77
3.564	Moody's Corp .....	1.239.274	0,96
5.076	Mosaic Co .....	177.660	0,14
1.134	MSC Industrial Direct Co Inc .....	108.047	0,08
108	Murphy USA Inc .....	33.600	0,03
1.620	National Fuel Gas Co .....	83.203	0,06
4.644	National Retail Properties Inc .....	198.717	0,15
5.940	NetApp Inc .....	453.816	0,35
12.042	New York Community Bancorp Inc .....	135.352	0,11
162	NewMarket Corp .....	65.143	0,05
2.646	Northrop Grumman Corp .....	1.206.047	0,94
6.858	Nucor Corp .....	1.124.575	0,87
79	NVR Inc .....	501.699	0,39
7.290	Occidental Petroleum Corp .....	428.652	0,33
2.268	Old Dominion Freight Line Inc .....	838.593	0,65
4.806	Old Republic International Corp .....	120.967	0,09
3.510	Omega Healthcare Investors Inc .....	107.722	0,08
5.184	Omnicom Group Inc .....	493.258	0,38
1.188	OneMain Holdings Inc .....	51.904	0,04
2.430	ONEOK Inc .....	149.980	0,12
1.350	O'Reilly Automotive Inc .....	1.289.655	1,00
5.616	Organon & Co .....	116.869	0,09
2.808	Ovintiv Inc .....	106.901	0,08
918	Owens Corning .....	119.799	0,09
11.502	PACCAR Inc .....	962.142	0,75
2.268	Packaging Corp of America .....	299.739	0,23
8.208	Paychex Inc .....	918.229	0,71
1.404	PDC Energy Inc .....	99.881	0,08
486	Penske Automotive Group Inc .....	80.982	0,06
6.642	PepsiCo Inc .....	1.230.231	0,96
31.860	Pfizer Inc .....	1.168.625	0,91
13.446	Philip Morris International Inc .....	1.312.598	1,02
7.290	Phillips 66 .....	695.320	0,54
3.672	Pioneer Natural Resources Co .....	760.765	0,59
972	Polaris Inc .....	117.544	0,09
2.646	Premier Inc .....	73.188	0,06
8.478	Procter & Gamble Co .....	1.286.452	1,00
4.266	Public Storage .....	1.245.160	0,97
5.778	PulteGroup Inc .....	448.835	0,35
10.638	QUALCOMM Inc .....	1.266.347	0,98
2.376	Quest Diagnostics Inc .....	333.971	0,26
1.242	Range Resources Corp .....	36.515	0,03
13.446	Realty Income Corp .....	803.936	0,63
1.620	Regeneron Pharmaceuticals Inc .....	1.164.035	0,91
1.404	Reliance Steel & Aluminum Co .....	381.312	0,30
6.102	Rithm Capital Corp .....	57.054	0,04
270	RLI Corp .....	36.847	0,03
2.916	Robert Half International Inc .....	219.341	0,17
5.670	Rollins Inc .....	242.846	0,19
756	Ryder System Inc .....	64.101	0,05
1.080	Schneider National Inc .....	31.018	0,02
2.592	SEI Investments Co .....	154.535	0,12
4.104	Skyworks Solutions Inc .....	454.272	0,35
1.296	Snap-on Inc .....	373.494	0,29
1.836	Southern Copper Corp .....	131.715	0,10
11.232	Southwestern Energy Co .....	67.504	0,05
3.024	Spirit Realty Capital Inc .....	119.085	0,09

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,88 % (30. Juni 2022: 99,81 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,05 % (30. Juni 2022: 97,41 %) (Fortsetzung)</b>		
3.996	Starwood Property Trust Inc .....	77.522	0,06
4.806	Steel Dynamics Inc .....	523.518	0,41
8.694	Synchrony Financial .....	294.900	0,23
4.752	T Rowe Price Group Inc .....	532.319	0,41
1.242	Tapestry Inc .....	53.158	0,04
2.268	Tempur Sealy International Inc .....	90.879	0,07
2.808	Teradyne Inc .....	312.615	0,24
6.912	Texas Instruments Inc .....	1.244.298	0,97
108	Texas Pacific Land Corp .....	142.182	0,11
378	Texas Roadhouse Inc .....	42.442	0,03
756	Thor Industries Inc .....	78.246	0,06
1.512	Toll Brothers Inc .....	119.554	0,09
2.592	Toro Co .....	263.477	0,21
2.916	Tractor Supply Co .....	644.728	0,50
6.912	Tyson Foods Inc .....	352.788	0,27
702	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc .....	330.358	0,26
6.318	Union Pacific Corp .....	1.292.789	1,01
7.236	United Parcel Service Inc .....	1.297.053	1,01
4.266	United States Steel Corp .....	106.693	0,08
756	United Therapeutics Corp .....	166.887	0,13
2.484	UnitedHealth Group Inc .....	1.193.910	0,93
2.970	Unum Group .....	141.669	0,11
6.102	Valero Energy Corp .....	715.765	0,56
33.858	Verizon Communications Inc .....	1.259.179	0,98
3.726	Vertex Pharmaceuticals Inc .....	1.311.217	1,02
17.280	VICI Properties Inc .....	543.110	0,42
1.026	Victoria's Secret & Co .....	17.883	0,01
8.262	Walmart Inc .....	1.298.621	1,01
1.242	Waters Corp .....	331.043	0,26
864	Watsco Inc .....	329.590	0,26
7.074	Western Union Co .....	82.978	0,06
432	Westlake Corp .....	51.611	0,04
2.106	Williams-Sonoma Inc .....	263.545	0,21
810	World Wrestling Entertainment Inc .....	87.861	0,07
4.914	WP Carey Inc .....	331.990	0,26
1.188	WW Grainger Inc .....	936.845	0,73
4.698	Yum! Brands Inc .....	650.908	0,51
		<b>124.802.566</b>	<b>97,05</b>
	<b>Aktien insgesamt.....</b>	<b>128.432.379</b>	<b>99,88</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt .....</b>	<b>128.432.379</b>	<b>99,88</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: 0,00 % (30. Juni 2022: (0,01) %)

Terminkontrakte (Futures): 0,00 % (30. Juni 2022: (0,01) %)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnittlicher Anschaffungskurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
132.509	4.417	17 of S&P 500 Mic Emin Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	2.139	0,00
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures).....</b>	<b>2.139</b>	<b>0,00</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt .....</b>	<b>2.139</b>	<b>0,00</b>
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	128.434.518	99,88
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	156.198	0,12
		<b>Nettovermögen</b>	<b>128.590.716</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		99,86
		Börsengehandelte derivative Instrumente.....		0,00
		Sonstiges Umlaufvermögen .....		0,14
		Gesamtvermögen.....		<b>100,00</b>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 6.174 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %)</b>		
	<b>Österreich: 0,41 % (30. Juni 2022: 0,61 %)</b>		
261	ams-OSRAM AG .....	1.723	0,01
54	BAWAG Group AG .....	2.280	0,01
135	Erste Group Bank AG .....	4.332	0,01
1.431	Verbund AG .....	105.107	0,35
225	voestalpine AG .....	7.402	0,02
117	Wienerberger AG .....	3.281	0,01
		<b>124.125</b>	<b>0,41</b>
	<b>Belgien: 1,29 % (30. Juni 2022: 1,35 %)</b>		
28	Aedifica SA .....	1.644	0,00
22	Aedifica SA (voting rights) .....	9	0,00
252	Ageas SA .....	9.352	0,03
3.105	Anheuser-Busch InBev SA .....	160.932	0,53
117	Cofinimmo SA .....	8.050	0,03
63	Elia Group SA .....	7.327	0,02
72	Groupe Bruxelles Lambert NV .....	5.196	0,02
423	KBC Group NV .....	27.038	0,09
9	Sofina SA .....	1.707	0,01
351	Solvay SA .....	35.907	0,12
612	UCB SA .....	49.694	0,16
2.259	Umicore SA .....	57.808	0,19
1.053	Warehouses De Pauw CVA .....	26.451	0,09
		<b>391.115</b>	<b>1,29</b>
	<b>Bermuda: 0,02 % (30. Juni 2022: 0,04 %)</b>		
540	Hiscox Ltd .....	6.865	0,02
		<b>6.865</b>	<b>0,02</b>
	<b>Dänemark: 7,42 % (30. Juni 2022: 6,93 %)</b>		
180	ALK-Abello A/S .....	1.800	0,01
252	Ambu A/S .....	3.779	0,01
90	Bavarian Nordic A/S .....	2.345	0,01
270	Carlsberg AS .....	39.543	0,13
432	Coloplast A/S .....	49.501	0,16
1.854	Danske Bank A/S .....	41.333	0,14
216	Demant A/S .....	8.369	0,03
1.314	DSV A/S .....	252.885	0,83
45	Genmab A/S .....	15.592	0,05
657	GN Store Nord AS .....	15.018	0,05
216	ISS A/S .....	4.185	0,01
36	Jyske Bank A/S .....	2.506	0,01
8.730	Novo Nordisk A/S .....	1.288.997	4,26
2.205	Novozymes A/S .....	94.142	0,31
837	Pandora A/S .....	68.481	0,23
27	Ringkjoebing Landbobank A/S .....	3.545	0,01
108	ROCKWOOL A/S .....	25.572	0,08
54	SimCorp A/S .....	5.243	0,02
54	Sydbank AS .....	2.286	0,01
171	Topdanmark AS .....	7.698	0,02
441	Tryg A/S .....	8.745	0,03
12.492	Vestas Wind Systems A/S .....	304.435	1,01
		<b>2.246.000</b>	<b>7,42</b>
	<b>Färöer: null (30. Juni 2022: 0,01 %)</b>		
	<b>Finnland: 1,02 % (30. Juni 2022: 1,20 %)</b>		
963	Elisa OYJ .....	47.129	0,15
162	Huhtamaki OYJ .....	4.870	0,02
360	Kesko OYJ .....	6.210	0,02

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Finnland: 1,02 % (30. Juni 2022: 1,20 %) (Fortsetzung)</b>		
405	Kojamo OYJ .....	3.491	0,01
558	Kone OYJ .....	26.689	0,09
765	Metso Outotec OYJ .....	8.449	0,03
11.439	Nokia OYJ .....	43.874	0,14
6.075	Nordea BankABP .....	60.543	0,20
225	Orion OYJ .....	8.555	0,03
693	Sampo OYJ .....	28.496	0,09
1.404	Stora Enso OYJ .....	14.918	0,05
1.098	TietoEVRY OYJ .....	27.757	0,09
963	UPM-Kymmene OYJ .....	26.261	0,09
126	Valmet OYJ .....	3.211	0,01
		<b>310.453</b>	<b>1,02</b>
	<b>Frankreich: 23,23 % (30. Juni 2022: 19,01 %)</b>		
144	Accor SA .....	4.899	0,02
27	Aeroports de Paris .....	3.551	0,01
5.499	Air France-KLM .....	9.475	0,03
3.330	Air Liquide SA .....	546.786	1,81
1.305	Alstom SA .....	35.653	0,12
135	Alten SA .....	19.480	0,06
162	Amundi SA .....	8.756	0,03
270	Arkema SA .....	23.301	0,08
8.631	AXA SA .....	233.253	0,77
108	BioMerieux .....	10.381	0,03
3.492	BNP Paribas SA .....	201.558	0,66
594	Bouygues SA .....	18.271	0,06
2.340	Capgemini SE .....	406.107	1,34
4	Christian Dior SE .....	3.252	0,01
963	Cie de Saint-Gobain .....	53.668	0,18
81	Covivio .....	3.498	0,01
1.071	Credit Agricole SA .....	11.644	0,04
1.638	Danone SA .....	91.957	0,30
4.527	Dassault Systemes SE .....	183.909	0,61
1.035	Edenred .....	63.487	0,21
90	Eiffage SA .....	8.602	0,03
216	Elis SA .....	3.845	0,01
126	EssilorLuxottica SA .....	21.748	0,07
63	Eurazeo SE .....	4.060	0,01
252	Faurecia SE .....	5.436	0,02
369	Gecina SA .....	35.996	0,12
3.699	Getlink SE .....	57.630	0,19
396	Hermes International .....	788.040	2,60
270	Ipsen SA .....	29.754	0,10
783	Kering SA .....	395.885	1,31
504	Klepierre SA .....	11.451	0,04
603	La Francaise des Jeux SAEM .....	21.732	0,07
657	Legrand SA .....	59.656	0,20
1.530	L'Oreal SA .....	653.463	2,16
1.647	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE .....	1.421.361	4,69
13.509	Orange SA .....	144.573	0,48
684	Pernod Ricard SA .....	138.442	0,46
3.573	Publicis Groupe SA .....	262.615	0,87
144	Remy Cointreau SA .....	21.161	0,07
189	Renault SA .....	7.292	0,02
369	Rexel SA .....	8.343	0,03
5.940	Sanofi .....	583.308	1,93
18	Sartorius Stedim Biotech .....	4.117	0,01

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Frankreich: 23,23 % (30. Juni 2022: 19,01 %) (Fortsetzung)</b>		
855	Schneider Electric SE .....	142.323	0,47
396	SCOR SE .....	10.648	0,03
36	SEB SA .....	3.407	0,01
1.350	Societe Generale SA .....	32.130	0,11
90	Sodexo SA .....	9.077	0,03
135	SOITEC .....	20.918	0,07
153	Sopra Steria Group SACA .....	27.968	0,09
468	SPIE SA .....	13.853	0,04
108	Teleperformance .....	16.573	0,05
333	Ubisoft Entertainment SA .....	8.618	0,03
171	Unibail-Rodamco-Westfield .....	8.234	0,03
252	Valeo .....	4.947	0,02
801	Veolia Environnement SA .....	23.189	0,08
117	Verallia SA .....	4.022	0,01
1.035	Vivendi SE .....	8.700	0,03
27	Wendel SE .....	2.538	0,01
2.259	Worldline SA .....	75.676	0,25
		<b>7.034.217</b>	<b>23,23</b>
	<b>Deutschland: 13,71 % (30. Juni 2022: 13,30 %)</b>		
819	adidas AG .....	145.602	0,48
72	AIXTRON SE .....	2.238	0,01
1.800	Allianz SE .....	383.760	1,27
108	Aurubis AG .....	8.482	0,03
1.782	BASF SE .....	79.245	0,26
369	Bayerische Motoren Werke AG .....	41.520	0,14
90	Bechtle AG .....	3.269	0,01
675	Beiersdorf AG .....	81.844	0,27
459	Brenntag SE .....	32.773	0,11
27	Carl Zeiss Meditec AG .....	2.674	0,01
1.998	Commerzbank AG .....	20.280	0,07
108	Continental AG .....	7.463	0,02
630	Covestro AG .....	29.975	0,10
54	CTS Eventim AG & Co KGaA .....	3.124	0,01
81	Daimler Truck Holding AG .....	2.673	0,01
144	Delivery Hero SE .....	5.818	0,02
1.710	Deutsche Bank AG .....	16.447	0,05
432	Deutsche Boerse AG .....	73.051	0,24
4.428	Deutsche Lufthansa AG .....	41.530	0,14
11.124	Deutsche Post AG .....	497.576	1,64
24.003	Deutsche Telekom AG .....	479.484	1,58
585	Encavis AG .....	8.790	0,03
747	Evonik Industries AG .....	13.020	0,04
108	Evotec SE .....	2.226	0,01
180	Freenet AG .....	4.136	0,01
99	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA .....	4.333	0,01
234	Fresenius SE & Co KGaA .....	5.937	0,02
198	GEA Group AG .....	7.585	0,03
99	Hannover Rueck SE .....	19.241	0,06
225	HeidelbergCement AG .....	16.920	0,06
504	HelloFresh SE .....	11.390	0,04
558	Henkel AG & Co KGaA .....	40.879	0,14
432	HUGO BOSS AG .....	30.905	0,10
2.340	Infineon Technologies AG .....	88.417	0,29
243	K&S AG .....	3.877	0,01
108	KION Group AG .....	3.981	0,01
45	Knorr-Bremse AG .....	3.149	0,01

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Deutschland: 13,71 % (30. Juni 2022: 13,30 %) (Fortsetzung)</b>		
414	LANXESS AG .....	11.426	0,04
54	LEG Immobilien SE .....	2.843	0,01
1.071	Mercedes-Benz Group AG .....	78.901	0,26
414	Merck KGaA .....	62.742	0,21
9	MTU Aero Engines AG .....	2.137	0,01
315	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen .....	108.234	0,36
54	Nemetschek SE .....	3.706	0,01
162	Porsche Automobil Holding SE .....	8.936	0,03
630	Puma SE .....	34.726	0,11
4	Rational AG .....	2.652	0,01
9	Rheinmetall AG .....	2.257	0,01
6.930	SAP SE .....	867.220	2,86
36	Sartorius AG .....	11.416	0,04
90	Scout24 SE .....	5.227	0,02
2.187	Siemens AG .....	333.605	1,10
2.124	Siemens Healthineers AG .....	110.151	0,36
1.602	Symrise AG .....	153.824	0,51
72	Talanx AG .....	3.784	0,01
6.597	Telefonica Deutschland Holding AG .....	17.000	0,06
2.439	thyssenkrupp AG .....	17.483	0,06
207	Volkswagen AG .....	25.449	0,08
261	Vonovia SE .....	4.671	0,02
198	Wacker Chemie AG .....	24.898	0,08
1.278	Zalando SE .....	33.688	0,11
		<b>4.150.590</b>	<b>13,71</b>
	<b>Irland: 1,28 % (30. Juni 2022: 3,08 %)</b>		
2.583	AIB Group Plc .....	9.945	0,03
5.004	Bank of Ireland Group Plc .....	43.725	0,15
1.917	CRH Plc .....	96.808	0,32
162	Flutter Entertainment Plc .....	29.849	0,10
315	Glanbia Plc .....	4.316	0,01
378	Grafton Group Plc .....	3.443	0,01
423	Kerry Group Plc .....	37.808	0,13
1.737	Kingspan Group Plc .....	105.783	0,35
765	Ryanair Holdings Plc .....	13.169	0,04
1.377	Smurfit Kappa Group Plc .....	42.040	0,14
		<b>386.886</b>	<b>1,28</b>
	<b>Isle of Man: 0,04 % (30. Juni 2022: 0,02 %)</b>		
738	Entain Plc .....	10.939	0,04
		<b>10.939</b>	<b>0,04</b>
	<b>Italien: 1,20 % (30. Juni 2022: 1,22 %)</b>		
2.961	Assicurazioni Generali SpA .....	55.134	0,18
108	Azimut Holding SpA .....	2.134	0,01
1.323	Banco BPM SpA .....	5.623	0,02
1.062	BPER Banca .....	2.954	0,01
378	Davide Campari-Milano NV .....	4.797	0,02
18	DiaSorin SpA .....	1.717	0,00
243	FinecoBank Banca Fineco SpA .....	2.993	0,01
477	Infrastrutture Wireless Italiane SpA .....	5.762	0,02
72	Interpump Group SpA .....	3.663	0,01
16.506	Intesa Sanpaolo SpA .....	39.614	0,13
882	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA .....	9.667	0,03
1.557	Moncler SpA .....	98.620	0,33
9.270	Nexi SpA .....	66.577	0,22
567	Poste Italiane SpA .....	5.622	0,02

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Italien: 1,20 % (30. Juni 2022: 1,22 %) (Fortsetzung)</b>		
90	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA .....	3.938	0,01
36	Reply SpA .....	3.748	0,01
19.278	Telecom Italia SpA .....	4.970	0,02
1.872	Terna - Rete Elettrica Nazionale .....	14.613	0,05
1.449	UniCredit SpA .....	30.813	0,10
		<b>362.959</b>	<b>1,20</b>
	<b>Jersey: 0,70 % (30. Juni 2022: 0,92 %)</b>		
4.257	Experian Plc .....	149.715	0,49
1.161	Man Group Plc .....	2.956	0,01
6.219	WPP Plc .....	59.672	0,20
		<b>212.343</b>	<b>0,70</b>
	<b>Luxemburg: 0,04 % (30. Juni 2022: 0,08 %)</b>		
63	Eurofins Scientific SE .....	3.664	0,01
423	Millicom International Cellular SA SDR .....	5.917	0,02
369	SES SA .....	1.991	0,01
		<b>11.572</b>	<b>0,04</b>
	<b>Malta: 0,01 % (30. Juni 2022: 0,01 %)</b>		
279	Kindred Group Plc SDR .....	2.719	0,01
		<b>2.719</b>	<b>0,01</b>
	<b>Niederlande: 8,77 % (30. Juni 2022: 6,36 %)</b>		
270	ABN AMRO Bank NV .....	3.842	0,01
27	Adyen NV .....	42.817	0,14
5.697	Aegon NV .....	26.377	0,09
1.881	Akzo Nobel NV .....	140.548	0,46
27	Argenx SE .....	9.596	0,03
54	ASM International NV .....	20.971	0,07
2.034	ASML Holding NV .....	1.348.542	4,45
342	ASR Nederland NV .....	14.104	0,05
63	BE Semiconductor Industries NV .....	6.256	0,02
1.224	CNH Industrial NV .....	16.163	0,05
126	Euronext NV .....	7.850	0,03
45	EXOR NV .....	3.676	0,01
126	Ferrari NV .....	37.737	0,12
63	Heineken Holding NV .....	5.018	0,02
513	Heineken NV .....	48.314	0,16
135	IMCD NV .....	17.780	0,06
11.844	ING Groep NV .....	146.131	0,48
387	JDE Peet's NV .....	10.550	0,03
144	Just Eat Takeaway.com NV .....	2.021	0,01
1.701	Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	53.173	0,18
26.073	Koninklijke KPN NV .....	85.233	0,28
4.284	Koninklijke Philips NV .....	84.857	0,28
531	NN Group NV .....	18.006	0,06
72	OCI NV .....	1.582	0,00
531	Prosus NV .....	35.635	0,12
81	QIAGEN NV .....	3.332	0,01
495	Randstad NV .....	23.913	0,08
225	Signify NV .....	5.776	0,02
702	Stellantis NV .....	11.295	0,04
6.084	STMicroelectronics NV .....	277.187	0,92
756	Universal Music Group NV .....	15.385	0,05
1.143	Wolters Kluwer NV .....	132.931	0,44
		<b>2.656.598</b>	<b>8,77</b>



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Norwegen: 0,39 % (30. Juni 2022: 0,57 %)</b>		
873	Gjensidige Forsikring ASA .....	12.832	0,04
2.151	Mowi ASA .....	31.322	0,10
1.350	NEL ASA .....	1.454	0,01
180	Nordic Semiconductor ASA .....	2.009	0,01
675	Norsk Hydro ASA .....	3.684	0,01
1.548	Orkla ASA .....	10.211	0,03
243	Salmar ASA .....	9.000	0,03
3.888	Storebrand ASA .....	27.828	0,09
1.170	Telenor ASA .....	10.891	0,04
243	Yara International ASA .....	7.879	0,03
		<u>117.110</u>	<u>0,39</u>
	<b>Polen: 0,06 % (30. Juni 2022: 0,08 %)</b>		
189	Bank Polska Kasa Opieki SA .....	4.724	0,01
81	KGHM Polska Miedz SA .....	2.054	0,01
1	LPP SA .....	3.160	0,01
648	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA .....	5.285	0,02
486	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA .....	4.321	0,01
		<u>19.544</u>	<u>0,06</u>
	<b>Portugal: 0,04 % (30. Juni 2022: 0,74 %)</b>		
450	Jeronimo Martins SGPS SA .....	11.358	0,04
		<u>11.358</u>	<u>0,04</u>
	<b>Spanien: 5,00 % (30. Juni 2022: 4,74 %)</b>		
135	Acciona SA .....	20.979	0,07
54	Aena SME SA .....	7.992	0,03
1.890	Amadeus IT Group SA .....	131.733	0,43
8.928	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA .....	62.782	0,21
4.923	Banco de Sabadell SA .....	5.189	0,02
15.903	Banco Santander SA .....	53.832	0,18
639	Bankinter SA .....	3.597	0,01
1.548	CaixaBank SA .....	5.862	0,02
1.494	Cellnex Telecom SA .....	55.263	0,18
7.182	EDP Renovaveis SA .....	131.395	0,43
396	Grifols SA .....	4.649	0,01
45.423	Iberdrola SA .....	542.805	1,79
7.371	Industria de Diseno Textil SA .....	261.375	0,86
378	Inmobiliaria Colonial Socimi SA .....	2.096	0,01
5.427	International Consolidated Airlines Group SA .....	10.239	0,03
1.386	Merlin Properties Socimi SA .....	10.866	0,04
711	Red Electrica Corp SA .....	10.939	0,04
52.110	Telefonica SA .....	193.641	0,64
		<u>1.515.234</u>	<u>5,00</u>
	<b>Schweden: 2,53 % (30. Juni 2022: 2,59 %)</b>		
180	AAK AB .....	3.098	0,01
585	AddTech AB .....	11.656	0,04
819	Assa Abloy AB .....	18.000	0,06
4.311	Atlas Copco AB 'A' Shares .....	56.850	0,19
189	Avanza Bank Holding AB .....	3.520	0,01
396	Axfood AB .....	7.669	0,02
263	Beijer Ref AB .....	3.071	0,01
450	Billerud AB .....	3.130	0,01
81	Boliden AB .....	2.141	0,01
2.187	Castellum AB .....	19.106	0,06
450	Electrolux AB .....	5.621	0,02
2.178	Elekta AB .....	15.403	0,05
4.932	EQT AB .....	86.802	0,29

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweden: 2,53 % (30. Juni 2022: 2,59 %) (Fortsetzung)</b>		
1.089	Essity AB .....	26.531	0,09
72	Evolution AB .....	8.345	0,03
1.188	Fabege AB .....	7.819	0,02
864	Fastighets AB Balder .....	2.886	0,01
369	Fortnox AB .....	1.994	0,01
342	Getinge AB .....	5.484	0,02
4.446	H & M Hennes & Mauritz AB .....	69.866	0,23
594	Hexpol AB .....	5.761	0,02
351	Holmen AB .....	11.539	0,04
666	Husqvarna AB .....	5.518	0,02
117	Industrivarden AB .....	2.951	0,01
702	Indutrade AB .....	14.470	0,05
117	Investment AB Latour .....	2.123	0,01
927	Investor AB .....	16.964	0,06
450	Kinnevik AB .....	5.705	0,02
72	L E Lundbergforetagen AB .....	2.803	0,01
216	Lifco AB .....	4.295	0,01
675	Nibe Industrier AB .....	5.865	0,02
189	Nordnet AB publ .....	2.314	0,01
441	Saab AB .....	21.825	0,07
189	Sagax AB .....	3.416	0,01
882	Securitas AB .....	6.621	0,02
2.016	Skandinaviska Enskilda Banken AB .....	20.384	0,07
2.277	Skanska AB .....	29.206	0,10
513	SKF AB .....	8.167	0,03
378	Svenska Cellulosa AB SCA .....	4.409	0,01
4.032	Svenska Handelsbanken AB .....	30.910	0,10
1.323	Sweco AB .....	13.326	0,04
2.592	Swedbank AB .....	39.999	0,13
117	Swedish Orphan Biovitrum AB .....	2.089	0,01
3.735	Tele2 AB .....	28.247	0,09
5.787	Telefonaktiebolaget LM Ericsson .....	28.684	0,09
16.191	Telia Co AB .....	32.494	0,11
729	Thule Group AB .....	19.617	0,06
117	Trelleborg AB .....	2.595	0,01
1.269	Volvo AB .....	24.014	0,08
684	Volvo Car AB .....	2.485	0,01
1.143	Wihborgs Fastigheter AB .....	7.566	0,02
		<b>765.354</b>	<b>2,53</b>
	<b>Schweiz: 15,45 % (30. Juni 2022: 17,50 %)</b>		
1.503	Adecco Group AG .....	45.010	0,15
279	Alcon Inc .....	21.181	0,07
18	Allreal Holding AG .....	2.788	0,01
27	Bachem Holding AG .....	2.158	0,01
36	Baloise Holding AG .....	4.846	0,02
36	Banque Cantonale Vaudoise .....	3.485	0,01
9	Barry Callebaut AG .....	15.924	0,05
9	Belimo Holding AG .....	4.114	0,01
18	BKW AG .....	2.914	0,01
9	Bucher Industries AG .....	3.642	0,01
36	Cembra Money Bank AG .....	2.737	0,01
1	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG .....	11.516	0,04
4.842	Cie Financiere Richemont SA .....	752.297	2,48
558	Coca-Cola HBC AG .....	15.248	0,05
27	DKSH Holding AG .....	1.841	0,01
1.107	DSM-Firmenich AG .....	109.172	0,36

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweiz: 15,45 % (30. Juni 2022: 17,50 %) (Fortsetzung)</b>		
18	Flughafen Zurich AG .....	3.428	0,01
72	Galenica AG .....	5.329	0,02
20	Geberit AG .....	9.592	0,03
104	Givaudan SA .....	315.922	1,04
54	Helvetia Holding AG .....	6.694	0,02
783	Holcim AG .....	48.292	0,16
306	Julius Baer Group Ltd .....	17.663	0,06
63	Kuehne & Nagel International AG .....	17.085	0,06
333	Logitech International SA .....	18.164	0,06
99	Lonza Group AG .....	54.102	0,18
5.850	Nestle SA .....	644.897	2,13
9.873	Novartis AG .....	910.361	3,01
36	Partners Group Holding AG .....	31.041	0,10
45	PSP Swiss Property AG .....	4.606	0,01
1.890	Roche Holding AG (non-voting rights) .....	529.591	1,75
54	Schindler Holding AG .....	11.601	0,04
3	Siegfried Holding AG .....	2.271	0,01
1.656	SIG Group AG .....	41.872	0,14
855	Sika AG .....	223.985	0,74
216	Sonova Holding AG .....	52.713	0,17
162	Straumann Holding AG .....	24.091	0,08
9	Swatch Group AG .....	2.407	0,01
54	Swiss Life Holding AG .....	28.935	0,09
99	Swiss Prime Site AG .....	7.876	0,03
1.458	Swiss Re AG .....	134.498	0,44
279	Swisscom AG .....	159.443	0,53
27	Tecan Group AG .....	9.494	0,03
216	Temenos AG .....	15.743	0,05
3.879	UBS Group AG .....	71.912	0,24
630	Zurich Insurance Group AG .....	274.252	0,91
		<b>4.676.733</b>	<b>15,45</b>
	<b>Vereinigtes Königreich: 17,21 % (30. Juni 2022: 19,50 %)</b>		
3.690	abrdn Plc .....	9.383	0,03
171	Admiral Group Plc .....	4.149	0,01
369	Allfunds Group Plc .....	2.063	0,01
207	Antofagasta Plc .....	3.524	0,01
189	Ashtead Group Plc .....	11.990	0,04
549	Associated British Foods Plc .....	12.738	0,04
9.783	AstraZeneca Plc .....	1.285.487	4,25
7.983	Auto Trader Group Plc .....	56.783	0,19
23.094	Aviva Plc .....	106.355	0,35
6.138	Barclays Plc .....	10.971	0,04
3.024	Barratt Developments Plc .....	14.571	0,05
1.152	Beazley Plc .....	7.907	0,03
324	Bellway Plc .....	7.506	0,02
486	Berkeley Group Holdings Plc .....	22.218	0,07
603	Big Yellow Group Plc .....	7.540	0,02
1.296	British Land Co PLC .....	4.573	0,01
1.044	Britvic Plc .....	10.414	0,03
50.760	BT Group Plc .....	72.371	0,24
585	Bunzl Plc .....	20.444	0,07
3.339	Burberry Group Plc .....	82.488	0,27
180	Close Brothers Group Plc .....	1.849	0,01
3.339	Compass Group Plc .....	85.679	0,28
180	Computacenter Plc .....	4.803	0,02
4.491	ConvaTec Group Plc .....	10.739	0,04

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 17,21 % (30. Juni 2022: 19,50 %) (Fortsetzung)</b>		
855	Croda International Plc .....	56.054	0,19
99	Dechra Pharmaceuticals Plc .....	4.252	0,01
369	Derwent London Plc .....	8.815	0,03
13.635	Diageo Plc .....	536.888	1,77
81	Diploma Plc .....	2.817	0,01
4.293	Direct Line Insurance Group Plc .....	6.801	0,02
1.989	Drax Group Plc .....	13.443	0,04
2.007	DS Smith Plc .....	6.357	0,02
729	Electrocomponents Plc .....	6.458	0,02
171	Greggs Plc .....	5.089	0,02
17.730	GSK Plc .....	286.939	0,95
405	Hargreaves Lansdown Plc .....	3.849	0,01
13.797	Hays Plc .....	16.431	0,05
126	Hikma Pharmaceuticals Plc .....	2.776	0,01
297	Howden Joinery Group Plc .....	2.223	0,01
16.380	HSBC Holdings Plc .....	118.668	0,39
1.926	IG Group Holdings Plc .....	15.195	0,05
333	Inchcape Plc .....	3.017	0,01
135	Indivior Plc .....	2.868	0,01
9.234	Informa Plc .....	78.121	0,26
171	InterContinental Hotels Group Plc .....	10.828	0,04
1.980	Intermediate Capital Group Plc .....	31.783	0,10
3.564	International Distributions Services Plc .....	9.174	0,03
1.161	Investec Plc .....	5.964	0,02
19.773	ITV Plc .....	15.737	0,05
11.511	JD Sports Fashion Plc .....	19.584	0,06
2.529	Johnson Matthey Plc .....	51.456	0,17
3.429	Kingfisher Plc .....	9.258	0,03
3.420	Land Securities Group Plc .....	22.884	0,08
24.039	Legal & General Group Plc .....	63.673	0,21
68.013	Lloyds Banking Group Plc .....	34.548	0,11
3.807	London Stock Exchange Group Plc .....	371.143	1,23
909	LondonMetric Property Plc .....	1.752	0,01
2.547	LXI REIT Plc .....	2.556	0,01
5.742	M&G Plc .....	12.807	0,04
4.338	Marks & Spencer Group Plc .....	9.741	0,03
645	Melrose Industries Plc .....	3.805	0,01
981	Mondi Plc .....	13.707	0,05
11.646	NatWest Group Plc .....	32.679	0,11
558	Next Plc .....	44.867	0,15
612	OSB Group Plc .....	3.423	0,01
5.535	Pearson Plc .....	53.019	0,18
315	Pennon Group Plc .....	2.610	0,01
1.215	Persimmon Plc .....	14.520	0,05
3.537	Phoenix Group Holdings Plc .....	21.919	0,07
3.123	Prudential Plc .....	40.341	0,13
1.269	QinetiQ Group Plc .....	5.232	0,02
981	Reckitt Benckiser Group Plc .....	67.584	0,22
5.634	RELX Plc .....	172.078	0,57
1.413	Rentokil Initial Plc .....	10.127	0,03
3.924	Rightmove Plc .....	23.924	0,08
279	Safestore Holdings Plc .....	2.760	0,01
3.843	Sage Group Plc .....	41.415	0,14
7.677	Schroders Plc .....	39.121	0,13
3.852	Segro Plc .....	32.176	0,11
1.674	Serco Group Plc .....	3.037	0,01
441	Severn Trent Plc .....	13.187	0,04

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,82 % (30. Juni 2022: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 17,21 % (30. Juni 2022: 19,50 %) (Fortsetzung)</b>		
1.575	Smith & Nephew Plc .....	23.272	0,08
576	Softcat Plc .....	9.504	0,03
54	Spirax-Sarco Engineering Plc .....	6.522	0,02
1.944	St James's Place Plc .....	24.636	0,08
7.569	Standard Chartered Plc .....	60.242	0,20
594	Tate & Lyle Plc .....	5.025	0,02
8.622	Taylor Wimpey Plc .....	10.324	0,03
189	Travis Perkins Plc .....	1.789	0,01
2.475	Tritax Big Box REIT Plc .....	3.605	0,01
10.980	Unilever Plc .....	524.278	1,73
918	UNITE Group Plc .....	9.307	0,03
1.899	United Utilities Group Plc .....	21.279	0,07
1.584	Virgin Money UK Plc .....	2.761	0,01
504	Vistry Group Plc .....	3.879	0,01
163.530	Vodafone Group Plc .....	140.959	0,47
333	Whitbread Plc .....	13.139	0,04
450	Wise Plc .....	3.446	0,01
		<b>5.211.992</b>	<b>17,21</b>
	<b>Aktien insgesamt</b> .....	<b>30.224.706</b>	<b>99,82</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<b>30.224.706</b>	<b>99,82</b>

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) % (30. Juni 2022: 0,00 %)

Terminkontrakte (Futures): (0,00) % (30. Juni 2022: 0,00 %)\*

Nominal- betrag EUR	Durchschnitt- licher An- schaffungskurs EUR		Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
46.584	466	2 of Stoxx Europe 600 Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	(204)	(0,00)
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures)</b> .....	<b>(204)</b>	<b>(0,00)</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt</b> .....	<b>(204)</b>	<b>(0,00)</b>
			<b>Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	30.224.502	99,82
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	53.719	0,18
		<b>Nettovermögen</b>	<b>30.278.221</b>	<b>100,00</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamt- vermögens</b>
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....	99,81
Sonstiges Umlaufvermögen .....	0,19
Gesamtvermögen.....	<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 3.981 EUR.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,13 % (30. Juni 2022: 0,04 %)</b>		
1.653	Arch Capital Group Ltd .....	123.727	0,08
2.697	Invesco Ltd .....	45.336	0,03
1.218	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd .....	26.516	0,02
		<u>195.579</u>	<u>0,13</u>
	<b>Irland: 1,41 % (30. Juni 2022: 2,27 %)</b>		
3.654	Accenture Plc .....	1.127.553	0,72
174	Allegion Plc .....	20.885	0,01
870	Aon Plc .....	300.325	0,19
6.003	Medtronic Plc .....	528.866	0,34
870	Pentair Plc .....	56.204	0,04
261	STERIS Plc .....	58.721	0,04
435	Willis Towers Watson Plc .....	102.444	0,07
		<u>2.194.998</u>	<u>1,41</u>
	<b>Jersey: 0,10 % (30. Juni 2022: 0,16 %)</b>		
5.046	Amcor Plc .....	50.359	0,03
1.044	Aptiv Plc .....	106.583	0,07
		<u>156.942</u>	<u>0,10</u>
	<b>Panama: 0,03 % (30. Juni 2022: null)</b>		
2.349	Carnival Corp .....	44.232	0,03
		<u>44.232</u>	<u>0,03</u>
	<b>Schweiz: 0,41 % (30. Juni 2022: 0,30 %)</b>		
1.479	Chubb Ltd .....	284.796	0,18
522	Garmin Ltd .....	54.440	0,03
2.175	TE Connectivity Ltd .....	304.848	0,20
		<u>644.084</u>	<u>0,41</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: null (30. Juni 2022: 0,07 %)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,76 % (30. Juni 2022: 96,93 %)</b>		
11.049	Abbott Laboratories .....	1.204.562	0,77
12.354	AbbVie Inc .....	1.664.458	1,07
2.784	Activision Blizzard Inc .....	234.691	0,15
3.132	Adobe Inc .....	1.531.518	0,98
1.479	Advanced Micro Devices Inc .....	168.477	0,11
2.436	Aflac Inc .....	170.033	0,11
1.740	Agilent Technologies Inc .....	209.236	0,13
1.131	Akamai Technologies Inc .....	101.643	0,07
609	Albemarle Corp .....	135.862	0,09
957	Alexandria Real Estate Equities Inc .....	108.610	0,07
174	Align Technology Inc .....	61.533	0,04
783	Allstate Corp .....	85.378	0,05
29.406	Alphabet Inc .....	3.557.245	2,28
33.843	Alphabet Inc .....	4.051.008	2,60
49.677	Amazon.com Inc .....	6.475.906	4,16
3.915	American Airlines Group Inc .....	70.235	0,05
3.567	American Express Co .....	621.373	0,40
2.349	American International Group Inc .....	135.161	0,09
2.001	American Tower Corp .....	388.074	0,25
696	American Water Works Co Inc .....	99.354	0,06
435	Ameriprise Financial Inc .....	144.490	0,09
1.740	AmerisourceBergen Corp .....	334.830	0,21
3.480	Amgen Inc .....	772.631	0,50
522	ANSYS Inc .....	172.401	0,11
62.640	Apple Inc .....	12.150.281	7,80
5.307	Applied Materials Inc .....	767.074	0,49
1.740	Arista Networks Inc .....	281.984	0,18

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,76 % (30. Juni 2022: 96,93 %) (Fortsetzung)</b>		
870	Arthur J Gallagher & Co .....	191.026	0,12
37.584	AT&T Inc .....	599.465	0,38
1.566	Autodesk Inc .....	320.419	0,21
4.176	Automatic Data Processing Inc .....	917.843	0,59
102	AutoZone Inc .....	254.323	0,16
609	AvalonBay Communities Inc .....	115.266	0,07
1.044	Avery Dennison Corp .....	179.359	0,12
348	Axon Enterprise Inc .....	67.902	0,04
3.306	Ball Corp .....	192.442	0,12
47.154	Bank of America Corp .....	1.352.855	0,87
5.046	Bank of New York Mellon Corp .....	224.649	0,14
1.392	Bath & Body Works Inc .....	52.200	0,03
2.436	Baxter International Inc .....	110.984	0,07
1.305	Becton Dickinson and Co .....	344.533	0,22
1.044	Biogen Inc .....	297.384	0,19
87	Bio-Rad Laboratories Inc .....	32.983	0,02
783	Bio-Techne Corp .....	63.916	0,04
957	BlackRock Inc .....	661.423	0,42
171	Booking Holdings Inc .....	461.756	0,30
957	Boston Properties Inc .....	55.114	0,04
6.438	Boston Scientific Corp .....	348.231	0,22
12.093	Bristol-Myers Squibb Co .....	773.348	0,50
493	Broadcom Inc .....	427.649	0,27
1.131	Broadridge Financial Solutions Inc .....	187.328	0,12
957	Brown & Brown Inc .....	65.880	0,04
1.479	Cadence Design Systems Inc .....	346.855	0,22
261	Camden Property Trust .....	28.415	0,02
1.392	Campbell Soup Co .....	63.628	0,04
2.001	Capital One Financial Corp .....	218.850	0,14
1.131	Cardinal Health Inc .....	106.959	0,07
435	Catalent Inc .....	18.862	0,01
435	Cboe Global Markets Inc .....	60.034	0,04
435	Celanese Corp .....	50.373	0,03
696	Ceridian HCM Holding Inc .....	46.611	0,03
1.044	CF Industries Holdings Inc .....	72.475	0,05
609	CH Robinson Worldwide Inc .....	57.460	0,04
87	Charles River Laboratories International Inc .....	18.292	0,01
8.439	Charles Schwab Corp .....	478.324	0,31
435	Charter Communications Inc .....	159.806	0,10
147	Chipotle Mexican Grill Inc .....	314.433	0,20
1.566	Church & Dwight Co Inc .....	156.961	0,10
435	Cincinnati Financial Corp .....	42.334	0,03
783	Cintas Corp .....	389.214	0,25
27.927	Cisco Systems Inc .....	1.444.943	0,93
11.136	Citigroup Inc .....	512.704	0,33
2.262	Citizens Financial Group Inc .....	58.993	0,04
435	Clorox Co .....	69.183	0,04
1.914	CME Group Inc .....	354.645	0,23
20.010	Coca-Cola Co .....	1.205.002	0,77
1.566	Cognizant Technology Solutions Corp .....	102.229	0,07
4.698	Colgate-Palmolive Co .....	361.937	0,23
19.749	Comcast Corp .....	820.573	0,53
609	Comerica Inc .....	25.797	0,02
2.871	Conagra Brands Inc .....	96.810	0,06
1.479	Constellation Energy Corp .....	135.402	0,09
174	Cooper Co Inc .....	66.717	0,04
1.914	Copart Inc .....	174.576	0,11



