

# FRANKLIN TEMPLETON ICAV

30. Juni 2024



FRANKLIN  
TEMPLETON

---

Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF

---

Franklin Catholic Principles Emerging Markets

---

Sovereign Debt UCITS ETF

---

Franklin Emerging Markets UCITS ETF

---

Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF

---

Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF

---

Franklin European Equity UCITS ETF

---

Franklin European Quality Dividend UCITS ETF

---

Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF

---

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

---

Franklin FTSE China UCITS ETF

---

Franklin FTSE Developed World UCITS ETF

---

Franklin FTSE India UCITS ETF

---

Franklin FTSE Korea UCITS ETF

---

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

---

---

Franklin Future of Food UCITS ETF

---

Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF

---

Franklin Global Equity SRI UCITS ETF

---

Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF

---

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

---

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned

---

Climate UCITS ETF

---

Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF

---

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

---

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned

---

Climate UCITS ETF

---

Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF

---

Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS

---

ETF

---

Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF

---

Franklin U.S. Equity UCITS ETF

---

Franklin USD Investment Grade Corporate

---

Bond UCITS ETF

---

# INHALT

	<b>Seite</b>
Inhaltsverzeichnis .....	3
Allgemeine Informationen .....	5
Bericht der Geschäftsleitung für das Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 .....	9
Bericht der Anlageverwaltung .....	13
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilsinhaber .....	45
Bericht der Unabhängigen Abschlussprüfer .....	46
Bilanz .....	51
Gesamtergebnisrechnung .....	58
Entwicklung des auf die Inhaber Rückkaufbarer Gewinnberechtigter Anteile Entfallenden Nettovermögens .....	65
Anhang zum Jahresabschluss für das zum 30. Juni 2024 Endende Geschäftsjahr .....	72
Anlagenportfolio zum 30. Juni 2024 .....	184
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF .....	184
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF .....	187
Franklin Emerging Markets UCITS ETF .....	190
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF .....	199
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF .....	202
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF .....	206
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF .....	209
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF .....	223
Franklin FTSE China UCITS ETF .....	226
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF .....	244
Franklin FTSE India UCITS ETF .....	272
Franklin FTSE Korea UCITS ETF .....	277
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF .....	281
Franklin Future of Food UCITS ETF .....	284
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF .....	286
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF .....	289
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF .....	296
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF .....	300
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF .....	304
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF .....	313
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF .....	328
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF .....	334

# INHALT

Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF .....	344
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF .....	349
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF .....	352
Franklin U.S. Equity UCITS ETF .....	355
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF .....	361
Offenlegung der Vergütungen (Ungeprüft) .....	365
Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (Ungeprüft) .....	367
Verordnung über Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten („SFDR“) und Taxonomieverordnung (Ungeprüft) .....	424

# INHALTSVERZEICHNIS

## VERWALTUNGSRAT

Joseph Carrier (USA)  
Fionnuala Doris (Irland)\*  
Joseph Keane (Irland)\*  
Joseph Larocque (USA) (Vorsitzender)  
Elinor Murray (UK) (ernannt am 1. November 2023)  
Jaspal Sagger (UK)  
Jane Trust (USA) (zurückgetreten am 21. Februar 2024)  
Craig Tyle (USA) (ernannt am 27. Juli 2023)  
William Jackson (UK) (zurückgetreten am 17. Juli 2023)  
Kein Verwaltungsratsmitglied ist geschäftsführend tätig.

## EINGETRAGENER SITZ:

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.

## REGISTERNUMMER

C167746

## UNABHÄNGIGE WIRTSCHAFTSPRÜFER

PricewaterhouseCoopers  
Wirtschaftsprüfer und eingetragene Rechnungsprüfer  
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

## MANAGER

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

## REPRÄSENTANT IN DER SCHWEIZ

Franklin Templeton Switzerland Limited  
Stockerstrasse 38  
CH-8002 Zürich  
Schweiz

# INHALTSVERZEICHNIS (Fortsetzung)

## **BEFUGTE 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

## **COMPANY SECRETARY**

Matsack Trust Limited (bis 1. April 2024)  
70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
Irland

OGS Corporate Governance Limited (seit 1. April 2024)  
30 Molesworth Street  
Dublin 2  
D02 AY19  
Irland

## **KUNDENBETREUUNG UK**

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

## **ZAHLSTELLE DÄNEMARK**

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

## **ZAHLSTELLE SCHWEIZ**

BNP Paribas, Paris,  
Zweigstelle Zürich  
Selnaustrasse 16  
CH-8002 Zürich  
Schweiz

## **INFORMATIONSTELLE DEUTSCHLAND**

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

## **ZAHLSTELLE SCHWEDEN**

Skandinaviska Enskilda Banken AB  
Kungstradgardsgatan 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 groß geschriebene, 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 oder mehrere Anteilklasse(n) 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 (wie nachstehend definiert) bestellt, mit Ausnahme des Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF, bei dem nur Franklin Templeton Investment Management Limited als Anlageverwalter fungiert.