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,76 % (30. Juni 2022: 96,93 %) (Fortsetzung)</b>		
2.697	Corning Inc .....	94.503	0,06
3.132	Corteva Inc .....	179.464	0,12
1.827	CoStar Group Inc .....	162.603	0,10
3.306	Costco Wholesale Corp .....	1.779.884	1,14
1.305	Crown Castle Inc .....	148.692	0,10
26.796	CSX Corp .....	913.744	0,59
6.003	CVS Health Corp .....	414.988	0,27
2.958	Danaher Corp .....	709.920	0,46
174	DaVita Inc .....	17.482	0,01
1.566	Deere & Co .....	634.534	0,41
696	DENTSPLY SIRONA Inc .....	27.854	0,02
1.392	Dexcom Inc .....	178.886	0,11
1.566	Digital Realty Trust Inc .....	178.320	0,11
1.131	Discover Financial Services .....	132.157	0,08
2.001	Dollar General Corp .....	339.730	0,22
1.392	Dollar Tree Inc .....	199.752	0,13
87	Domino's Pizza Inc .....	29.318	0,02
783	Dover Corp .....	115.611	0,07
3.654	Dow Inc .....	194.612	0,12
1.218	DR Horton Inc .....	148.218	0,10
522	Eastman Chemical Co .....	43.702	0,03
4.002	eBay Inc .....	178.850	0,11
2.175	Ecolab Inc .....	406.051	0,26
3.915	Edwards Lifesciences Corp .....	369.303	0,24
1.218	Electronic Arts Inc .....	157.975	0,10
783	Elevance Health Inc .....	347.879	0,22
4.176	Eli Lilly & Co .....	1.958.461	1,26
696	Enphase Energy Inc .....	116.566	0,07
261	EPAM Systems Inc .....	58.660	0,04
1.131	Equifax Inc .....	266.124	0,17
435	Equinix Inc .....	341.014	0,22
1.740	Equity Residential .....	114.788	0,07
261	Essex Property Trust Inc .....	61.153	0,04
957	Estee Lauder Co Inc .....	187.936	0,12
870	Etsy Inc .....	73.612	0,05
1.566	Eversource Energy .....	111.061	0,07
522	Expedia Group Inc .....	57.102	0,04
1.914	Expeditors International of Washington Inc .....	231.843	0,15
609	Extra Space Storage Inc .....	90.650	0,06
261	F5 Inc .....	38.174	0,02
174	FactSet Research Systems Inc .....	69.713	0,04
87	Fair Isaac Corp .....	70.401	0,05
4.959	Fastenal Co .....	292.531	0,19
348	Federal Realty Investment Trust .....	33.676	0,02
2.523	FedEx Corp .....	625.452	0,40
2.871	Fidelity National Information Services Inc .....	157.044	0,10
4.089	Fifth Third Bancorp .....	107.173	0,07
2.958	Fiserv Inc .....	373.152	0,24
261	FleetCor Technologies Inc .....	65.532	0,04
1.827	FMC Corp .....	190.629	0,12
2.958	Fortinet Inc .....	223.595	0,14
2.436	Fortive Corp .....	182.140	0,12
870	Fox Corp .....	29.580	0,02
1.131	Franklin Resources Inc .....	30.209	0,02
5.916	Freeport-McMoRan Inc .....	236.640	0,15
348	Gartner Inc .....	121.908	0,08
1.653	GE Healthcare Inc .....	134.290	0,09

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,76 % (30. Juni 2022: 96,93 %) (Fortsetzung)</b>		
4.263	Gen Digital Inc .....	79.079	0,05
4.785	General Mills Inc .....	367.010	0,24
783	Genuine Parts Co .....	132.508	0,09
8.265	Gilead Sciences Inc .....	636.984	0,41
1.218	Global Payments Inc .....	119.997	0,08
261	Globe Life Inc .....	28.611	0,02
2.349	Goldman Sachs Group Inc .....	757.648	0,49
348	Hartford Financial Services Group Inc .....	25.064	0,02
522	Hasbro Inc .....	33.810	0,02
348	HCA Healthcare Inc .....	105.611	0,07
3.654	Healthpeak Properties Inc .....	73.445	0,05
609	Henry Schein Inc .....	49.391	0,03
1.305	Hershey Co .....	325.859	0,21
7.482	Hewlett Packard Enterprise Co .....	125.699	0,08
1.218	Hilton Worldwide Holdings Inc .....	177.280	0,11
1.131	Hologic Inc .....	91.577	0,06
3.480	Home Depot Inc .....	1.081.032	0,69
4.959	Host Hotels & Resorts Inc .....	83.460	0,05
6.003	HP Inc .....	184.353	0,12
348	Humana Inc .....	155.601	0,10
7.482	Huntington Bancshares Inc .....	80.656	0,05
348	IDEX Corp .....	74.911	0,05
348	IDEXX Laboratories Inc .....	174.776	0,11
2.088	Illinois Tool Works Inc .....	522.336	0,34
1.044	Illumina Inc .....	195.740	0,13
783	Incyte Corp .....	48.742	0,03
3.654	Ingersoll Rand Inc .....	238.828	0,15
261	Insulet Corp .....	75.257	0,05
26.622	Intel Corp .....	890.240	0,57
2.871	Intercontinental Exchange Inc .....	324.653	0,21
4.437	International Business Machines Corp .....	593.715	0,38
3.306	International Flavors & Fragrances Inc .....	263.125	0,17
1.305	International Paper Co .....	41.512	0,03
2.436	Interpublic Group of Co Inc .....	93.981	0,06
1.740	Intuit Inc .....	797.251	0,51
1.218	Intuitive Surgical Inc .....	416.483	0,27
2.001	Invitation Homes Inc .....	68.834	0,04
696	IQVIA Holdings Inc .....	156.440	0,10
1.218	Iron Mountain Inc .....	69.207	0,04
609	J M Smucker Co .....	89.931	0,06
261	Jack Henry & Associates Inc .....	43.673	0,03
957	JB Hunt Transport Services Inc .....	173.246	0,11
14.355	JPMorgan Chase & Co .....	2.087.795	1,34
1.044	Juniper Networks Inc .....	32.709	0,02
1.914	Kellogg Co .....	129.004	0,08
5.742	Keurig Dr Pepper Inc .....	179.553	0,12
4.437	KeyCorp .....	40.998	0,03
1.131	Keysight Technologies Inc .....	189.386	0,12
783	Kimberly-Clark Corp .....	108.101	0,07
870	KLA Corp .....	421.967	0,27
5.394	Kraft Heinz Co .....	191.487	0,12
3.567	KRC Interim Corp .....	70.341	0,05
5.394	Kroger Co .....	253.518	0,16
174	Laboratory Corp of America Holdings .....	41.991	0,03
957	Lam Research Corp .....	615.223	0,39
783	Lamb Weston Holdings Inc .....	90.006	0,06
783	Lennar Corp .....	98.118	0,06

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,76 % (30. Juni 2022: 96,93 %) (Fortsetzung)</b>		
435	Live Nation Entertainment Inc .....	39.633	0,03
1.305	LKQ Corp .....	76.042	0,05
2.262	Lowe's Co Inc .....	510.536	0,33
870	M&T Bank Corp .....	107.671	0,07
174	MarketAxess Holdings Inc .....	45.487	0,03
2.088	Marsh & McLennan Co Inc .....	392.711	0,25
348	Martin Marietta Materials Inc .....	160.668	0,10
5.829	Mastercard Inc .....	2.292.546	1,47
1.305	Match Group Inc .....	54.614	0,04
2.001	McCormick & Co Inc .....	174.548	0,11
3.654	McDonald's Corp .....	1.090.391	0,70
1.305	McKesson Corp .....	557.641	0,36
14.355	Merck & Co Inc .....	1.656.424	1,06
7.830	Meta Platforms Inc .....	2.247.053	1,44
1.566	MetLife Inc .....	88.526	0,06
116	Mettler-Toledo International Inc .....	152.150	0,10
9.396	Micron Technology Inc .....	592.982	0,38
32.016	Microsoft Corp .....	10.902.729	7,00
348	Mid-America Apartment Communities Inc .....	52.847	0,03
1.653	Moderna Inc .....	200.840	0,13
174	Mohawk Industries Inc .....	17.950	0,01
12.441	Mondelez International Inc .....	907.447	0,58
87	Monolithic Power Systems Inc .....	47.000	0,03
3.654	Monster Beverage Corp .....	209.886	0,13
1.218	Moody's Corp .....	423.523	0,27
5.916	Morgan Stanley .....	505.231	0,32
1.305	Mosaic Co .....	45.675	0,03
1.044	Motorola Solutions Inc .....	306.184	0,20
522	MSCI Inc .....	244.970	0,16
2.697	Nasdaq Inc .....	134.446	0,09
696	NetApp Inc .....	53.174	0,03
1.566	Netflix Inc .....	689.808	0,44
4.785	Newmont Corp .....	204.128	0,13
1.566	News Corp 'A' Shares .....	30.537	0,02
5.220	NIKE Inc .....	576.131	0,37
348	Nordson Corp .....	86.367	0,06
2.349	Norfolk Southern Corp .....	532.659	0,34
1.392	Northern Trust Corp .....	103.203	0,07
14.181	NVIDIA Corp .....	5.998.860	3,85
10	NVR Inc .....	63.506	0,04
783	Old Dominion Freight Line Inc .....	289.514	0,19
696	Omnicom Group Inc .....	66.224	0,04
7.134	Oracle Corp .....	849.592	0,55
870	Organon & Co .....	18.105	0,01
2.175	Otis Worldwide Corp .....	193.599	0,12
435	Packaging Corp of America .....	57.490	0,04
3.306	Paychex Inc .....	369.842	0,24
174	Paycom Software Inc .....	55.896	0,04
6.177	PayPal Holdings Inc .....	412.191	0,26
8.265	PepsiCo Inc .....	1.530.843	0,98
348	PerkinElmer Inc .....	41.339	0,03
25.926	Pfizer Inc .....	950.966	0,61
2.001	PNC Financial Services Group Inc .....	252.026	0,16
174	Pool Corp .....	65.187	0,04
783	PPG Industries Inc .....	116.119	0,07
783	Principal Financial Group Inc .....	59.383	0,04
8.526	Procter & Gamble Co .....	1.293.742	0,83

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,76 % (30. Juni 2022: 96,93 %) (Fortsetzung)</b>		
1.914	Progressive Corp .....	253.357	0,16
6.264	Prologis Inc .....	768.156	0,49
435	PTC Inc .....	61.901	0,04
696	Public Storage .....	203.150	0,13
870	PulteGroup Inc .....	67.582	0,04
7.830	QUALCOMM Inc .....	932.083	0,60
1.392	Quanta Services Inc .....	273.458	0,18
348	Quest Diagnostics Inc .....	48.915	0,03
261	Ralph Lauren Corp .....	32.181	0,02
870	Raymond James Financial Inc .....	90.280	0,06
2.610	Realty Income Corp .....	156.052	0,10
696	Regency Centers Corp .....	42.992	0,03
696	Regeneron Pharmaceuticals Inc .....	500.105	0,32
5.220	Regions Financial Corp .....	93.021	0,06
783	Republic Services Inc .....	119.932	0,08
609	ResMed Inc .....	133.067	0,09
957	Robert Half International Inc .....	71.986	0,05
261	Rockwell Automation Inc .....	85.989	0,06
1.131	Rollins Inc .....	48.441	0,03
522	Roper Technologies Inc .....	250.978	0,16
2.001	Ross Stores Inc .....	224.374	0,14
2.610	S&P Global Inc .....	1.046.326	0,67
7.656	Salesforce Inc .....	1.617.407	1,04
435	SBA Communications Corp .....	100.816	0,06
2.088	Sealed Air Corp .....	83.520	0,05
1.479	ServiceNow Inc .....	831.154	0,53
1.131	Sherwin-Williams Co .....	300.303	0,19
1.392	Simon Property Group Inc .....	160.749	0,10
174	Snap-on Inc .....	50.145	0,03
348	SolarEdge Technologies Inc .....	93.630	0,06
1.392	Stanley Black & Decker Inc .....	130.445	0,08
5.829	Starbucks Corp .....	577.421	0,37
2.349	State Street Corp .....	171.901	0,11
522	Steel Dynamics Inc .....	56.861	0,04
1.392	Stryker Corp .....	424.685	0,27
2.088	Synchrony Financial .....	70.825	0,05
1.044	Synopsys Inc .....	454.568	0,29
3.915	Sysco Corp .....	290.494	0,19
1.044	T Rowe Price Group Inc .....	116.949	0,08
522	Take-Two Interactive Software Inc .....	76.818	0,05
696	Tapestry Inc .....	29.789	0,02
3.045	Target Corp .....	401.636	0,26
174	Teleflex Inc .....	42.113	0,03
696	Teradyne Inc .....	77.486	0,05
10.962	Tesla Inc .....	2.869.523	1,84
2.262	Thermo Fisher Scientific Inc .....	1.180.199	0,76
7.743	TJX Co Inc .....	656.531	0,42
2.001	T-Mobile US Inc .....	277.939	0,18
435	Tractor Supply Co .....	96.180	0,06
696	Travelers Co Inc .....	120.867	0,08
957	Trimble Inc .....	50.664	0,03
7.134	Truist Financial Corp .....	216.517	0,14
261	Tyler Technologies Inc .....	108.699	0,07
957	UDR Inc .....	41.113	0,03
261	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc .....	122.825	0,08
7.743	Union Pacific Corp .....	1.584.373	1,02
2.088	United Airlines Holdings Inc .....	114.573	0,07

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,84 % (30. Juni 2022: 99,77 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 97,76 % (30. Juni 2022: 96,93 %) (Fortsetzung)</b>		
8.526	United Parcel Service Inc .....	1.528.286	0,98
522	United Rentals Inc .....	232.485	0,15
5.220	UnitedHealth Group Inc .....	2.508.941	1,61
5.655	US Bancorp .....	186.842	0,12
2.175	Ventas Inc .....	102.812	0,07
435	VeriSign Inc .....	98.297	0,06
1.914	Verisk Analytics Inc .....	432.622	0,28
14.268	Verizon Communications Inc .....	530.627	0,34
1.479	Vertex Pharmaceuticals Inc .....	520.477	0,33
1.131	VF Corp .....	21.591	0,01
5.481	Viatis Inc .....	54.700	0,04
11.571	Visa Inc .....	2.747.882	1,76
870	Vulcan Materials Co .....	196.133	0,13
522	W R Berkley Corp .....	31.090	0,02
6.786	Walgreens Boots Alliance Inc .....	193.333	0,12
8.700	Walt Disney Co .....	776.739	0,50
10.788	Warner Bros Discovery Inc .....	135.282	0,09
4.437	Waste Management Inc .....	769.465	0,49
348	Waters Corp .....	92.756	0,06
2.697	Welltower Inc .....	218.160	0,14
261	West Pharmaceutical Services Inc .....	99.825	0,06
1.131	Westrock Co .....	32.878	0,02
6.786	Weyerhaeuser Co .....	227.406	0,15
2.088	Yum! Brands Inc .....	289.293	0,19
261	Zebra Technologies Corp .....	77.212	0,05
870	Zimmer Biomet Holdings Inc .....	126.672	0,08
957	Zions Bancorp NA .....	25.705	0,02
1.827	Zoetis Inc .....	314.628	0,20
		<b>152.303.282</b>	<b>97,76</b>
	<b>Aktien insgesamt.....</b>	<b>155.539.117</b>	<b>99,84</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt .....</b>	<b>155.539.117</b>	<b>99,84</b>

Derivative Finanzinstrumente: 0,01 % (30. Juni 2022: (0,01) %)

Terminkontrakte (Futures): 0,01 % (30. Juni 2022: (0,01) %)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnitt- licher An- schaffungskurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
598.631	4.434	17 of S&P 500 Mic Emin Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	7.283	0,01
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures) .....</b>	<b>7.283</b>	<b>0,01</b>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt .....</b>	<b>7.283</b>	<b>0,01</b>
			<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlageportfolio</b>	155.546.400	99,85
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	241.378	0,15
		<b>Nettovermögen</b>	<b>155.787.778</b>	<b>100,00</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....	84,06
Börsengehandelte derivative Instrumente .....	0,00
Sonstiges Umlaufvermögen .....	15,94
Gesamtvermögen .....	100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 30.006 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,36 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,36 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,49 % (30. Juni 2022: 1,70 %)</b>		
56.725	Alibaba Health Information Technology Ltd .....	34.093	0,21
192.000	China Ruyi Holdings Ltd .....	45.081	0,28
		<u>79.174</u>	<u>0,49</u>
	<b>Kaimaninseln: 51,41 % (30. Juni 2022: 52,63 %)</b>		
400	360 DigiTech Inc ADR .....	6.912	0,04
24.000	3SBio Inc .....	24.102	0,15
157.600	Alibaba Group Holding Ltd .....	1.632.994	10,08
5.372	ANTA Sports Products Ltd .....	54.874	0,34
1.360	Autohome Inc ADR .....	39.658	0,24
25.600	Baidu Inc .....	433.821	2,68
8.000	BeiGene Ltd .....	109.639	0,68
1.920	Bilibili Inc .....	28.592	0,18
180.000	China Conch Venture Holdings Ltd .....	234.285	1,44
4.800	China Literature Ltd .....	20.182	0,12
16.000	China Medical System Holdings Ltd .....	26.052	0,16
32.989	China Resources Land Ltd .....	139.759	0,86
1.600	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd .....	7.942	0,05
29.800	Country Garden Services Holdings Co Ltd .....	38.483	0,24
26.537	Genscript Biotech Corp .....	59.599	0,37
16.000	Greentown Service Group Co Ltd .....	7.656	0,05
1.416	H World Group Ltd ADR .....	54.913	0,34
32.000	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd .....	51.451	0,32
12.800	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd .....	69.255	0,43
18.063	Innovent Biologics Inc .....	68.227	0,42
8.400	JD Health International Inc .....	53.005	0,33
84.000	JD Logistics Inc .....	130.985	0,81
250	JD.com Inc .....	4.224	0,02
6.168	Kanzhun Ltd ADR .....	92.828	0,57
96.000	Kingdee International Software Group Co Ltd .....	128.382	0,79
11.200	Kingsoft Corp Ltd .....	44.091	0,27
16.000	Kuaishou Technology .....	109.333	0,67
2.536	Legend Biotech Corp ADR .....	175.060	1,08
9.600	Li Auto Inc .....	165.990	1,02
16.000	Li Ning Co Ltd .....	86.058	0,53
21.272	Meituan .....	331.976	2,05
16.000	NetEase Inc .....	311.564	1,92
4.024	Pinduoduo Inc ADR .....	278.219	1,72
7.200	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd .....	17.401	0,11
8.000	Shenzhou International Group Holdings Ltd .....	76.309	0,47
120.000	Sino Biopharmaceutical Ltd .....	52.217	0,32
1.600	Sunny Optical Technology Group Co Ltd .....	15.956	0,10
59.008	Tencent Holdings Ltd .....	2.496.880	15,41
32.000	Topsports International Holdings Ltd .....	27.726	0,17
3.984	Trip.com Group Ltd .....	138.585	0,85
960	Weibo Corp ADR .....	12.586	0,08
35.265	Wuxi Biologics Cayman Inc .....	168.977	1,04
152.912	Xinyi Solar Holdings Ltd .....	176.589	1,09
8.800	XPeng Inc .....	56.147	0,35
3.200	Yihai International Holding Ltd .....	6.852	0,04
24.560	Zai Lab Ltd .....	65.814	0,41
		<u>8.332.150</u>	<u>51,41</u>
	<b>China: 44,16 % (30. Juni 2022: 41,62 %)</b>		
800	3peak Inc .....	23.973	0,15
9.606	Aier Eye Hospital Group Co Ltd .....	24.494	0,15
4.900	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'B' Shares .....	84.412	0,52
9.600	AVIC Industry-Finance Holdings Co Ltd .....	5.054	0,03

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 44,16 % (30. Juni 2022: 41,62 %) (Fortsetzung)</b>		
38.400	Bank of Chengdu Co Ltd .....	64.450	0,40
30.400	Beijing Enlight Media Co Ltd .....	33.807	0,21
1.160	Beijing Kingsoft Office Software Inc .....	75.298	0,46
15.600	Beijing Shiji Information Technology Co Ltd .....	30.021	0,19
280	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd .....	2.570	0,02
800	Bloomage Biotechnology Corp Ltd .....	9.805	0,06
19.200	BOC International China Co Ltd .....	28.134	0,17
12.400	BYD Co Ltd 'H' Shares .....	395.580	2,44
1.600	By-health Co Ltd .....	5.274	0,03
45.600	Caitong Securities Co Ltd .....	45.382	0,28
39.200	CECEP Solar Energy Co Ltd .....	36.534	0,23
62.400	CECEP Wind-Power Corp .....	31.480	0,19
100	Changchun High & New Technology Industry Group Inc .....	1.874	0,01
10.400	Changjiang Securities Co Ltd .....	8.292	0,05
800	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd .....	13.592	0,08
352.000	China Cinda Asset Management Co Ltd .....	35.036	0,22
296.000	China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	191.501	1,18
32.000	China Galaxy Securities Co Ltd .....	17.069	0,11
25.600	China Great Wall Securities Co Ltd .....	28.609	0,18
16.000	China International Capital Corp Ltd 'H' Shares .....	28.053	0,17
128.000	China Life Insurance Co Ltd .....	213.317	1,32
24.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd .....	24.715	0,15
16.000	China Merchants Bank Co Ltd .....	72.685	0,45
281.600	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd .....	207.867	1,28
2.800	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd .....	42.542	0,26
10.400	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd .....	140.673	0,87
43.200	China Vanke Co Ltd 'H' Shares .....	57.992	0,36
48.800	China Yangtze Power Co Ltd .....	147.980	0,91
1.200	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd .....	7.291	0,05
36.000	CITIC Securities Co Ltd 'H' Shares .....	65.232	0,40
4.860	Contemporary Amperex Technology Co Ltd .....	152.845	0,94
5.600	CSC Financial Co Ltd 'A' Shares .....	18.629	0,12
1.600	Dong-E-E-Jiao Co Ltd .....	11.756	0,07
156.820	East Money Information Co Ltd .....	306.104	1,89
500	Eve Energy Co Ltd .....	4.158	0,03
36.000	First Capital Securities Co Ltd .....	28.306	0,17
20.800	Focus Media Information Technology Co Ltd .....	19.471	0,12
2.080	Ganfeng Lithium Group Co Ltd 'H' Shares .....	13.563	0,08
14.400	Gotion High-tech Co Ltd .....	54.672	0,34
100	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd .....	1.038	0,01
2.400	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd .....	22.051	0,14
9.615	Guangzhou Yuexiu Capital Holdings Group Co Ltd .....	8.393	0,05
24.000	Guolian Securities Co Ltd .....	30.021	0,19
7.200	Guotai Junan Securities Co Ltd 'A' Shares .....	13.846	0,09
11.200	Guoyuan Securities Co Ltd .....	10.038	0,06
217.600	Haitong Securities Co Ltd .....	133.282	0,82
800	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd .....	3.329	0,02
400	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'A' Shares .....	3.549	0,02
17.600	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' Shares .....	100.278	0,62
24.800	Hengtong Optic-electric Co Ltd .....	49.976	0,31
4.000	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd .....	96.377	0,59
822	Hoymiles Power Electronics Inc .....	40.129	0,25
1.100	Huadong Medicine Co Ltd .....	6.558	0,04
2.400	Hualan Biological Engineering Inc .....	7.393	0,05
43.200	Huatai Securities Co Ltd 'H' Shares .....	53.362	0,33
20.800	Huaxi Securities Co Ltd .....	23.760	0,15
4.190	Hundsun Technologies Inc .....	25.509	0,16



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 44,16 % (30. Juni 2022: 41,62 %) (Fortsetzung)</b>		
1.000	Imeik Technology Development Co Ltd .....	61.163	0,38
11.200	Industrial Securities Co Ltd .....	9.422	0,06
32.800	JA Solar Technology Co Ltd .....	188.013	1,16
16.000	Jiangsu Expressway Co Ltd .....	14.741	0,09
800	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd .....	14.444	0,09
2.400	JiuGui Liquor Co Ltd .....	29.741	0,18
4.100	Joinn Laboratories China Co Ltd 'A' Shares .....	23.051	0,14
20.800	Kuang-Chi Technologies Co Ltd .....	43.631	0,27
900	Kweichow Moutai Co Ltd .....	209.202	1,29
55.200	LONGi Green Energy Technology Co Ltd .....	217.543	1,34
800	Mango Excellent Media Co Ltd .....	3.762	0,02
4.800	Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd .....	4.691	0,03
22.400	Ming Yang Smart Energy Group Ltd .....	51.976	0,32
3.632	Montage Technology Co Ltd .....	28.667	0,18
800	Muyuan Foods Co Ltd .....	4.635	0,03
4.800	Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co Ltd .....	8.907	0,06
33.600	Nanjing Securities Co Ltd .....	37.781	0,23
72.000	NARI Technology Co Ltd .....	228.625	1,41
11.200	Nongfu Spring Co Ltd .....	61.813	0,38
3.200	Ovctek China Inc .....	13.280	0,08
5.600	Pharmaron Beijing Co Ltd .....	17.293	0,11
4.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' Shares .....	25.445	0,16
10.400	Riyue Heavy Industry Co Ltd .....	27.148	0,17
2.400	Sangfor Technologies Inc .....	37.362	0,23
1.040	SG Micro Corp .....	11.741	0,07
28.800	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd .....	37.633	0,23
17.280	Shanghai Baosight Software Co Ltd .....	120.690	0,75
37.632	Shanghai Baosight Software Co Ltd .....	99.348	0,61
1.416	Shanghai Friendess Electronic Technology Corp Ltd .....	36.702	0,23
12.000	Shanghai International Airport Co Ltd .....	74.922	0,46
800	Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'A' Shares .....	4.238	0,03
68.800	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd .....	42.794	0,26
15.725	Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd .....	82.615	0,51
16.800	Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd .....	17.343	0,11
2.400	Shanxi Securities Co Ltd .....	1.841	0,01
800	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd .....	20.352	0,13
212.800	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd 'A' Shares .....	135.143	0,83
9.600	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd .....	84.733	0,52
1.600	Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd .....	5.584	0,03
1.600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd .....	65.937	0,41
1.600	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd .....	6.860	0,04
43.200	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd .....	89.372	0,55
15.200	Sichuan New Energy Power Co Ltd .....	30.087	0,19
27.200	Songcheng Performance Development Co Ltd .....	46.363	0,29
7.200	SooChow Securities Co Ltd .....	6.869	0,04
65.600	Southwest Securities Co Ltd .....	32.914	0,20
14.600	Sungrow Power Supply Co Ltd .....	234.068	1,44
31.000	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd .....	141.475	0,87
1.600	Thunder Software Technology Co Ltd .....	21.191	0,13
2.400	Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co Ltd .....	9.966	0,06
34.400	Tongwei Co Ltd .....	162.240	1,00
300	Topchoice Medical Corp .....	3.994	0,02
24.000	TravelSky Technology Ltd .....	40.732	0,25
2.240	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H' Shares .....	20.352	0,13
11.200	Unisplendour Corp Ltd .....	49.035	0,30
4.000	Walvax Biotechnology Co Ltd .....	14.543	0,09
12.000	Western Securities Co Ltd .....	10.474	0,06

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,53 % (30. Juni 2022: 99,36 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 44,16 % (30. Juni 2022: 41,62 %) (Fortsetzung)</b>		
5.600	Westone Information Industry Inc .....	21.454	0,13
2.000	Wuliangye Yibin Co Ltd .....	44.969	0,28
8.000	WuXi AppTec Co Ltd 'H' Shares .....	63.803	0,39
34.400	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'A' Shares .....	50.218	0,31
12.460	Yealink Network Technology Corp Ltd .....	60.067	0,37
3.200	Yunnan Baiyao Group Co Ltd .....	23.085	0,14
900	Yunnan Botanee Bio-Technology Group Co Ltd .....	10.996	0,07
2.100	Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co Ltd .....	82.663	0,51
10.400	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd .....	39.528	0,24
64.000	Zhejiang Expressway Co Ltd .....	48.592	0,30
1.600	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd .....	15.594	0,10
1.160	Zhejiang Supcon Technology Co Ltd .....	10.011	0,06
5.600	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd .....	25.888	0,16
15.200	Zheshang Securities Co Ltd .....	20.643	0,13
9.600	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd .....	26.093	0,16
13.600	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H' Shares .....	50.675	0,31
		<u>7.157.747</u>	<u>44,16</u>
	<b>Hongkong: 1,77 % (30. Juni 2022: 2,24 %)</b>		
51.000	China Overseas Land & Investment Ltd .....	111.155	0,69
6.400	China Resources Beer Holdings Co Ltd .....	42.141	0,26
104.141	CSPC Pharmaceutical Group Ltd .....	90.499	0,56
37.000	Yuexiu Property Co Ltd .....	43.012	0,26
		<u>286.807</u>	<u>1,77</u>
	<b>Singapur: 0,44 % (30. Juni 2022: 0,36 %)</b>		
8.800	BOC Aviation Ltd .....	71.138	0,44
		<u>71.138</u>	<u>0,44</u>
	<b>Vereinigte Staaten: 1,26 % (30. Juni 2022: 0,81 %)</b>		
3.608	Yum China Holdings Inc .....	203.852	1,26
		<u>203.852</u>	<u>1,26</u>
	<b>Aktien insgesamt.....</b>	<u>16.130.868</u>	<u>99,53</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt .....</b>	<u>16.130.868</u>	<u>99,53</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) % (30. Juni 2022: null)

Terminkontrakte (Futures): (0,00) % (30. Juni 2022: null)\*

Nominal- betrag USD	Durchschnitt- licher An- schaffungs- kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
46.465	465	3 of MSCI China Long Futures Contracts Expiring September 2023 .....	(415)	(0,00)
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures) .....</b>	<u>(415)</u>	<u>(0,00)</u>
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt .....</b>	<u>(415)</u>	<u>(0,00)</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>Anlageportfolio</b>	16.130.453	99,53
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	75.633	0,47
<b>Nettovermögen</b>	<u>16.206.086</u>	<u>100,00</u>

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamt- vermögens</b>
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind.....	99,51
Sonstiges Umlaufvermögen .....	<u>0,49</u>
Gesamtvermögen.....	<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2023 5.412 USD.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 91,55 % (30. Juni 2022: 95,23 %)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 91,55 % (30. Juni 2022: 95,23 %)</b>		
	<b>Albanien: 0,18 % (30. Juni 2022: 0,33 %)</b>		
110.000	Albania Government International Bond 3.50% 16/06/2027 .....	111.030	0,18
		<u>111.030</u>	<u>0,18</u>
	<b>Armenien: 0,51 % (30. Juni 2022: 0,47 %)</b>		
400.000	Republic of Armenia Government International Bond 3.60% 02/02/2031 .....	314.560	0,51
		<u>314.560</u>	<u>0,51</u>
	<b>Benin: 0,13 % (30. Juni 2022: 0,25 %)</b>		
100.000	Benin Government International Bond 4.88% 19/01/2032 .....	83.100	0,13
		<u>83.100</u>	<u>0,13</u>
	<b>Brasilien: 7,03 % (30. Juni 2022: 6,93 %)</b>		
2.300.000	Brazilian Government International Bond 4.75% 14/01/2050 .....	1.699.017	2,73
2.800.000	Brazilian Government International Bond 2.88% 06/06/2025 .....	2.670.530	4,30
		<u>4.369.547</u>	<u>7,03</u>
	<b>Bulgarien: 0,90 % (30. Juni 2022: null)</b>		
400.000	Bulgaria Government International Bond 3.12% 26/03/2035 .....	382.143	0,61
300.000	Bulgaria Government International Bond 1.38% 23/09/2050 .....	180.406	0,29
		<u>562.549</u>	<u>0,90</u>
	<b>Chile: 10,68 % (30. Juni 2022: 6,81 %)</b>		
1.100.000	Chile Government International Bond 1.62% 30/01/2025 .....	1.161.685	1,87
1.100.000	Chile Government International Bond 1.44% 01/02/2029 .....	1.051.646	1,69
1.480.000	Chile Government International Bond 2.55% 27/07/2033 .....	1.213.128	1,95
1.130.000	Chile Government International Bond 4.34% 07/03/2042 .....	1.006.000	1,62
350.000	Chile Government International Bond 1.25% 22/01/2051 .....	200.802	0,32
2.200.000	Chile Government International Bond 0.56% 21/01/2029 .....	2.005.104	3,23
		<u>6.638.365</u>	<u>10,68</u>
	<b>Kolumbien: 5,60 % (30. Juni 2022: 5,13 %)</b>		
240.000	Colombia Government International Bond 4.00% 26/02/2024 .....	236.593	0,38
2.800.000	Colombia Government International Bond 7.37% 18/09/2037 .....	2.667.423	4,29
900.000	Colombia Government International Bond 4.13% 22/02/2042 .....	576.170	0,93
		<u>3.480.186</u>	<u>5,60</u>
	<b>Costa Rica: 1,68 % (30. Juni 2022: 0,63 %)</b>		
400.000	Costa Rica Government International Bond 6.12% 19/02/2031 .....	398.100	0,64
750.000	Costa Rica Government International Bond 5.63% 30/04/2043 .....	646.177	1,04
		<u>1.044.277</u>	<u>1,68</u>
	<b>Kroatien: null (30. Juni 2022: 3,27 %)</b>		
	<b>Dominikanische Republik: 4,68 % (30. Juni 2022: 4,33 %)</b>		
1.250.000	Dominican Republic Government International Bond 5.87% 30/01/2060 .....	971.800	1,56
1.500.000	Dominican Republic Government International Bond 6.00% 19/07/2028 .....	1.465.691	2,36
550.000	Dominican Republic Government International Bond 4.88% 23/09/2032 .....	469.504	0,76
		<u>2.906.995</u>	<u>4,68</u>
	<b>Ghana: null (30. Juni 2022: 1,52 %)</b>		
	<b>Ungarn: 1,88 % (30. Juni 2022: 3,41 %)</b>		
100.000	Hungary Government International Bond 1.63% 28/04/2032 .....	83.259	0,13
1.170.000	Hungary Government International Bond 3.12% 21/09/2051 .....	730.071	1,18
500.000	Hungary Government International Bond 3.12% 21/09/2051 .....	311.996	0,50
50.000	Hungary Government International Bond 1.63% 28/04/2032 .....	41.629	0,07
		<u>1.166.955</u>	<u>1,88</u>
	<b>Israel: 5,23 % (30. Juni 2022: 6,26 %)</b>		
2.250.000	Israel Government International Bond 2.75% 03/07/2030 .....	1.990.350	3,20

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 91,55 % (30. Juni 2022: 95,23 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 91,55 % (30. Juni 2022: 95,23 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Israel: 5,23 % (30. Juni 2022: 6,26 %) (Fortsetzung)</b>		
1.160.000	Israel Government International Bond 3.87% 03/07/2050 .....	953.567	1,54
400.000	Israel Government International Bond 3.80% 13/05/2060 .....	304.733	0,49
		<u>3.248.650</u>	<u>5,23</u>
	<b>Elfenbeinküste: 1,50 % (30. Juni 2022: 1,27 %)</b>		
300.000	Ivory Coast Government International Bond 6.87% 17/10/2040 .....	249.333	0,40
800.000	Ivory Coast Government International Bond 4.88% 30/01/2032 .....	681.721	1,10
		<u>931.054</u>	<u>1,50</u>
	<b>Kenia: 1,16 % (30. Juni 2022: 1,04 %)</b>		
400.000	Republic of Kenya Government International Bond 8.00% 22/05/2032 .....	338.926	0,54
200.000	Republic of Kenya Government International Bond 6.87% 24/06/2024 .....	190.734	0,31
200.000	Republic of Kenya Government International Bond 6.88% 24/06/2024 .....	190.734	0,31
		<u>720.394</u>	<u>1,16</u>
	<b>Mazedonien: 0,33 % (30. Juni 2022: 0,34 %)</b>		
230.000	North Macedonia Government International Bond 1.63% 10/03/2028 .....	203.892	0,33
		<u>203.892</u>	<u>0,33</u>
	<b>Mexiko: null (30. Juni 2022: 9,35 %)</b>		
	<b>Mongolei: 0,54 % (30. Juni 2022: 0,54 %)</b>		
400.000	Mongolia Government International Bond 3.50% 07/07/2027 .....	334.528	0,54
		<u>334.528</u>	<u>0,54</u>
	<b>Montenegro: 0,15 % (30. Juni 2022: 0,27 %)</b>		
100.000	Montenegro Government International Bond 2.88% 16/12/2027 .....	90.482	0,15
		<u>90.482</u>	<u>0,15</u>
	<b>Panama: 4,31 % (30. Juni 2022: 5,04 %)</b>		
400.000	Panama Government International Bond 3.16% 23/01/2030 .....	351.201	0,57
1.200.000	Panama Government International Bond 2.25% 29/09/2032 .....	920.000	1,48
1.750.000	Panama Government International Bond 3.87% 23/07/2060 .....	1.164.319	1,87
250.000	Panama Government International Bond 4.00% 22/09/2024 .....	245.070	0,39
		<u>2.680.590</u>	<u>4,31</u>
	<b>Paraguay: 0,90 % (30. Juni 2022: 1,00 %)</b>		
430.000	Paraguay Government International Bond 6.10% 11/08/2044 .....	408.222	0,66
100.000	Paraguay Government International Bond 5.00% 15/04/2026 .....	99.374	0,16
50.000	Paraguay Government International Bond 5.00% 15/04/2026 .....	49.687	0,08
		<u>557.283</u>	<u>0,90</u>
	<b>Peru: 5,11 % (30. Juni 2022: 5,00 %)</b>		
2.550.000	Peruvian Government International Bond 2.78% 23/01/2031 .....	2.186.268	3,52
500.000	Peruvian Government International Bond 3.23% 28/07/2121 .....	303.880	0,49
1.000.000	Peruvian Government International Bond 3.60% 15/01/2072 .....	684.260	1,10
		<u>3.174.408</u>	<u>5,11</u>
	<b>Philippinen: 8,98 % (30. Juni 2022: 7,25 %)</b>		
200.000	Philippine Government International Bond 3.95% 20/01/2040 .....	172.282	0,28
950.000	Philippine Government International Bond 4.20% 21/01/2024 .....	942.766	1,52
2.250.000	Philippine Government International Bond 3.70% 02/02/2042 .....	1.848.164	2,97
1.500.000	Philippine Government International Bond 3.00% 01/02/2028 .....	1.400.325	2,25
800.000	Philippine Government International Bond 1.65% 10/06/2031 .....	631.886	1,02
700.000	Philippine Government International Bond 1.20% 28/04/2033 .....	585.536	0,94
		<u>5.580.959</u>	<u>8,98</u>
	<b>Polen: 10,03 % (30. Juni 2022: 5,56 %)</b>		
400.000	Republic of Poland Government International Bond 3.25% 06/04/2026 .....	385.436	0,62
1.300.000	Republic of Poland Government International Bond 2.75% 25/05/2032 .....	1.302.732	2,10
1.600.000	Republic of Poland Government International Bond 0.00% 07/07/2023 .....	1.745.173	2,81

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 91,55 % (30. Juni 2022: 95,23 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 91,55 % (30. Juni 2022: 95,23 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Polen: 10,03 % (30. Juni 2022: 5,56 %) (Fortsetzung)</b>		
1.700.000	Republic of Poland Government International Bond 1.13% 07/08/2026 .....	1.739.828	2,80
1.100.000	Republic of Poland Government International Bond 1.00% 25/10/2028 .....	1.060.272	1,70
		<u>6.233.441</u>	<u>10,03</u>
	<b>Rumänien: 9,70 % (30. Juni 2022: 8,43 %)</b>		
3.000.000	Romanian Government International Bond 4.62% 03/04/2049 .....	2.535.699	4,08
2.100.000	Romanian Government International Bond 2.87% 28/10/2024 .....	2.257.909	3,63
1.300.000	Romanian Government International Bond 2.88% 11/03/2029 .....	1.236.421	1,99
		<u>6.030.029</u>	<u>9,70</u>
	<b>Senegal: 1,31 % (30. Juni 2022: 0,64 %)</b>		
250.000	Senegal Government International Bond 6.25% 23/05/2033 .....	209.921	0,34
200.000	Senegal Government International Bond 6.25% 23/05/2033 .....	167.937	0,27
600.000	Senegal Government International Bond 5.37% 08/06/2037 .....	439.154	0,70
		<u>817.012</u>	<u>1,31</u>
	<b>Serbien: 1,48 % (30. Juni 2022: 1,35 %)</b>		
1.000.000	Serbia Government International Bond 1.50% 26/06/2029 .....	845.945	1,36
100.000	Serbia Government International Bond 1.65% 03/03/2033 .....	72.991	0,12
		<u>918.936</u>	<u>1,48</u>
	<b>Südafrika: 3,87 % (30. Juni 2022: 3,99 %)</b>		
550.000	Republic of South Africa Government International Bond 5.75% 30/09/2049 ...	390.692	0,63
2.200.000	Republic of South Africa Government International Bond 5.87% 22/06/2030 ...	2.012.450	3,24
		<u>2.403.142</u>	<u>3,87</u>
	<b>Südkorea: 1,31 % (30. Juni 2022: 1,74 %)</b>		
900.000	Korea Government International Bond 2.50% 19/06/2029 .....	811.334	1,31
		<u>811.334</u>	<u>1,31</u>
	<b>Uruguay: 2,37 % (30. Juni 2022: 3,08 %)</b>		
1.000.000	Uruguay Government International Bond 4.97% 20/04/2055 .....	975.562	1,57
500.000	Uruguay Government International Bond 4.50% 14/08/2024 .....	499.420	0,80
		<u>1.474.982</u>	<u>2,37</u>
	<b>Staatsanleihen insgesamt</b> .....	<u>56.888.680</u>	<u>91,55</u>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<u>56.888.680</u>	<u>91,55</u>
		<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlageportfolio</b>	56.888.680	91,55
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	5.249.413	8,45
	<b>Nettovermögen</b>	<u>62.138.093</u>	<u>100,00</u>
	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		91,52
	Sonstiges Umlaufvermögen .....		<u>8,48</u>
	Gesamtvermögen .....		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023

## Franklin Metaverse UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,86 %</b>		
	<b>Aktien: 99,86 %</b>		
	<b>Australien: 0,41 %</b>		
7.504	Appen Ltd .....	11.938	0,41
		<u>11.938</u>	<u>0,41</u>
	<b>Kaimaninseln: 6,51 %</b>		
15.500	AAC Technologies Holdings Inc .....	36.472	1,25
324	Ambarella Inc .....	27.109	0,93
3.231	Galaxy Digital Holdings Ltd .....	13.991	0,48
3.941	Himax Technologies Inc ADR .....	26.602	0,91
7.500	NetDragon Websoft Holdings Ltd .....	14.107	0,49
3.500	Sunny Optical Technology Group Co Ltd .....	34.903	1,20
10.740	Zhen Ding Technology Holding Ltd .....	36.209	1,25
		<u>189.393</u>	<u>6,51</u>
	<b>Irland: 2,81 %</b>		
265	Accenture Plc .....	81.774	2,81
		<u>81.774</u>	<u>2,81</u>
	<b>Japan: 0,58 %</b>		
1.400	COLOPL Inc .....	6.296	0,22
2.600	Wacom Co Ltd .....	10.577	0,36
		<u>16.873</u>	<u>0,58</u>
	<b>Luxemburg: 1,12 %</b>		
182	Globant SA .....	32.709	1,12
		<u>32.709</u>	<u>1,12</u>
	<b>Niederlande: 3,04 %</b>		
1.777	STMicroelectronics NV .....	88.337	3,04
		<u>88.337</u>	<u>3,04</u>
	<b>Norwegen: 0,65 %</b>		
1.546	Nordic Semiconductor ASA .....	18.824	0,65
		<u>18.824</u>	<u>0,65</u>
	<b>Südkorea: 6,09 %</b>		
1.606	MAXST Co Ltd .....	12.712	0,44
1.427	Motrex Co Ltd .....	20.425	0,70
2.561	Namuga Co Ltd .....	28.960	0,99
411	NAVER Corp .....	57.019	1,96
250	Samsung SDS Co Ltd .....	23.318	0,80
1.301	Skonec Entertainment Co Ltd .....	12.194	0,42
9.574	Wysiywg Studios Co Ltd .....	22.634	0,78
		<u>177.262</u>	<u>6,09</u>
	<b>Schweden: 0,74 %</b>		
601	Mycronic AB .....	14.856	0,51
298	Surgical Science Sweden AB .....	6.655	0,23
		<u>21.511</u>	<u>0,74</u>
	<b>Taiwan: 2,15 %</b>		
12.000	Altek Corp .....	13.139	0,45
9.000	Career Technology MFG. Co Ltd .....	7.715	0,26
22.785	HTC Corp .....	41.774	1,44
		<u>62.628</u>	<u>2,15</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 0,48 %</b>		
8.614	S4 Capital Plc .....	13.799	0,48
		<u>13.799</u>	<u>0,48</u>
	<b>Vereinigte Staaten: 75,28 %</b>		
982	Activision Blizzard Inc .....	82.783	2,85
180	Adobe Inc .....	88.018	3,03

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin Metaverse UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,86 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,86 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigte Staaten: 75,28 % (Fortsetzung)</b>		
802	Advanced Micro Devices Inc .....	91.356	3,14
871	Alphabet Inc .....	105.365	3,62
663	Apple Inc .....	128.602	4,42
380	Autodesk Inc .....	77.752	2,67
1.665	Block Inc .....	110.839	3,81
549	CEVA Inc .....	14.027	0,48
6.021	Cleantech Inc .....	25.830	0,89
389	Coherent Corp .....	19.831	0,68
1.214	Coinbase Global Inc .....	86.862	2,99
717	Electronic Arts Inc .....	92.995	3,20
2.811	eXp World Holdings Inc .....	57.007	1,96
23.935	fuboTV Inc .....	49.785	1,71
1.855	Immersion Corp .....	13.133	0,45
6.900	Lumen Technologies Inc .....	15.594	0,54
4.854	Marathon Digital Holdings Inc .....	67.277	2,31
872	Matterport Inc .....	2.747	0,09
463	Meta Platforms Inc .....	132.872	4,57
292	Microsoft Corp .....	99.438	3,42
147	MicroStrategy Inc .....	50.336	1,73
1.725	MicroVision Inc .....	7.901	0,27
309	NVIDIA Corp .....	130.713	4,49
2.569	Overstock.com Inc .....	83.672	2,88
1.506	PayPal Holdings Inc .....	100.495	3,45
428	PTC Inc .....	60.904	2,09
780	QUALCOMM Inc .....	92.851	3,19
3.742	Riot Blockchain Inc .....	44.230	1,52
2.329	Robinhood Markets Inc .....	23.243	0,80
1.808	ROBLOX Corp .....	72.862	2,50
6.683	Snap Inc .....	79.127	2,72
1.509	Unity Software Inc .....	65.521	2,25
1.095	Xerox Holdings Corp .....	16.305	0,56
		<b>2.190.273</b>	<b>75,28</b>
	<b>Aktien insgesamt</b> .....	<b>2.905.321</b>	<b>99,86</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<b>2.905.321</b>	<b>99,86</b>
		<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlageportfolio</b>	2.905.321	99,86
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	4.150	0,14
	<b>Nettovermögen</b>	<b>2.909.471</b>	<b>100,00</b>
			<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind .....		99,79
	Sonstiges Umlaufvermögen .....		0,21
	<b>Gesamtvermögen</b> .....		<b>100,00</b>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 %</b>		
	<b>Aktien: 99,93 %</b>		
	<b>Bermuda: 0,64 %</b>		
4.000	Alibaba Health Information Technology Ltd .....	2.404	0,05
60.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd .....	14.241	0,28
8.000	China Ruyi Holdings Ltd .....	1.878	0,03
96	Credicorp Ltd .....	14.174	0,28
		<b>32.697</b>	<b>0,64</b>
	<b>Brasilien: 5,37 %</b>		
6.400	Ambev SA .....	20.444	0,40
9.800	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	29.680	0,59
1.800	Banco BTG Pactual SA .....	11.735	0,23
4.200	BB Seguridade Participacoes SA .....	26.790	0,53
1.200	CCR SA .....	3.495	0,07
1.800	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo .....	21.108	0,42
6.400	Hapvida Participacoes e Investimentos S/A .....	5.811	0,11
800	Hypera SA .....	7.630	0,15
6.400	Itau Unibanco Holding SA (preferred stock) .....	37.705	0,74
7.600	Itausa SA .....	15.187	0,30
1.004	Localiza Rent a Car SA .....	14.257	0,28
4.600	Lojas Renner SA .....	19.071	0,38
3.800	Magazine Luiza SA .....	2.655	0,05
1.000	Natura & Co Holding SA .....	3.470	0,07
1.664	Raia Drogasil SA .....	10.210	0,20
400	Rede D'Or Sao Luiz SA .....	2.730	0,05
800	Telefonica Brasil SA .....	7.176	0,14
2.800	TIM SA .....	8.486	0,17
3.200	WEG SA .....	25.042	0,49
		<b>272.682</b>	<b>5,37</b>
	<b>Kaimaninseln: 16,00 %</b>		
2.000	3SBio Inc .....	2.008	0,04
160	Airtac International Group .....	5.266	0,10
600	Akeso Inc .....	2.707	0,05
13.600	Alibaba Group Holding Ltd .....	140.918	2,78
400	ANTA Sports Products Ltd .....	4.086	0,08
54	Autohome Inc ADR .....	1.575	0,03
2.100	Baidu Inc .....	35.587	0,70
500	BeiGene Ltd .....	6.852	0,13
80	Bilibili Inc .....	1.191	0,02
4.000	Bosideng International Holdings Ltd .....	1.684	0,03
1.360	Chailease Holding Co Ltd .....	8.908	0,18
22.000	China Conch Venture Holdings Ltd .....	28.635	0,56
2.000	China Feihe Ltd .....	1.113	0,02
400	China Literature Ltd .....	1.682	0,03
10.000	China Medical System Holdings Ltd .....	16.283	0,32
3.400	China Resources Land Ltd .....	14.404	0,28
2.000	Country Garden Services Holdings Co Ltd .....	2.583	0,05
500	East Buy Holding Ltd .....	1.627	0,03
1.286	Genscript Biotech Corp .....	2.888	0,06
114	H World Group Ltd ADR .....	4.421	0,09
1.000	Haidilao International Holding Ltd .....	2.200	0,04
1.000	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd .....	1.608	0,03
800	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd .....	4.328	0,09
1.000	Innovent Biologics Inc .....	3.777	0,07
254	iQIYI Inc ADR .....	1.356	0,03
1.100	JD Health International Inc .....	6.941	0,14
1.600	JD.com Inc .....	27.032	0,53
1.200	Jiumaojiu International Holdings Ltd .....	1.966	0,04
60	JOYY Inc ADR .....	1.843	0,04

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Kaimaninseln: 16,00 % (Fortsetzung)</b>		
168	Kanzhun Ltd ADR .....	2.528	0,05
262	KE Holdings Inc ADR .....	3.891	0,08
2.000	Kingdee International Software Group Co Ltd .....	2.675	0,05
400	Kingsoft Corp Ltd .....	1.575	0,03
1.800	Kuaishou Technology .....	12.300	0,24
52	Legend Biotech Corp ADR .....	3.590	0,07
800	Li Auto Inc .....	13.833	0,27
1.500	Li Ning Co Ltd .....	8.068	0,16
1.000	Longfor Group Holdings Ltd .....	2.430	0,05
3.800	Meituan .....	59.304	1,17
200	Microport Scientific Corp .....	361	0,01
1.270	NetEase Inc .....	24.730	0,49
1.200	New Oriental Education & Technology Group Inc .....	4.709	0,09
348	Pinduoduo Inc ADR .....	24.061	0,47
600	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd .....	1.450	0,03
800	Shenzhen International Group Holdings Ltd .....	7.631	0,15
1.180	Silergy Corp .....	14.587	0,29
10.000	Sino Biopharmaceutical Ltd .....	4.351	0,09
400	Sunny Optical Technology Group Co Ltd .....	3.989	0,08
340	TAL Education Group ADR .....	2.026	0,04
5.148	Tencent Holdings Ltd .....	217.834	4,29
130	Tencent Music Entertainment Group ADR .....	959	0,02
2.000	Topsports International Holdings Ltd .....	1.733	0,03
536	Trip.com Group Ltd .....	18.645	0,37
60	Weibo Corp ADR .....	787	0,02
2.674	Wuxi Biologics Cayman Inc .....	12.813	0,25
18.300	Xinyi Solar Holdings Ltd .....	21.133	0,42
400	XPeng Inc .....	2.552	0,05
400	Yihai International Holding Ltd .....	856	0,02
600	Zai Lab Ltd .....	1.608	0,03
		<b>812.478</b>	<b>16,00</b>
	<b>Chile: 0,91 %</b>		
76.594	Banco de Chile .....	7.991	0,16
128	Banco de Credito e Inversiones SA .....	3.909	0,08
196.406	Banco Santander Chile .....	9.290	0,18
2.596	Falabella SA .....	6.230	0,12
260	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA .....	18.929	0,37
		<b>46.349</b>	<b>0,91</b>
	<b>China: 12,10 %</b>		
300	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'B' Shares .....	5.168	0,10
200	Anhui Kouzi Distillery Co Ltd .....	1.357	0,03
4.000	Beijing Dabeinong Technology Group Co Ltd .....	3.629	0,07
600	BYD Co Ltd 'A' Shares .....	21.301	0,42
1.980	BYD Co Ltd 'H' Shares .....	63.165	1,24
400	By-health Co Ltd .....	1.318	0,03
3.800	CECEP Solar Energy Co Ltd .....	3.541	0,07
4.800	CECEP Wind-Power Corp .....	2.421	0,05
100	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd .....	1.699	0,03
18.000	China Cinda Asset Management Co Ltd .....	1.792	0,04
1.000	China Galaxy Securities Co Ltd .....	533	0,01
800	China International Capital Corp Ltd 'H' Shares .....	1.403	0,03
10.000	China Life Insurance Co Ltd .....	16.665	0,33
28.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd .....	28.834	0,57
25.800	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd .....	19.045	0,38
4.000	China Vanke Co Ltd 'H' Shares .....	5.370	0,11
5.400	China Yangtze Power Co Ltd .....	16.375	0,32

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 12,10 % (Fortsetzung)</b>		
2.000	CITIC Securities Co Ltd 'H' Shares .....	3.624	0,07
360	Contemporary Amperex Technology Co Ltd .....	11.322	0,22
400	Dajin Heavy Industry Co Ltd .....	1.696	0,03
600	DHC Software Co Ltd .....	582	0,01
400	Dong-E-E-Jiao Co Ltd .....	2.939	0,06
200	Eve Energy Co Ltd .....	1.663	0,03
1.000	Fangda Carbon New Material Co Ltd .....	852	0,02
800	Focus Media Information Technology Co Ltd .....	749	0,01
240	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd .....	1.546	0,03
400	Ganfeng Lithium Group Co Ltd 'H' Shares .....	2.608	0,05
1.000	GEM Co Ltd .....	950	0,02
400	Ginlong Technologies Co Ltd .....	5.724	0,11
200	GoodWe Technologies Co Ltd .....	4.587	0,09
600	Gotion High-tech Co Ltd .....	2.278	0,04
2.600	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai .....	13.049	0,26
400	Guangzhou Haige Communications Group Inc Co .....	569	0,01
200	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd .....	1.838	0,04
400	Haier Smart Home Co Ltd 'H' Shares .....	1.258	0,02
12.800	Haitong Securities Co Ltd .....	7.840	0,15
1.200	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd .....	4.993	0,10
100	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'A' Shares .....	887	0,02
200	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' Shares .....	1.139	0,02
1.400	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd .....	3.504	0,07
2.200	Hengtong Optic-electric Co Ltd .....	4.433	0,09
400	Hongfa Technology Co Ltd .....	1.751	0,03
400	Huadong Medicine Co Ltd .....	2.385	0,05
2.800	Huatai Securities Co Ltd 'H' Shares .....	3.459	0,07
3.080	JA Solar Technology Co Ltd .....	17.655	0,35
4.000	Jiangsu Expressway Co Ltd .....	3.685	0,07
200	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd .....	1.317	0,03
200	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd .....	1.452	0,03
200	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd .....	3.611	0,07
82	Kweichow Moutai Co Ltd .....	19.061	0,38
200	Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd .....	622	0,01
6.800	LONGi Green Energy Technology Co Ltd .....	26.799	0,53
100	Luzhou Laojiao Co Ltd .....	2.881	0,06
2.000	Ming Yang Smart Energy Group Ltd .....	4.641	0,09
200	Muyuan Foods Co Ltd .....	1.159	0,02
7.440	NARI Technology Co Ltd .....	23.625	0,47
800	Nongfu Spring Co Ltd .....	4.415	0,09
1.000	Riyue Heavy Industry Co Ltd .....	2.610	0,05
600	Sany Heavy Industry Co Ltd .....	1.372	0,03
200	Shandong Buchang Pharmaceuticals Co Ltd .....	566	0,01
3.200	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd .....	4.181	0,08
1.400	Shanghai Aiko Solar Energy Co Ltd .....	5.918	0,12
240	Shanghai Baosight Software Co Ltd .....	1.676	0,03
7.400	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd .....	4.603	0,09
580	Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd .....	3.047	0,06
600	Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd .....	619	0,01
400	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd .....	377	0,01
100	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd .....	2.544	0,05
2.400	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd 'A' Shares .....	1.524	0,03
600	Shenzhen Capchem Technology Co Ltd .....	4.280	0,08
160	Shenzhen Dynanonic Co Ltd .....	2.424	0,05
1.200	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd .....	10.592	0,21
100	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd .....	4.121	0,08
600	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd .....	2.572	0,05

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 12,10 % (Fortsetzung)</b>		
1.200	Shenzhen Senior Technology Material Co Ltd .....	2.835	0,06
3.600	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd .....	7.448	0,15
1.400	Sichuan New Energy Power Co Ltd .....	2.771	0,05
1.600	Sinoma Science & Technology Co Ltd .....	4.513	0,09
1.400	Sungrow Power Supply Co Ltd .....	22.445	0,44
1.200	Sunwoda Electronic Co Ltd .....	2.692	0,05
3.000	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd .....	13.691	0,27
200	Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co Ltd .....	831	0,02
1.800	Titan Wind Energy Suzhou Co Ltd .....	3.768	0,07
4.000	Tongwei Co Ltd .....	18.865	0,37
4.000	TravelSky Technology Ltd .....	6.789	0,13
500	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H' Shares .....	4.543	0,09
600	Unisplendour Corp Ltd .....	2.627	0,05
400	Wens Foodstuffs Group Co Ltd .....	1.009	0,02
300	Wuliangye Yibin Co Ltd .....	6.745	0,13
600	WuXi AppTec Co Ltd 'H' Shares .....	4.785	0,09
3.200	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'A' Shares .....	4.671	0,09
280	Yealink Network Technology Corp Ltd .....	1.350	0,03
400	Yintai Gold Co Ltd .....	643	0,01
200	Yunda Holding Co Ltd .....	263	0,01
400	Yunnan Baiyao Group Co Ltd .....	2.886	0,06
100	Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co Ltd .....	3.936	0,08
2.000	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd .....	7.602	0,15
8.000	Zhejiang Expressway Co Ltd .....	6.074	0,12
200	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd .....	506	0,01
200	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd .....	1.262	0,02
200	Zhejiang NHU Co Ltd .....	423	0,01
800	Zhejiang Weiming Environment Protection Co Ltd .....	1.926	0,04
600	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd .....	1.631	0,03
4.400	Zhuzhou CRRR Times Electric Co Ltd 'H' Shares .....	16.395	0,32
3.200	ZTE Corp 'H' Shares .....	12.822	0,25
		<b>614.537</b>	<b>12,10</b>
	<b>Kolumbien: 0,05 %</b>		
678	Interconexion Electrica SA ESP .....	2.742	0,05
		<b>2.742</b>	<b>0,05</b>
	<b>Tschechische Republik: 0,21 %</b>		
202	Komerčni Banka AS .....	6.164	0,12
1.228	Moneta Money Bank AS .....	4.500	0,09
		<b>10.664</b>	<b>0,21</b>
	<b>Griechenland: 0,98 %</b>		
1.228	Hellenic Telecommunications Organization SA .....	21.048	0,42
244	JUMBO SA .....	6.708	0,13
246	OPAP SA .....	4.289	0,08
810	Terna Energy SA .....	17.851	0,35
		<b>49.896</b>	<b>0,98</b>
	<b>Hongkong: 0,72 %</b>		
5.000	China Overseas Land & Investment Ltd .....	10.897	0,21
1.336	China Resources Beer Holdings Co Ltd .....	8.797	0,17
10.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd .....	8.690	0,17
400	Hua Hong Semiconductor Ltd .....	1.307	0,03
6.000	Yuexiu Property Co Ltd .....	6.975	0,14
		<b>36.666</b>	<b>0,72</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Ungarn: 0,33 %</b>		
324	OTP Bank Nyrt .....	11.495	0,23
218	Richter Gedeon Nyrt .....	5.369	0,10
		<b>16.864</b>	<b>0,33</b>
	<b>Indien: 16,79 %</b>		
894	Adani Green Energy Ltd .....	10.308	0,20
1.042	Asian Paints Ltd .....	42.704	0,84
554	AU Small Finance Bank Ltd .....	5.090	0,10
346	Aurobindo Pharma Ltd .....	3.068	0,06
218	Avenue Supermarts Ltd .....	10.335	0,20
1.068	Axis Bank Ltd .....	12.855	0,25
316	Bajaj Finance Ltd .....	27.582	0,54
1.176	Bajaj Finserv Ltd .....	21.904	0,43
74	Bajaj Holdings & Investment Ltd .....	6.318	0,12
926	Berger Paints India Ltd .....	7.654	0,15
39.358	Bharat Electronics Ltd .....	60.330	1,19
1.084	Bharat Forge Ltd .....	11.057	0,22
2.210	Bharti Airtel Ltd .....	23.673	0,47
88	Britannia Industries Ltd .....	5.390	0,11
874	Cholamandalam Investment and Finance Co Ltd .....	12.167	0,24
400	Cipla Ltd .....	4.949	0,10
1.372	Colgate-Palmolive India Ltd .....	28.232	0,56
390	Container Corp Of India Ltd .....	3.146	0,06
1.046	Dabur India Ltd .....	7.305	0,14
134	Divi's Laboratories Ltd .....	5.854	0,12
558	DLF Ltd .....	3.337	0,07
116	Dr Reddy's Laboratories Ltd .....	7.296	0,14
544	Godrej Consumer Products Ltd .....	7.168	0,14
126	Godrej Properties Ltd .....	2.409	0,05
1.544	Havells India Ltd .....	24.144	0,48
1.322	HCL Technologies Ltd .....	19.144	0,38
986	HDFC Life Insurance Co Ltd .....	7.827	0,15
1.376	Hindustan Unilever Ltd .....	44.921	0,89
1.606	Housing Development Finance Corp Ltd .....	55.245	1,09
4.768	ICICI Bank Ltd .....	54.320	1,07
588	ICICI Lombard General Insurance Co Ltd .....	9.636	0,19
540	ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd .....	3.768	0,07
228	Indian Railway Catering & Tourism Corp Ltd .....	1.765	0,04
92	Info Edge India Ltd .....	5.028	0,10
3.356	Infosys Ltd .....	54.634	1,08
160	Jubilant Foodworks Ltd .....	978	0,02
722	Kotak Mahindra Bank Ltd .....	16.251	0,32
258	Lupin Ltd .....	2.839	0,06
518	Max Healthcare Institute Ltd .....	3.785	0,07
26	Nestle India Ltd .....	7.256	0,14
10	Page Industries Ltd .....	4.589	0,09
216	PI Industries Ltd .....	10.326	0,20
130	Pidilite Industries Ltd .....	4.116	0,08
178	SBI Cards & Payment Services Ltd .....	1.838	0,04
530	SBI Life Insurance Co Ltd .....	8.443	0,17
802	Shriram Finance Ltd .....	16.964	0,33
204	Siemens Ltd .....	9.366	0,18
1.104	Sun Pharmaceutical Industries Ltd .....	14.152	0,28
938	Tata Consultancy Services Ltd .....	37.758	0,74
3.892	Tata Consumer Products Ltd .....	40.843	0,80
868	Tech Mahindra Ltd .....	11.965	0,24
502	Titan Co Ltd .....	18.649	0,37

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 16,79 % (Fortsetzung)</b>		
182	Torrent Pharmaceuticals Ltd .....	4.226	0,08
246	Trent Ltd .....	5.290	0,10
550	United Spirits Ltd .....	6.116	0,12
110	UPL Ltd .....	922	0,02
2.752	Wipro Ltd .....	12.334	0,24
4.014	Yes Bank Ltd .....	795	0,02
2.250	Zomato Ltd .....	2.058	0,04
		<u>852.422</u>	<u>16,79</u>
	<b>Indonesien: 0,73 %</b>		
49.800	Bank Central Asia Tbk PT .....	30.393	0,60
32.800	Merdeka Copper Gold Tbk PT .....	6.695	0,13
		<u>37.088</u>	<u>0,73</u>
	<b>Kuwait: 0,14 %</b>		
1.517	Boubyan Bank KSCP .....	3.159	0,06
1.346	National Bank of Kuwait SAKP .....	4.095	0,08
		<u>7.254</u>	<u>0,14</u>
	<b>Luxemburg: 0,41 %</b>		
1.502	Allegro.eu SA .....	11.830	0,23
404	Reinet Investments SCA .....	8.916	0,18
		<u>20.746</u>	<u>0,41</u>
	<b>Malaysia: 0,81 %</b>		
2.200	Genting Malaysia Bhd .....	1.160	0,02
1.600	Hong Leong Bank Bhd .....	6.499	0,13
3.200	IHH Healthcare Bhd .....	4.038	0,08
3.400	Malayan Banking Bhd .....	6.287	0,13
800	Malaysia Airports Holdings Bhd .....	1.179	0,02
3.000	Maxis Bhd .....	2.635	0,05
40	Nestle Malaysia Bhd .....	1.123	0,02
1.000	PPB Group Bhd .....	3.372	0,07
18.000	Public Bank Bhd .....	14.847	0,29
		<u>41.140</u>	<u>0,81</u>
	<b>Mexiko: 3,02 %</b>		
4.202	America Movil SAB de CV .....	4.557	0,09
126	Arca Continental SAB de CV .....	1.293	0,03
666	Coca-Cola Femsa SAB de CV .....	5.556	0,11
5.436	Fibra Uno Administracion SA de CV .....	7.924	0,16
4.040	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV .....	72.372	1,42
440	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV .....	12.243	0,24
2.670	Grupo Financiero Banorte SAB de CV .....	21.984	0,43
3.512	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV .....	8.326	0,16
2.744	Grupo Televisa SAB .....	2.817	0,06
2.786	Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV .....	2.646	0,05
2.976	Orbia Advance Corp SAB de CV .....	6.399	0,13
724	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV .....	7.239	0,14
		<u>153.356</u>	<u>3,02</u>
	<b>Niederlande: 0,52 %</b>		
4.514	NEPI Rockcastle NV .....	26.396	0,52
		<u>26.396</u>	<u>0,52</u>
	<b>Philippinen: 0,10 %</b>		
3.000	Ayala Land Inc .....	1.321	0,02
3.880	Metropolitan Bank & Trust Co .....	3.915	0,08
		<u>5.236</u>	<u>0,10</u>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Polen: 1,40 %</b>		
324	Bank Polska Kasa Opieki SA .....	8.836	0,17
64	CD Projekt SA .....	2.439	0,05
400	Cyfrowy Polsat SA .....	1.625	0,03
68	Dino Polska SA .....	7.947	0,16
3	LPP SA .....	10.345	0,20
1.450	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA .....	12.901	0,26
1.060	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA .....	10.282	0,20
176	Santander Bank Polska SA .....	16.851	0,33
		<u>71.226</u>	<u>1,40</u>
	<b>Katar: 0,67 %</b>		
12.080	Masraf Al Rayan QSC .....	8.506	0,17
35.602	Mesaieed Petrochemical Holding Co .....	18.583	0,37
2.000	Qatar International Islamic Bank QSC .....	5.495	0,11
258	Qatar Islamic Bank SAQ .....	1.255	0,02
		<u>33.839</u>	<u>0,67</u>
	<b>Saudi-Arabien: 5,71 %</b>		
254	Advanced Petrochemical Co .....	2.986	0,06
2.850	Al Rajhi Bank .....	55.470	1,09
2.022	Alinma Bank .....	18.060	0,35
306	Almarai Co JSC .....	4.952	0,10
1.328	Arab National Bank .....	9.330	0,18
1.382	Bank AlBilad .....	14.260	0,28
2.408	Bank Al-Jazira .....	11.736	0,23
1.020	Banque Saudi Fransi .....	11.340	0,22
104	Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co .....	5.146	0,10
18	Dallah Healthcare Co .....	805	0,02
2.482	Dar Al Arkan Real Estate Development Co .....	10.151	0,20
72	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co .....	5.494	0,11
2.176	Emaar Economic City .....	5.430	0,11
630	Etihad Etisalat Co .....	8.046	0,16
1.840	Jarir Marketing Co .....	8.114	0,16
24	Mouwasat Medical Services Co .....	1.549	0,03
2.130	Riyad Bank .....	19.110	0,38
424	SABIC Agri-Nutrients Co .....	14.651	0,29
1.538	Saudi Awwal Bank .....	15.644	0,31
4.566	Saudi National Bank .....	44.799	0,88
68	Saudi Tadawul Group Holding Co .....	3.412	0,07
1.658	Saudi Telecom Co .....	19.229	0,38
		<u>289.714</u>	<u>5,71</u>
	<b>Südafrika: 2,84 %</b>		
684	Absa Group Ltd .....	6.079	0,12
82	Bidvest Group Ltd .....	1.136	0,02
116	Capitec Bank Holdings Ltd .....	9.627	0,19
338	Clicks Group Ltd .....	4.675	0,09
1.016	Discovery Ltd .....	7.844	0,16
5.792	FirstRand Ltd .....	21.002	0,41
17.396	Growthpoint Properties Ltd .....	10.737	0,21
504	Mr Price Group Ltd .....	3.847	0,08
304	MultiChoice Group .....	1.537	0,03
224	Naspers Ltd .....	40.303	0,80
44.516	Old Mutual Ltd .....	28.560	0,56
2.826	Sanlam Ltd .....	8.729	0,17
		<u>144.076</u>	<u>2,84</u>
	<b>Südkorea: 10,75 %</b>		
20	Amorepacific Corp .....	1.481	0,03

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 10,75 % (Fortsetzung)</b>		
74	Celltrion Healthcare Co Ltd .....	3.679	0,07
80	Celltrion Inc .....	9.283	0,18
10	Celltrion Pharm Inc .....	579	0,01
100	Coway Co Ltd .....	3.335	0,07
36	DB Insurance Co Ltd .....	2.038	0,04
12	Hanmi Pharm Co Ltd .....	2.810	0,06
274	Hanwha Solutions Corp .....	8.796	0,17
92	HLB Inc .....	2.269	0,04
6	HYBE Co Ltd .....	1.282	0,03
106	Ilgjin Materials Co Ltd .....	3.877	0,08
236	Kakao Corp .....	8.794	0,17
18	Kakao Games Corp .....	449	0,01
272	KakaoBank Corp .....	4.903	0,10
102	Kangwon Land Inc .....	1.345	0,03
52	Korea Investment Holdings Co Ltd .....	2.036	0,04
8	Krafton Inc .....	1.183	0,02
76	L&F Co Ltd .....	14.016	0,28
16	LG Energy Solution Ltd .....	6.715	0,13
10	LG H&H Co Ltd .....	3.483	0,07
30	Meritz Financial Group Inc .....	945	0,02
112	NAVER Corp .....	15.538	0,31
14	NCSOFT Corp .....	3.134	0,06
16	Netmarble Corp .....	596	0,01
2.246	NH Investment & Securities Co Ltd .....	16.278	0,32
14	Orion Corp .....	1.275	0,02
16	Samsung Biologics Co Ltd .....	9.034	0,18
658	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd .....	72.160	1,42
2.992	Samsung Electronics Co Ltd .....	163.945	3,23
156	Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock) .....	7.044	0,14
2.816	Samsung Heavy Industries Co Ltd .....	14.255	0,28
100	Samsung Life Insurance Co Ltd .....	5.108	0,10
232	Samsung SDI Co Ltd .....	117.792	2,32
80	Samsung Securities Co Ltd .....	2.186	0,04
110	SK Biopharmaceuticals Co Ltd .....	6.754	0,13
16	SK Bioscience Co Ltd .....	965	0,02
254	SK Hynix Inc .....	22.207	0,44
90	Yuhan Corp .....	4.126	0,08
		<b>545.695</b>	<b>10,75</b>
	<b>Taiwan: 14,78 %</b>		
740	Accton Technology Corp .....	8.292	0,16
840	Advantech Co Ltd .....	11.045	0,22
12.000	Cathay Financial Holding Co Ltd .....	16.626	0,33
8.880	Delta Electronics Inc .....	98.225	1,93
14.588	E.Sun Financial Holding Co Ltd .....	12.202	0,24
280	Eclat Textile Co Ltd .....	4.491	0,09
14.000	First Financial Holding Co Ltd .....	12.429	0,24
180	Globalwafers Co Ltd .....	2.872	0,06
14.000	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd .....	9.979	0,20
100	Largan Precision Co Ltd .....	6.839	0,13
1.700	MediaTek Inc .....	37.554	0,74
14.000	Mega Financial Holding Co Ltd .....	17.172	0,34
960	Nanya Technology Corp .....	2.182	0,04
220	Nien Made Enterprise Co Ltd .....	2.419	0,05
620	Novatek Microelectronics Corp .....	8.490	0,17
160	PharmaEssentia Corp .....	1.744	0,03
638	Realtek Semiconductor Corp .....	7.938	0,16



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Taiwan: 14,78 % (Fortsetzung)</b>		
10.000	Taishin Financial Holding Co Ltd .....	6.069	0,12
30.000	Taiwan High Speed Rail Corp .....	30.969	0,61
22.400	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	414.275	8,16
4.000	United Microelectronics Corp .....	6.229	0,12
200	Win Semiconductors Corp .....	1.053	0,02
220	Yageo Corp .....	3.472	0,07
38.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd .....	28.185	0,55
		<b>750.751</b>	<b>14,78</b>
	<b>Thailand: 3,25 %</b>		
6.400	Airports of Thailand PCL NVDR .....	12.997	0,26
62.800	Asset World Corp PCL NVDR .....	8.750	0,17
11.800	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR .....	9.236	0,18
11.800	Bangkok Expressway & Metro PCL NVDR .....	2.845	0,06
118.000	BTS Group Holdings PCL NVDR .....	24.795	0,49
200	Bumrungrad Hospital PCL .....	1.275	0,03
4.800	Central Pattana PCL NVDR .....	8.867	0,17
2.800	Central Retail Corp PCL NVDR .....	3.080	0,06
1.000	Delta Electronics Thailand PCL NVDR .....	2.595	0,05
7.400	Energy Absolute PCL NVDR .....	11.897	0,23
6.600	Home Product Center PCL .....	2.606	0,05
6.600	Intouch Holdings PCL .....	13.775	0,27
7.600	Krungthai Card PCL NVDR .....	10.611	0,21
2.600	Minor International PCL NVDR .....	2.512	0,05
600	Muangthai Capital PCL NVDR .....	664	0,01
1.600	Osotspa PCL .....	1.342	0,03
12.600	SCB X PCL NVDR .....	37.848	0,75
6.800	Srisawad Corp PCL NVDR .....	9.062	0,18
		<b>164.757</b>	<b>3,25</b>
	<b>Türkei: 0,21 %</b>		
2.818	Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS .....	5.886	0,12
1.796	Hektas Ticaret TAS .....	2.085	0,04
2.644	Koza Altin Isletmeleri AS .....	2.515	0,05
		<b>10.486</b>	<b>0,21</b>
	<b>Vereinigte Arabische Emirate: 0,15 %</b>		
8.938	Multiply Group PJSC .....	7.690	0,15
		<b>7.690</b>	<b>0,15</b>
	<b>Vereinigte Staaten: 0,34 %</b>		
306	Yum China Holdings Inc .....	17.289	0,34
		<b>17.289</b>	<b>0,34</b>
	<b>Aktien insgesamt</b> .....	<b>5.074.736</b>	<b>99,93</b>
	<b>Wertpapiere insgesamt</b> .....	<b>5.074.736</b>	<b>99,93</b>

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2023 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) %

Devisenterminkontrakte: (0,00) %

Abrechnungs- datum	Betrag gekauft	Betrag verkauft	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
03.07.2023	1.600 QAR	440 USD	State Street	(0)	(0,00)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisenterminkontrakten</b> .....		(0)	(0,00)
		<b>Derivative Finanzinstrumente insgesamt</b> .....		(0)	(0,00)
				<b>Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlageportfolio</b>			5.074.736	99,93
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			3.388	0,07
	<b>Nettovermögen</b>			5.078.124	100,00
	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind.....				99,47
	Sonstiges Umlaufvermögen .....				0,53
	Gesamtvermögen.....				100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

# OFFENLEGUNG ZU VERGÜTUNGEN (UNGEPRÜFT)

## Vergütungspolitik

FTIS ist eine Verwaltungsgesellschaft, die für die Verwaltung von OGAW-Fonds zugelassen ist und nach der Umsetzung der EU-Richtlinie 2014/91/EU zur Änderung der Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (EU-Richtlinie 2009/65/EG) („OGAW V“) am 18. März 2016 dem OGAW-Vergütungskodex unterliegt.

## Zweck und Umfang der Erklärung zur Vergütungspolitik

Die Vergütungspolitik von FTIS wurde entwickelt, um die persönlichen Ziele der Mitarbeiter mit den langfristigen Interessen von FTIS und den von FTIS verwalteten OGAW und AIF abzustimmen. Sie zielt darauf ab, Anreizpraktiken abzuschwächen, welche die Mitarbeiter ermutigen können, unnötige Risiken einzugehen.

Die Vergütungspolitik gilt für eine bestimmte Kategorie von Mitarbeitern, die als identifizierte Mitarbeiter bezeichnet werden, zu denen Mitglieder des Verwaltungsrats, leitende Angestellte, Mitglieder von Kontrollfunktionen, Risikoträger und alle Mitarbeiter mit einer Vergütung gehören, die sie in die gleiche Kategorie wie leitende Angestellte oder Risikoträger einordnet, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder des von ihr verwalteten OGAW haben.

## Beschreibung der Struktur der Vergütung

Die Vergütung beinhaltet einen festen und einen variablen Bestandteil.

**Feste Vergütung:** Die feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt zuzüglich wesentlicher, von der Gesellschaft erbrachter Leistungen, die Dienstwagen, Betriebsrentenbeiträge, private Krankenversicherungsprämien und Lebensversicherungsprämien umfassen können.

Das Grundgehalt (einschließlich Leistungen) wird unter Bezugnahme auf Marktvergleichsdaten (Branchenumfragen) festgelegt, die regelmäßig überprüft werden.

Die Festgehälter werden als ausreichend hoher Anteil an der Gesamtvergütung festgelegt, so dass FTIS in der Lage ist, eine vollständig flexible Bonuspolitik mit der Möglichkeit, keinen Bonus zu zahlen, zu betreiben.

**Variable Vergütung:** Die variable Vergütung ist definiert als jährliche Boni, die im Rahmen des Annual Incentive Plan (AIP) ausgezahlt werden, Langzeitprämien in Form von leistungsabhängigen Anteilszuteilungen und Verkaufsbonsuzahlungen. Die Bonusstufen werden in Abhängigkeit von der Gesamtpformance des Unternehmens und der Geschäftseinheiten sowie der individuellen Leistung bei FTIS festgelegt.

## Vergütung

Franklin Templeton International Services S.à r.l. („FTIS“), als für OGAW zugelassene Verwaltungsgesellschaft (die „Verwaltungsgesellschaft“) hat eine etablierte Vergütungspolitik (die „Politik“), die für alle von ihr verwalteten OGAW-Fonds (jeweils ein „OGAW“ und zusammen die „OGAW“) gilt. Die Politik wurde konzipiert, um das Eingehen von übermäßigen Risiken zu entmutigen, und integriert die für von ihr abgedeckten Geschäftseinheiten spezifischen Risikokriterien in ihre Performance-Management-Systeme. Die Politik hat eine Führungsstruktur, die interne Interessenkonflikte vermeiden soll.

Es bestehen festgelegte Verfahren zur Gestaltung, Aktualisierung, Überprüfung und Genehmigung der Politik sowie für die Kommunikation und Umsetzung der Politik. Die oberste Führungsebene, die Personalabteilung, die Compliance-Abteilung und andere Abteilungen sind alle an diesem Prozess beteiligt, und die Politik wird von der obersten Führungsebene und vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft genehmigt.

Die feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt zuzüglich anderer Leistungen, die Rentenbeiträge, Lebensversicherungsprämien oder private Krankenversicherungsprämien umfassen können. Die Höhe der festen Vergütung wird in Abhängigkeit von der Job-Komplexität, der Verantwortungsebene, der Leistung und Marktvergleichsdaten festgelegt. Dies wird regelmäßig überprüft.

Die variable Vergütung ist definiert als jährliche Boni, Langzeitprämien in Form von leistungsabhängigen Anteilszuteilungen oder Verkaufsbonsuzahlungen. Die Höhe der variablen Vergütung wird in Abhängigkeit von der Gesamtpformance des Unternehmens und der Geschäftseinheiten sowie der individuellen Leistung festgelegt.

Die vollständige Politik ist vom eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich. Für die Franklin Templeton Investment Funds relevante Informationen sind nachstehend aufgeführt:

Gesamtbetrag der festen Vergütungen, die von FTIS und ihren Beauftragten während des zum 30. September 2022 endenden Geschäftsjahres gezahlt wurden *, **, ***.	583.032 €
Gesamtbetrag der von FTIS und ihren Beauftragten während des zum 30. September 2022 endenden Geschäftsjahres gezahlten variablen Vergütung *, **, ***.	391.472 €
Anzahl der Mitarbeiter/innen von FTIS und ihren Beauftragten zum 30. September 2022.	549
Gesamtbetrag der von FTIS und ihren Beauftragten im Laufe des zum 30. September 2022 endenden Geschäftsjahres an leitende Angestellte gezahlten Vergütungen *, **, ***.	296.040 €

## Vergütung

---

Gesamtbetrag, den FTIS und ihre Beauftragten während des zum 30. September 2022 endenden Geschäftsjahres an andere Mitarbeiter/innen gezahlt haben, die einen wesentlichen Einfluss auf das Profil von AIF haben*, **, ***.	61.663 €
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------

---

\* Der Gesamtbetrag der von FTIS gezahlten Vergütungen wurde dem AIF auf der Grundlage seines Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen zum Monatsende der von FTIS verwalteten Fonds insgesamt für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 zugewiesen.

\*\* Der Gesamtbetrag der von den FTIS-Beauftragten gezahlten Vergütungen wurde dem AIF auf der Grundlage seines Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen zum Monatsende der von FTIS verwalteten Fonds insgesamt für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 zugewiesen.

\*\*\* Beauftragte sind Anlageverwaltungsgesellschaften, die regulatorischen Anforderungen unterliegen, die gleichermaßen wirksam sind wie die in Artikel 69(3)(a) der OGAW-Richtlinie aufgeführten.

Einzelheiten zur Vergütungspolitik sind auf der Website der Verwaltungsgesellschaft abrufbar:

<https://www.franklintempleton.lu/investor/our-approach/our-company/regulatory-information>

Ein gedrucktes Exemplar der FTIS-Vergütungspolitik ist auf Anfrage kostenlos in unserer Niederlassung erhältlich.

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Vale SA ADR .....	83.025	1.281.703
Petroleo Brasileiro SA ADR (preferred stock) .....	68.523	700.285
Itau Unibanco Holding SA ADR .....	117.952	578.001
Petroleo Brasileiro SA ADR .....	44.321	510.554
Banco Bradesco SA ADR .....	127.144	364.983
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	148.700	333.880
Localiza Rent a Car SA .....	26.197	302.425
Ambev SA ADR .....	108.440	299.277
Centrais Eletricas Brasileiras SA .....	38.500	290.725
WEG SA .....	38.200	271.023
Itausa SA .....	131.500	217.926
Sendas Distribuidora SA .....	62.300	199.909
Suzano SA .....	17.300	153.158
Banco do Brasil SA .....	21.000	152.072
Hapvida Participacoes e Investimentos S/A .....	157.800	139.467
Gerdau SA .....	25.700	131.857
Raia Drogasil SA .....	27.976	127.748
Banco BTG Pactual SA .....	28.800	126.318
Petro Rio SA .....	18.000	122.112
Equatorial Energia SA .....	23.600	118.759
Rumo SA .....	31.800	114.716
JBS SA ADR .....	13.528	111.393
BB Seguridade Participacoes SA .....	18.000	110.757
Atacadao SA .....	31.200	108.105

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Vale SA ADR .....	83.272	1.264.278
Petroleo Brasileiro SA ADR (preferred stock) .....	57.939	632.354
Itau Unibanco Holding SA ADR .....	99.714	487.096
Petroleo Brasileiro SA ADR .....	36.997	451.572
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	153.200	369.316
Banco Bradesco SA ADR .....	108.548	324.341
Ambev SA ADR .....	92.145	263.625
WEG SA .....	33.000	237.471
Centrais Eletricas Brasileiras SA .....	28.100	225.879
Localiza Rent a Car SA .....	17.100	201.704
Itausa SA .....	115.810	193.826
Suzano SA .....	17.200	173.739
Banco do Brasil SA .....	19.000	137.635
Equatorial Energia SA .....	25.482	137.325

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Gerdau SA .....	24.500	135.202
Vale SA .....	8.000	123.442
Banco BTG Pactual SA .....	25.800	120.224
JBS SA ADR .....	10.860	109.238
Raia Drogasil SA .....	23.800	106.015
Rumo SA .....	28.000	103.924
Lojas Renner SA .....	21.700	98.707
Petro Rio SA .....	15.000	96.691

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin FTSE China UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Tencent Holdings Ltd .....	325.000	13.506.606
Alibaba Group Holding Ltd .....	1.055.800	11.881.559
Meituan .....	293.990	5.583.692
Yum China Holdings Inc .....	64.300	3.345.362
China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	4.834.000	2.980.792
JD.com Inc .....	120.850	2.953.972
Pinduoduo Inc ADR .....	27.184	2.134.423
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' Shares .....	335.500	2.101.083
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares .....	4.031.000	2.038.322
NetEase Inc .....	125.600	2.035.594
Baidu Inc .....	114.650	1.857.889
BYD Co Ltd 'H' Shares .....	56.239	1.603.586
ZTO Express Cayman Inc .....	54.200	1.453.707
Bank of China Ltd 'H' Shares .....	3.893.000	1.419.228
Kuaishou Technology .....	176.100	1.350.300
Wuxi Biologics Cayman Inc .....	183.500	1.306.962
Kweichow Moutai Co Ltd .....	4.600	1.176.607
Xiaomi Corp .....	752.600	1.101.486
China Merchants Bank Co Ltd .....	195.000	1.004.492
ANTA Sports Products Ltd .....	73.850	915.153

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Tencent Holdings Ltd .....	146.400	6.849.590
Alibaba Group Holding Ltd .....	410.840	5.260.485
Meituan .....	111.134	2.429.237
JD.com Inc .....	63.650	1.733.424
China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	2.574.000	1.653.284
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares .....	2.115.000	1.117.386
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' Shares .....	146.500	1.082.193
Baidu Inc .....	58.700	1.055.364
Pinduoduo Inc ADR .....	10.061	922.306
NetEase Inc .....	48.500	899.290
Yum China Holdings Inc .....	14.150	871.039
Bank of China Ltd 'H' Shares .....	2.061.000	787.343
Wuxi Biologics Cayman Inc .....	101.000	767.415
Xiaomi Corp .....	403.000	642.164
BYD Co Ltd 'H' Shares .....	19.348	623.146
China Merchants Bank Co Ltd .....	105.500	619.980
NIO Inc ADR .....	44.923	534.651
Kweichow Moutai Co Ltd .....	1.800	485.846

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
ANTA Sports Products Ltd .....	34.450	484.406
Contemporary Ampere Technology Co Ltd .....	9.700	436.070



# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin FTSE India UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Reliance Industries Ltd .....	415.119	13.134.592
Infosys Ltd .....	425.576	7.986.920
Housing Development Finance Corp Ltd .....	210.322	6.765.926
Tata Consultancy Services Ltd .....	122.458	4.995.283
Hindustan Unilever Ltd .....	106.375	3.397.730
Axis Bank Ltd .....	272.673	2.983.038
Bharti Airtel Ltd .....	277.138	2.797.928
Bajaj Finance Ltd .....	29.859	2.467.789
Larsen & Toubro Ltd .....	82.614	2.133.199
ICICI Bank Ltd .....	187.622	2.102.548
Asian Paints Ltd .....	54.091	2.075.203
Adani Enterprises Ltd .....	50.938	1.923.076
Mahindra & Mahindra Ltd .....	112.560	1.761.703
HCL Technologies Ltd .....	129.964	1.753.577
Maruti Suzuki India Ltd .....	15.856	1.715.414
Sun Pharmaceutical Industries Ltd .....	130.483	1.616.532
Titan Co Ltd .....	49.919	1.606.980
ITC Ltd .....	354.945	1.552.880
State Bank of India .....	214.165	1.550.312
Tata Steel Ltd .....	963.981	1.311.155

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Reliance Industries Ltd .....	54.033	1.560.241
Infosys Ltd .....	55.257	948.243
Housing Development Finance Corp Ltd .....	20.154	624.954
Tata Consultancy Services Ltd .....	12.878	500.869
Hindustan Unilever Ltd .....	11.155	352.597
Axis Bank Ltd .....	27.225	280.354
HCL Technologies Ltd .....	20.128	263.840
Asian Paints Ltd .....	5.792	226.848
Bharti Airtel Ltd .....	23.538	224.363
Larsen & Toubro Ltd .....	8.520	220.754
Bajaj Finance Ltd .....	2.514	204.421
Tata Power Co Ltd .....	68.617	198.275
ICICI Bank Ltd .....	17.780	192.730
Maruti Suzuki India Ltd .....	1.644	180.301
Titan Co Ltd .....	5.063	163.391
Sun Pharmaceutical Industries Ltd .....	13.767	158.448
ITC Ltd .....	33.448	146.482
State Bank of India .....	21.308	144.315

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Mahindra & Mahindra Ltd .....	9.388	143.241
Wipro Ltd .....	27.052	138.831
Piramal Pharma Ltd .....	66.912	136.661

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin FTSE Korea UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Samsung Electronics Co Ltd .....	850.227	39.260.632
SK Hynix Inc .....	106.016	7.914.006
Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock) .....	147.977	6.190.879
Samsung SDI Co Ltd .....	10.419	5.054.430
NAVER Corp .....	28.019	4.717.355
LG Chem Ltd .....	9.495	4.710.153
LG Energy Solution Ltd .....	10.707	3.969.026
Hyundai Motor Co .....	26.646	3.773.616
POSCO Holdings Inc .....	14.537	3.191.258
Kakao Corp .....	59.404	2.905.897
Celltrion Inc .....	20.573	2.832.804
KB Financial Group Inc .....	75.255	2.826.935
Kia Corp .....	46.579	2.694.095
Shinhan Financial Group Co Ltd .....	88.098	2.416.316
Samsung Biologics Co Ltd .....	3.203	2.065.564
Meritz Financial Group Inc .....	61.143	1.994.011
Hyundai Mobis Co Ltd .....	11.888	1.978.387
Hana Financial Group Inc .....	57.061	1.745.575
LG Electronics Inc .....	21.034	1.596.202
Ecopro BM Co Ltd .....	10.854	1.554.763

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Samsung Electronics Co Ltd .....	337.242	16.750.613
Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock) .....	57.890	2.516.156
HMM Co Ltd .....	69.887	1.038.605
SK Hynix Inc .....	14.003	904.579
SK Telecom Co Ltd .....	23.412	864.143
Samsung SDI Co Ltd .....	1.389	718.395
LG Chem Ltd .....	1.182	593.203
NAVER Corp .....	3.725	574.589
Meritz Financial Group Inc .....	14.715	504.471
Hyundai Motor Co .....	3.555	488.546
Kia Corp .....	6.847	405.238
POSCO Holdings Inc .....	1.769	392.246
Kakao Corp .....	7.504	353.031
Celltrion Inc .....	2.747	331.770
KB Financial Group Inc .....	8.901	326.822
Shinhan Financial Group Co Ltd .....	11.865	316.835
Samsung Biologics Co Ltd .....	473	286.793
SK Innovation Co Ltd .....	2.288	283.000

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
LG Energy Solution Ltd .....	672	281.522
Hana Financial Group Inc .....	7.588	232.086

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	40.203	741.143
Hon Hai Precision Industry Co Ltd .....	32.000	112.601
MediaTek Inc .....	3.990	98.867
Delta Electronics Inc .....	5.790	61.406
United Microelectronics Corp .....	31.740	52.500
Chunghwa Telecom Co Ltd .....	10.150	41.202
Fubon Financial Holding Co Ltd .....	19.860	39.791
Nan Ya Plastics Corp .....	15.220	39.150
CTBC Financial Holding Co Ltd .....	48.000	38.275
Cathay Financial Holding Co Ltd .....	25.603	37.660
ASE Technology Holding Co Ltd .....	9.200	36.925
Mega Financial Holding Co Ltd .....	29.350	35.240
E.Sun Financial Holding Co Ltd .....	37.482	32.570
Uni-President Enterprises Corp .....	12.900	31.501
China Steel Corp .....	32.000	31.120
Formosa Plastics Corp .....	9.660	29.571
Quanta Computer Inc .....	7.010	28.130
First Financial Holding Co Ltd .....	28.500	25.834
Chailease Holding Co Ltd .....	3.693	25.595
Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd .....	27.100	24.960

Größte Verkäufe*	Anteile	Erlöse USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	2.183	40.794
Formosa Plastics Corp .....	2.410	6.635
Walsin Lihwa Corp .....	4.266	6.491
OBI Pharma Inc .....	450	1.138
Asia Cement Corp .....	540	774
Catcher Technology Co Ltd .....	50	279
Uni-President Enterprises Corp .....	100	212
Fubon Financial Holding Co Ltd .....	90	164
Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd .....	30	158
Yageo Corp .....	10	156
Taiwan Mobile Co Ltd .....	50	153
Parade Technologies Ltd .....	5	132
Foxconn Technology Co Ltd .....	50	83

\* In vorstehender Tabelle sind alle Verkäufe im Geschäftsjahr angegeben.

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin Euro Green Bond UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
Bundesobligation 0.00% 10/10/2025 .....	22.500.000	21.392.075
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030 .....	17.400.000	15.072.541
Netherlands Government Bond 0.50% 15/01/2040 .....	17.400.000	12.682.669
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2050 .....	20.700.000	11.885.592
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/06/2029 .....	11.800.000	10.142.232
Ireland Government Bond 1.35% 18/03/2031 .....	8.200.000	7.556.895
Austria Treasury Bill 0.00% 25/05/2023 .....	7.000.000	6.955.317
Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 22/04/2033 .....	7.200.000	6.288.672
Region Wallonne Belgium 3.75% 22/04/2039 .....	6.000.000	5.986.500
Austria Treasury Bill 0.00% 24/08/2023 .....	6.000.000	5.953.662
Spain Government Bond 1.00% 30/07/2042 .....	8.400.000	5.515.170
French Republic Government Bond OAT 1.75% 25/06/2039 .....	6.100.000	5.282.624
Intesa Sanpaolo SpA 6.50% 14/03/2029 .....	3.500.000	3.911.469
Austria Treasury Bill 0.00% 23/02/2023 .....	3.700.000	3.685.132
Societe Nationale SNCF SA 0.63% 17/04/2030 .....	3.900.000	3.360.281
Autonomous Community of Madrid Spain 0.83% 30/07/2027 .....	3.600.000	3.309.898
Thames Water Utilities Finance Plc 4.00% 18/04/2027 .....	3.000.000	2.989.895
BPCE SA 0.13% 04/12/2024 .....	3.000.000	2.841.026
NTT Finance Corp 0.08% 13/12/2025 .....	3.100.000	2.837.791
Stellantis NV 4.38% 14/03/2030 .....	2.800.000	2.827.941
NN Group NV 6.00% 03/11/2043 .....	2.700.000	2.692.453
Elia Transmission Belgium SA 3.63% 18/01/2033 .....	2.600.000	2.605.526
Swedbank AB 0.30% 20/05/2027 .....	2.900.000	2.570.528
ERG SpA 0.88% 15/09/2031 .....	3.300.000	2.553.795
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 4.13% 18/01/2027 .....	2.500.000	2.497.906
SpareBank 1 SR-Bank ASA 2.88% 20/09/2025 .....	2.500.000	2.458.181

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Netherlands Government Bond 0.50% 15/01/2040 .....	9.800.000	6.809.772
Bundesobligation 0.00% 10/10/2025 .....	6.900.000	6.502.154
ERG SpA 0.50% 11/09/2020 .....	3.500.000	3.047.520
Thames Water Utilities Finance Plc 4.00% 18/04/2027 .....	3.000.000	2.687.500
Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 16/03/2021 .....	3.000.000	2.497.020
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030 .....	2.500.000	2.117.865
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2050 .....	4.000.000	2.104.232
Orange SA 0.13% 16/09/2020 .....	2.300.000	1.865.875
Hungary Government International Bond 1.75% 05/06/2020 .....	2.700.000	1.831.650
Enel Finance International NV 0.38% 17/10/2019 .....	1.900.000	1.676.962
Intesa Sanpaolo SpA 6.50% 14/03/2029 .....	1.500.000	1.676.889

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Landesbank Baden-Wuerttemberg 1.50% 03/02/2020 .....	1.300.000	1.357.892
Ireland Government Bond 1.35% 18/03/2031 .....	1.300.000	1.174.605
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/06/2029 .....	1.300.000	1.090.002
Austria Treasury Bill 0.00% 25/05/2023 .....	1.000.000	999.970
Enel Finance International NV 1.00% 20/10/2020 .....	1.000.000	967.258
EDP - Energias de Portugal SA 1.88% 02/02/2021 .....	1.100.000	960.850
BNP Paribas SA 0.38% 14/10/2020 .....	1.000.000	865.500
French Republic Government Bond OAT 1.75% 25/06/2039 .....	1.000.000	825.610
Spain Government Bond 1.00% 30/07/2042 .....	1.300.000	811.010
Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 22/04/2033 .....	900.000	767.689
Austria Treasury Bill 0.00% 23/02/2023 .....	600.000	599.690
Autonomous Community of Madrid Spain 0.83% 30/07/2027 .....	600.000	543.416

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
German Treasury Bill 0.00% 21/06/2023 .....	50.000.000	49.865.463
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 10/11/2022 .....	40.000.000	39.975.056
Austria Treasury Bill 0.00% 25/05/2023 .....	40.000.000	39.795.261
Austria Treasury Bill 0.00% 24/08/2023 .....	40.000.000	39.691.083
German Treasury Bill 0.00% 22/11/2023 .....	40.000.000	39.177.248
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.00% 29/11/2023 .....	35.000.000	34.399.800
France Treasury Bill 0.00% 26/10/2022 .....	30.000.000	29.992.519
Netherlands Treasury Bill 0.00% 28/10/2022 .....	30.000.000	29.986.569
Austria Treasury Bill 0.00% 23/02/2023 .....	30.000.000	29.869.322
France Treasury Bill BTF 0.00% 08/03/2023 .....	30.000.000	29.853.816
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 09/03/2023 .....	30.000.000	29.823.972
Denmark Government International Bond 2.50% 18/11/2024 .....	25.000.000	25.026.117
European Stability Mechanism Treasury Bill 0.00% 18/05/2023 .....	25.000.000	24.728.000
Spain Letras del Tesoro 0.00% 07/10/2022 .....	20.000.000	19.993.781
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.01% 15/04/2023 .....	18.643.500	18.559.604
France Treasury Bill BTF 0.00% 30/11/2022 .....	11.400.000	11.397.716
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 15/12/2022 .....	10.000.000	9.987.571
European Union Bill 0.00% 08/12/2023 .....	10.000.000	9.834.430
German Treasury Bill 0.00% 15/05/2024 .....	10.000.000	9.700.823
France Treasury Bill BTF 0.00% 26/07/2023 .....	6.000.000	5.985.035

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
German Treasury Bill 0.00% 21/06/2023 .....	50.000.000	49.776.228
Netherlands Government Bond 2.00% 28/03/2014 .....	20.000.000	19.942.400
Bundesschatzanweisungen 0.00% 03/02/2022 .....	20.000.000	19.931.400
France Treasury Bill BTF 0.00% 10/08/2022 .....	18.000.000	18.002.078
Spain Letras del Tesoro 0.00% 09/12/2022 .....	17.000.000	16.987.538
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 09/03/2023 .....	17.000.000	16.977.913
French Republic Government Bond OAT 0.25% 26/02/2013 .....	16.067.295	16.423.989
Spain Government Inflation Linked Bond 1.80% 20/05/2014 .....	15.368.789	16.106.491
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0.00% 14/12/2022 .....	15.000.000	14.987.302
European Financial Stability Facility 1.88% 23/05/2023 .....	12.185.000	12.163.676
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 08/09/2022 .....	10.000.000	10.003.044
France Treasury Bill BTF 0.00% 30/11/2022 .....	10.000.000	10.001.911
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 12/01/2023 .....	10.000.000	10.001.416
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0.00% 14/11/2022 .....	10.000.000	9.994.830
Commonwealth Bank of Australia 0.38% 24/04/2023 .....	4.093.000	4.090.135
Indonesia Government International Bond 2.63% 14/06/2023 .....	4.000.000	3.986.200
ASB Bank Ltd 0.13% 18/10/2016 .....	4.000.000	3.920.440
UBS Group AG 1.00% 21/03/2025 .....	4.000.000	3.853.200



# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
National Westminster Bank PLC 0.50% 15/05/2017 .....	3.914.000	3.804.291
Thames Water Utilities Finance Plc 0.19% 23/10/2023 .....	4.000.000	3.760.000
Bank of America Corp 0.75% 26/07/2023 .....	3.500.000	3.466.330
ANZ New Zealand Int'l Ltd 0.13% 22/09/2016 .....	3.500.000	3.434.130

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
United States Treasury Floating Rate Note 5.23% 31/01/2024 .....	477.000	477.151
Bank of America Corp 6.20% 10/11/2022 .....	300.000	302.430
Goldman Sachs Group Inc 2.64% 24/02/2028 .....	250.000	224.775
United States Treasury Bond 4.00% 15/11/2022 .....	200.000	205.203
Verizon Communications Inc 2.85% 03/09/2041 .....	275.000	201.426
Electricite de France SA 5.70% 23/05/2028 .....	200.000	199.700
T-Mobile USA Inc 3.38% 15/04/2029 .....	215.000	196.230
Comcast Corp 4.65% 15/02/2033 .....	175.000	176.078
UBS Group AG 2.10% 11/02/2032 .....	225.000	173.835
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.30% 19/05/2053 .....	155.000	156.820
Toyota Motor Credit Corp 2.15% 13/02/2030 .....	175.000	153.193
Public Service Electric and Gas Co 3.10% 15/03/2032 .....	175.000	152.987
Morgan Stanley 5.25% 21/04/2023 .....	150.000	150.495
Bank of New York Mellon Corp 4.95% 26/04/2027 .....	150.000	150.000
United Parcel Service Inc 4.88% 27/02/2023 .....	150.000	149.952
JPMorgan Chase & Co 4.91% 25/07/2022 .....	150.000	148.433
PepsiCo Inc 3.90% 18/07/2032 .....	150.000	146.814
JPMorgan Chase & Co 0.77% 09/08/2025 .....	150.000	141.207
Ford Foundation 2.82% 01/06/2070 .....	225.000	140.576
United States Treasury Note 3.50% 15/02/2023 .....	140.000	140.350
AerCap Ireland Capital DAC 2.45% 29/10/2026 .....	150.000	133.552
Warnermedia Holdings Inc 4.28% 15/03/2032 .....	150.000	132.055
General Mills Inc 5.24% 18/11/2022 .....	125.000	125.000
Mastercard Inc 4.88% 09/03/2023 .....	125.000	124.879
Northern Trust Corp 4.00% 10/05/2027 .....	125.000	120.344
Alexandria Real Estate Equities Inc 2.95% 15/03/2034 .....	150.000	113.214
Southern California Gas Co 6.35% 15/11/2052 .....	100.000	109.192
Arch Capital Group Ltd 3.64% 30/06/2050 .....	150.000	107.780
BP Capital Markets America Inc 4.81% 13/02/2033 .....	105.000	102.792
PacifiCorp 5.35% 01/12/2022 .....	100.000	99.700
Motorola Solutions Inc 4.60% 23/05/2029 .....	100.000	97.566
Otis Worldwide Corp 2.57% 15/02/2030 .....	100.000	86.337
Apple Inc 2.70% 05/08/2051 .....	125.000	85.958
Conagra Brands Inc 5.40% 01/11/2048 .....	85.000	82.466
Albemarle Corp 5.05% 01/06/2032 .....	85.000	81.796
Celanese US Holdings LLC 6.05% 15/03/2025 .....	80.000	80.417
LYB International Finance III LLC 5.63% 15/05/2033 .....	75.000	74.816
Medtronic Global Holdings SCA 4.25% 30/03/2023 .....	75.000	74.770
Target Corp 4.80% 15/01/2053 .....	75.000	73.588
Roper Technologies Inc 1.75% 15/02/2031 .....	90.000	72.023
Freeport-McMoRan Inc 5.45% 15/03/2043 .....	75.000	71.293

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Citigroup Inc 3.67% 24/07/2028 .....	75.000	70.867
Church & Dwight Co Inc 5.60% 15/11/2032 .....	65.000	69.398
Lowe's Cos Inc 5.75% 30/03/2023 .....	70.000	68.277
Kaiser Foundation Hospitals 2.81% 01/06/2041 .....	90.000	67.914

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
United States Treasury Floating Rate Note 5.23% 31/01/2024 .....	477.000	476.894
Bank of America Corp 6.20% 10/11/2022 .....	300.000	312.141
Bank of America Corp 4.18% 25/11/2016 .....	300.000	276.738
Microsoft Corp 2.53% 01/06/2020 .....	325.000	223.085
T-Mobile USA Inc 3.75% 21/05/2021 .....	230.000	221.644
Verizon Communications Inc 3.40% 22/03/2021 .....	265.000	210.217
United States Treasury Bond 4.00% 15/11/2022 .....	200.000	202.588
Goldman Sachs Group Inc 4.25% 21/10/2015 .....	200.000	196.684
Dominion Energy Inc 3.90% 24/09/2015 .....	185.000	180.412
UniCredit SpA 1.98% 03/06/2021 .....	200.000	177.372
Cigna Corp 3.05% 15/10/2027 .....	190.000	176.834
UBS Group AG 4.19% 01/04/2020 .....	250.000	175.000
Exelon Corp 4.05% 01/04/2020 .....	175.000	164.313
Vistra Operations Co LLC 3.55% 11/06/2019 .....	165.000	159.842
Citigroup Inc 3.67% 24/07/2028 .....	165.000	154.986
United Parcel Service Inc 4.88% 27/02/2023 .....	150.000	152.038
Morgan Stanley 5.25% 21/04/2023 .....	150.000	148.028
JPMorgan Chase & Co 4.91% 25/07/2022 .....	150.000	146.704
United States Treasury Note 3.50% 15/02/2023 .....	140.000	139.765
Apple Inc 2.70% 05/08/2051 .....	200.000	137.206
Goldman Sachs Group Inc 2.64% 24/02/2028 .....	150.000	136.074
Berkshire Hathaway Energy Co 6.13% 16/10/2006 .....	120.000	134.170
Archer-Daniels-Midland Co 2.90% 28/02/2022 .....	150.000	129.813
CSX Corp 3.25% 01/06/2027 .....	135.000	129.021
Mastercard Inc 4.88% 09/03/2023 .....	125.000	127.451
General Mills Inc 5.24% 18/11/2022 .....	125.000	125.014
RELX Capital Inc 3.00% 22/05/2030 .....	140.000	124.857
Costco Wholesale Corp 1.75% 20/04/2020 .....	150.000	122.662
Comcast Corp 4.95% 05/10/2018 .....	125.000	121.704
ConocoPhillips Co 3.80% 08/03/2022 .....	150.000	121.688
Duke Energy Corp 4.80% 19/11/2015 .....	130.000	121.035
Honeywell International Inc 1.95% 18/05/2020 .....	140.000	119.522
Essex Portfolio LP 2.65% 15/03/2032 .....	140.000	112.442
Burlington Northern Santa Fe LLC 5.75% 17/05/2010 .....	100.000	108.446
UnitedHealth Group Inc 3.05% 15/05/2041 .....	140.000	107.216
Caterpillar Inc 2.60% 09/04/2020 .....	120.000	104.230

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
PacifiCorp 5.35% 01/12/2022 .....	100.000	103.555
WRKCo Inc 3.90% 20/05/2019 .....	110.000	102.763
Netflix Inc 5.75% 01/03/2024 .....	100.000	100.112
Fidelity National Information Services Inc 2.25% 02/03/2021 .....	125.000	99.917
Home Depot Inc 3.35% 15/04/2050 .....	135.000	99.683
Amgen Inc 2.45% 21/02/2030 .....	115.000	98.118
Ecolab Inc 2.70% 15/12/2021 .....	150.000	96.374
Carrier Global Corp 3.58% 05/04/2050 .....	125.000	92.807

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
MediaTek Inc .....	9.320	211.673
Bank Central Asia Tbk PT .....	350.800	200.956
Infosys Ltd .....	8.968	154.520
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT .....	466.600	153.685
Tata Consultancy Services Ltd .....	3.125	125.121
China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	187.000	119.273
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares .....	219.000	115.209
Bank of China Ltd 'H' Shares .....	300.000	111.510
Kia Corp .....	2.008	111.318
Kweichow Moutai Co Ltd .....	400	100.272
POSCO Holdings Inc .....	444	96.043
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	6.520	95.960
Sun Hung Kai Properties Ltd .....	6.773	93.417
United Microelectronics Corp .....	67.000	91.476
Samsung Electronics Co Ltd .....	1.922	87.392
Bank Mandiri Persero Tbk PT .....	165.800	86.535
BOC Hong Kong Holdings Ltd .....	26.000	83.786
Formosa Plastics Corp .....	28.000	81.893
Nan Ya Plastics Corp .....	32.000	78.208
CK Asset Holdings Ltd .....	12.500	77.963
Singapore Telecommunications Ltd .....	41.200	77.702
KB Financial Group Inc .....	1.920	76.074
Telkom Indonesia Persero Tbk PT .....	299.500	73.901
China Petroleum & Chemical Corp 'H' Shares .....	150.000	73.334
China Shenhua Energy Co Ltd 'H' Shares .....	25.000	73.134
ITC Ltd .....	18.452	73.017
Shinhan Financial Group Co Ltd .....	2.544	72.721

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Singapore Telecommunications Ltd .....	82.700	152.385
Fubon Financial Holding Co Ltd .....	69.400	136.860
Asian Paints Ltd .....	1.602	62.298
Capitaland Investment Ltd .....	24.000	58.610
CLP Holdings Ltd .....	7.500	54.310
Cathay Financial Holding Co Ltd .....	35.000	49.163
Pidilite Industries Ltd .....	1.384	43.625
Singapore Technologies Engineering Ltd .....	15.300	41.256
Bharat Electronics Ltd .....	28.778	38.967
NTPC Ltd .....	17.103	36.107
Power Grid Corp of India Ltd .....	12.830	35.219

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Sino Biopharmaceutical Ltd .....	74.000	35.209
Siam Cement PCL NVDR .....	3.600	34.293
DiGi.Com Bhd .....	35.200	33.953
Bank of China Ltd 'H' Shares .....	80.000	31.328
Yuanta Financial Holding Co Ltd .....	40.170	29.281
China Development Financial Holding Corp .....	63.000	27.127
AUO Corp .....	44.600	25.464
Quanta Computer Inc .....	11.000	25.403
POSCO Holdings Inc .....	92	24.899
Taiwan Mobile Co Ltd .....	8.000	24.624
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares .....	44.000	23.517
Vipshop Holdings Ltd ADR .....	1.971	21.976
Adani Total Gas Ltd .....	2.546	20.414
Dabur India Ltd .....	2.775	20.012
Parade Technologies Ltd .....	602	19.870
Infosys Ltd .....	991	19.845
Advantech Co Ltd .....	1.840	19.732
China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	30.000	19.172
CK Asset Holdings Ltd .....	3.500	19.127

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
MediaTek Inc .....	16.960	400.551
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA .....	4.912	400.441
Kia Corp .....	5.760	315.947
Formosa Plastics Corp .....	96.000	283.428
Nan Ya Plastics Corp .....	109.120	271.895
Emaar Properties PJSC .....	156.016	260.205
China Overseas Land & Investment Ltd .....	96.000	238.979
Tata Steel Ltd .....	174.000	229.836
ASE Technology Holding Co Ltd .....	48.000	174.211
Nongfu Spring Co Ltd .....	29.200	164.911
Infosys Ltd .....	9.758	163.028
Lenovo Group Ltd .....	176.000	154.209
Petro Rio SA .....	19.200	130.381
Longfor Group Holdings Ltd .....	48.000	128.612
Astra International Tbk PT .....	315.800	126.270
Polski Koncern Naftowy ORLEN SA .....	8.550	124.346
PTT Exploration & Production PCL .....	25.200	122.513
Türkiye Petrol Rafinerileri AS .....	22.080	119.180
Shinhan Financial Group Co Ltd .....	3.996	116.993
Sasol Ltd .....	10.000	116.908

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Grupo Mexico SAB de CV .....	93.008	411.110
Fubon Financial Holding Co Ltd .....	175.560	344.272
Asian Paints Ltd .....	8.778	341.354
Emirates Telecommunications Group Co PJSC .....	51.776	324.934
Al Rajhi Bank .....	13.790	294.913
Tech Mahindra Ltd .....	17.094	225.661
Cathay Financial Holding Co Ltd .....	159.600	224.185
Sibanye Stillwater Ltd .....	110.446	202.430
PetroChina Co Ltd 'H' Shares .....	256.000	165.235
Yuanta Financial Holding Co Ltd .....	216.300	157.667
Pidilite Industries Ltd .....	4.816	152.070
ITC Ltd .....	32.196	145.831
China Petroleum & Chemical Corp 'H' Shares .....	228.000	143.382
LTIMindtree Ltd .....	2.506	142.470
Bharat Electronics Ltd .....	99.152	134.298
Dabur India Ltd .....	19.724	132.946
Advantech Co Ltd .....	11.250	120.646
DiGi.Com Bhd .....	125.200	120.431

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Dubai Islamic Bank PJSC .....	82.714	118.334
AUO Corp .....	178.800	102.085
Korea Zinc Co Ltd .....	270	99.146
Synnex Technology International Corp .....	47.400	97.451
POSCO Holdings Inc .....	370	95.814
Yanbu National Petrochemical Co .....	8.242	93.037
Powszechny Zakład Ubezpieczeń SA .....	13.188	91.768
Adani Total Gas Ltd .....	8.632	91.677
Bharat Petroleum Corp Ltd .....	21.686	90.703



# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Dividend UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
Anglo American Plc .....	55.146	1.946.960
AP Moller - Maersk A/S 'A' Shares .....	559	1.119.399
GSK Plc .....	57.231	935.265
Aker BP ASA .....	30.621	923.292
Telenor ASA .....	82.130	814.359
Imperial Tobacco Group Plc .....	37.320	812.419
Orion OYJ .....	16.315	811.412
UPM-Kymmene OYJ .....	25.687	809.432
AP Moller - Maersk A/S 'B' Shares .....	490	770.835
Yara International ASA .....	22.035	768.289
Rio Tinto Plc .....	11.950	761.848
Koninklijke KPN NV .....	245.578	758.335
Admiral Group Plc .....	28.836	718.757
Gaztransport Et Technigaz SA .....	7.023	707.520
Sanofi .....	7.880	706.197
Swiss Prime Site AG .....	8.779	704.586
IG Group Holdings Plc .....	78.595	671.959
Swisscom AG .....	1.207	664.290
BAE Systems Plc .....	66.845	659.985
Zurich Insurance Group AG .....	1.478	651.364
Elisa OYJ .....	12.397	648.299
TotalEnergies SE .....	11.546	647.532
BE Semiconductor Industries NV .....	9.534	617.739
Hannover Rueck SE .....	3.537	613.050
Iberdrola SA .....	56.637	608.004
Allianz SE .....	2.898	605.052
Snam SpA .....	125.504	596.689
Assicurazioni Generali SpA .....	34.185	594.760
Red Electrica Corp SA .....	36.323	592.995
Endesa SA .....	31.254	579.219
Tryg A/S .....	26.748	565.505
Kesko OYJ .....	25.852	530.436
Gjensidige Forsikring ASA .....	27.591	493.575
Bankinter SA .....	77.567	478.612
Tele2 AB .....	49.641	428.130
Azimut Holding SpA .....	17.723	366.936
Axfood AB .....	14.775	338.099
Moneysupermarket.com Group Plc .....	114.126	307.171
Tate & Lyle Plc .....	34.516	300.938
Cembra Money Bank AG .....	3.957	293.891

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
CaixaBank SA .....	334.240	1.184.581
Aker BP ASA .....	44.046	903.154
BE Semiconductor Industries NV .....	8.407	824.133
Orion OYJ .....	16.315	646.953
Hannover Rueck SE .....	2.966	542.880
BAE Systems Plc .....	50.440	531.233
Gjensidige Forsikring ASA .....	27.591	433.497
Swisscom AG .....	589	341.444
Admiral Group Plc .....	14.244	340.990
Sanofi .....	3.470	328.294
Koninklijke KPN NV .....	96.842	309.277
Iberdrola SA .....	27.176	304.499
Imperial Tobacco Group Plc .....	12.820	296.847
Tryg A/S .....	13.125	287.994
TotalEnergies SE .....	4.761	273.483
Bankinter SA .....	45.882	267.823
Elisa OYJ .....	4.770	248.890
UPM-Kymmene OYJ .....	7.384	243.410
Zurich Insurance Group AG .....	515	231.266
Allianz SE .....	1.122	224.156
Tate & Lyle Plc .....	25.558	219.300
Assicurazioni Generali SpA .....	12.283	213.441
Gaztransport Et Technigaz SA .....	1.838	207.787
AP Moller - Maersk A/S .....	125	198.075
Telenor ASA .....	19.341	191.165
Haleon PLC .....	53.509	176.406
Nexity SA .....	7.100	168.598
Endesa SA .....	8.490	161.127
Red Electrica Corp SA .....	8.861	152.216
IG Group Holdings Plc .....	16.101	144.028
Kesko OYJ .....	6.962	141.213
Rio Tinto Plc .....	2.208	133.310
GSK Plc .....	7.873	130.800
Azimut Holding SpA .....	6.815	128.193

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
Eni SpA .....	7.336	101.010
Mercedes-Benz Group AG .....	1.404	98.011
HSBC Holdings Plc .....	14.199	97.999
Equinor ASA .....	3.027	93.131
UniCredit SpA .....	6.039	90.222
BNP Paribas SA .....	1.665	90.221
Anglo American Plc .....	2.308	73.907
GSK Plc .....	4.475	73.609
Volkswagen AG .....	559	72.075
Banco Santander SA .....	23.692	67.996
Glencore Plc .....	11.067	63.211
British American Tobacco Plc .....	1.820	62.881
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA .....	9.708	59.558
BAE Systems Plc .....	5.906	58.993
BASF SE .....	1.186	57.683
Repsol SA .....	3.982	57.231
Societe Generale SA .....	2.342	55.192
Standard Chartered Plc .....	7.408	54.007
Rio Tinto Plc .....	808	51.138
Sanofi .....	539	49.045
STMicroelectronics NV .....	1.170	47.586
TotalEnergies SE .....	729	42.091
Barclays Plc .....	23.646	41.828
Roche Holding AG (non-voting rights) .....	139	41.245
Industria de Diseno Textil SA .....	1.608	41.087
Novo Nordisk A/S .....	302	39.422
Shell Plc .....	1.427	38.530
Bayerische Motoren Werke AG .....	438	37.758
Unilever Plc .....	741	35.436
Novartis AG .....	409	35.361
RELX Plc .....	1.301	34.479
Zurich Insurance Group AG .....	75	33.926
Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	1.218	33.428
BP Plc .....	6.034	33.262
Stellantis NV .....	2.353	32.679
Imperial Tobacco Group Plc .....	1.364	32.393
Nestle SA .....	291	32.021
<b>Größte Verkäufe</b>	<b>Anteile</b>	<b>Erlöse EUR</b>
BP Plc .....	30.978	166.149

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Nestle SA .....	1.395	158.569
Zurich Insurance Group AG .....	363	158.406
Hermes International .....	86	141.766
BASF SE .....	2.942	132.104
Novo Nordisk A/S .....	894	117.473
Industria de Diseno Textil SA .....	3.190	91.229
Kone OYJ .....	1.804	85.502
ASML Holding NV .....	145	83.925
Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	2.886	83.030
Unilever Plc .....	1.694	82.434
Telefonica SA .....	21.766	81.434
Sanofi .....	774	75.724
CaixaBank SA .....	22.789	75.497
Ferrari NV .....	310	72.582
Deutsche Post AG .....	1.743	72.454
Banco Santander SA .....	24.647	72.019
RELX Plc .....	2.441	71.755
Stellantis NV .....	4.885	71.670
TotalEnergies SE .....	1.313	70.984
Novartis AG .....	798	70.327
Imperial Tobacco Group Plc .....	3.104	69.147
Bayerische Motoren Werke AG .....	715	65.641
Swedish Match AB .....	6.248	65.337
Partners Group Holding AG .....	68	65.052
Wolters Kluwer NV .....	556	62.918
Atlas Copco AB 'A' Shares .....	5.137	62.450
Shell Plc .....	2.260	60.168
Roche Holding AG (non-voting rights) .....	195	59.454
Rio Tinto Plc .....	985	56.518
Coloplast A/S .....	465	56.377
British American Tobacco Plc .....	1.569	55.948
GSK Plc .....	3.167	55.860
Glencore Plc .....	10.070	54.301
Geberit AG .....	104	52.993
SGS SA .....	625	51.692
Novozymes A/S .....	889	50.301
Logitech International SA .....	876	50.010
Epiroc AB .....	2.744	49.226
Anglo American Plc .....	1.598	49.062
Equinor ASA .....	1.562	46.241

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Global Dividend UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Broadcom Inc .....	1.360	1.098.826
Texas Instruments Inc .....	5.811	1.042.312
ConocoPhillips .....	9.024	896.083
Partners Group Holding AG .....	832	785.251
3M Co .....	4.684	521.578
GSK Plc .....	30.620	516.915
Pfizer Inc .....	11.106	477.046
Principal Financial Group Inc .....	5.474	442.529
T Rowe Price Group Inc .....	3.631	424.302
Amgen Inc .....	1.782	420.959
QUALCOMM Inc .....	3.284	389.455
Bank of Nova Scotia .....	7.570	388.611
Al Rajhi Bank .....	17.940	372.413
KDDI Corp .....	11.900	359.285
Emerson Electric Co .....	3.905	325.629
Paychex Inc .....	2.816	318.829
Johnson & Johnson .....	1.826	308.349
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	19.680	307.497
Macquarie Group Ltd .....	2.513	291.732
CF Industries Holdings Inc .....	3.591	286.341
Rio Tinto Plc .....	4.292	281.899
Commonwealth Bank of Australia .....	4.180	281.087
Toronto-Dominion Bank .....	4.236	277.175
United Parcel Service Inc .....	1.523	268.713
Philip Morris International Inc .....	2.711	263.145
Royal Bank of Canada .....	2.724	261.298
Lockheed Martin Corp .....	594	260.139
Unilever Plc .....	5.370	258.117
Novartis AG .....	2.889	250.242
Merck & Co Inc .....	2.504	250.146
Zurich Insurance Group AG .....	541	245.350
Procter & Gamble Co .....	1.710	245.277
Kimberly-Clark Corp .....	1.881	245.022
Cisco Systems Inc .....	5.454	243.800
Coca-Cola Co .....	3.983	242.343
Allianz SE .....	1.174	239.481
Eaton Corp Plc .....	1.632	238.825
Target Corp .....	1.559	238.766
AP Moller - Maersk A/S .....	123	237.558
Nucor Corp .....	1.860	237.366
Roche Holding AG (non-voting rights) .....	705	230.926

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Rio Tinto Ltd .....	2.999	223.036
Tokio Marine Holdings Inc .....	9.100	220.488

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
GSK Plc .....	64.076	1.082.415
Philip Morris International Inc .....	11.069	1.006.311
Target Corp .....	7.061	966.617
Toronto-Dominion Bank .....	15.968	913.619
Eaton Corp Plc .....	2.538	415.349
Merck & Co Inc .....	3.632	384.831
Unilever Plc .....	7.496	374.395
Cisco Systems Inc .....	6.828	335.835
Nucor Corp .....	2.192	321.623
Novartis AG .....	3.265	303.033
Amgen Inc .....	1.098	292.316
Cummins Inc .....	1.183	281.145
Kimberly-Clark Corp .....	2.051	275.102
Emerson Electric Co .....	2.799	256.898
Allianz SE .....	1.230	256.427
Lockheed Martin Corp .....	536	251.856
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	13.920	242.889
Procter & Gamble Co .....	1.614	233.793
Zurich Insurance Group AG .....	479	221.681
United Parcel Service Inc .....	1.155	221.411
KDDI Corp .....	6.900	214.365
Seagate Technology Holdings Plc .....	3.445	209.412
Coca-Cola Co .....	3.309	206.231
Paychex Inc .....	1.538	185.021
Sun Life Financial Inc .....	3.865	181.194
Nippon Telegraph & Telephone Corp .....	6.342	178.847
Kone OYJ .....	3.586	175.475
Tokio Marine Holdings Inc .....	6.400	161.929
TELUS Corp .....	8.218	159.591
ASX Ltd .....	3.206	156.270
Haleon PLC .....	44.608	152.066

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin Global Equity SRI UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Valero Energy Corp .....	3.222	413.873
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc .....	6.900	280.415
Verizon Communications Inc .....	7.696	274.208
Deutsche Post AG .....	5.976	267.901
Hermes International .....	128	260.300
Nutrien Ltd .....	3.483	247.770
Old Dominion Freight Line Inc .....	782	236.707
Newmont Corp .....	5.051	233.156
SoftBank Corp .....	20.612	219.090
Amgen Inc .....	865	211.887
Grupo Financiero Banorte SAB de CV .....	25.683	205.601
Tokyo Electron Ltd .....	853	201.660
Intact Financial Corp .....	1.372	201.114
Cummins Inc .....	873	199.431
Bank of Nova Scotia .....	3.901	194.588
Agnico Eagle Mines Ltd .....	3.906	193.990
Travelers Co Inc .....	1.062	190.582
Phillips 66 .....	1.895	190.191
West Pharmaceutical Services Inc .....	634	188.796
Biogen Inc .....	671	185.591

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Industria de Diseno Textil SA .....	15.988	513.675
Vertex Pharmaceuticals Inc .....	1.557	498.521
Tokyo Electron Ltd .....	3.329	470.777
S&P Global Inc .....	1.217	434.267
Lowe's Co Inc .....	2.136	428.575
IDEXX Laboratories Inc .....	1.012	425.753
Allianz SE .....	1.960	422.917
Kimberly-Clark Corp .....	3.121	418.175
Colgate-Palmolive Co .....	5.412	405.450
Roche Holding AG (non-voting rights) .....	1.246	393.573
AmerisourceBergen Corp .....	2.291	385.270
Fortescue Metals Group Ltd .....	29.952	383.571
ResMed Inc .....	1.639	374.118
Target Corp .....	2.632	373.447
Cardinal Health Inc .....	4.560	369.247
American Tower Corp .....	1.837	353.452
Biogen Inc .....	1.143	336.948
Novo Nordisk A/S .....	2.212	325.739

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Ferguson Plc .....	2.871	318.862
National Grid PLC .....	24.013	287.256
Waters Corp .....	825	282.361
Fujitsu Ltd .....	2.040	267.257
Gilead Sciences Inc .....	3.042	257.963
HCA Healthcare Inc .....	985	247.138
L'Oreal SA .....	616	245.195



# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin U.S. Equity UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Broadcom Inc .....	1.512	1.243.091
Meta Platforms Inc .....	7.237	1.024.902
Citigroup Inc .....	21.032	951.016
Cigna Corp .....	3.056	928.819
EOG Resources Inc .....	7.028	821.082
Intel Corp .....	26.416	768.224
ConocoPhillips .....	7.282	765.045
Verizon Communications Inc .....	19.342	759.478
Aon Plc .....	2.390	750.143
Pfizer Inc .....	16.876	735.358
AT&T Inc .....	40.192	719.007
3M Co .....	6.044	699.394
Colgate-Palmolive Co .....	8.726	675.215
CVS Health Corp .....	8.356	662.580
Amgen Inc .....	2.661	644.647
QUALCOMM Inc .....	5.255	633.460
Marathon Petroleum Corp .....	5.618	620.797
Automatic Data Processing Inc .....	2.795	619.412
Pioneer Natural Resources Co .....	2.892	612.239
Bristol-Myers Squibb Co .....	8.489	592.023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Meta Platforms Inc .....	7.912	2.110.718
Gilead Sciences Inc .....	19.193	1.656.211
Costco Wholesale Corp .....	3.093	1.596.787
Intel Corp .....	49.006	1.591.455
Oracle Corp .....	17.323	1.376.955
Target Corp .....	8.801	1.204.105
Motorola Solutions Inc .....	4.273	1.182.911
Southern Co .....	16.498	1.145.853
NIKE Inc .....	10.340	1.096.563
Dollar General Corp .....	6.008	1.088.303
Comcast Corp .....	28.102	973.167
American Electric Power Co Inc .....	10.631	899.817
Moderna Inc .....	4.620	890.929
Newmont Corp .....	16.006	674.767
Microsoft Corp .....	2.115	653.598
Eli Lilly & Co .....	1.656	644.629
ResMed Inc .....	3.025	635.901
Walgreens Boots Alliance Inc .....	19.760	634.452

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Lam Research Corp .....	1.012	573.794
Applied Materials Inc .....	4.436	567.259
Apple Inc .....	3.143	544.294
KLA Corp .....	1.237	519.805
Blackstone Inc .....	6.432	487.461

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
ASML Holding NV .....	1.596	844.873
AstraZeneca Plc .....	5.918	763.410
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE .....	1.053	762.556
Novo Nordisk A/S .....	4.788	617.336
Novartis AG .....	5.344	456.859
Hermès International .....	271	431.470
SAP SE .....	3.882	423.472
Nestlé SA .....	3.343	373.365
Roche Holding AG (non-voting rights) .....	1.265	353.837
Cie Financière Richemont SA .....	2.617	350.162
Diageo Plc .....	7.425	307.974
Air Liquide SA .....	2.189	301.451
Iberdrola SA .....	26.808	299.875
Sanofi .....	3.213	296.453
Deutsche Telekom AG .....	14.528	293.049
L'Oréal SA .....	780	291.632
Deutsche Post AG .....	7.134	280.809
Unilever Plc .....	5.841	280.138
Kering SA .....	534	279.585
Capgemini SE .....	1.560	260.468
London Stock Exchange Group Plc .....	2.362	210.996
Publicis Groupe SA .....	2.983	206.834

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Linde Plc .....	1.655	518.346
Nestlé SA .....	3.128	350.311
HSBC Holdings Plc .....	31.129	202.932
Bayer AG .....	3.951	192.430
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE .....	254	180.206
Koninklijke DSM NV .....	1.486	179.564
Novartis AG .....	1.916	154.311
Novo Nordisk A/S .....	958	124.933
EDP - Energias de Portugal SA .....	26.191	121.453
Unilever Plc .....	2.596	121.437
Iberdrola SA .....	10.874	113.363
ASML Holding NV .....	147	93.353
Siemens AG .....	764	87.643
Ferguson Plc .....	610	72.678
Schneider Electric SE .....	450	51.639
L'Oréal SA .....	145	48.733

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF  
(Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
DSV A/S .....	326	48.251
Diageo Plc .....	1.070	45.781
Haleon PLC .....	12.220	44.438
Deutsche Post AG .....	1.090	41.743

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Apple Inc .....	49.266	8.357.983
Microsoft Corp .....	20.272	5.621.104
Amazon.com Inc .....	39.157	3.988.442
Alphabet Inc 'A' Shares .....	23.858	2.405.990
NVIDIA Corp .....	12.363	2.368.919
Meta Platforms Inc .....	8.122	2.236.213
Alphabet Inc 'C' Shares .....	20.612	2.091.334
Tesla Inc .....	7.851	1.909.734
Costco Wholesale Corp .....	3.306	1.779.884
UnitedHealth Group Inc .....	3.133	1.571.140
United Parcel Service Inc .....	8.526	1.528.286
Procter & Gamble Co .....	10.165	1.495.258
Visa Inc .....	6.559	1.388.287
Bank of America Corp .....	43.680	1.387.753
JPMorgan Chase & Co .....	10.532	1.375.562
AbbVie Inc .....	8.644	1.297.653
Union Pacific Corp .....	6.174	1.258.464
Salesforce Inc .....	6.745	1.192.290
Mastercard Inc .....	3.255	1.129.900
PepsiCo Inc .....	5.924	1.054.751

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Amazon.com Inc .....	39.356	4.622.763
Apple Inc .....	26.068	3.995.766
NVIDIA Corp .....	15.942	3.732.893
Microsoft Corp .....	13.194	3.275.367
Caterpillar Inc .....	8.647	2.011.931
Procter & Gamble Co .....	11.185	1.614.005
PepsiCo Inc .....	8.981	1.597.293
Bank of America Corp .....	51.138	1.576.062
Alphabet Inc 'A' Shares .....	12.344	1.570.740
Alphabet Inc 'C' Shares .....	11.921	1.504.248
Adobe Inc .....	3.449	1.250.038
AbbVie Inc .....	8.574	1.237.171
Lam Research Corp .....	2.274	1.234.074
Deere & Co .....	3.144	1.219.626
JPMorgan Chase & Co .....	9.053	1.138.069
Broadcom Inc .....	1.532	1.090.586
Home Depot Inc .....	3.573	1.079.403
Texas Instruments Inc .....	6.108	1.065.660

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Johnson Controls International Plc .....	16.468	1.021.429
Visa Inc .....	4.830	997.033
Walt Disney Co .....	10.402	985.243
Weyerhaeuser Co .....	28.670	957.279
Comcast Corp .....	24.749	916.709

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Tencent Holdings Ltd .....	53.156	2.318.403
Alibaba Group Holding Ltd .....	138.755	1.546.406
Meituan .....	38.251	689.820
Baidu Inc .....	22.550	347.381
East Money Information Co Ltd .....	154.400	319.552
BYD Co Ltd 'H' Shares .....	10.921	303.871
China Conch Venture Holdings Ltd .....	161.000	280.294
LONGi Green Energy Technology Co Ltd .....	49.100	275.820
Pinduoduo Inc ADR .....	3.542	253.047
China Three Gorges Renewables Group Co Ltd .....	309.600	247.063
NetEase Inc .....	14.060	246.282
Sungrow Power Supply Co Ltd .....	14.100	225.722
Wuxi Biologics Cayman Inc .....	31.615	203.683
China Life Insurance Co Ltd .....	112.559	199.054
NARI Technology Co Ltd .....	52.800	199.008
Kweichow Moutai Co Ltd .....	800	198.221
Yum China Holdings Inc .....	3.176	194.208
Trip.com Group Ltd ADR .....	5.048	181.256
China Tourism Group Duty Free Corp Ltd .....	10.400	177.616
JA Solar Technology Co Ltd .....	22.000	177.574
Tongwei Co Ltd .....	30.300	174.368
China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	262.000	173.907

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Meituan .....	23.104	324.773
JD.com Inc .....	7.900	137.611
Trip.com Group Ltd ADR .....	1.752	55.328
Tencent Holdings Ltd .....	1.392	55.151
China Construction Bank Corp 'H' Shares .....	88.000	53.028
DHC Software Co Ltd .....	35.200	36.359
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd .....	53.400	36.020
Haidilao International Holding Ltd .....	16.000	33.635
New Oriental Education & Technology Group Inc .....	8.900	33.091
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H' Shares .....	34.200	30.796
360 Security Technology Inc .....	15.200	29.718
Beijing Enterprises Water Group Ltd .....	90.000	23.835
TAL Education Group ADR .....	4.152	22.545
Sungrow Power Supply Co Ltd .....	1.400	21.611
NIO Inc ADR .....	1.680	21.470
China Three Gorges Renewables Group Co Ltd .....	28.000	21.309

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
JOYY Inc ADR .....	800	19.840
GDS Holdings Ltd .....	13.600	16.758
Tencent Music Entertainment Group ADR .....	2.320	16.101
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' Shares .....	2.500	15.273
ZTE Corp 'H' Shares .....	6.800	14.737
Shanghai Medicilon Inc .....	800	14.630
China Longyuan Power Group Corp Ltd .....	11.000	13.300
ZTE Corp 'A' Shares .....	3.800	13.126



# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Republic of Poland Government International Bond 1.13% 07/08/2026 .....	2.000.000	2.036.076
Brazilian Government International Bond 2.88% 06/06/2025 .....	1.700.000	1.606.750
Mexico Government International Bond 2.38% 11/02/2022 .....	1.900.000	1.604.695
Colombia Government International Bond 7.38% 18/09/2037 .....	1.700.000	1.458.390
Romanian Government International Bond 2.88% 11/03/2029 .....	1.500.000	1.398.174
Chile Government International Bond 1.63% 30/01/2025 .....	1.300.000	1.353.794
Romanian Government International Bond 4.63% 03/04/2049 .....	1.900.000	1.259.440
Israel Government International Bond 2.75% 03/07/2030 .....	1.400.000	1.249.197
Republic of Poland Government International Bond 1.00% 25/10/2028 .....	1.300.000	1.239.640
Chile Government International Bond 1.44% 01/02/2029 .....	1.300.000	1.234.548
Republic of South Africa Government International Bond 5.88% 22/06/2030 .....	1.400.000	1.225.526
Peruvian Government International Bond 2.78% 23/01/2031 .....	1.500.000	1.196.265
Chile Government International Bond 0.56% 21/01/2029 .....	1.350.000	1.070.983
Philippine Government International Bond 3.70% 02/02/2042 .....	1.400.000	1.062.438
Republic of Poland Government International Bond 0.00% 07/07/2023 .....	1.000.000	979.661
Philippine Government International Bond 3.00% 01/02/2028 .....	1.050.000	964.775
Brazilian Government International Bond 4.75% 14/01/2050 .....	1.400.000	960.730
Chile Government International Bond 2.55% 27/07/2033 .....	1.050.000	868.125
Romanian Government International Bond 2.88% 28/10/2024 .....	900.000	854.339
Croatia Government International Bond 2.88% 22/04/2022 .....	930.000	830.746
Mexico Government International Bond 5.00% 27/04/2020 .....	1.000.000	763.400
Panama Government International Bond 3.87% 23/07/2060 .....	1.150.000	722.318
Hungary Government International Bond 5.38% 25/03/2014 .....	720.000	717.720
Dominican Republic Government International Bond 6.00% 19/07/2028 .....	800.000	715.790
Republic of Poland Government International Bond 2.75% 25/05/2032 .....	800.000	692.612
Philippine Government International Bond 1.20% 28/04/2033 .....	800.000	676.907
Philippine Government International Bond 1.65% 10/06/2031 .....	800.000	647.520
Philippine Government International Bond 4.20% 21/01/2024 .....	650.000	646.210
Costa Rica Government International Bond 5.63% 30/04/2043 .....	750.000	629.625
Uruguay Government International Bond 4.98% 20/04/2055 .....	700.000	611.770
Colombia Government International Bond 4.13% 22/02/2042 .....	900.000	608.562
Chile Government International Bond 4.34% 07/03/2042 .....	700.000	564.850
Mexico Government International Bond 4.75% 08/03/2012 .....	700.000	545.310
Panama Government International Bond 2.25% 29/09/2032 .....	750.000	537.638
Dominican Republic Government International Bond 5.88% 30/01/2060 .....	720.000	484.040
Senegal Government International Bond 5.38% 08/06/2037 .....	600.000	470.337
Dominican Republic Government International Bond 4.88% 23/09/2032 .....	550.000	435.050
<b>Größte Verkäufe</b>	<b>Anteile</b>	<b>Erlöse USD</b>
Mexico Government International Bond 3.63% 09/04/2014 .....	1.850.000	1.947.915

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Mexico Government International Bond 2.38% 11/02/2022 .....	1.900.000	1.815.616
Croatia Government International Bond 2.88% 22/04/2022 .....	1.650.000	1.649.528
Hungary Government International Bond 5.38% 25/03/2014 .....	1.300.000	1.306.695
Mexico Government International Bond 4.75% 08/03/2012 .....	1.430.000	1.254.110
Mexico Government International Bond 4.50% 31/07/2019 .....	1.270.000	1.054.837
Mexico Government International Bond 5.00% 27/04/2020 .....	1.000.000	880.500
Croatia Government International Bond 2.70% 15/06/2018 .....	550.000	565.136
Republic of Poland Government International Bond 1.13% 07/08/2026 .....	300.000	308.265
Colombia Government International Bond 7.38% 18/09/2037 .....	300.000	288.534
Brazilian Government International Bond 2.88% 06/06/2025 .....	300.000	286.500
Ghana Government International Bond 10.75% 14/10/2015 .....	420.000	276.570
Peruvian Government International Bond 2.78% 23/01/2031 .....	300.000	258.600
Ghana Government International Bond 8.63% 16/05/2018 .....	900.000	256.725
Romanian Government International Bond 4.63% 03/04/2049 .....	300.000	253.595
Chile Government International Bond 0.56% 21/01/2029 .....	250.000	228.601
Republic of South Africa Government International Bond 5.88% 22/06/2030 .....	250.000	227.750
Israel Government International Bond 2.75% 03/07/2030 .....	250.000	221.352
Republic of Poland Government International Bond 0.00% 07/07/2023 .....	200.000	218.786
Romanian Government International Bond 2.88% 28/10/2024 .....	200.000	215.972
Chile Government International Bond 1.63% 30/01/2025 .....	200.000	212.028
Philippine Government International Bond 4.20% 21/01/2024 .....	200.000	198.750
Colombia Government International Bond 4.00% 26/02/2024 .....	200.000	197.340
Panama Government International Bond 4.00% 22/09/2024 .....	200.000	196.036
Uruguay Government International Bond 4.98% 20/04/2055 .....	200.000	195.000
Republic of Poland Government International Bond 1.00% 25/10/2028 .....	200.000	193.205
Chile Government International Bond 1.44% 01/02/2029 .....	200.000	191.373
Romanian Government International Bond 2.88% 11/03/2029 .....	200.000	191.044
Philippine Government International Bond 3.00% 01/02/2028 .....	200.000	187.194
Chile Government International Bond 4.34% 07/03/2042 .....	200.000	178.500

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung) Franklin Metaverse UCITS ETF

## Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
PayPal Holdings Inc .....	1.691	140.231
Meta Platforms Inc .....	895	130.506
Apple Inc .....	791	122.504
Block Inc .....	1.665	109.039
Alphabet Inc .....	972	104.514
QUALCOMM Inc .....	789	99.756
Microsoft Corp .....	389	98.524
ROBLOX Corp .....	2.507	95.663
Electronic Arts Inc .....	760	94.995
Advanced Micro Devices Inc .....	1.153	89.267
Accenture Plc .....	302	88.315
Take-Two Interactive Software Inc .....	738	88.222
Mastercard Inc .....	268	86.862
NVIDIA Corp .....	645	86.858
Snap Inc .....	8.058	85.989
Autodesk Inc .....	380	81.051
Visa Inc .....	406	80.656
Adobe Inc .....	234	79.133
PTC Inc .....	647	78.162
Amazon.com Inc .....	862	78.058
Coinbase Global Inc .....	1.249	76.304
Activision Blizzard Inc .....	982	76.056
STMicroelectronics NV .....	2.179	75.382
Unity Software Inc .....	1.830	70.756
STMicroelectronics NV (France Traded) .....	1.777	70.154
Overstock.com Inc .....	2.930	65.651
fuboTV Inc .....	23.935	64.604
Globant SA .....	317	63.688
NAVER Corp .....	411	61.781
Sunny Optical Technology Group Co Ltd .....	4.400	53.546
HTC Corp .....	27.000	52.925
Marathon Digital Holdings Inc .....	4.896	46.149
Signature Bank .....	271	45.633
Vuzix Corp .....	6.100	45.511
Zhen Ding Technology Holding Ltd .....	10.740	39.188
Riot Blockchain Inc .....	6.741	38.575
eXp World Holdings Inc .....	2.811	38.464
Cleanspark Inc .....	9.575	37.472

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Metaverse UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
NVIDIA Corp .....	336	128.437
Meta Platforms Inc .....	432	117.208
Amazon.com Inc .....	862	109.179
Mastercard Inc .....	268	95.926
Take-Two Interactive Software Inc .....	738	90.486
Visa Inc .....	406	87.120
STMicroelectronics NV .....	2.179	83.631
Penumbra Inc .....	157	44.516
Advanced Micro Devices Inc .....	351	43.709
Riot Blockchain Inc .....	2.999	30.769
Microsoft Corp .....	97	29.072
Vuzix Corp .....	6.100	27.943
PTC Inc .....	219	27.174
Adobe Inc .....	54	25.865
Globant SA .....	135	23.743
ROBLOX Corp .....	699	23.311
Apple Inc .....	128	18.494
Kopin Corp .....	11.390	15.775
PayPal Holdings Inc .....	185	13.652
Snap Inc .....	1.375	13.000

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF

### Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd .....	22.400	379.878
Tencent Holdings Ltd .....	5.148	223.382
Samsung Electronics Co Ltd .....	3.562	162.055
Alibaba Group Holding Ltd .....	13.600	146.643
Samsung SDI Co Ltd .....	234	129.554
Delta Electronics Inc .....	8.880	85.278
Samsung Electro-Mechanics Co Ltd .....	658	76.016
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV .....	4.040	75.148
Hanwha Solutions Corp .....	1.621	64.665
Meituan .....	3.800	62.908
Infosys Ltd .....	3.356	60.541
Al Rajhi Bank .....	2.850	57.013
BYD Co Ltd 'H' Shares .....	2.000	55.911
Housing Development Finance Corp Ltd .....	1.606	52.352
China Conch Venture Holdings Ltd .....	26.000	50.115
ICICI Bank Ltd .....	4.768	49.912
Bharat Electronics Ltd .....	39.358	45.900
China Longyuan Power Group Corp Ltd .....	36.000	44.621
LONGi Green Energy Technology Co Ltd .....	7.000	43.189
Hindustan Unilever Ltd .....	1.376	42.540

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Hanwha Solutions Corp .....	1.347	45.316
Samsung Electronics Co Ltd .....	570	30.596
Orbia Advance Corp SAB de CV .....	12.800	26.396
SK Hynix Inc .....	214	17.472
Barwa Real Estate Co .....	20.546	14.475
Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock) .....	288	12.688
Ijjin Materials Co Ltd .....	260	11.200
LG Electronics Inc .....	98	9.047
China Longyuan Power Group Corp Ltd .....	8.000	8.960
BOC Aviation Ltd .....	1.000	7.341
ZTE Corp 'A' Shares .....	1.400	6.903
China Conch Venture Holdings Ltd .....	4.000	5.021
L&F Co Ltd .....	24	4.872
Kia Corp .....	72	4.650
Kweichow Moutai Co Ltd .....	18	4.109
Bandhan Bank Ltd .....	1.186	3.837
Ayala Corp .....	320	3.736
LPP SA .....	1	2.821

# ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS  
ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Yuexiu Property Co Ltd .....	1.800	2.353
Cia de Minas Buenaventura SA ADR .....	308	2.241

# Anhang: Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

## Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen und bei nachhaltigen Investitionen in regelmäßigen Berichten

Die Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor ([EU] 2019/2088, die Offenlegungsverordnung, kurz „SFDR“) schreibt der Gesellschaft Erläuterungen zu folgenden Aspekten in ihren regelmäßigen Berichten vor: inwieweit ein gemäß Artikel 8 der SFDR klassifizierter Fonds (ein „Artikel-8-Fonds“) seine ökologischen oder sozialen Merkmale erfüllt hat oder inwieweit ein gemäß Artikel 9 der SFDR (ein „Artikel-9-Fonds“) sein nachhaltiges Investitionsziel erfüllt hat. Die SFDR überträgt ferner der Europäischen Bankenaufsichtsbehörde, der Europäischen Aufsichtsbehörde für das Versicherungswesen und die betriebliche Altersversorgung und der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (zusammen die Europäischen Aufsichtsbehörden, kurz „ESAs“) die Befugnis, Entwürfe für technische Regulierungsstandards („RTS“) auszuarbeiten, in denen das Format der Informationen und der Darstellung in den regelmäßigen Berichten näher festgelegt wird. Die folgenden regelmäßigen Offenlegungen zu Fonds gemäß Artikel 8 und Artikel 9 der SFDR wurden unter Verwendung der gemeinsamen Offenlegungen zur Nachhaltigkeit oder Berichtsanforderungen der RTS, die am 1. Januar 2023 in Kraft traten, erstellt. Die Klassifizierungen von Anlagen in den folgenden Offenlegungen basieren auf MSCI und können sich von der Klassifizierung der Wertpapiere in der Vermögensaufstellung unterscheiden.

Die Offenlegungen für die einzelnen Klassifizierungen werden wie folgt zusammengefasst:

<b>Name des Teilfonds</b>	<b>SFDR-Klassifizierung</b>
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	Artikel 9
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	Artikel 8
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	Artikel 8
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 8
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 8
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	Artikel 8
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 8

# Franklin Euro Green Bond UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
549300DYLFFY0UQSSHE55



FRANKLIN  
TEMPLETON

## Nachhaltiges Investitionsziel

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="checkbox"/> JA	<input type="checkbox"/> NEIN
<input checked="" type="checkbox"/> Damit wurden <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: 97,16% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<input type="checkbox"/> Damit wurden <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> , und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul>
<input type="checkbox"/> Damit wurden <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: 0,00% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> Damit wurden <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b>, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>.</li> </ul>	



## Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Im Berichtszeitraum verfolgte der Fonds sein ökologisches Ziel durch Allokationen in Produkte, bei denen nachhaltiges Investieren ein Kernziel war, flankiert durch eine Kombination von Ausschlüssen und Engagement:

\* Der Fonds investierte 95,57 % in grüne Anleihen, 1,59 % in andere geeignete Instrumente zur Finanzierung einer positiven ökologischen Einflussnahme und 2,84 % in liquide Mittel und Derivate.

\* Zur Erreichung seines Umweltziels analysierte das Anlageverwaltungsteam alle relevanten Ausgaben, die mit einer Anleihe finanziert würden, sowie die wirtschaftliche Tätigkeit des Emittenten insgesamt, um sicherzustellen, dass weder das eine noch das andere den übrigen ökologischen oder sozialen Zielen schaden würde. Darüber hinaus würde jeder Emittent aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen werden, der in schädliche Wirtschaftstätigkeiten und/oder Kontroversen involviert ist.

\* Der Fonds verpflichtete sich zu Investitionen in als grün bezeichnete Anleihen und andere geeignete Wertpapiere, die als nachhaltige Investition mit einem Umweltziel gelten (d. h. eine CO<sub>2</sub>-arme Zukunft fördern). Ein Beispiel dafür ist die Investition des Fonds in eine von TenneT, einem niederländischen Betreiber von Übertragungssystemen für die Niederlande und große Teile Deutschlands, begebene Anleihe. Die grünen Anleihen des Unternehmens tragen zur Finanzierung neuer Verbindungen zwischen dem Stromnetz und der erzeugten Energie mithilfe erneuerbarer Energiequellen wie Offshore-Windkraftanlagen bei. Darüber hinaus hat sich TenneT verpflichtet, die Biodiversität in seinen Hochspannungsschaltanlagen zu verbessern, und setzt verschiedene Naturschutz- und Renaturierungsprojekte an der Nordseeküste um. Gemäß einer unabhängigen Überprüfung der Anleihe durch einen externen Dritten tragen diese Ausgaben erheblich zu den folgenden SDGs bei: Nr. 7 „Bezahlbare und saubere Energie“ und Nr. 13 „Klimaschutz“. Ein Beispiel aus dem Bereich Staatsanleihen ist die Investition des Fonds in eine von der Bundesrepublik Deutschland begebene Anleihe, mit der das Ziel der THG-Neutralität bis 2045 erreicht werden soll. Der größte Teil der mit der Anleihe beschafften Mittel wurde in die Förderung der Bioökonomie gelenkt. Mit Bioökonomie wird die Verwendung erneuerbarer biologischer Land- und Meeresressourcen für die Herstellung von Nahrungsmitteln, Grundstoffen und Energie bezeichnet. Ziel ist es, eine nachhaltigere Verwendung von Ressourcen sicherzustellen. Erwähnenswert sind unter anderem Projekte zur Erforschung der Substitution fossiler Rohstoffe durch erneuerbare Rohstoffe, zur Verbesserung der Nachhaltigkeit des Pflanzenbaus und zur Entwicklung nachhaltigerer biotechnologischer Methoden und Prozesse, die in der Produktion von chemischen Stoffen für Arzneimittel, Kosmetik oder Nahrungsmittel eingesetzt werden könnten. Die grünen Ausgaben Deutschlands trugen positiv zu den folgenden SDGs bei: Nr. 1 „Keine Armut“, Nr. 2 „Kein Hunger“, Nr. 7 „Bezahlbare und saubere Energie“, Nr. 8 „Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum“, Nr. 9 „Industrie, Innovation und Infrastruktur“, Nr. 11 „Nachhaltige Städte und Gemeinschaften“, Nr. 12



Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

(Alle Werte mit Stand vom 30. Juni, sofern nicht anders angegeben.)

- Betrag (in Euro), der vierteljährlich für geeignete Projekte bereitgestellt wird – auf der Grundlage der Allokation in grüne Anleihen:

Q3 2022 – 109.900.000 €

Q4 2022 – 212.431.000 €

Q1 2023 – 276.587.000 €

Q2 2023 – 297.737.000 €

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	95,57%
Prozentualer Anteil der Investitionen in andere zulässige Anleihen, die eine CO2-arme Zukunft fördern oder das Pariser Klimaabkommen unterstützen	1,59%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die in bestimmten Sektoren tätig sind oder mit ihnen in Verbindung stehen, und der zusätzlichen Ausschlüsse	0,00%

## ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

## ● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Der Anlageverwalter verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen.

Unternehmensemittenten wurden mit Hilfe der Principal Adverse Impacts („PAI“) Risk App (die „PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten eines Drittanbieters, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche Wirtschaftstätigkeiten und/oder Kontroversen involviert sind, und solche Emittenten aus dem Anlageuniversum auszuschließen.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft. Des Weiteren nahm der Anlageverwalter eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Einschätzung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und des Projekts vor.

Während des Bezugszeitraums gab es keine Verstöße gegen die Kriterien des Fonds.

## --- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Indikatoren nachteiliger Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die der Anlageverwalter als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden zu Folgendem benutzt:

Emittenten, die als schädlich eingestuft wurden, aus dem investierbaren Universum auszuschließen und

den Anlageverwalter über das mit nachteiligen Auswirkungen verbundene Risiko zu informieren und geeignete Maßnahmen zu ergreifen; dazu gehörten Due-Diligence-Prüfungen, qualitative Prüfungen und/oder Engagement.

Bei der Bewertung der in Frage kommenden Anleihen prüfte und dokumentierte der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der relevanten PAIs für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

Wenn der Anlageverwalter beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte er sich, dass die finanzierten Projekte in Bezug auf die PAI-Faktoren für Treibhausgasemissionen gut abgeschnitten.

## --- **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei Anleihen von Unternehmensemittenten stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Bei Anleihen, die von souveränen Staaten begeben werden, sind die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte nicht auf solche Investitionen anwendbar.

Diese Konformität wird mit Hilfe von Daten von MSCI überwacht. Verstöße, die anhand der Daten von MSCI festgestellt werden, werden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit der Anlageverwalter sie untersuchen kann.

Ergibt die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht einhält, wird er als nicht investierbar eingestuft und vom Anlageverwalter veräußert.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

- **Durchführung der DNSH-bezogenen Überprüfung und**
- **Hilfestellung für thematisches Engagement.**

Durchführung der DNSH-bezogenen Überprüfung

Der Anlageverwalter verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen anhand der PAI-Indikatoren sicherzustellen. Unternehmensemittenten wurden mit der PAI Risk App überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten eines Drittanbieters, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen involviert sind (basierend auf allen verpflichtenden PAIs), und schloss solche Emittenten aus dem Anlageuniversum aus. Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre Treibhausgasemissionen, politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft und entsprechend bewertet.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwalter erfüllten ihre zum 1. Januar 2023 eingegangene Verpflichtung zu einem Engagement (auf Basis des Kalenderjahres) bei 5 % der Beteiligungen, die in Bezug auf ihre Gesamtexponierung gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-07-01 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Bundesobligation 10/10/2025 REG S	Staatsanleihen	8,23%	Deutschland
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 08/15/2030 REG S	Staatsanleihen	6,34%	Deutschland
Netherlands Government Bond .5% 01/15/2040 144A REG S	Staatsanleihen	4,97%	Niederlande
Kreditanstalt Fuer Wiederaufbau 06/15/2029 REG S	Staatsanleihen	4,19%	Deutschland
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 08/15/2050 REG S	Staatsanleihen	4,00%	Deutschland
Ireland Government Bond 1.35% 03/18/2031 REG S	Staatsanleihen	3,37%	Irland
Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 04/22/2033 REG S	Staatsanleihen	2,30%	Belgien
Spain Government Bond 1% 07/30/2042 144A REG S	Staatsanleihen	2,20%	Spanien
French Republic Government Bond OAT 1.75% 06/25/2039 REG S 144A	Staatsanleihen	2,12%	Frankreich
Societe Nationale SNCF SA .625% 04/17/2030 REG S	Staatsanleihen	1,93%	Frankreich
Autonomous Community Of Madrid Spain .827% 07/30/2027 REG S	Staatsanleihen	1,54%	Spanien
Societe Du Grand Paris EPIC 11/25/2030 REG S	Staatsanleihen	1,49%	Frankreich
Arion Banki HF .375% 07/14/2025 REG S	Finanzsektor	1,29%	Island
Chile Government International Bond .83% 07/02/2031	Staatsanleihen	1,20%	Chile
Orsted AS FRN 12/09/3019 REG S *FIXED TO FLOAT*	Versorgungsunternehmen	1,11%	Dänemark



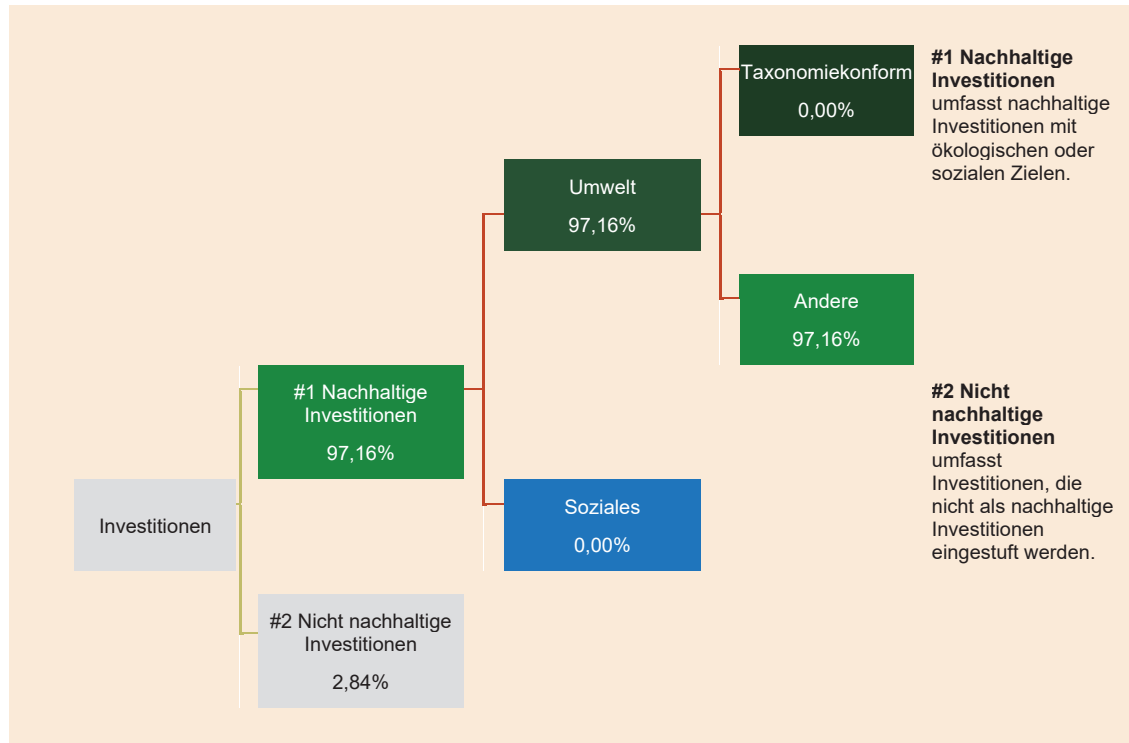
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 97,16 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,16 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,84 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln sowie Derivaten, die zu Absicherungszwecken eingesetzt werden, und Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und -untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

<b>Wichtigster Sektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Staatsanleihen	45,45%
Finanzsektor	23,13%
Versorgungsunternehmen	16,64%
Industrie	4,08%
Immobilien	2,76%
Zyklische Konsumgüter	2,15%
Kommunikationsdienste	1,67%
Basiskonsumgüter	0,79%
Grundstoffe	0,42%
<b>Wichtigster Teilsektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Staatsanleihen	45,45%
Banken	15,98%
Stromversorger	12,87%
Versicherungen	4,41%
Multi-Versorger	2,84%
Finanzdienstleistungen	2,74%
Diversifizierte REITs	1,71%
Bau- u. Ingenieurwesen	1,68%
Automobilindustrie	1,63%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,37%
Überlandtransport	1,09%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	1,05%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	0,93%
Lebensmittel	0,79%
Luftfracht u. -logistik	0,77%



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind **Wirtschaftstätigkeiten**, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

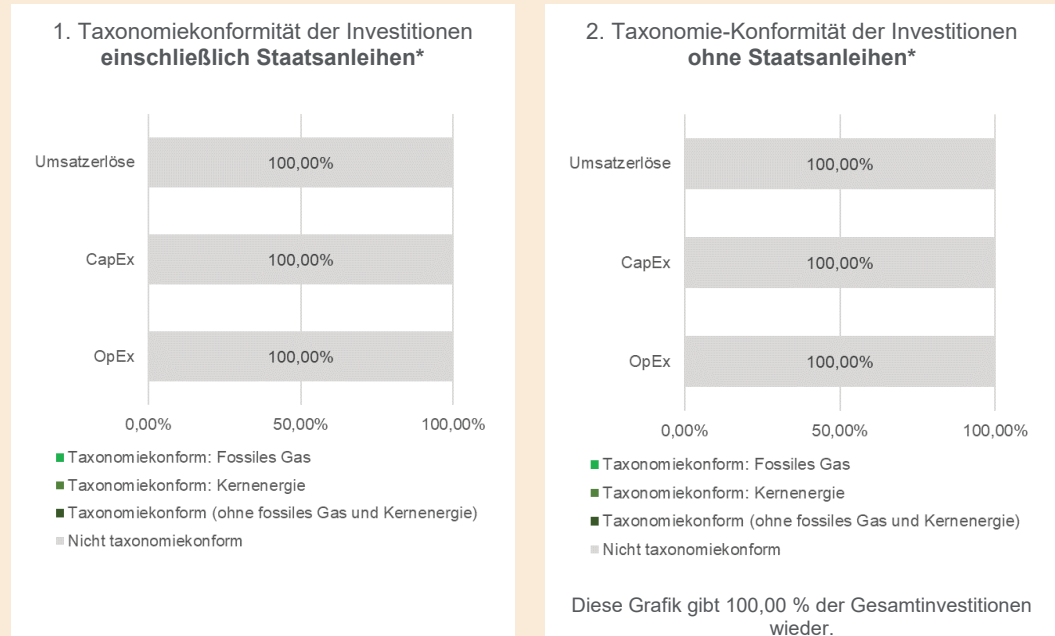
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Nicht zutreffend. Wie im Nachtrag dargelegt, verpflichtet sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert? <sup>1</sup>

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Der Fonds investierte 97,16 % des NIW in Wirtschaftstätigkeiten, die als ökologisch nachhaltig gemäß Definition von nachhaltigen Investitionen in der SFDR gelten (2.17).



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.



## Welche Investitionen fielen unter „Nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ fallenden Anlagen lag bei 2,84 % und umfasste liquide Mittel (ergänzende liquide Mittel, Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds), die für das Tagesgeschäft und die Anforderungen des Fonds gehalten werden, sowie derivative Instrumente, die zu Absicherungszwecken eingesetzt werden.

Bei Derivaten bestimmte der Anlageverwalter den Basiswert und unterzog diesen gegebenenfalls je nach Art des Basiswerts allen relevanten ESG-Screenings. Zur Klarstellung: Der Anlageverwalter stellt sicher, dass der Basiswert von Derivaten, die für ein effizientes Portfoliomanagement verwendet werden, als nachhaltige Investition eingestuft werden kann.

Wenn es dem Anlageverwalter aufgrund der Art des Basiswerts nicht möglich war, dessen ESG-Qualität zu bestimmen (z. B. bei Devisentermingeschäften zu Absicherungszwecken), bewerte er das ESG-Profil der Gegenpartei eines Derivatkontrakts. Handelte es sich bei der Gegenpartei um eine Tochtergesellschaft ohne eigenes ESG-Berichtssystem, wurden die ESG-Merkmale einer Muttergesellschaft herangezogen. Der Fonds schloss keine Derivate mit Finanzinstituten, die die ESG-Kriterien des Anlageverwalters nicht erfüllten. Um als Gegenpartei in Frage zu kommen, muss ein Finanzinstitut mindestens zwei der folgenden Kriterien erfüllen:

- MSCI ESG-Rating von BBB oder besser – oder, falls kein MSCI-Rating vorliegt, ein über dem Branchendurchschnitt liegendes Rating, das vom alternativen externen ESG-Datenanbieter vergeben wird,
- Unterzeichner der Equator Principles,
- Unterzeichner der Task Force on Climate-Related Financial Disclosures und
- Verpflichtung zur Festlegung eines SBTi-Ziels (Science Based Target initiative).

Bei liquiden Mitteln wendet der Anlageverwalter einen ökologischen und sozialen Mindestschutz an, indem er überprüft, ob die für die Platzierung von Einlagen verwendeten Gegenparteien die EU Taxonomy Safeguards, wie von MSCI bewertet, erfüllen. Gegenparteien, die diese Kriterien nicht erfüllen, werden von dem Fonds nicht eingesetzt.

Der begrenzte Anteil der Investitionen, die unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ fallen, und der geltende Mindestschutz beeinträchtigten die Einhaltung der nachhaltigen Anlageziele des Fonds auf kontinuierlicher Basis nicht.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Mehrere verbindliche Elemente in der Anlagestrategie trugen dazu bei, die Erreichung des vom Fonds beworbenen Umweltziels zu fördern:

\* Um sicherzustellen, dass der Fonds mindestens 75 % seines NIW in als grün bezeichnete Anleihen und mindestens 90 % in nachhaltige Anlagen investierte, implementierten die Portfoliomanager einen aus mehreren Schritten bestehenden Wertpapierauswahlprozess. Zunächst überprüfte der Anlageverwalter, dass alle relevanten Ausgaben für eine Anleihe nachhaltig waren und positiv zu Umweltzielen beitrugen. Dann stellte der Anlageverwalter sicher, dass weder die Projekte noch der Emittent anderen ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Der Emittent durfte auch nicht in schädliche Wirtschaftstätigkeiten und/oder Kontroversen involviert sein. Der prozentuale Anteil von bis zu 25 % des NIW, die der Fonds in Anleihen investieren darf, die nicht als grün eingestuft sind, ermöglichte es uns, in andere Instrumente zu investieren, die positiv zu Umweltzielen beitrugen, wie z. B. blaue Anleihen oder von Pure Playern begebene Anleihen.

\* Der Anlageverwalter setzte zahlreiche IT-Tools ein, um das Portfolio so zusammenzustellen, dass es auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist. Mithilfe interner und externer Inputdaten (z. B. von MSCI) beurteilten die Anlageverwalter, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht. Beispielsweise wurden staatliche Emittenten, die als „Unfrei“ nach dem Freedom House Index eingestuft waren, oder Versorgungsunternehmen, die einen nicht akzeptablen Anteil der Umsätze aus fossilen Brennstoffen erzielten oder keine ehrgeizigen Dekarbonisierungsziele verfolgten, aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen (die komplette Aufstellung der Ausschlüsse ist in den vorvertraglichen Informationen des Fonds zu finden).

\* Engagement ist integraler Bestandteil des Nachhaltigkeitsansatzes und ESG-Managements des Fonds. Alle unsere Engagements sind oben im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“ aufgeführt. Das nachfolgende Beispiel soll jedoch den Ansatz der Portfoliomanager verdeutlichen. Im Berichtszeitraum arbeitete der Anlageverwalter im Rahmen eines Engagements mit dem österreichischen Büro für Schuldenmanagement zusammen, um die Nachhaltigkeitspolitik des Landes besser zu verstehen. Bei unseren Sitzungen besprach der Anlageverwalter, wie wichtig Maßnahmen zur Anpassung an den Klimawandel sind, um langfristiges Wachstum der nationalen Volkswirtschaft sicherzustellen. Dabei erörterte er die Auswirkungen von Wetterveränderungen auf die Erzeugung von Strom aus Wasserkraft als Beispiel für schädliche Auswirkungen, die mit modernen technischen Lösungen angegangen werden können. Darüber hinaus sprach der Anlageverwalter das Problem der Biodiversitätskrise an, das nach dessen Auffassung genauso wichtig ist wie die Klimawandelkrise.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt das nachhaltige Ziel erreicht.

Nicht zutreffend



# Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
549300WLCPUDYKVK0X09



FRANKLIN  
TEMPLETON

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 22,38% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte ökologische und soziale Merkmale, das heißt (i) den Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft und (ii) die Anwendung von Negativ-Filtern im Rahmen des Anlageprozesses, durch eine Kombination aus Ausschlüssen, Best-in-Class-Investments und Engagement:

\* Um die Energieeinsparung und die Reduzierung von Treibhausgasemissionen zu fördern, war das Portfoliomanagementteam bestrebt, in vom Anlageverwalter als Umweltchampions bezeichnete Emittenten zu investieren. Als Umweltchampions wurden staatliche Emittenten bezeichnet, die bei Umweltfaktoren wie Treibhausgasemissionen, Energieintensität, Schutz der biologischen Vielfalt, Luftverschmutzung und Anteil erneuerbarer Energien zu den besten 20 % ihrer Vergleichsgruppe gehörten. Dabei handelte es sich bei Unternehmensemittenten um Unternehmen, die basierend auf der Treibhausgasintensität zu den oberen 20 % ihrer Branchenvergleichsgruppe zählten. Am Ende des Berichtszeitraums lag die Allokation des Fonds in Umweltchampions bei 32,3 % seines Nettoinventarwerts (NIW).

\* Darüber hinaus wurden die unteren 20 %, die sogenannten Umweltnachzügler, aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen. Zudem investierte der Fonds nicht in Emittenten, deren Beteiligung an der Förderung fossiler Brennstoffe oder an der Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen über das vom Anlageteam für akzeptabel erachtete Niveau hinausging (wie in den vorvertraglichen Informationen des Fonds beschrieben; zum Beispiel wird jedes Unternehmen, das mehr als 5 % seines Umsatzes aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielt, für nicht investierbar erachtet).

\* Um den Schutz der Biodiversität zu unterstützen und ein verantwortungsbewusstes Abfallmanagement (insbesondere Plastikabfall) zu fördern, wurden diese Themen im Rahmen der umfangreichen Engagements des Anlageverwalters mit Emittenten aus Sektoren, die wesentliche Auswirkungen auf die Biodiversität haben (z. B. Nahrungsmittel und Getränke), besprochen. Weitere Informationen sind unten im Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ zu finden. Darüber hinaus hielt sich der Fonds von Emittenten mit negativen Auswirkungen auf die Artenvielfalt in sensiblen Bereichen fern.

\* Im Berichtszeitraum war der Fonds auf die verschiedenen internationalen Normen ausgerichtet und beachtete die Vorgaben von UN Global Compact, die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.

\* Das Portfoliomanagementteam initiierte auch eine Engagement-Kampagne, um die Geschlechtervielfalt zu fördern, mit Fokus auf dem geschlechtsspezifischen Lohngefälle sowie Frauen in Führungs- und Managementpositionen. Dieses Engagement wird bis ins dritte Quartal 2023 fortgesetzt.

\* Der Fonds hat sich zu einer Mindestallokation von 10 % seines NIW in nachhaltigen Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten verpflichtet, die zu ökologischen Zielen beitragen, und zu einer Mindestallokation von 1 % in solche, die zu sozialen Zielen beitragen. Im Berichtszeitraum waren 22,38 % des NIW des Fonds in nachhaltigen Investitionen angelegt (siehe detaillierte Aufgliederung im unten stehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“). Erreicht wurde dies

hauptsächlich durch Investitionen in Anleihen, bei denen die Mittel für grüne, soziale und nachhaltige Zwecke verwendet werden und die ausdrücklich für die Finanzierung geeigneter ökologischer und/oder sozialer Projekte begeben werden. Ein Beispiel dafür ist die Investition des Fonds in eine von der Bundesrepublik Deutschland begebene Anleihe, mit der das Ziel der THG-Neutralität bis 2045 erreicht werden soll. Der größte Teil der mit der Anleihe beschafften Mittel wurde in die Förderung der Bioökonomie gelenkt. Mit Bioökonomie wird die Verwendung erneuerbarer biologischer Land- und Meeresressourcen für die Herstellung von Nahrungsmitteln, Grundstoffen und Energie bezeichnet. Ziel ist es, eine nachhaltigere Verwendung von Ressourcen sicherzustellen. Erwähnenswert sind unter anderem Projekte zur Erforschung der Substitution fossiler Rohstoffe durch erneuerbare Rohstoffe, zur Verbesserung der Nachhaltigkeit des Pflanzenbaus und zur Entwicklung nachhaltigerer biotechnologischer Methoden und Prozesse, die in der Produktion von chemischen Stoffen für Arzneimittel, Kosmetik oder Nahrungsmittel eingesetzt werden könnten.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

(Alle Werte mit Stand vom 30. Juni, sofern nicht anders angegeben.)

- Exponierung gegenüber den Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) im Vergleich zum ICE BofA 0-1 Year Euro Broad Market Index. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren per 30. Juni 2023 ab.

- Liste der Emittenten, mit denen zwischen dem 1. Juli 2022 und 30. Juni 2023 ein Engagement mit Franklin Templeton Investment Management Limited und Franklin Advisers, Inc. (die „Anlageverwalter“) bestand. 1. ABANCA CORP BANCARIA SA, 2. ABB FINANCE BV, 3. ABBVIE INC, 4. ABERTIS INFRASTRUCTURAS, 5. AIB GROUP PLC, 6. APPLE INC, 7. ARION BANKI HF, 8. ARKEA HOME LOANS, 9. ASAHI GROUP HOLDINGS LTD, 10. ATF NETHERLANDS BV, 11. AUTOROUTES DU SUD DE LA, 12. AUTOSTRADE PER LITALIA, 13. AXA SA, 14. BACARDI LTD, 15. BANK OF AMERICA CORP, 16. BELFIUS BANK SA/NV, 17. BELGIUM KINGDOM, 18. BLACKSTONE PP EUR HOLD, 19. BNP PARIBAS, 20. BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND, 21. CAIXA GERAL DE DEPOSITOS, 22. CAIXABANK SA, 23. COCA-COLA HBC FINANCE BV, 24. CREDIT AGRICOLE LONDON, 25. CREDIT AGRICOLE SA, 26. CREDIT MUTUEL ARKEA, 27. CREDIT SUISSE AG LONDON, 28. CTP NV, 29. DEUTSCHE TELEKOM INT FIN, 30. ENEL SPA, 31. ENGIE SA, 32. EUROPEAN INVESTMENT BANK, 33. EUROPÄISCHE UNION, 34. GOLDMAN SACHS GROUP INC, 35. GRAND CITY PROPERTIES SA, 36. HEIMSTADEN BOSTAD AB, 37. IBERCAJA BANCO SA, 38. IBM CORP, 39. ING GROEP NV, 40. KRAFT HEINZ FOODS CO, 41. LANDSBANKINN HF, 42. LLOYDS BANKING GROUP PLC, 43. LOGICOR FINANCING SARL, 44. LOREAL SA, 45. MORGAN STANLEY, 46. MYLAN NV, 47. NATIONAL GRID NA INC, 48. NATIONWIDE BLDG SOCIETY, 49. NATL WESTMINSTER BANK, 50. NETHERLANDS GOVERNMENT, 51. NOVO NORDISK FINANCE NL, 52. NYKREDIT REALKREDIT AS, 53. PERNOD RICARD SA, 54. Primrose Residential, 55. RCI BANQUE SA, 56. REPUBLIK ÖSTERREICH, 57. REPUBLIK ZYPERN, 58. REPUBLIK ISLAND, 59. REPUBLIK LITAUEN, 60. REPUBLIK POLEN, 61. RUMÄNIEN, 62. SANOFI, 63. SANTANDER UK PLC, 64. SCHNEIDER ELECTRIC SE, 65. SELP FINANCE SARL, 66. SIEMENS FINANCIERINGSMAT, 67. SMITHS GROUP PLC, 68. SOCIETA INIZIATIVE AUSTR, 69. SOCIETE GENERALE, 70. STELLANTIS NV, 71. TELEFONICA EUROPE BV, 72. THAMES WATER UTIL FIN, 73. UPJOHN FINANCE BV, 74. VIVION INVESTMENTS, 75. VODAFONE GROUP PLC, 76. VOLKSWAGEN FIN SERV AG.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	20,84%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	1,54%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden	32,30%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die in ausgeschlossenen Sektoren tätig sind oder mit diesen in Verbindung stehen und weiterer Ausschlüsse (Wertpapiere, bei denen der prozentuale Anteil der Umsätze aus ausgeschlossenen Sektoren nach dem Ersterwerb über die im Verkaufsprospekt vorgegebenen Grenzen gestiegen ist, sodass ein Plan zur zeitnahen Veräußerung der Wertpapiere im besten Interesse der Anteilinhaber ausgelöst wurde)	0,99%
Anzahl der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter im Rahmen eines Engagements zusammenarbeitete	76,00

## ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

## ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Zu den Zielsetzungen nachhaltiger Investitionen gehörten unter anderem die Finanzierung und Förderung:

- der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- der sozialen Integration,

g) guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder

h) Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten eine Mindestallokation von 10 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die zu Umweltzielen beitrugen.

Dies wurde durch Investitionen in als „grün“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,

B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang stand (u. a. den Green Bond Principles der International Capital Market Association („ICMA“) und dem künftigen Green Bond Standard der Europäischen Union („EU GBS“)) und

C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufwiesen.

Die Verwendung der Mittel für diese Anleihen war klar definiert und auf die oben genannten Ziele ausgerichtet.

Darüber hinaus verpflichtete sich der Fonds, mindestens 1 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige soziale Aktivitäten zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,

B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang stand (u. a. den Social Bond Principles der ICMA), und

C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufwiesen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***• Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Der Anlageverwalter verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen.

Unternehmensemittenten wurden mit Hilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzt Daten von MSCI, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen involviert sind. Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken), Nr. 10 (Verletzung der Prinzipien des UN Global Compact und der OECD für multinationale Unternehmen) und Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verstoßen, sind vom Anlageuniversum des Fonds ausgeschlossen.

Der Anlageverwalter verwendet auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Intensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO<sub>2</sub>-Fußabdruck) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Intensität) (für Staaten) zu den untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppen gehören, werden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Darüber hinaus werden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten (PAI Nr. 16) und/oder Korruption überprüft.

Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm der Anlageverwalter eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Während des Bezugszeitraums gab es keine Verstöße gegen die Kriterien des Fonds.

### ***-----Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Indikatoren nachteiliger Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die der Anlageverwalter als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden zu Folgendem benutzt:

a) dem Ausschluss von Emittenten, die dem Portfolio wesentlich schaden, und

b) den Anlageverwalter über das mit nachteiligen Auswirkungen verbundene Risiko zu informieren und geeignete Maßnahmen zu ergreifen – dazu gehören Due-Diligence-Prüfungen, qualitative Prüfungen und/oder aktive Beteiligung (Einzelheiten zum Thema aktive Beteiligung sind in den Abschnitten „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie des Teilfonds“ des Fonds in diesem Anhang zu finden).

Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüfte und dokumentierte der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der relevanten PAI für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

Wenn der Anlageverwalter beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte er sich, dass die finanzierten Projekte in Bezug auf die PAI für Treibhausgasemissionen gut abschnitten.

### ***-----Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:***

Bei Anleihen von Unternehmensemittenten stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Bei Anleihen, die von souveränen Staaten begeben werden, sind die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte nicht auf solche Investitionen anwendbar.

Diese Konformität wird mit Hilfe von Daten von MSCI überwacht. Verstöße, die anhand der Daten von MSCI festgestellt werden, werden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit der Anlageverwalter sie untersuchen kann.

Ergibt die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht einhält, wird er als nicht investierbar eingestuft und vom Anlageverwalter veräußert.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

- (i) Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten,
- (ii) Beschränkung des Anlageuniversums des Fonds und
- (iii) Hilfestellung für thematisches Engagement.

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die vom Anlageverwalter als „Umweltchampions“ eingestuft wurden. „Umweltchampions“ wurden anhand von zwei proprietären ESG-Rankings identifiziert:

- Der EETI bewertete die Leistung staatlicher Emittenten in den Bereichen Energieeffizienz, Erhaltung des Naturkapitals und erneuerbare Energien anhand verschiedener Datenpunkte, einschließlich der Treibhausgasintensität (Emissionen normiert nach Bruttoinlandsprodukt, CO<sub>2</sub>e/BIP).
- Die ESG Credit App stufte Unternehmensemittenten nach ihren THG-Emissionen und ihrer THG-Emissionsintensität ein und verwendet dazu verschiedene Datenpunkte, wie z. B. die Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen sowie die historische Entwicklung der THG-Emittenten.

Einschränkung des investierbaren Universums des Fonds

Staatliche Emittenten, die basierend auf dem EETI zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehören, und Unternehmensemittenten, die basierend auf der ESG Credit App zu den untersten 20 % gehören (d. h. Klima-Nachzügler), wurden ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwalter erfüllten ihre zum 1. Januar 2023 eingegangene Verpflichtung zu einem Engagement (auf Basis des Kalenderjahres) bei 5 % der Beteiligungen, die in Bezug auf ihre Gesamtexponierung gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	6 014,33	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	1 715,76	24,67%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	1 165,49	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	322,76	24,67%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	47 124,30	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	13 614,10	24,60%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	7 179,81	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	2 038,52	24,67%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	54 304,10	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	15 652,70	24,67%
CO <sub>2</sub> -Bilanz 1&2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	33,12	42,62%
Benchmark – CO <sub>2</sub> -Bilanz 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	59,41	24,67%
Geschätzte CO <sub>2</sub> -Bilanz (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	250,49	42,62%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Benchmark – Geschätzte CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	456,15	24,67%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	47,21	50,34%
Benchmark – THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	57,97	39,72%
Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	660,38	50,34%
Benchmark – Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	774,58	39,72%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	1,51%	49,07%
Benchmark – Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	2,72%	38,73%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	61,91%	47,54%
Benchmark – Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	61,81%	34,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,23	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,52	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	9,55	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	2,93	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,95	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,25	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,58	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,11	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,58	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,56	24,75%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	49,07%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Benchmark – Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,09%	38,73%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%
Benchmark – Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,07%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,26	15,47%
Benchmark – Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	20,81	9,80%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	49,21%
Benchmark – Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,77%	38,77%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	13,14%	49,07%
Benchmark – Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	13,73%	38,73%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle der Portfoliounternehmen	19,47%	16,04%
Benchmark – Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle der Portfoliounternehmen	17,94%	10,99%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	40,96%	46,70%
Benchmark – Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	38,23%	31,38%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	49,07%
Benchmark – Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	38,73%





## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-07-01 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.10% 04/15/2023 INDEX LINKED TO CPTFEMU REG S	Staatsanleihen	5,88%	Deutschland
Bundesobligation 10/10/2025 REG S	Staatsanleihen	3,93%	Deutschland
Denmark Government International Bond 2.5% 11/18/2024 REG S	Staatsanleihen	3,25%	Dänemark
German Treasury Bill 11/22/2023 TBLM	Staatsanleihen	3,10%	Deutschland
Kreditanstalt Fuer Wiederaufbau .125% 06/07/2023	Staatsanleihen	2,25%	Deutschland
European Stability Mechanism Treasury Bill 05/18/2023 SPDC	Staatsanleihen	2,20%	Supranationale Titel
Austria Treasury Bill 08/24/2023 TBLM	Staatsanleihen	1,95%	Österreich
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 11/29/2023 REG S	Staatsanleihen	1,69%	Italien
Instituto De Credito Oficial 1.3% 10/31/2026 REG S	Staatsanleihen	1,65%	Spanien
Spain Letras Del Tesoro 10/07/2022 TBLM	Staatsanleihen	1,50%	Spanien
Austria Treasury Bill 02/23/2023 TBLM	Staatsanleihen	1,22%	Österreich
France Treasury Bill BTF 03/08/2023 TBLM	Staatsanleihen	1,22%	Frankreich
Kingdom Of Belgium Treasury Bill 03/09/2023 TBLM	Staatsanleihen	1,22%	Belgien
Austria Treasury Bill 05/25/2023 TBLM	Staatsanleihen	1,19%	Österreich
Dutch Treasury Certificate 10/28/2022 TBLM	Staatsanleihen	1,12%	Niederlande



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

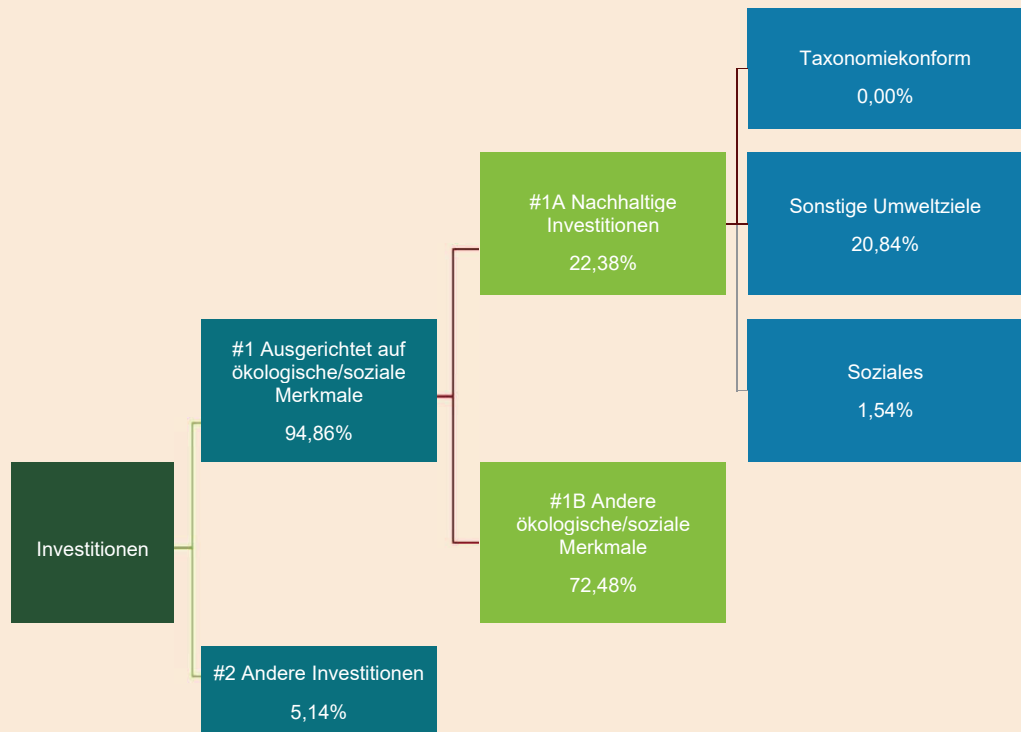
Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 22,38 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

94,86 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (5,14 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 22,38 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und -untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	46,53%
Finanzsektor	29,03%
Industrie	5,89%
Gesundheitssektor	4,19%
Basiskonsumgüter	4,14%
Kommunikationsdienste	2,00%
Versorgungsunternehmen	0,88%
Immobilien	0,83%
Informationstechnologie	0,58%
Zyklische Konsumgüter	0,40%
Grundstoffe	0,39%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	46,53%
Banken	20,23%
Finanzdienstleistungen	5,66%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,31%
Getränke	2,27%
Produkte für den persönlichen Bedarf	1,87%
Maschinen	1,66%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,46%
Versicherungen	1,34%
Verkehrsinfrastruktur	1,28%
Pharma	1,09%
Kapitalmärkte	1,04%
Baustoffe	1,01%
Biotechnologie	0,78%
Elektronikgeräte	0,76%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. **- Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **- Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **- Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



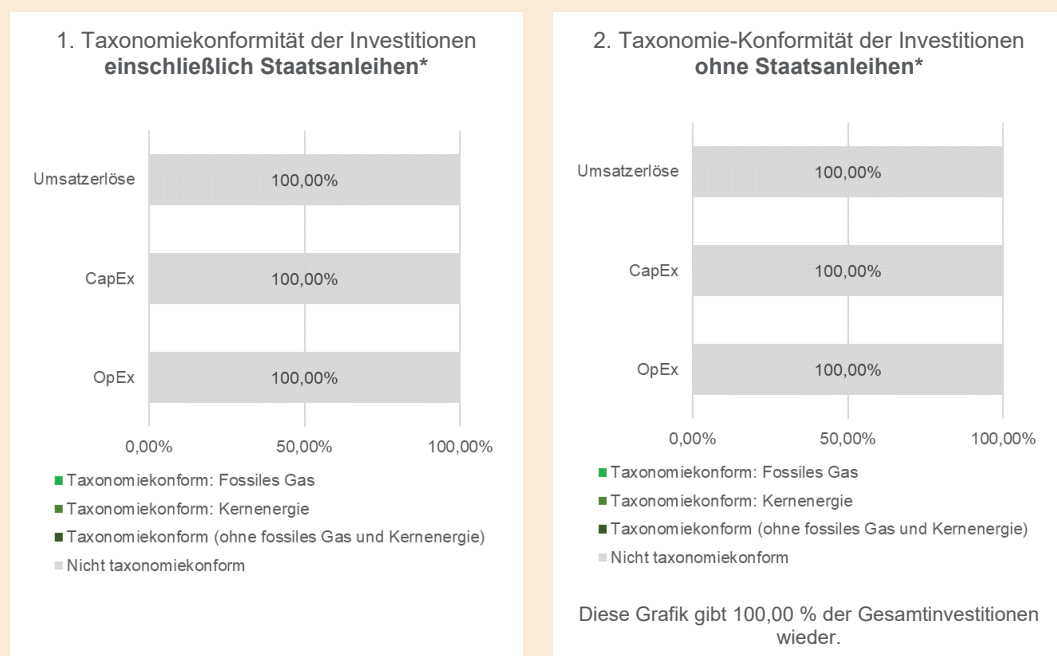
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?<sup>1</sup>

- Ja  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 20,84 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 1,54 %.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 5,14 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Dies schloss auch Emittenten ein, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Mehrere verbindliche Elemente in der Anlagestrategie trugen dazu bei, die vom Fonds beworbenen ökologischen Merkmale zu fördern:

\* Der Anlageverwalter setzte zahlreiche IT-Tools ein, um das Portfolio so zusammenzustellen, dass es auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist. Mithilfe interner und externer Inputdaten (z. B. von MSCI) beurteilten die Anlageverwalter, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht. Beispielsweise wurden staatliche Emittenten, die als „Unfrei“ nach dem Freedom House Index eingestuft waren oder die als „ökologische Nachzügler“ betrachtet wurden (d. h. solche, die zu den unteren 20 % im Ranking nach unserem proprietären Tool, dem Energy and Environmental Transition Index [EETI] gehören), oder Versorgungsunternehmen, die einen nicht akzeptablen Anteil der Umsätze aus fossilen Brennstoffen erzielten oder keine ehrgeizigen Dekarbonisierungsziele verfolgten, aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen (die komplette Aufstellung der Ausschlüsse ist in den vorvertraglichen Informationen des Fonds zu finden).

\* Engagement ist integraler Bestandteil des Nachhaltigkeitsansatzes und ESG-Managements des Fonds. Alle unsere Engagements sind oben im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“ aufgeführt. Das nachfolgende Beispiel soll jedoch den Ansatz der Portfoliomanager verdeutlichen. Im Berichtszeitraum arbeitete der Anlageverwalter im Rahmen eines Engagements mit dem österreichischen Büro für Schuldenmanagement zusammen, um die Nachhaltigkeitspolitik des Landes besser zu verstehen. Bei unseren Sitzungen besprach der Anlageverwalter, wie wichtig Maßnahmen zur Anpassung an den Klimawandel sind, um langfristiges Wachstum der nationalen Volkswirtschaft sicherzustellen. Dabei erörterte er die Auswirkungen von Wetterveränderungen auf die Erzeugung von Strom aus Wasserkraft als Beispiel für schädliche Auswirkungen, die mit modernen technischen Lösungen angegangen werden können. Darüber hinaus sprach der Anlageverwalter das Problem der Biodiversitätskrise an, das nach dessen Auffassung genauso wichtig ist wie die Klimawandelkrise.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

# Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (der „Fonds“)



FRANKLIN  
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
549300YP1QL6V1LW2575

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●●  JA

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

●●  NEIN

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 17,59% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Im Berichtszeitraum förderte der Fonds ökologische und soziale Merkmale durch eine Kombination aus Ausschlüssen, Best-in-Class-Investments und Engagement:

\* Um die Energieeinsparung und die Reduzierung von Treibhausgasemissionen zu fördern, war das Portfoliomanagementteam bestrebt, in Umweltchampions zu investieren. Als Umweltchampions wurden staatliche Emittenten bezeichnet, die bei Umweltfaktoren wie Treibhausgasemissionen, Energieintensität, Schutz der biologischen Vielfalt, Luftverschmutzung und Anteil erneuerbarer Energien zu den besten 20 % ihrer Vergleichsgruppe gehörten. Dabei handelte es sich bei Unternehmensemittenten um Unternehmen, die basierend auf der Treibhausgasintensität zu den oberen 20 % ihrer Branchenvergleichsgruppe zählten. Am Ende des Berichtszeitraums lag die Allokation des Fonds in Umweltchampions bei 33,24 % seines Nettoinventarwerts (NIW).

\* Darüber hinaus wurden die unteren 20 %, die sogenannten Umweltnachzügler, aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen. Zudem investierte der Fonds nicht in Emittenten, deren Beteiligung an der Förderung fossiler Brennstoffe oder an der Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen über das vom Anlageteam für akzeptabel erachtete Niveau hinausging (wie in den vorvertraglichen Informationen des Fonds beschrieben; zum Beispiel wird jedes Unternehmen, das mehr als 5 % seines Umsatzes aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielt, für nicht investierbar erachtet).

\* Um den Schutz der Biodiversität zu schützen und ein verantwortungsbewusstes Abfallmanagement (insbesondere Plastikabfall) zu fördern, wurden diese Themen im Rahmen der umfangreichen Engagements mit Emittenten aus Sektoren, die wesentliche Auswirkungen auf die Biodiversität haben (z. B. Nahrungsmittel und Getränke), besprochen. Weitere Informationen sind unten im Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ zu finden. Darüber hinaus hielt sich der Fonds von Emittenten mit negativen Auswirkungen auf die Artenvielfalt in sensiblen Bereichen fern.

\* Im Berichtszeitraum war der Fonds auf die verschiedenen internationalen Normen ausgerichtet und beachtete die Vorgaben von UN Global Compact, die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.

\* Das Portfoliomanagementteam initiierte auch eine Engagement-Kampagne, um die Geschlechtervielfalt zu fördern, mit Fokus auf dem geschlechtsspezifischen Lohngefälle sowie Frauen in Führungs- und Managementpositionen. Dieses Engagement wird bis ins dritte Quartal 2023 fortgesetzt.

\* Der Fonds hat sich zu einer Mindestallokation von 10 % seines NIW in nachhaltigen Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten verpflichtet, die zu ökologischen Zielen beitragen, und zu einer Mindestallokation von 1 % in solche, die zu sozialen Zielen beitragen. Im Berichtszeitraum waren 17,59 % des NIW des Fonds in nachhaltigen Investitionen angelegt (siehe detaillierte Aufgliederung im unten stehenden Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“). Erreicht wurde dies hauptsächlich durch Investitionen in Anleihen, bei denen die Mittel für grüne, soziale und nachhaltige Zwecke verwendet werden

und die ausdrücklich für die Finanzierung geeigneter ökologischer und/oder sozialer Projekte begeben werden. Ein Beispiel dafür ist die Investition des Fonds in eine von dem US-Telekommunikationsunternehmen Verizon begebene Anleihe. Mit diesen durch diese Transaktion beschafften Mitteln werden verschiedene Umweltziele finanziert, zum Beispiel die Entwicklung von internen Solar- und Windenergiequellen und der Bezug von erneuerbarer Energie bei Dritten, die Umstellung auf energieeffizientere Hardwarelösungen und Gebäude und nachhaltiges Wassermanagement an den Standorten von Verizon.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

(Alle Werte mit Stand vom 30. Juni, sofern nicht anders angegeben.)

- Exponierung gegenüber den Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) im Vergleich zum Bloomberg US Corporate Bond Index. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren per 30. Juni 2023 ab.

- Liste der Emittenten, mit denen zwischen dem 1. Juli 2022 und 30. Juni 2023 ein Engagement mit Franklin Templeton Investment Management Limited und Franklin Advisers, Inc. (die „Anlageverwalter“) bestand. 1. ABBVIE INC, 2. ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV, 3. APPLE INC, 4. ASTRAZENECA PLC, 5. AXA SA, 6. BAKER HUGHES LLC/CO-OBL, 7. BANK OF AMERICA CORP, 8. BNP PARIBAS, 9. BRISTOL-MYERS SQUIBB CO, 10. CIGNA CORP, 11. COCA-COLA EUROPACIFIC, 12. CREDIT SUISSE GROUP AG, 13. CVS HEALTH CORP, 14. EDP FINANCE BV, 15. ELECTRICITE DE FRANCE SA, 16. ENEL FINANCE INTL NV, 17. ENTERPRISE PRODUCTS OPER, 18. ERP OPERATING LP, 19. EXELON CORP, 20. GOLDMAN SACHS GROUP INC, 21. HOME DEPOT INC, 22. KRAFT HEINZ FOODS CO, 23. LOWES COS INC, 24. MASTERCARD INC, 25. MDC HOLDINGS INC, 26. MORGAN STANLEY, 27. NETFLIX INC, 28. ORANGE SA, 29. PEPSICO INC, 30. PFIZER INVESTMENT ENTER, 31. ROPER TECHNOLOGIES INC, 32. SIMON PROPERTY GROUP LP, 33. SUZANO AUSTRIA GMBH, 34. TAKEDA PHARMACEUTICAL, 35. TARGET CORP, 36. TELEFONICA EMISIONES SAU, 37. TOYOTA MOTOR CREDIT CORP, 38. WRKCO INC.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	16,09%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	1,50%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden	33,24%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die in ausgeschlossenen Sektoren tätig sind oder mit diesen in Verbindung stehen, sowie der zusätzlichen Ausschlüsse	0,00%
Anzahl der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter im Rahmen eines Engagements zusammenarbeitete	38,00

## ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

## ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Zu den Zielsetzungen nachhaltiger Investitionen gehörten unter anderem die Finanzierung und Förderung:

- der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- der sozialen Integration,
- guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Teilfonds umfassten eine Mindestallokation von 10 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die zu Umweltzielen beitragen.

Dies wurde durch Investitionen in als „grün“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang stand (u. a. den Green Bond Principles der International Capital Market Association („ICMA“) und dem künftigen Green Bond Standard der Europäischen Union („EU GBS“)) und
- deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufwiesen.

Die Verwendung der Mittel für diese Anleihen war klar definiert und auf die oben genannten Ziele ausgerichtet.

Darüber hinaus verpflichtete sich der Teilfonds, mindestens 1 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige soziale Aktivitäten zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang stand (u. a. den Social Bond Principles der ICMA), und
- C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigten und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufwiesen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### ***• Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Der Anlageverwalter verwendet eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) sicherzustellen.

Unternehmensemittenten werden mit Hilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzt Daten von MSCI, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen involviert sind. Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken), Nr. 10 (Verletzung der Prinzipien des UN Global Compact und der OECD für multinationale Unternehmen) und Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verstoßen, sind vom Anlageuniversum des Teilfonds ausgeschlossen.

Der Anlageverwalter verwendet auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Teilfonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Intensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO<sub>2</sub>-Fußabdruck) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Intensität) (für Staaten) zu den untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppen gehören, werden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Darüber hinaus werden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten (PAI Nr. 16) und/oder Korruption überprüft.

Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nimmt der Anlageverwalter eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Einschätzung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

### ***-----Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Indikatoren nachteiliger Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die der Anlageverwalter als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden zu Folgendem benutzt:

- a) dem Ausschluss von Emittenten, die dem Portfolio wesentlich schaden, und
- b) den Anlageverwalter über das mit nachteiligen Auswirkungen verbundene Risiko zu informieren und geeignete Maßnahmen zu ergreifen – dazu gehören Due-Diligence-Prüfungen, qualitative Prüfungen und/oder aktive Beteiligung (Einzelheiten zum Thema aktive Beteiligung sind in den Abschnitten „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie des Teilfonds“ in diesem Anhang zu finden).

Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüfte und dokumentierte der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der relevanten PAI für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

Wenn der Anlageverwalter beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte er sich, dass die finanzierten Projekte in Bezug auf die PAI für Treibhausgasemissionen gut abschnitten.

### ***-----Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:***

Bei Anleihen, die von souveränen Staaten begeben werden, sind die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte nicht auf solche Investitionen anwendbar. Bei Anleihen, die von Unternehmen begeben werden, stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

Diese Konformität wird mit Hilfe von Daten von MSCI überwacht. Von diesen Dienstleistern festgestellte Verstöße werden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit der Anlageverwalter sie untersuchen kann.

Ergibt die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht einhält, wird er als nicht investierbar eingestuft.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*





## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

- (i) Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten,
- (ii) Beschränkung des Anlageuniversums des Teilfonds und
- (iii) Hilfestellung für thematisches Engagement

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Teilfonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die vom Anlageverwalter als „Umweltchampions“ eingestuft wurden. „Umweltchampions“ wurden anhand von zwei proprietären ESG-Rankings identifiziert:

- Der EETI bewertete die Leistung staatlicher Emittenten in den Bereichen Energieeffizienz, Erhaltung des Naturkapitals und erneuerbare Energien anhand verschiedener Datenpunkte, einschließlich der Treibhausgasintensität (Emissionen normiert nach Bruttoinlandsprodukt, CO<sub>2</sub>e/BIP).
- Die ESG Credit App stufte Unternehmensemittenten nach ihren THG-Emissionen und ihrer THG-Emissionsintensität ein und verwendet dazu verschiedene Datenpunkte, wie z. B. die Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen sowie die historische Entwicklung der THG-Emittenten.

Einschränkung des investierbaren Universums des Fonds

Staatliche Emittenten, die basierend auf dem EETI zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehören, und Unternehmensemittenten, die basierend auf der ESG Credit App zu den untersten 20 % gehören (d. h. Klima-Nachzügler), wurden ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwalter erfüllten ihre zum 1. Januar 2023 eingegangene Verpflichtung zu einem Engagement (auf Basis des Kalenderjahres) bei 5 % der Beteiligungen, die in Bezug auf ihre Gesamtexponierung gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

Anwendung von Ausschlüssen.

Der Fonds berücksichtigte auch Verstöße gegen die UNGC und die Verbindung zu umstrittenen Waffen bei der Anwendung spezifischer ESG-Ausschlüsse.

Stand der PAI-Kennzahlen: 30. Juni 2023.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	300,50	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	28 856,40	91,74%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	71,56	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	5 490,44	91,74%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	2 335,23	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	237 613,00	91,65%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	372,05	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	34 346,90	91,74%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	2 707,28	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	271 959,00	91,74%
CO <sub>2</sub> -Bilanz 1&2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	45,15	89,12%
Benchmark – CO <sub>2</sub> -Bilanz 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	59,29	91,74%
Geschätzte CO <sub>2</sub> -Bilanz (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	328,57	89,12%
Benchmark – Geschätzte CO <sub>2</sub> -Bilanz (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	469,48	91,74%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	95,03	94,55%
Benchmark – THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	301,24	99,01%
Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	708,01	94,55%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Benchmark – Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	1 131,27	99,01%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	15,75%	93,05%
Benchmark– Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	16,26%	96,92%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	72,75%	82,30%
Benchmark – Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	71,95%	85,22%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,69	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,97	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,83	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,76	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	2,60	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	9,11	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,71	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,20	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,06	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,06	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	11,17	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	4,65	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,40	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,56	77,80%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	93,05%
Benchmark – Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,11%	96,92%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%
Benchmark – Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	1 830,61	0,16%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,31	33,64%



PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Benchmark – Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,65	27,28%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	93,05%
Benchmark – Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,32%	98,03%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	53,57%	93,05%
Benchmark – Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	62,27%	96,92%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle der Portfoliounternehmen	15,55%	26,61%
Benchmark – Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle der Portfoliounternehmen	20,02%	22,80%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	33,79%	93,05%
Benchmark – Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	33,50%	96,90%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	93,05%
Benchmark – Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,95%	96,92%



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-07-01 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
United States Treasury Floating Rate Note FRN 01/31/2024	Staatsanleihen	3,56%	USA
Citigroup Inc 3.668% 07/24/2028 FIXED TO FLOAT	Finanzsektor	2,10%	USA
HSBC Holdings PLC 1.645% 04/18/2026 *FIXED TO FLOAT*	Finanzsektor	1,96%	Vereinigtes Königreich
Morgan Stanley 3.591% 07/22/2028 FIXED TO FLOAT	Finanzsektor	1,68%	USA
Jpmorgan Chase & Co 2.522% 04/22/2031 *FIXED TO FLOAT*	Finanzsektor	1,68%	USA
BNP Paribas SA 3.375% 01/09/2025 REG S	Finanzsektor	1,66%	Frankreich
AT&T Inc 3.5% 06/01/2041	Kommunikationsdienste	1,64%	USA
Enel Finance International NV 3.5% 04/06/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,56%	Italien
American Express Co 3.3% 05/03/2027	Finanzsektor	1,49%	USA
Thermo Fisher Scientific Inc 1.215% 10/18/2024	Gesundheitssektor	1,49%	USA
CVS Health Corp 5.3% 12/05/2043	Gesundheitssektor	1,47%	USA
RELX Capital Inc 3% 05/22/2030	Kommunikationsdienste	1,47%	Vereinigtes Königreich
Toronto-Dominion Bank/The 1.15% 06/12/2025	Finanzsektor	1,45%	Kanada
EDP Finance BV 1.71% 01/24/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,45%	Portugal
Cigna Corp 3.05% 10/15/2027	Gesundheitssektor	1,43%	USA



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

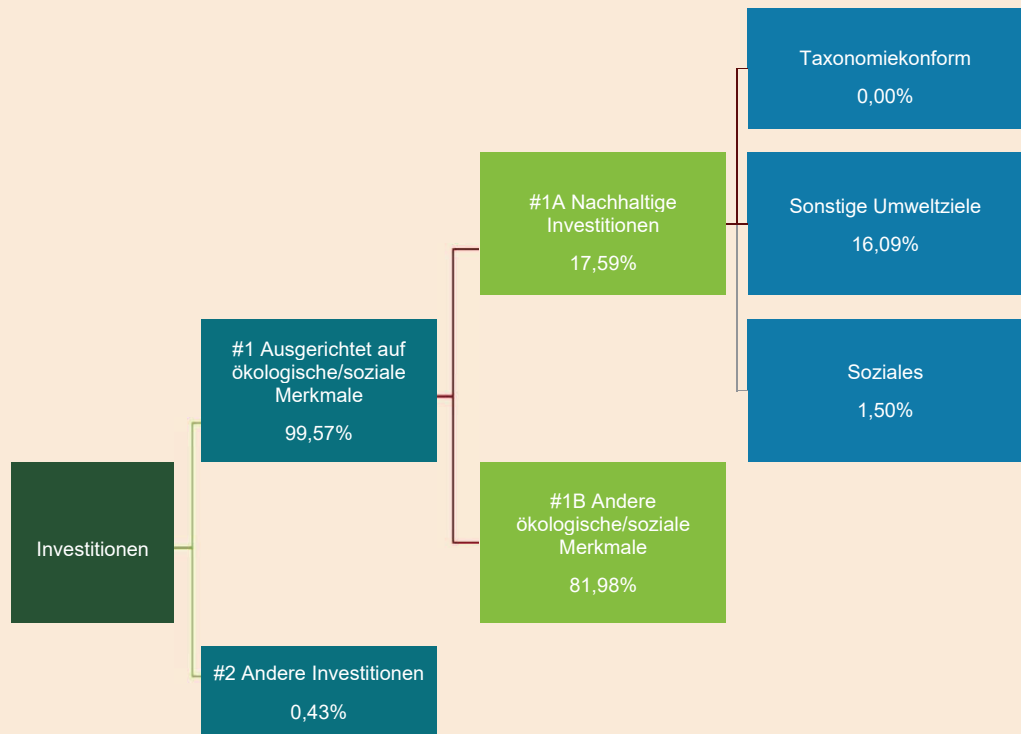
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 17,59 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,57 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,42 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln, die für das Tagesgeschäft des Fonds gehalten wurden, oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 17,59 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel):

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	28,01%
Gesundheitssektor	14,07%
Kommunikationsdienste	13,60%
Versorgungsunternehmen	9,38%
Energie	7,14%
Basiskonsumgüter	5,58%
Staatsanleihen	4,32%
Grundstoffe	4,19%
Industrie	4,16%
Informationstechnologie	3,54%
Zyklische Konsumgüter	3,29%
Immobilien	2,32%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	11,43%
Kapitalmärkte	8,86%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	6,27%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	6,25%
Stromversorger	5,98%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	5,28%
Pharma	5,13%
Staatsanleihen	4,32%
Medien	3,90%
Versicherungen	3,49%
Chemische Erzeugnisse	2,98%
Finanzdienstleistungen	2,72%
Getränke	2,37%
Multi-Versorger	2,20%
Biotechnologie	2,13%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. **- Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **- Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **- Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



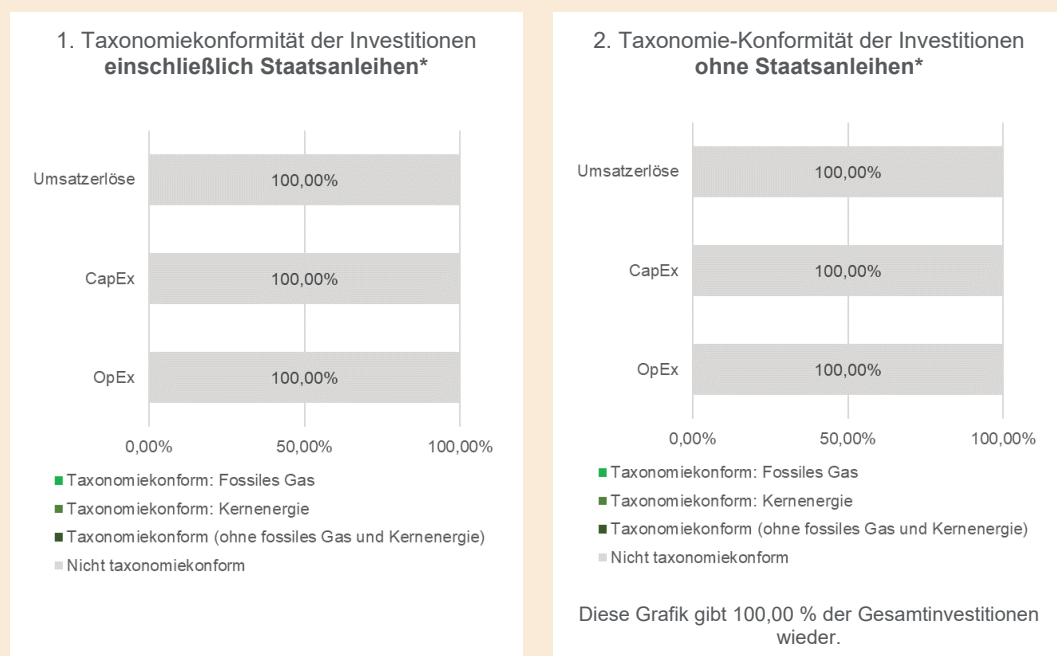
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?<sup>1</sup>

- Ja  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 (17) SFDR, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 16,09 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 1.50 %.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,43 % und umfasste für Zwecke der täglichen Anforderungen des Fonds gehaltene liquide Mittel ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Dies schloss auch Emittenten ein, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Mehrere verbindliche Elemente in der Anlagestrategie trugen dazu bei, die vom Fonds beworbenen ökologischen Merkmale zu fördern:

\* Das Anlageverwaltungsteam setzte zahlreiche IT-Tools ein, um das Portfolio so zusammenzustellen, dass es auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist. Mithilfe interner und externer Inputdaten (z. B. von MSCI) beurteilten die Anlageverwalter, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht. Beispielsweise wurden staatliche Emittenten, die als „Unfrei“ nach dem Freedom House Index eingestuft waren oder die als „ökologische Nachzügler“ betrachtet wurden (d. h. solche, die zu den unteren 20 % im Ranking nach unserem proprietären Tool, dem Energy and Environmental Transition Index [EETI] gehören), oder Versorgungsunternehmen, die einen nicht akzeptablen Anteil der Umsätze aus fossilen Brennstoffen erzielten oder keine ehrgeizigen Dekarbonisierungsziele verfolgten, aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen (die komplette Aufstellung der Ausschlüsse ist in den vorvertraglichen Informationen des Fonds zu finden).

\* Engagement ist integraler Bestandteil des Nachhaltigkeitsansatzes und ESG-Managements des Fonds. Alle Engagements sind oben im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“ aufgeführt. Das nachfolgende Beispiel soll jedoch den Ansatz der Portfoliomanager verdeutlichen. Die Nachhaltigkeitsanalysten der Anlageverwalter trafen sich mit Investor Relations-Vertretern von Orange SA, um über die Themen Energieeffizienz und digitaler Ausschluss zu sprechen. Die Analysten erfuhren, dass das Unternehmen komplexe Tools verwendet, um die optimale Abdeckung und Kapazität ihres Netzes für die mobile Telekommunikation zu überwachen. Dies schlug sich in einer effizienteren Nutzung elektrischer Energie nieder, was wiederum die Treibhausgasemissionen senkte. Die Analysten ermutigten den Emittenten, weitere Quellen grüner Energie zu erschließen, sowohl durch die Beschaffung als auch durch die Erzeugung vor Ort. Ein weiteres Thema war der digitale Ausschluss. Orange SA fördert die Inklusion von Menschen mit begrenzten digitalen Fähigkeiten (z. B. ältere Menschen). Die Analysten betonten jedoch, wie wichtig es sei, grundlegende Telekommunikationsdienste in wirtschaftlich benachteiligten entlegenen und ländlichen Gebieten bereitzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

# Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
549300ZPOUIIE1XTV058



FRANKLIN  
TEMPLETON

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 20,26% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte die ökologischen und sozialen Merkmale, das heißt (i) die Investition in ökologisch und sozial verantwortungsvolle Unternehmen und (ii) die Vermeidung der Investition in Unternehmen, deren Produkte negative soziale und ökologische Auswirkungen haben, durch die Nachbildung des LibertyQ Global Equity SRI Index (der „Index“), der die Wertentwicklung von Unternehmen repräsentiert, die hohe ESG-Ratings im Vergleich zu ihren Branchenmitbewerbern haben. Dadurch wird sichergestellt, dass Best-in-Class-Unternehmen aus ESG-Perspektive in den Fonds aufgenommen werden, die aus dem MSCI ACWI Index (dem „Hauptindex“) ausgewählt wurden. Die in den Index aufgenommenen Unternehmen müssen ein MSCI ESG-Rating von mindestens ‚A‘ aufweisen und zu den oberen 25 % der Emittenten in ihrer jeweiligen Branche gehören.

Der Fonds investierte in ein Portfolio aus Large- und Mid-Cap-Aktien aus aller Welt, zu denen auch alle oder ein Großteil der im Index enthaltenen Wertpapiere gehörten. Wertpapiere wurden zudem im gleichen Verhältnis gehalten wie ihre Gewichtung im Index.

Der Index förderte ökologische Merkmale durch Ausschluss von Unternehmen, die einen Bezug zu Aktivitäten wie fossile Brennstoffreserven, Förderung fossiler Brennstoffe und schwerwiegende ökologische Kontroversen hatten oder daraus Umsätze erzielten. Der Index wendete zudem eine Reihe sozial verantwortungsbewusster Ausschlüsse an, unter anderem in Bezug auf konventionelle und umstrittene Waffen, zivile Feuerwaffen, Atomwaffen, Tabak, Erwachsenenunterhaltung, Alkohol, Glücksspiel, GMO und Kernkraft. Der Index schloss auch Unternehmen aus, die die UNGC-Prinzipien, die UN-Menschenrechtserklärung sowie die ILO-Erklärung über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit nicht beachteteten.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Fonds verwendet den MSCI ESG-Rating-Score des Index im Verhältnis zum breiteren Marktuniversum der Benchmark (abgebildet durch den Hauptindex) und die Treibhausgasintensität der Wertpapiere im Index, gemessen anhand der Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen, als Nachhaltigkeitsindikator.

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/\$ Umsatz) des Index war um 32,7 % niedriger als beim Hauptindex (654,8 gegenüber 973). Als Grundlage dienten Daten von MSCI. Der Index erreichte zudem einen ESG-Score von 8,4 gegenüber dem breiteren Benchmark-Universum, abgebildet durch den Hauptindex (6,8).

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Benchmark
MSCI ESG-Rating-Score der Referenz-Benchmark im Vergleich zum Hauptindex	8,40	6,80
Treibhausgasintensität der Wertpapiere im Index im Vergleich zum Hauptindex, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO2e/investierte Mio. USD)	654,80	973,00

### ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

### ● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die Zielsetzungen der vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen umfassten die Finanzierung und Förderung von ökologisch und sozial verantwortungsvollen Unternehmen. Die nachhaltigen Investitionen erfüllten auch die DNSH-Kriterien („Do No Significant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, hatte er sich dennoch verpflichtet, mindestens 5 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere zu investieren, die als nachhaltig mit Umweltziel definiert werden können. Es handelte sich dabei um Wertpapiere, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem Umweltziel beitrugen und die DNSH-Kriterien („Do No Significant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 7,37 % der Wertpapiere des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel angelegt.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, hatte er sich dennoch verpflichtet, mindestens 5 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere zu investieren, die als nachhaltig mit einem sozialen Ziel definiert werden können. Es handelte sich dabei um Wertpapiere, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem sozialen Ziel beitrugen und die DNSH-Kriterien gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 12,89 % der Wertpapiere des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel angelegt.

### ● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Durch Nachbildung des Index konnte der Fonds die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Darüber hinaus wurden diese als nachhaltige Investitionen definierten Wertpapiere bewertet, um sicherzustellen, dass sie keine ökologischen oder sozialen Anlageziele beeinträchtigen, und um die Ausrichtung auf Artikel 2 (17) SFDR zu gewährleisten. Diese Bewertung sah vor, dass das einzelne Unternehmen strenge Kriterien erfüllt, wie zum Beispiel:

- kein Bezug zu umstrittenen Waffen
- weniger als 1 % Umsatz aus Kraftwerkkohle
- weniger als 5 % Umsatz aus tabakbezogenen Aktivitäten
- darf kein Tabakproduzent sein
- keine Beteiligung an schwerwiegenden ESG-Kontroversen.

Während des Bezugszeitraums gab es keine Verstöße gegen die Kriterien des Fonds.

### -----Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Index-Methodik beinhaltet Kriterien zur Reduzierung des Engagements in oder zum Ausschluss von Wertpapieren, die mit den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Konflikt stehen:

- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind (Nr. 4)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact (Nr. 10)
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (Nr. 14)

### -----Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Jegliche Wertpapiere, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, wurden aus dem Index ausgeschlossen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*





## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Siehe dazu die Antwort unter „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Bezugszeitraum waren die 15 Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-07-01 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Novo Nordisk A/S ORD DKK.2 CL B	Gesundheitssektor	1,15%	Dänemark
L'Oreal SA ORD EUR.2	Basiskonsumgüter	1,08%	Frankreich
Biogen Inc COM USD.0005	Gesundheitssektor	1,07%	USA
Microsoft Corp COM USD0.001	Informationstechnologie	1,06%	USA
HCA HEALTHCARE INC COM USD .01	Gesundheitssektor	1,06%	USA
Unilever PLC ORD GBP.0311	Basiskonsumgüter	1,06%	Vereinigtes Königreich
General Mills Inc COM USD.1	Basiskonsumgüter	1,06%	USA
RELX PLC ORD GBP.144397	Industrie	1,05%	Vereinigtes Königreich
Cummins Inc COM USD2.5	Industrie	1,04%	USA
Illinois Tool Works Inc COM NPV	Industrie	1,03%	USA
Bank of New York Mellon Corp/The COM USD.01	Finanzsektor	1,02%	USA
Marsh & McLennan Cos Inc COM USD1	Finanzsektor	1,02%	USA
Home Depot Inc/The COM USD0.05	Zyklische Konsumgüter	1,02%	USA
Texas Instruments Inc COM USD1	Informationstechnologie	1,01%	USA
PepsiCo Inc COM USD.017	Basiskonsumgüter	1,01%	USA



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

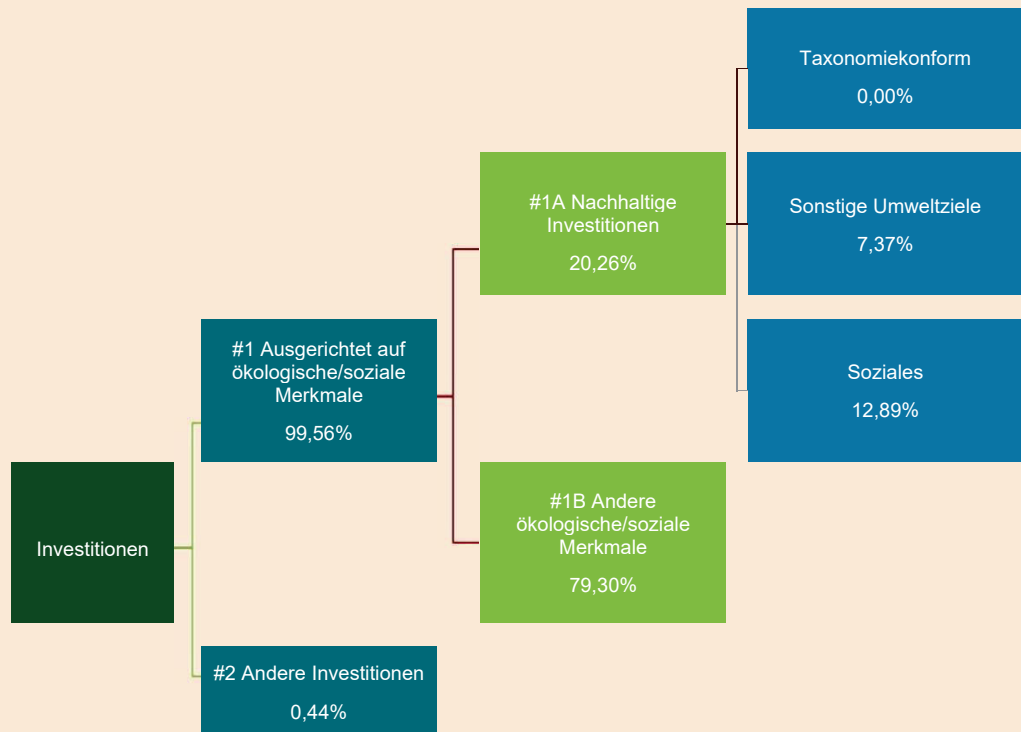
Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 20,26 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,56 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,44 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 20,26 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und -untersektoren des Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

<b>Wichtigster Sektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Finanzsektor	19,10%
Industrie	16,98%
Basiskonsumgüter	11,88%
Gesundheitssektor	11,22%
Kommunikationsdienste	9,11%
Zyklische Konsumgüter	8,97%
Grundstoffe	8,63%
Informationstechnologie	6,66%
Energie	3,00%
Versorgungsunternehmen	2,34%
Immobilien	1,68%
<b>Wichtigster Teilsektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Banken	7,22%
Versicherungen	6,23%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	4,82%
Kapitalmärkte	4,59%
Metalle u. Bergbau	4,37%
Lebensmittel	3,92%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	3,23%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	3,20%
Produkte für den persönlichen Bedarf	3,06%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,02%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	3,00%
Fachhandel	2,92%
Biotechnologie	2,88%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	2,81%
Überlandtransport	2,80%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



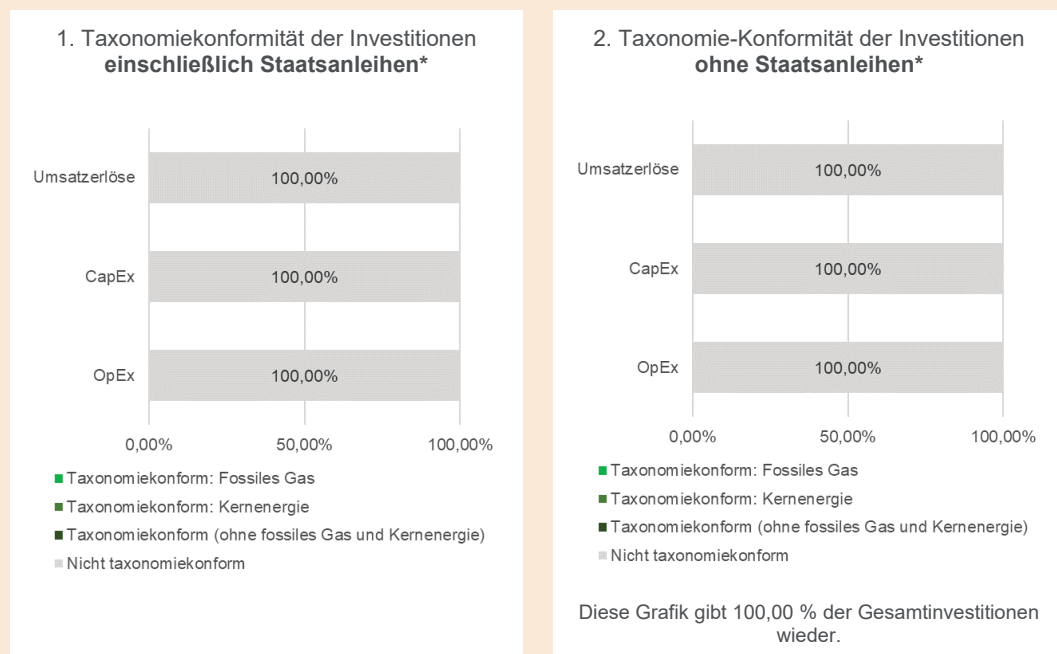
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?<sup>1</sup>

- Ja  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, investierte der Fonds nicht in Übergangs- oder ermöglichende Tätigkeiten.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend. Wie im Nachtrag dargelegt, verpflichtet sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, hatten alle nachhaltigen Investitionen des Fonds ein Umweltziel, das nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet war.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 12,89 %.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 0,44 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Dies schloss auch Emittenten ein, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Wie oben dargelegt, bildete der Fonds den Index nach, der Aktien von Unternehmen ausschloss, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird halbjährlich überprüft und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwacht das Portfolio regelmäßig und stellt sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtet. Er überprüft die Investments auf Portfolioebene auf mögliche nachteilige Auswirkungen durch die Indexnachbildung. Der Anlageverwalter stellt sicher, dass die Fondsanlagen den Index stets eng nachbilden, damit die Ausrichtung auf die ESG-Merkmale des Index gewährleistet ist.

Wertpapiere, die die Kriterien für den Verbleib im Index nicht mehr erfüllen, werden bei der Neugewichtung aus dem Portfolio herausgenommen und vom Fonds abgestoßen. Die Anlageverwalter setzen die Indexänderungen um und verkaufen die betroffenen Wertpapiere zeitnah.

Eine Stimmrechtsvertretung ist für unsere aktiv und passiv verwalteten Fonds sowie ETFs vorgesehen. Auf diese Weise können wir unsere Stimmrechte in unseren aktiv und passiv verwalteten Strategien ausüben, damit diese systematisch stärker auf Nachhaltigkeitsbelange ausgerichtet werden. Findet ein Engagement statt, erfolgt dies in der Regel durch unsere Fundamentalresearch-Analysten aus aktiv verwalteten Strategien, die in direktem Kontakt zu den betroffenen Emittenten stehen. Engagements werden protokolliert und die diesbezüglichen Informationen werden über ein zentrales Engagement-Tool zwischen den Teams ausgetauscht.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nähere Informationen zur Methodik finden Sie unter folgenden Links:

- [https://www.msci.com/eqb/methodology/meth\\_docs/LibertyQ\\_Global\\_Equity\\_SRI\\_Index\\_Feb\\_2018.pdf](https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/LibertyQ_Global_Equity_SRI_Index_Feb_2018.pdf)
- [https://www.msci.com/eqb/methodology/meth\\_docs/MSCI\\_SRI\\_Methodology\\_Feb2021.pdf](https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_SRI_Methodology_Feb2021.pdf)

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index ist so aufgebaut, dass er die Wertentwicklung von Unternehmen repräsentiert, die hohe Ratings in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) im Vergleich zu ihren Branchenmitbewerbern haben. Dadurch wird sichergestellt, dass die Best-in-Class-Unternehmen aus ESG-Perspektive mitaufgenommen werden. Dies ist beim Hauptindex, dem relevanten breiten Marktindex des Fonds, nicht der Fall. Die Indexmethodik sieht auch mehrere aktivitätsbasierte Ausschlüsse vor, wie oben beschrieben, die nicht Teil des Hauptindex sind.

### Wie hat dieses Finanzprodukt ...

**...in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

**...im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

**...im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

	Finanzprodukt	Referenzwert	Breiter Marktindex
	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	LibertyQ Global Equity SRI Index	MSCI ACWI
Treibhausgasintensität der Wertpapiere, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO2e/investierte Mio. USD)	660,60	654,80	973,00

# Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (der „Fonds“)



FRANKLIN  
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
549300ZDC0V552DW8K29

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●●  **JA**

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

●●  **NEIN**

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 10,51% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte die ökologischen Merkmale, indem er (i) Investoren beim Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft unterstützte und (ii) seine Investitionen durch Nachbildung des STOXX® Europe 600 Paris-Aligned Benchmark Index (der „Index“) auf das Pariser Klimaabkommen ausrichtete. Der Index ist auf die Mindestanforderungen für die EU Paris Aligned Benchmarks (EU-PABs) ausgelegt.

Der Fonds investierte in ein Portfolio aus europäischen Large- und Mid-Cap-Aktien, zu denen auch alle oder ein Großteil der im Index enthaltenen Wertpapiere gehörten. Wertpapiere wurden zudem im gleichen Verhältnis gehalten wie ihre Gewichtung im Index. Der Index ist auf das Pariser Klimaabkommen ausgerichtet und unterstützt Investoren beim Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft. Im Vergleich zum STOXX Europe 600 Index (der „Hauptindex“) weist er geringere CO<sub>2</sub>-Emissionen, eine geringere Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen und ein höheres Engagement in potenziellen klimawandelbezogenen Chancen auf.

Der Index schließt auch Unternehmen aus, die einen Bezug zu umstrittenen Waffen, Tabak, Stromerzeugung mit Kohle und fossilen Brennstoffen, vorbehaltlich spezifischer Umsatz-Obergrenzen, die vom Indexanbieter festgelegt werden, Militäraufträgen, Kraftwerkskohle, Ölsanden, Schieferenergie, Glücksspiel und Alkohol sowie zu anderen Bereichen haben, die von ISS als schädlich für das UN-SDG (UN Sustainable Development Goal) Nr. 13 Klimaschutz erachtet werden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Fonds verwendet die Treibhausgasintensität der Wertpapiere im Index, gemessen anhand der Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen, als Nachhaltigkeitsindikator.

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/\$ Umsatz) des Index war um 38,5 % niedriger als beim Hauptindex (531,5 gegenüber 864,3). Als Grundlage dienten Daten von MSCI. Die absolute CO<sub>2</sub>-Intensität von Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen des Index war um 52,2 % niedriger als beim Hauptindex (544,8 gegenüber 1.140,9). Stoxx berechnet die CO<sub>2</sub>-Intensität anhand der Daten von ISS ESG.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Benchmark
Treibhausgasintensität der Wertpapiere in der Referenz-Benchmark im Vergleich zum Hauptindex, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD)	531,50	864,30
Treibhausgasintensität der Wertpapiere in der Referenz-Benchmark im Vergleich zum Hauptindex, gemessen anhand der absoluten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD)	544,80	1 140,90

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

### Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Fonds tätigte, wurden durch Investition entweder in Unternehmen, die Lösungen zur Begrenzung der Folgen des Klimawandels anbieten oder die Klimarichtlinien erarbeitet und Kohlenstoffreduktionsziele festgelegt haben und Bestandteile des Index sind, umgesetzt. Die nachhaltigen Investitionen erfüllten auch die DNSH-Kriterien gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, hatte er sich dennoch verpflichtet, mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere zu investieren, die als nachhaltig definiert werden können. Es handelte sich dabei um Wertpapiere, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem Umweltziel beitragen und die DNSH-Kriterien („Do No Significant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllen. Am Ende des Referenzzeitraums waren 10,51 % des Nettoinventarwerts des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel angelegt.

### Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Durch Nachbildung des Index konnte der Fonds die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Darüber hinaus wurden diese als nachhaltige Investitionen definierten Wertpapiere bewertet, um sicherzustellen, dass sie keine ökologischen oder sozialen Anlageziele beeinträchtigen, und um die Ausrichtung auf Artikel 2 (17) SFDR zu gewährleisten. Diese Bewertung sah vor, dass das einzelne Unternehmen strenge Kriterien erfüllt, wie zum Beispiel:

- kein Bezug zu umstrittenen Waffen
- weniger als 1 % Umsatz aus Kraftwerkkohle
- weniger als 5 % Umsatz aus tabakbezogenen Aktivitäten
- darf kein Tabakproduzent sein
- keine Beteiligung an schwerwiegenden ESG-Kontroversen.

Während des Bezugszeitraums gab es keine Verstöße gegen die Kriterien des Fonds.

### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Index-Methodik beinhaltet Kriterien zur Reduzierung des Engagements in oder zum Ausschluss von Wertpapieren, die mit den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Konflikt stehen:

- THG-Intensität der Portfoliounternehmen (Nr. 3)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind (Nr. 4)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact (Nr. 10)
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (Nr. 14)

### Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Jegliche Wertpapiere, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, wurden aus dem Index ausgeschlossen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.





## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Siehe dazu die Antwort unter „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Bezugszeitraum waren die 15 Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-07-01 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE ORD EUR.3	Zyklische Konsumgüter	4,57%	Frankreich
Novo Nordisk A/S ORD DKK.2 CL B	Gesundheitssektor	4,21%	Dänemark
ASML Holding NV ORD EUR.09	Informationstechnologie	4,13%	Niederlande
AstraZeneca PLC ORD GBP.25	Gesundheitssektor	4,07%	Vereinigtes Königreich
Novartis AG ORD CHF.5	Gesundheitssektor	3,27%	Schweiz
Nestle SA ORD REGD CHF0.1	Basiskonsumgüter	2,83%	USA
SAP SE ORD EUR NPV	Informationstechnologie	2,36%	Deutschland
Cie Financiere Richemont SA ORD CHF1 CL A	Zyklische Konsumgüter	2,11%	Schweiz
Hermes International ORD NPV	Zyklische Konsumgüter	2,04%	Frankreich
Unilever PLC ORD GBP.0311	Basiskonsumgüter	1,99%	Vereinigtes Königreich
L'Oreal SA ORD EUR.2	Basiskonsumgüter	1,93%	Frankreich
Sanofi ORD EUR2	Gesundheitssektor	1,91%	Frankreich
Diageo PLC ORD GBP.28935	Basiskonsumgüter	1,86%	Vereinigtes Königreich
Iberdrola SA ORD EUR.75	Versorgungsunternehmen	1,71%	Spanien
Air Liquide SA ORD EUR5.5	Grundstoffe	1,67%	Frankreich



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

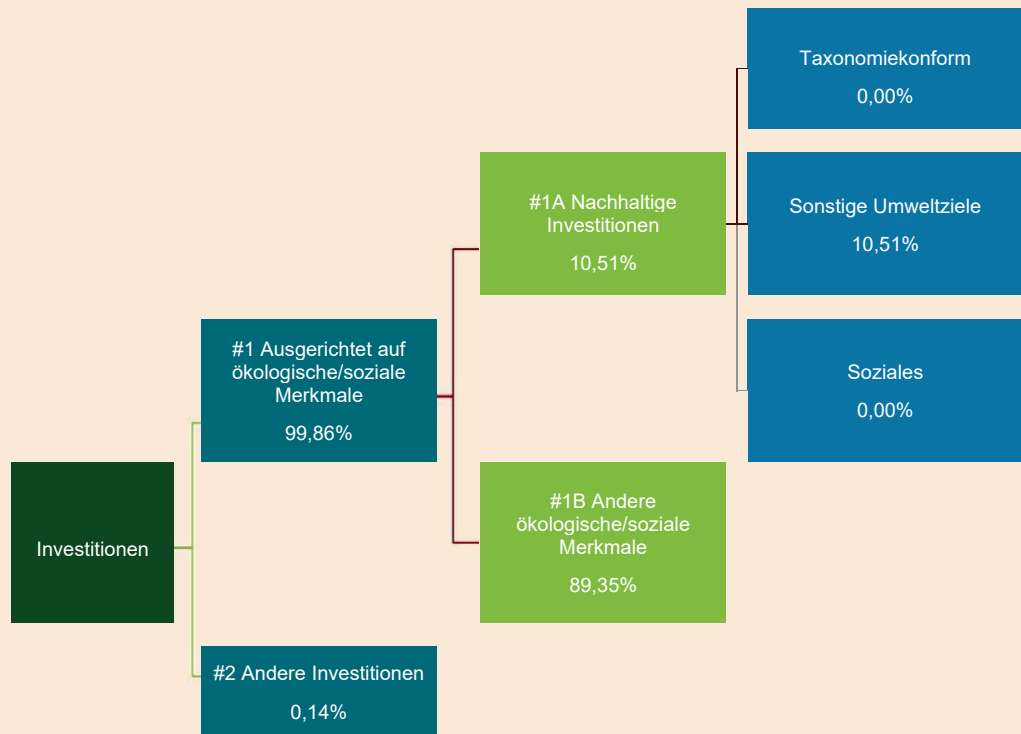
Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 10,51 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,86 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,14 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 10,51 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und -untersektoren des Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Gesundheitssektor	18,63%
Zyklische Konsumgüter	16,68%
Finanzsektor	13,32%
Informationstechnologie	11,50%
Basiskonsumgüter	11,11%
Industrie	10,16%
Grundstoffe	7,83%
Kommunikationsdienste	6,70%
Versorgungsunternehmen	3,03%
Immobilien	0,90%
Wichtigster Teilssektor	% der Vermögenswerte
Pharma	16,69%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	12,64%
Chemische Erzeugnisse	6,56%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	5,84%
Versicherungen	5,57%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	4,32%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,16%
Banken	3,97%
Software	3,70%
Getränke	3,24%
Lebensmittel	2,94%
Kapitalmärkte	2,73%
Luftfracht u. -logistik	2,51%
Stromversorger	2,33%
Fachdienstleistungen	1,85%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



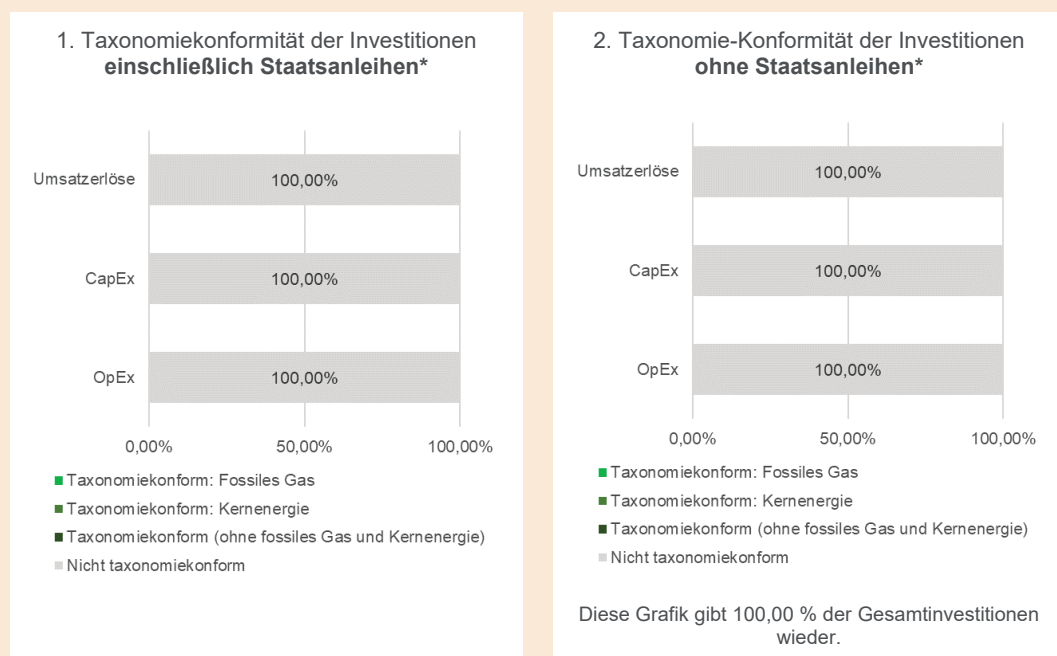
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?<sup>1</sup>

- Ja  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, investierte der Fonds nicht in Übergangs- oder ermöglichende Tätigkeiten.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend. Wie im Nachtrag dargelegt, verpflichtet sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, hatten alle nachhaltigen Investitionen des Fonds ein Umweltziel, das nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet war.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 0,14 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Dies schloss auch Emittenten ein, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Wie oben dargelegt, bildete der Fonds den Index nach, der Aktien von Unternehmen ausschloss, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird vierteljährlich neu gewichtet und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwacht das Portfolio regelmäßig und stellt sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtet. Er überprüft die Investments auf Portfolioebene auf mögliche nachteilige Auswirkungen durch die Indexnachbildung. Der Anlageverwalter stellt sicher, dass die Fondsanlagen den Index stets eng nachbilden, damit die Ausrichtung auf die ESG-Merkmale des Index gewährleistet ist.

Wertpapiere, die die Kriterien für den Verbleib im Index nicht mehr erfüllen, werden bei der Neugewichtung aus dem Portfolio herausgenommen und vom Fonds abgestoßen. Die Anlageverwalter setzen die Indexänderungen um und verkaufen die betroffenen Wertpapiere zeitnah.

Eine Stimmrechtsvertretung ist für unsere aktiv und passiv verwalteten Fonds sowie ETFs vorgesehen. Auf diese Weise können wir unsere Stimmrechte in unseren aktiv und passiv verwalteten Strategien ausüben, damit diese systematisch stärker auf Nachhaltigkeitsbelange ausgerichtet werden. Findet ein Engagement statt, erfolgt dies in der Regel durch unsere Fundamentalresearch-Analysten aus aktiv verwalteten Strategien, die in direktem Kontakt zu den betroffenen Emittenten stehen. Engagements werden protokolliert und die diesbezüglichen Informationen werden über ein zentrales Engagement-Tool zwischen den Teams ausgetauscht.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nähere Informationen zur Methodik finden Sie unter folgendem Link:

[https://www.stoxx.com/document/Indices/Common/Indexguide/stoxx\\_index\\_guide.pdf](https://www.stoxx.com/document/Indices/Common/Indexguide/stoxx_index_guide.pdf)

Seite 357

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index ist so aufgebaut, dass er die Dekarbonisierungsanforderungen absolut und im Verhältnis zum Hauptindex (einem relevanten breiten Marktindex) erfüllt. Die Indexmethodik sieht auch mehrere aktivitätsbasierte Ausschlüsse vor, wie oben beschrieben, die nicht Teil des Hauptindex sind.

### Wie hat dieses Finanzprodukt ...

**...in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

**...im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

**...im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

	Finanzprodukt	Referenzwert	Breiter Marktindex
	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	STOXX Europe 600 Paris-Aligned Benchmark Index	STOXX 600 Index
Treibhausgasintensität der Wertpapiere, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD)	530,90	531,50	864,30

# Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (der „Fonds“)



**FRANKLIN  
TEMPLETON**

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
5493008P5LV6DXD8IP28

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 17,34% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte die ökologischen Merkmale, indem er (i) Investoren beim Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft unterstützte und (ii) seine Investitionen durch Nachbildung des S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Index (der „Index“) auf das Pariser Klimaabkommen ausrichtete. Der Index ist auf die Mindestanforderungen für die EU Paris Aligned Benchmarks (EU-PABs) ausgelegt.

Der Fonds investierte in ein Portfolio aus US-Beteiligungspapieren, zu denen auch alle oder ein Großteil der im Index enthaltenen Wertpapiere gehörten. Wertpapiere wurden zudem im gleichen Verhältnis gehalten wie ihre Gewichtung im Index. Der Index ist auf das Pariser Klimaabkommen ausgerichtet und unterstützt Investoren beim Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft. Im Vergleich zum S&P 500 Index (der „Hauptindex“) weist er geringere CO<sub>2</sub>-Emissionen, eine geringere Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen und ein höheres Engagement in potenziellen klimawandelbezogenen Chancen auf.

Der Index schließt zudem Unternehmen aus, die einen Bezug zu umstrittenen Waffen, Tabak, Kleinwaffen, Militäraufträgen, Kraftwerkskohle, Ölsanden, Schieferenergie, Glücksspiel und Alkohol sowie anderen Bereichen haben, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Fonds verwendet die Treibhausgasintensität der Wertpapiere im Index, gemessen anhand der Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen, als Nachhaltigkeitsindikator.

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/\$ Umsatz) des Index war um 61,2 % niedriger als beim Hauptindex (120,9 gegenüber 311,8). Als Grundlage dienten Daten von S&P und Trucost.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Benchmark
Treibhausgasintensität der Wertpapiere des Referenzindex im Vergleich zum Hauptindex, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD) (S&P und Trucost)	120,90	311,83

## ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

## ● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Fonds tätigte, wurden durch Investition entweder in Unternehmen, die Lösungen zur Begrenzung der Folgen des Klimawandels anbieten oder die Klimarichtlinien erarbeitet und Kohlenstoffreduktionsziele festgelegt haben und Bestandteile des Index sind, umgesetzt. Die nachhaltigen Investitionen erfüllten auch die DNSH-Kriterien gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, hatte er sich dennoch verpflichtet, mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere zu investieren, die als nachhaltig definiert werden können. Es handelte sich dabei um Wertpapiere, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem Umweltziel beitragen und die DNSH-Kriterien („Do No Significant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 17,34 % des Nettoinventarwerts des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel angelegt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

## ● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Durch Nachbildung des Index konnte der Fonds die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Darüber hinaus wurden diese als nachhaltige Investitionen definierten Wertpapiere bewertet, um sicherzustellen, dass sie keine ökologischen oder sozialen Anlageziele beeinträchtigen, und um die Ausrichtung auf Artikel 2 (17) SFDR zu gewährleisten. Diese Bewertung sah vor, dass das einzelne Unternehmen strenge Kriterien erfüllt, wie zum Beispiel:

- kein Bezug zu umstrittenen Waffen
- weniger als 1 % Umsatz aus Kraftwerkkohle
- weniger als 5 % Umsatz aus tabakbezogenen Aktivitäten
- darf kein Tabakproduzent sein
- keine Beteiligung an schwerwiegenden ESG-Kontroversen.

Während des Bezugszeitraums gab es keine Verstöße gegen die Kriterien des Fonds.

## ----- Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Index-Methodik beinhaltet Kriterien zur Reduzierung des Engagements in oder zum Ausschluss von Wertpapieren, die mit den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Konflikt stehen:

- THG-Intensität der Portfoliounternehmen (Nr. 3)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind (Nr. 4)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact (Nr. 10)
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (Nr. 14)

## ----- Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Jegliche Wertpapiere, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, wurden aus dem Index ausgeschlossen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Siehe dazu die Antwort unter „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.





## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Bezugszeitraum waren die 15 Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-07-01 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Microsoft Corp COM USD0.001	Informationstechnologie	6,05%	USA
Apple Inc COM USD.00001	Informationstechnologie	5,60%	USA
Alphabet Inc.	Kommunikationsdienste	4,92%	USA
Amazon.com Inc COM USD.01	Zyklische Konsumgüter	4,48%	USA
NVIDIA Corp COM USD.001	Informationstechnologie	3,01%	USA
UnitedHealth Group Inc COM USD0.01	Gesundheitssektor	1,83%	USA
Visa Inc COM USD NPV CL A	Finanzsektor	1,83%	USA
AbbVie Inc COM USD NPV	Gesundheitssektor	1,57%	USA
Mastercard Inc COM USD.0001 CL A	Finanzsektor	1,47%	USA
JPMorgan Chase & Co COM USD1	Finanzsektor	1,40%	USA
Bank of America Corp COM USD.01	Finanzsektor	1,39%	USA
Procter & Gamble Co/The COM NPV	Basiskonsumgüter	1,26%	USA
TESLA INC COM USD.001	Zyklische Konsumgüter	1,24%	USA
PepsiCo Inc COM USD.017	Basiskonsumgüter	1,21%	USA
Merck & Co Inc COM USD.5	Gesundheitssektor	1,07%	USA



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

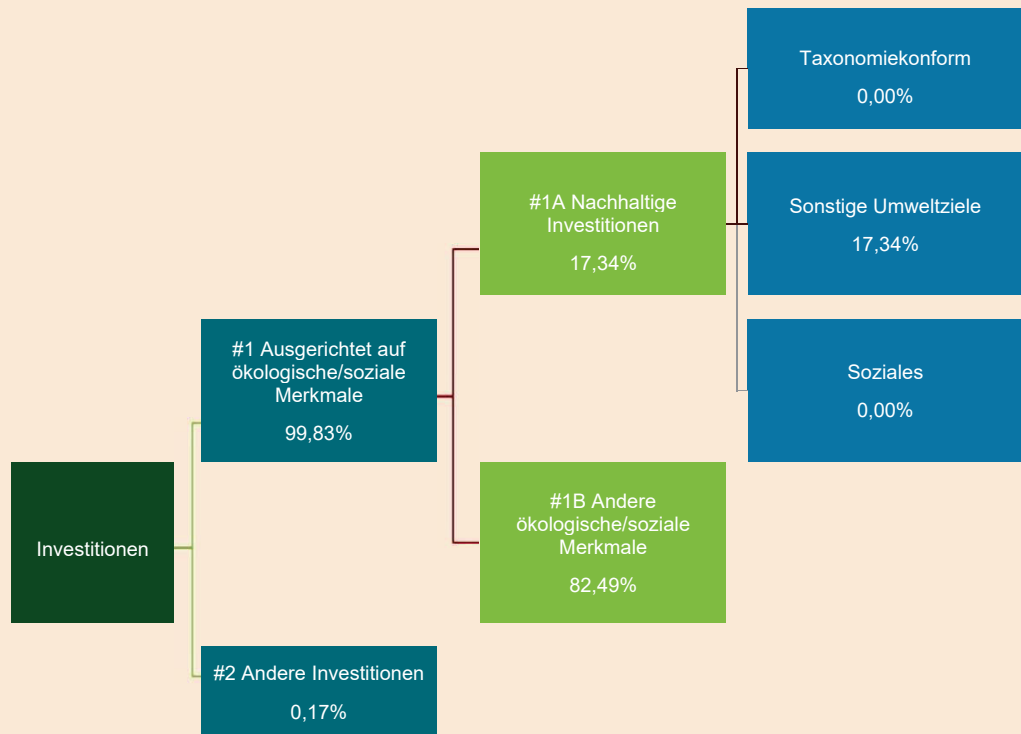
Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 17,34 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,83 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,17 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 17,34 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und -untersektoren des Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	30,36%
Gesundheitssektor	14,73%
Finanzsektor	13,44%
Zyklische Konsumgüter	11,03%
Kommunikationsdienste	9,38%
Industrie	8,49%
Basiskonsumgüter	7,19%
Immobilien	2,74%
Grundstoffe	2,24%
Versorgungsunternehmen	0,22%
Wichtigster Teilssektor	% der Vermögenswerte
Software	11,95%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	8,03%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	7,16%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	6,36%
Allgemeiner Einzelhandel	4,32%
Finanzdienstleistungen	3,99%
Kapitalmärkte	3,87%
Pharma	3,69%
Banken	3,30%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	3,16%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,01%
Biotechnologie	2,98%
Überlandtransport	2,24%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	2,22%
Getränke	2,01%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



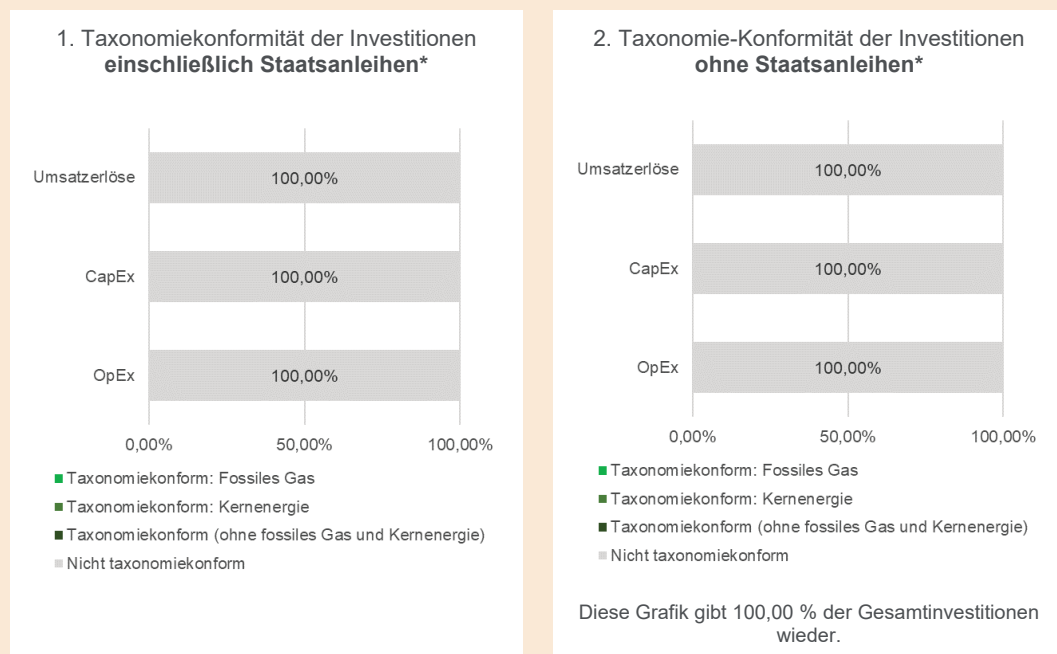
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?<sup>1</sup>

- Ja  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, investierte der Fonds nicht in Übergangs- oder ermöglichende Tätigkeiten.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend. Wie im Nachtrag dargelegt, verpflichtet sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, hatten alle nachhaltigen Investitionen des Fonds ein Umweltziel, das nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet war.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 0,17 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Dies schloss auch Emittenten ein, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Wie oben dargelegt, bildete der Fonds den Index nach, der Aktien von Unternehmen ausschloss, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird vierteljährlich neu gewichtet und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwacht das Portfolio regelmäßig und stellt sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtet. Er überprüft die Investments auf Portfolioebene auf mögliche nachteilige Auswirkungen durch die Indexnachbildung. Der Anlageverwalter stellt sicher, dass die Fondsanlagen den Index stets eng nachbilden, damit die Ausrichtung auf die ESG-Merkmale des Index gewährleistet ist.

Wertpapiere, die die Kriterien für den Verbleib im Index nicht mehr erfüllen, werden bei der Neugewichtung aus dem Portfolio herausgenommen und vom Fonds abgestoßen. Die Anlageverwalter setzen die Indexänderungen um und verkaufen die betroffenen Wertpapiere zeitnah.

Eine Stimmrechtsvertretung ist für unsere aktiv und passiv verwalteten Fonds sowie ETFs vorgesehen. Auf diese Weise können wir unsere Stimmrechte in unseren aktiv und passiv verwalteten Strategien ausüben, damit diese systematisch stärker auf Nachhaltigkeitsbelange ausgerichtet werden. Findet ein Engagement statt, erfolgt dies in der Regel durch unsere Fundamentalforschungs-Analysten aus aktiv verwalteten Strategien, die in direktem Kontakt zu den betroffenen Emittenten stehen. Engagements werden protokolliert und die diesbezüglichen Informationen werden über ein zentrales Engagement-Tool zwischen den Teams ausgetauscht.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nähere Informationen zur Methodik finden Sie unter folgendem Link:

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-paris-aligned-climate-transition-pact-indices.pdf>

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index ist so aufgebaut, dass er die Dekarbonisierungsanforderungen absolut und im Verhältnis zum Hauptindex (einem relevanten breiten Marktindex) erfüllt. Die Indexmethodik sieht auch mehrere aktivitätsbasierte Ausschlüsse vor, wie oben beschrieben, die nicht Teil des Hauptindex sind.

### Wie hat dieses Finanzprodukt ...

**...in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

**...im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

**...im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

	Finanzprodukt	Referenzwert	Breiter Marktindex
	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	S&P 500 Net Zero 2050 Paris Aligned ESG Index NR	S&P 500 Index
Treibhausgasintensität der Wertpapiere, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen, basierend auf MSCI ESG-Daten. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD)	462,30	462,70	714,60

# Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (der „Fonds“)



**FRANKLIN  
TEMPLETON**

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
254900G70W062PBB4G48

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●●  **JA**

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

●●  **NEIN**

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 16,33% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte die ökologischen Merkmale, indem er (i) Investoren beim Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft unterstützte und (ii) seine Investitionen durch Nachbildung des MSCI China Climate Paris Aligned Net Total Return Index (der „Index“) auf das Pariser Klimaabkommen ausrichtete. Der Index ist auf die Mindestanforderungen für die EU Paris Aligned Benchmarks (EU-PABs) ausgelegt.

Der Fonds investierte in ein Portfolio aus chinesischen Large- und Mid-Cap-Aktien, zu denen auch alle oder ein Großteil der im Index enthaltenen Wertpapiere gehörten. Wertpapiere wurden zudem im gleichen Verhältnis gehalten wie ihre Gewichtung im Index. Der Index ist auf das Pariser Klimaabkommen ausgerichtet und unterstützt Investoren beim Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft. Im Vergleich zum MSCI China Index (seinem Hauptindex) weist er zudem geringere CO<sub>2</sub>-Emissionen, eine geringere Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen und ein höheres Engagement in potenziellen klimawandelbezogenen Chancen auf.

Der Index schließt zudem Unternehmen aus, die einen Bezug zu umstrittenen Waffen, ESG-Kontroversen, Tabak, Abbau von Kraftwerkskohle, Stromerzeugung mit Öl, Gas und Kraftwerkskohle und anderen Bereichen haben, die nicht auf die UNGC-Prinzipien, die OECD-Leitsätze oder die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte ausgerichtet sind.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Fonds verwendet die Treibhausgasintensität der Wertpapiere im Index, gemessen anhand der Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen, als Nachhaltigkeitsindikator.

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/\$ Umsatz) des Index war um 55,7 % niedriger als beim Hauptindex (422,2 gegenüber 954,1). Als Grundlage dienten Daten von MSCI.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Benchmark
Treibhausgasintensität der Wertpapiere in der Referenz-Benchmark im Vergleich zur Haupt-Benchmark, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD)	422,50	954,10

## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

## Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Fonds tätigte, wurden durch Investition entweder in Unternehmen, die Lösungen zur Begrenzung der Folgen des Klimawandels anbieten oder die Klimarichtlinien erarbeitet und Kohlenstoffreduktionsziele festgelegt haben und Bestandteile des Index sind, umgesetzt. Die nachhaltigen Investitionen erfüllten auch die DNSH-Kriterien gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, hatte er sich dennoch verpflichtet, mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere zu investieren, die als nachhaltig definiert werden können. Es handelte sich dabei um Wertpapiere, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem Umweltziel beitragen und die DNSH-Kriterien („Do No Significant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 16,33 % des Nettoinventarwerts des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel angelegt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

## Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Durch Nachbildung des Index konnte der Fonds die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Darüber hinaus wurden diese als nachhaltige Investitionen definierten Wertpapiere bewertet, um sicherzustellen, dass sie keine ökologischen oder sozialen Anlageziele beeinträchtigen, und um die Ausrichtung auf Artikel 2 (17) SFDR zu gewährleisten. Diese Bewertung sah vor, dass das einzelne Unternehmen strenge Kriterien erfüllt, wie zum Beispiel:

- kein Bezug zu umstrittenen Waffen
- weniger als 1 % Umsatz aus Kraftwerkkohle
- weniger als 5 % Umsatz aus tabakbezogenen Aktivitäten
- darf kein Tabakproduzent sein
- keine Beteiligung an schwerwiegenden ESG-Kontroversen.

Während des Bezugszeitraums gab es keine Verstöße gegen die Kriterien des Fonds.

## Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Index-Methodik beinhaltet Kriterien zur Reduzierung des Engagements in oder zum Ausschluss von Wertpapieren, die mit den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Konflikt stehen:

- THG-Intensität der Portfoliounternehmen (Nr. 3)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind (Nr. 4)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact (Nr. 10)
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (Nr. 14)

## Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Jegliche Wertpapiere, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, wurden aus dem Index ausgeschlossen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Siehe dazu die Antwort unter „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Bezugszeitraum waren die 15 Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-07-01 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Tencent Holdings Ltd ORD HKD 0.000020	Kommunikationsdienste	15,72%	China
Alibaba Group Holding Ltd ORD HKD 0.000003125	Zyklische Konsumgüter	10,45%	China
Meituan ORD HKD 0.000010 CL B	Zyklische Konsumgüter	3,22%	China
Baidu Inc ORD HKD 0.000000625 CL A	Kommunikationsdienste	2,65%	China
BYD Co Ltd ORD HKD1	Zyklische Konsumgüter	2,20%	China
Netease Inc ORD HKD.0001	Kommunikationsdienste	1,72%	China
PDD Holdings Inc SPONSORED ADR	Zyklische Konsumgüter	1,68%	China
China Conch Venture Holdings Ltd ORD HKD.01	Industrie	1,57%	China
LONGi Green Energy Technology Co Ltd ORD CNY 1 CL A *XSSC SS-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Informationstechnologie	1,55%	China
Sungrow Power Supply Co Ltd ORD CNY 1 *XSEC SZ-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Industrie	1,38%	China
NARI Technology Co Ltd ORD CNY1 CL A *XSSC SS-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Industrie	1,35%	China
China Three Gorges Renewables Group Co Ltd ORD CNY 1 *XSSC SS-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Versorgungsunternehmen	1,31%	China
Yum China Holdings Inc COM USD.01	Zyklische Konsumgüter	1,25%	China
China Life Insurance Co Ltd ORD HKD1 CLASS H	Finanzsektor	1,23%	China
Kweichow Moutai Co Ltd ORD CNY1 CL A *XSSC SS-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Basiskonsumgüter	1,22%	China





## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

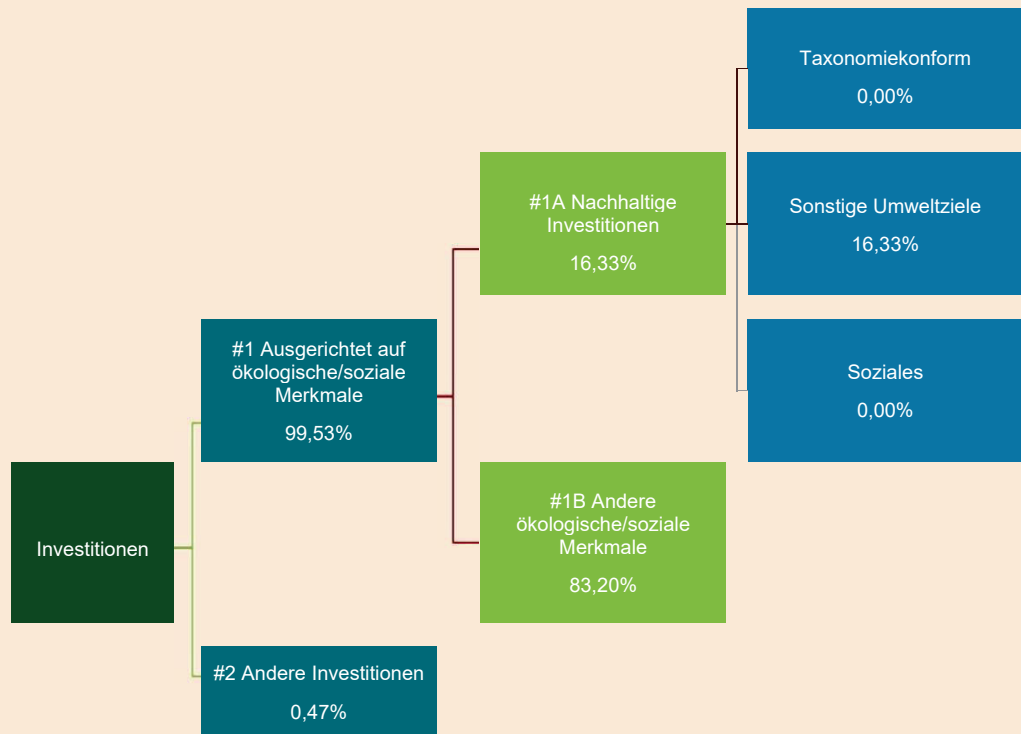
Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 16,33 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,53 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,47 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 16,33 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und -untersektoren des Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Zyklische Konsumgüter	23,38%
Kommunikationsdienste	22,77%
Finanzsektor	11,35%
Informationstechnologie	11,00%
Industrie	10,29%
Gesundheitssektor	9,98%
Basiskonsumgüter	4,07%
Versorgungsunternehmen	3,32%
Immobilien	2,77%
Grundstoffe	0,59%
Wichtigster Teilssektor	% der Vermögenswerte
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	19,64%
Allgemeiner Einzelhandel	11,81%
Kapitalmärkte	7,61%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	5,98%
Elektronikgeräte	5,29%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	5,04%
Automobilindustrie	3,81%
Biotechnologie	3,53%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	3,32%
Software	3,32%
Getränke	3,26%
Unterhaltung	2,88%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	2,77%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	2,69%
Pharma	2,35%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



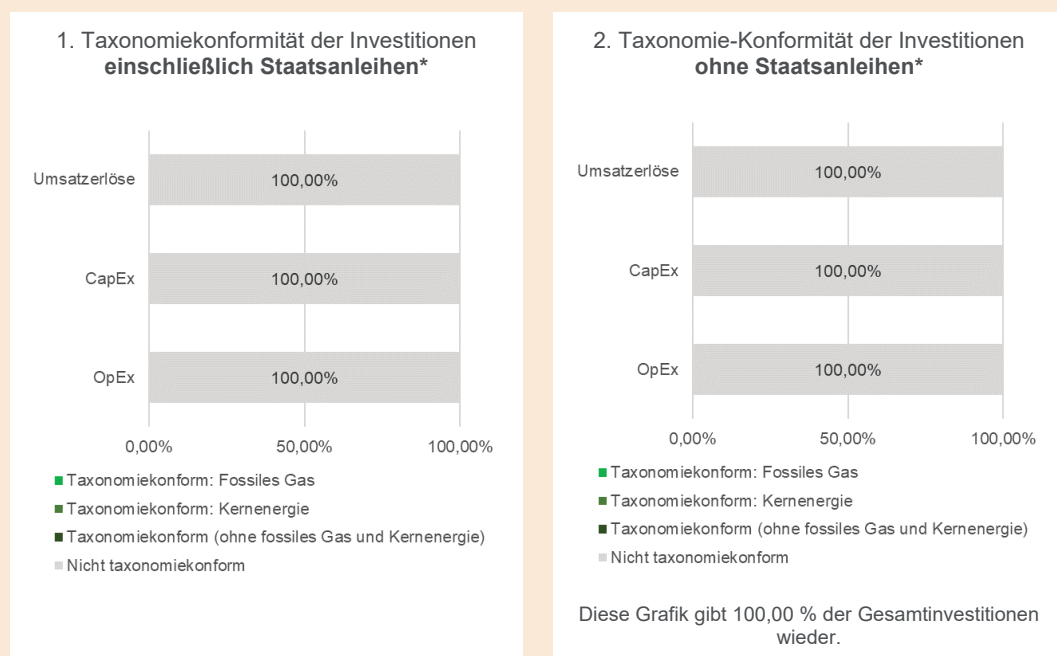
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?<sup>1</sup>

- Ja  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, investierte der Fonds nicht in Übergangs- oder ermöglichende Tätigkeiten.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend. Wie im Nachtrag dargelegt, verpflichtet sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, hatten alle nachhaltigen Investitionen des Fonds ein Umweltziel, das nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet war.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 0,47 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Dies schloss auch Emittenten ein, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Wie oben dargelegt, bildete der Fonds den Index nach, der Aktien von Unternehmen ausschloss, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird jährlich im März überprüft und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwacht das Portfolio regelmäßig und stellt sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtet. Er überprüft die Investments auf Portfolioebene auf mögliche nachteilige Auswirkungen durch die Indexnachbildung. Der Anlageverwalter stellt sicher, dass die Fondsanlagen den Index stets eng nachbilden, damit die Ausrichtung auf die ESG-Merkmale des Index gewährleistet ist.

Wertpapiere, die die Kriterien für den Verbleib im Index nicht mehr erfüllen, werden bei der Neugewichtung aus dem Portfolio herausgenommen und vom Fonds abgestoßen. Die Anlageverwalter setzen die Indexänderungen um und verkaufen die betroffenen Wertpapiere zeitnah.

Eine Stimmrechtsvertretung ist für unsere aktiv und passiv verwalteten Fonds sowie ETFs vorgesehen. Auf diese Weise können wir unsere Stimmrechte in unseren aktiv und passiv verwalteten Strategien ausüben, damit diese systematisch stärker auf Nachhaltigkeitsbelange ausgerichtet werden. Findet ein Engagement statt, erfolgt dies in der Regel durch unsere Fundamentalresearch-Analysten aus aktiv verwalteten Strategien, die in direktem Kontakt zu den betroffenen Emittenten stehen. Engagements werden protokolliert und die diesbezüglichen Informationen werden über ein zentrales Engagement-Tool zwischen den Teams ausgetauscht.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nähere Informationen zur Methodik finden Sie unter folgendem Link: [https://www.msci.com/eqb/methodology/meth\\_docs/MSCI\\_Climate\\_Paris\\_Aligned\\_Indexes.pdf](https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_Climate_Paris_Aligned_Indexes.pdf)

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index ist so aufgebaut, dass er die Dekarbonisierungsanforderungen absolut und im Verhältnis zum Hauptindex (einem relevanten breiten Marktindex) erfüllt. Die Indexmethodik sieht auch mehrere aktivitätsbasierte Ausschlüsse vor, wie oben beschrieben, die nicht Teil des Hauptindex sind.

### Wie hat dieses Finanzprodukt ...

**...in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

**...im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

**...im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

	Finanzprodukt	Referenzwert	Breiter Marktindex
	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	MSCI China Paris Aligned Index	MSCI China Index
Treibhausgasintensität der Wertpapiere, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO2e/investierte Mio. USD)	422,50	422,20	954,10

# Franklin Catholic Principles Emerging Market Sovereign Debt UCITS ETF (der „Fonds“)



FRANKLIN  
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
254900HUXLPRCSWYJV17

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●●  JA

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

●●  NEIN

Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte soziale und ökologische Merkmale, das heißt (i) die Reduzierung der Treibhausgasemissionen in nationalen Volkswirtschaften, (ii) gute Governance-Praktiken für Länder und (iii) soziale Gerechtigkeit, durch Nachbildung des ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index (Kennung: EMCV, der „Index“) und Minimierung des Tracking Error. Der Index basiert auf dem ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index (der „Hauptindex“ oder die „Benchmark“) und setzt sich aus auf USD und EUR lautenden Schwellenländer-Staatsanleihen zusammen. Der Index (i) schließt Wertpapiere des Hauptindex aus, die von Ländern begeben werden, welche bestimmte römisch-katholische Grundsätze nicht erfüllen, und (ii) passt die Gewichtung der Wertpapiere zum Hauptindex an, um die gesamte CO<sub>2</sub>-Bilanz des Index im Vergleich zum Hauptindex zu verbessern.

\* Der Index konzentriert sich daher auf ökologische Merkmale sowie gute Governance-Praktiken und soziale Gerechtigkeit. Bei der Zusammenstellung des Index wurden die folgenden Merkmale berücksichtigt: Korruptionskontrolle, Rechtsstaatlichkeit, Effizienz der Regierung, politische Stabilität, regulatorische Qualität, politische Rechte, Bürgerrecht, politische Freiheit, Abschaffung der Todesstrafe und Treibhausgasemissionen.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Exponierung gegenüber den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) im Vergleich zur Benchmark, dem ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren per 30. Juni 2023 ab.

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend. Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, verpflichtete sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend. Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, verpflichtete sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen.

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend. Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, verpflichtete sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen.

-----**Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Nicht zutreffend. Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, verpflichtete sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

PAI-Indikatoren wurden auf zwei Ebenen berücksichtigt:

**a) Einschränkung des investierbaren Universums**

PAIs wurden angewendet, um aus dem investierbaren Universum Unternehmen auszuschließen, die gegen soziale Normen (PAI Nr. 16), Menschenrechte (sozialer PAI Nr. 20), Korruptionsnormen (sozialer PAI Nr. 21) und Rechtsstaatlichkeit (sozialer PAI Nr. 24) verstoßen.

**b) Hilfestellung für thematisches Engagement.**

Das Engagement bei staatlichen Emittenten basierte auf PAIs. Das Anlageteam arbeitete im Rahmen eines Engagements mit 5 % der Emittenten mit dem schlechtesten Score im Portfolio zusammen, basierend auf deren aggregierter Exponierung gegenüber den PAIs Nr. 15 und Nr. 16 und den optionalen sozialen PAIs Nr. 18 bis Nr. 24, bezogen auf den Fonds auf Jahresbasis.

Die Anlageverwalter erfüllten ihre zum 1. Januar 2023 eingegangene Verpflichtung zu einem Engagement (auf Basis des Kalenderjahres) bei 5 % der Beteiligungen, die in Bezug auf ihre Gesamtexponierung gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	571,77	92,42%
Benchmark – THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	750,69	95,76%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	82,66%
Benchmark – Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	5,00	92,88%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Einkommensungleichheit	Durchschnittlicher Score	41,82	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Einkommensungleichheit	Durchschnittlicher Score	40,47	94,23%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Meinungsfreiheit	Durchschnittlicher Score	60,90	92,42%

PAI-Indikatoren	Masseinheit	Wert	Umfang
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Meinungsfreiheit	Durchschnittlicher Score	52,10	98,87%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittliche Leistung Menschenrechte	Durchschnittliche Leistung	0,59	86,47%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittliche Leistung Menschenrechte	Durchschnittliche Leistung	0,53	82,30%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Korruption	Durchschnittlicher Score	46,44	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Korruption	Durchschnittlicher Score	43,89	100,00%
Zusätzliche Indikatoren: Kooperationsunwillige Steuergebiete	Gewichtung (in %)	6,07%	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Kooperationsunwillige Steuergebiete	Gewichtung (in %)	3,72%	100,00%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für politische Stabilität	Durchschnittlicher Score	5,88	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für politische Stabilität	Durchschnittlicher Score	5,63	100,00%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Rechtsstaatlichkeit	Durchschnittlicher Score	0,12	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Rechtsstaatlichkeit	Durchschnittlicher Score	0,03	100,00%



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-07-01 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Brazilian Government International Bond 2.875% 06/06/2025	Staatsanleihen	4,49%	Brasilien
Colombia Government International Bond 7.375% 09/18/2037	Staatsanleihen	4,43%	Kolumbien
Romanian Government International Bond 4.625% 04/03/2049 REG S	Staatsanleihen	3,94%	Rumänien
Romanian Government International Bond 2.875% 10/28/2024 REG S	Staatsanleihen	3,67%	Rumänien
Peruvian Government International Bond 2.783% 01/23/2031	Staatsanleihen	3,63%	Peru
Israel Government International Bond 2.75% 07/03/2030	Staatsanleihen	3,45%	Israel
Republic Of South Africa Government International Bond 5.875% 06/22/2030	Staatsanleihen	3,42%	Südafrika
Chile Government International Bond .555% 01/21/2029	Staatsanleihen	3,21%	Chile
Philippine Government International Bond 3.70% 02/02/2042	Staatsanleihen	3,05%	Philippinen
Republic of Poland Government International Bond 07/07/2023 REG S	Staatsanleihen	2,84%	Polen
Brazilian Government International Bond 4.75% 01/14/2050	Staatsanleihen	2,80%	Brasilien
Dominican Republic International Bond 6% 07/19/2028 REG S	Staatsanleihen	2,44%	Dominikanische Republik
Philippine Government International Bond 3% 02/01/2028	Staatsanleihen	2,41%	Philippinen
Republic Of Poland Government International Bond 2.75% 05/25/2032 REG S	Staatsanleihen	2,12%	Polen
Israel Government International Bond 3.875% 07/03/2050	Staatsanleihen	2,00%	Israel





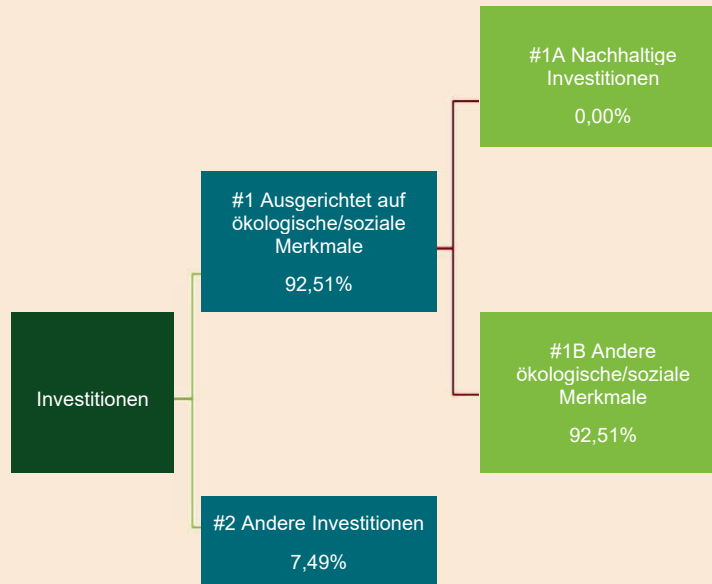
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nicht zutreffend. Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, verpflichtete sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

92,51 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (7,49 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und -untersektoren dieses Fonds:

<b>Wichtigster Sektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Staatsanleihen	92,51%
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	7,49%
<b>Wichtigster Teilsektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Staatsanleihen	92,51%
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	7,49%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. **- Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **- Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **- Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



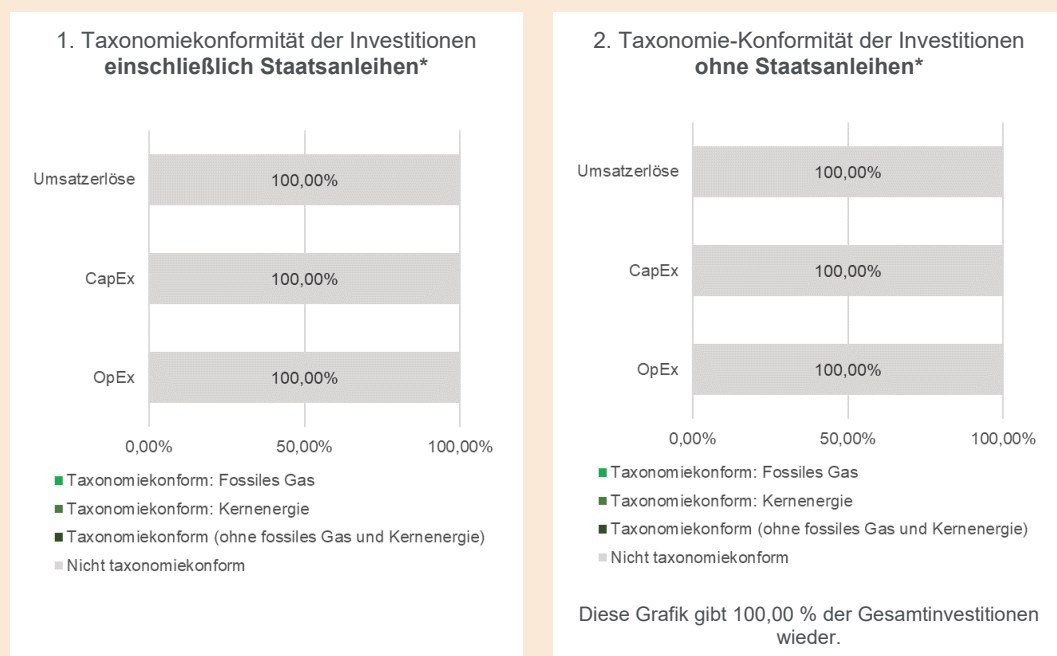
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?<sup>1</sup>

- Ja  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend. Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, verpflichtete sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend. Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, verpflichtete sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 7,49 % und umfasste für Zwecke der täglichen Anforderungen des Fonds gehaltene liquide Mittel ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Dies schloss auch Emittenten ein, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Portfoliomanager ergriffen zwei Arten von Maßnahmen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu fördern. Zum einen die enge Nachbildung des Hauptindex und zum anderen das Engagement mit den 5 % der Emittenten mit dem schlechtesten Score, basierend auf deren PAI-Indikatoren.

\* Der Fonds bildete den Hauptindex während des Berichtszeitraums erfolgreich nach. Bei der Zusammenstellung des Index wurden sowohl ökologische Merkmale (Treibhausgasemissionen) als auch soziale Merkmale (Korruptionskontrolle, Rechtsstaatlichkeit, Effizienz der Regierung, politische Stabilität, Bürgerrecht, politische Freiheit und keine Todesstrafe) berücksichtigt.

\* Darüber hinaus förderte der Fonds diese ökologischen und sozialen Merkmale durch Engagement bei mehreren staatlichen Emittenten (zum Beispiel Bulgarien, Chile, Mongolei, Polen und Rumänien), um die Bedeutung einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen, des Schutzes der Biodiversität, der Rechtsstaatlichkeit und der Korruptionskontrolle deutlich zu machen. Unser Engagement mit Chile und Rumänien erfolgte in Form von Telefongesprächen, während die Portfoliomanager mit Bulgarien per E-Mail kommunizierten. Die Vertreter Polens trafen die Portfoliomanager auf einer Konferenz in London. Die Portfoliomanager unternahmen alle Anstrengungen, um mit der Mongolei in Kontakt zu treten, unter anderem mit E-Mails und Einschreiben an das Finanzministerium, Anrufen bei der Botschaft der Mongolei und über die Investitionsbank, die die Anleiheemission des Landes syndiziert hat. Leider sind unsere Bemühungen erfolglos geblieben, auch wenn die Portfoliomanager alles dafür getan haben, mit dem Emittenten in Kontakt zu treten.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Der Fonds ist passiv und bildet den Index mit minimalem Tracking Error nach.

Weitere Informationen zum Index, unter anderem über seine Regeln und Wertentwicklung, sind unter <https://indices.ice.com/> erhältlich. Hierfür muss im Feld „Index“ des Bereichs „Index Snapshot“ die entsprechende Indexkennung (EMCV) eingegeben werden. Die Indexkomponenten können durch Eingabe der Indexkennung auf der Registerkarte „ETF Benchmarks“ unter <https://indices.ice.com/publications> abgerufen werden.

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index ist die Referenz und (einzige) Benchmark für den Fonds.

Der breite Marktindex, der ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index, schließt alle Länder aus, die eines der folgenden Screening-Kriterien basierend auf ESG-Ratingdaten von Sustainalytics erfüllen, bzw. für den Fall, dass sie von Sustainalytics nicht erfasst werden:

Sustainalytics Feldname-Code Ausschlusskriterien Schwelle

- NCPC-Control of Corruption - Score (241211203999) < 35
- NCPC-Rule of Law-Score (241211213999) < 40
- IC-Control of Corruption-Score (241213343999) < 35
- IC-Rule of Law-Score-(241213353999) < 40
- IC-Government Effectiveness-Score (241213363999) < 40
- IC-Political Stability-Score (241213373999) < 30
- IC-Regulatory Quality-Score (241213383999) < 40
- IC-Political Rights-Score (241213393999) < 40
- IC-Civil Liberty-Score (241213403999) < 40
- Political Freedom (251116161799) "Not Free"
- Death Penalty (251116151799) "Retentionist"

Die CO<sub>2</sub>-Kennzahl für den Hauptindex wird auf Basis der durchschnittlichen Pro-Kopf-CO<sub>2</sub>-Emissionen der einzelnen Länder in Tonnen CO<sub>2</sub> berechnet. Liegt die CO<sub>2</sub>-Kennzahl des Index mindestens 30 % unter derjenigen des Hauptindex, ist keine weitere Anpassung notwendig. Liegt die CO<sub>2</sub>-Kennzahl des Index weniger als 30 % unter derjenigen des Hauptindex, werden die Ländergewichtungen angepasst, vorbehaltlich der Ländergrenze von 10 %, um eine Reduzierung um 30 % zu erreichen. Die Daten zu den Pro-Kopf-CO<sub>2</sub>-Emissionen basieren auf den von Emissions Database for Global Atmospheric Research („EDGAR Carbon Data Report“) veröffentlichten Daten. Die Daten werden jährlich im Dezember aktualisiert, wobei die neuen Daten vom Jahresende für die Neugewichtung im Januar herangezogen werden.

Der Index entfernt Länder, die gegen die katholischen Governance- und sozialen Normen verstoßen und gewichtet das Portfolio neu, um niedrigere Treibhausgasemissionen zu erreichen.

### Wie hat dieses Finanzprodukt ...

**...in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

**...im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

**...im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

	Finanzprodukt	Referenzwert	Breiter Marktindex
	Franklin Catholic Principles Emerging Market Sovereign Debt UCITS ETF	ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index	ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	571,77	511,88	750,69
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	0,00	5,00
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Einkommensungleichheit	41,82	36,06	40,47
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Meinungsfreiheit	60,90	63,04	52,10
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittliche Leistung Menschenrechte	0,59	0,62	0,53
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Korruption	46,44	48,94	43,89
Zusätzliche Indikatoren: Kooperationsunwillige Steuergebiete (Gewichtung in %)	6,07%	0,00%	3,72%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für politische Stabilität	5,88	6,87	5,63
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Rechtsstaatlichkeit	0,12	0,32	0,03

# Franklin MSCI EM Paris Aligned Climate UCITS ETF (der „Fonds“)



**FRANKLIN  
TEMPLETON**

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
254900TC8K24IWZL578

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 18,32% an nachhaltigen Investitionen
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte die ökologischen Merkmale, indem er (i) Investoren beim Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft unterstützte und (ii) seine Investitionen durch Nachbildung des MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned Net Total Return Index (der „Index“) auf das Pariser Klimaabkommen ausrichtete. Der Index ist auf die Mindestanforderungen für die EU Paris Aligned Benchmarks (EU-PABs) ausgelegt.

Der Fonds investierte in ein Portfolio aus Large- und Mid-Cap-Aktien aus Schwellenländern, zu denen auch alle oder ein Großteil der im Index enthaltenen Wertpapiere gehörten. Wertpapiere wurden zudem im gleichen Verhältnis gehalten wie ihre Gewichtung im Index. Der Index ist auf das Pariser Klimaabkommen ausgerichtet und unterstützt Investoren beim Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft. Im Vergleich zum MSCI Emerging Markets Index (seinem Hauptindex) weist er geringere CO<sub>2</sub>-Emissionen, eine geringere Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen und ein höheres Engagement in potenziellen klimawandelbezogenen Chancen auf.

Der Index schließt zudem Unternehmen aus, die einen Bezug zu umstrittenen Waffen, ESG-Kontroversen, Tabak, Abbau von Kraftwerkskohle, Stromerzeugung mit Öl, Gas und Kraftwerkskohle und anderen Bereichen haben, die nicht auf die UNGC-Prinzipien, die OECD-Leitsätze oder die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte ausgerichtet sind.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Fonds verwendet die Treibhausgasintensität der Wertpapiere im Index, gemessen anhand der Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen, als Nachhaltigkeitsindikator.

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/\$ Umsatz) des Index war um 55,7 % niedriger als beim Hauptindex (533,6 gegenüber 1.203,7). Als Grundlage dienten Daten von MSCI.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Benchmark
Treibhausgasintensität der Wertpapiere in der Referenz-Benchmark, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD)	533,60	1 203,70

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend. Dies ist der erste regelmäßige Bericht, der für den Fonds gemäß der Verordnung (EU) 2022/1288 erstellt wurde.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Fonds tätigte, wurden durch Investition entweder in Unternehmen, die Lösungen zur Begrenzung der Folgen des Klimawandels anbieten oder die Klimarichtlinien erarbeitet und Kohlenstoffreduktionsziele festgelegt haben und Bestandteile des Index sind, umgesetzt. Die nachhaltigen Investitionen erfüllten auch die DNSH-Kriterien gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, hatte er sich dennoch verpflichtet, mindestens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere zu investieren, die als nachhaltig definiert werden können. Es handelte sich dabei um Wertpapiere, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem Umweltziel beitragen und die DNSH-Kriterien („Do No Significant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllen. Am Ende des Referenzzeitraums waren 18,32 % des Nettoinventarwerts des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel angelegt.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Durch Nachbildung des Index konnte der Fonds die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Darüber hinaus wurden diese als nachhaltige Investitionen definierten Wertpapiere bewertet, um sicherzustellen, dass sie keine ökologischen oder sozialen Anlageziele beeinträchtigen, und um die Ausrichtung auf Artikel 2 (17) SFDR zu gewährleisten. Diese Bewertung sah vor, dass das einzelne Unternehmen strenge Kriterien erfüllt, wie zum Beispiel:

- kein Bezug zu umstrittenen Waffen
- weniger als 1 % Umsatz aus Kraftwerkkohle
- weniger als 5 % Umsatz aus tabakbezogenen Aktivitäten
- darf kein Tabakproduzent sein
- keine Beteiligung an schwerwiegenden ESG-Kontroversen.

Während des Bezugszeitraums gab es keine Verstöße gegen die Kriterien des Fonds.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Index-Methodik beinhaltet Kriterien zur Reduzierung des Engagements in oder zum Ausschluss von Wertpapieren, die mit den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Konflikt stehen:

- THG-Intensität der Portfoliounternehmen (Nr. 3)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind (Nr. 4)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact (Nr. 10)
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (Nr. 14)

----- **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Ja. Jegliche Wertpapiere, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, wurden aus dem Index ausgeschlossen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Siehe dazu die Antwort unter „Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Bezugszeitraum waren die 15 Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2023-03-09 - 2023-06-30.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ORD TWD10	Informationstechnologie	7,89%	Taiwan
Tencent Holdings Ltd ORD HKD 0.000020	Kommunikationsdienste	4,61%	China
Samsung Electronics Co Ltd ORD KRW 100	Informationstechnologie	3,33%	Südkorea
Alibaba Group Holding Ltd ORD HKD 0.000003125	Zyklische Konsumgüter	3,09%	China
Samsung SDI Co Ltd ORD KRW5000	Informationstechnologie	2,44%	Südkorea
Delta Electronics Inc ORD TWD10	Informationstechnologie	1,82%	Taiwan
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV ORD MXN NPV B SHARES	Industrie	1,48%	Mexiko
Samsung Electro-Mechanics Co Ltd ORD KRW5000	Informationstechnologie	1,46%	Südkorea
Meituan ORD HKD 0.000010 CL B	Zyklische Konsumgüter	1,25%	China
BYD Co Ltd ORD HKD1	Zyklische Konsumgüter	1,20%	China
Infosys Ltd ORD INR5 (DEMAT)	Informationstechnologie	1,10%	Indien
Al Rajhi Bank ORD SAR10	Finanzsektor	1,09%	Saudi-Arabien
Bharat Electronics Ltd ORD INR1	Industrie	1,05%	Indien
Housing Development Finance Corp Ltd ORD INR2 (DEMAT)	Finanzsektor	1,04%	Indien
ICICI Bank Ltd ORD INR2 (DEMAT)	Finanzsektor	1,03%	Indien





## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

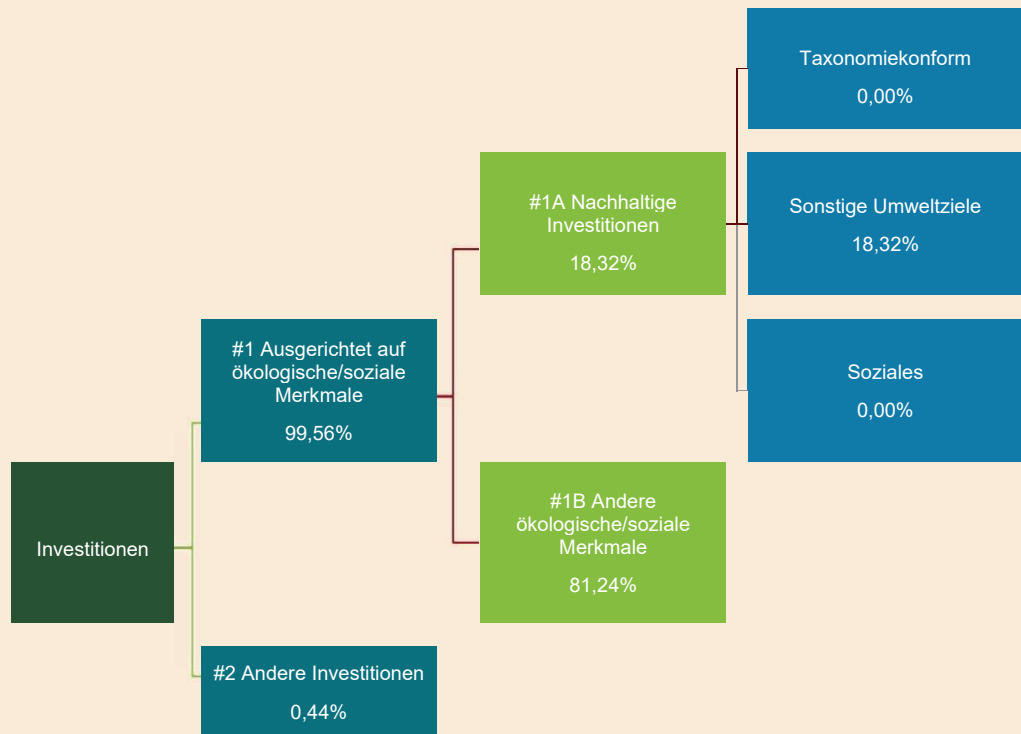
Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 18,32 %.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,56 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,44 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 18,32 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Mit Stand vom 30. Juni 2023 waren die Hauptsektoren und -untersektoren des Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate):

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	25,71%
Finanzsektor	22,44%
Zyklische Konsumgüter	12,50%
Industrie	10,22%
Kommunikationsdienste	9,07%
Basiskonsumgüter	6,09%
Gesundheitssektor	4,65%
Grundstoffe	3,33%
Versorgungsunternehmen	3,06%
Immobilien	2,51%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	13,12%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	12,32%
Elektronische Ausrüstung, Geräte u. Komponenten	6,49%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	5,92%
Allgemeiner Einzelhandel	5,02%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	3,57%
Versicherungen	3,12%
Chemische Erzeugnisse	3,10%
Elektronikgeräte	3,05%
Verkehrsinfrastruktur	3,00%
Finanzdienstleistungen	2,80%
IT-Dienstleistungen	2,69%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	2,58%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	2,31%
Pharma	2,16%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



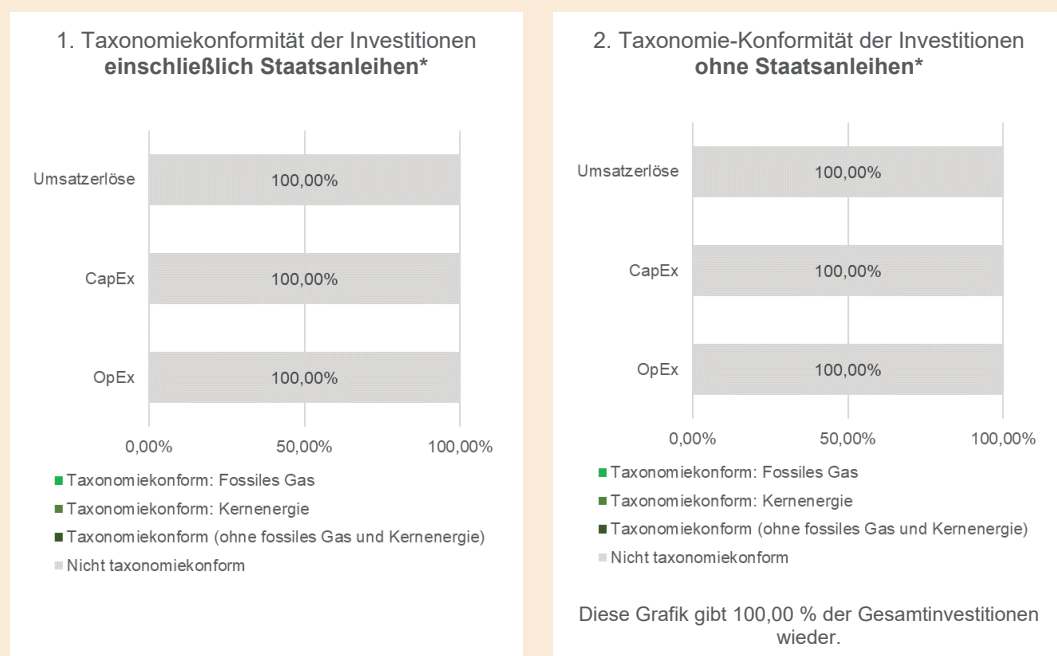
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?<sup>1</sup>

- Ja  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, investierte der Fonds nicht in Übergangs- oder ermöglichende Tätigkeiten.

### Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend. Wie im Nachtrag dargelegt, verpflichtet sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet sind.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, hatten alle nachhaltigen Investitionen des Fonds ein Umweltziel, das nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet war.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie beabsichtigt und im Nachtrag dargelegt, tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 0,44 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz. Dies schloss auch Emittenten ein, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Wie oben dargelegt, bildete der Fonds den Index nach, der Aktien von Unternehmen ausschloss, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird jährlich im März überprüft und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwacht das Portfolio regelmäßig und stellt sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtet. Er überprüft die Investments auf Portfolioebene auf mögliche nachteilige Auswirkungen durch die Indexnachbildung. Der Anlageverwalter stellt sicher, dass die Fondsanlagen den Index stets eng nachbilden, damit die Ausrichtung auf die ESG-Merkmale des Index gewährleistet ist.

Wertpapiere, die die Kriterien für den Verbleib im Index nicht mehr erfüllen, werden bei der Neugewichtung aus dem Portfolio herausgenommen und vom Fonds abgestoßen. Die Anlageverwalter setzen die Indexänderungen um und verkaufen die betroffenen Wertpapiere zeitnah.

Eine Stimmrechtsvertretung ist für unsere aktiv und passiv verwalteten Fonds sowie ETFs vorgesehen. Auf diese Weise können wir unsere Stimmrechte in unseren aktiv und passiv verwalteten Strategien ausüben, damit diese systematisch stärker auf Nachhaltigkeitsbelange ausgerichtet werden. Findet ein Engagement statt, erfolgt dies in der Regel durch unsere Fundamentalresearch-Analysten aus aktiv verwalteten Strategien, die in direktem Kontakt zu den betroffenen Emittenten stehen. Engagements werden protokolliert und die diesbezüglichen Informationen werden über ein zentrales Engagement-Tool zwischen den Teams ausgetauscht.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nähere Informationen zur Methodik finden Sie unter folgendem Link:

[https://www.msci.com/eqb/methodology/meth\\_docs/MSCI\\_Climate\\_Paris\\_Aligned\\_Indexes.pdf](https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_Climate_Paris_Aligned_Indexes.pdf)

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der Index ist so aufgebaut, dass er die Dekarbonisierungsanforderungen absolut und im Verhältnis zum Hauptindex (einem relevanten breiten Marktindex) erfüllt. Die Indexmethodik sieht auch mehrere aktivitätsbasierte Ausschlüsse vor, wie oben beschrieben, die nicht Teil des Hauptindex sind.

### Wie hat dieses Finanzprodukt ...

**...in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

**...im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

**...im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

	Finanzprodukt	Referenzwert	Breiter Marktindex
	Franklin MSCI EM Paris Aligned Climate UCITS ETF	MSCI EM Climate Paris Aligned Index	MSCI Emerging Markets Index
Treibhausgasintensität der Wertpapiere, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD)	534,10	533,60	1 203,70

Nur zum Vertrieb zugelassen, wenn ein zusammenfassender Prospekt und/oder Prospekt beigefügt oder vorausgegangen ist. Anleger sollten die Anlageziele, Risiken, Gebühren und Aufwendungen eines Fonds sorgfältig prüfen, bevor sie investieren. Ein Prospekt enthält diese und andere Informationen. Bitte lesen Sie ihn sorgfältig durch, bevor Sie investieren.

Um sicherzustellen, dass wir Ihnen einen qualitativ hochwertigen Service bieten, werden alle Anrufe zu und von unseren Servicebereichen überwacht und/oder aufgezeichnet.



**Jahresbericht**  
**Franklin Templeton ICAV**