Die Verwaltungsgesellschaft der ICAV hat Franklin Templeton Investment Management Limited zum Anlageverwalter des Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF, Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF, Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF und Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF bestellt.

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 Unteranlageverwalter 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 Portfolio der Vermögenswerte, die für jede Anteilserie gehalten werden und einen Teilfonds bilden, wird in Übereinstimmung mit den für den betreffenden Teilfonds geltenden Anlagezielen und der Anlagerichtlinien angelegt, die im jeweiligen Nachtrag angegeben sind. Die Anteile können unter anderem nach unterschiedlichen Dividendenrichtlinien, Gebühren, Gebührenvereinbarungen (einschließlich unterschiedlicher Gesamtkostenquoten) und Währungen, oder um jeweils eine Währungsabsicherung in Übereinstimmung mit der Politik und den Anforderungen der Zentralbank zu ermöglichen, in unterschiedliche Anteilsklassen eingeteilt werden.

Generell darf nur ein befugter Teilnehmer an Auflegungs- oder Rücknahmetransaktionen teilnehmen, die am Primärmarkt (dieser ist vom Sekundärmarkt, an dem Anteile gehandelt werden können, zu unterscheiden) direkt mit dem Teilfonds durchgeführt werden. Die ETF-Anteile sind an jeder Börse, an der sie notiert sind, für den Sekundärhandel notiert (laut Definition im Prospekt sind dies ausgesuchte Börsen, die die Verwaltungsratsmitglieder jeweils für jeden Fonds festlegen und die auf der Website aufgeführt sind), und einzelne ETF-Anteile können von Anlegern über einen Broker-Dealer an den Börsen, an denen sie notiert sind, erworben und verkauft werden. Der Teilfonds emittiert Primärmarktanteile an befugte Teilnehmer oder nimmt sie zurück (Primärmarktanteile sind im Prospekt definiert als Block von 50.000 Anteilen (oder Vielfachen davon). Dies ist die Einheit, in der der Fonds die Anteile durch Transaktionen mit befugten Teilnehmern begibt oder zurücknimmt. Befugte Teilnehmer sind im Prospekt in Bezug auf ETF-Anteile definiert als Market-Maker- oder Broker-Dealer-Gesellschaft, die zum Zweck der direkten Zeichnung und/oder Rücknahme von ETF-Anteilen beim Fonds (d. H. Primärmarkt) einen Vertrag für teilnehmende Händler geschlossen hat). Anteile der Teilfonds können an jedem Handelstag zum Nettoinventarwert je Anteil am maßgeblichen Handelstag abzüglich eines angemessenen Betrags für Abgaben und Gebühren begeben oder zurückgegeben werden. In der Regel erfolgt die Ausgabe oder Rücknahme von Primärmarktanteilen gegen einen vom Teilfonds an jedem Tag festgelegten Korb von Wertpapieren (und/oder Barbetrag). 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 oder verkauft, 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 über Käufe und Verkäufe am Primär- und Sekundärmarkt sind im Prospekt enthalten.

# ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

## Teilfonds und Anteilsklassen

Zum 30. Juni 2024 bestehen siebenundzwanzig Teilfonds. Einundzwanzig dieser Teilfonds bilden einen Index nach (die „indexnachbildenden Teilfonds“), und sechs der Teilfonds werden von der Anlageverwaltung aktiv gemanagt, um ein bestimmtes Anlageziel zu erreichen (die „aktiv gemanagten Teilfonds“). Franklin European Equity UCITS ETF wurde am 16. November 2023 geschlossen.

In der folgenden Tabelle sind die indexnachbildenden Teilfonds der ICAV aufgeführt.

Teilfonds	Auflegungsdatum	Funktionale Währung	Anteilsklasse	Strategie
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	06. Sep. 2022	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	27. Juni 2022	USD	USD thesaurierende Anteile	Optimiert
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	17. Okt. 2017	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	06. Sep. 2017	EUR	EUR ausschüttende Anteile	nachbildend
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	27. Sep. 2018	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	04. Juni 2019	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin FTSE China UCITS ETF	04. Juni 2019	USD	USD thesaurierende Anteile	Optimiert
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF	24. Juni 2024	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin FTSE India UCITS ETF	25. Juni 2019	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	04. Juni 2019	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	21. März 2022	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin Future of Food UCITS ETF	05. Juli 2023	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF	05. Juli 2023	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	06. Sep. 2017	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	06. Sep. 2017	USD	USD ausschüttende Anteile	nachbildend
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	14. Juni 2022	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	09. März 2023	USD	USD thesaurierende Anteile	Optimiert
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF	24. Apr. 2024	USD	USD thesaurierende Anteile	
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	29. Juli 2020	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	29. Juli 2020	EUR	EUR thesaurierende Anteile	nachbildend
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	06. Sep. 2017	USD	USD thesaurierende Anteile	nachbildend

In der folgenden Tabelle sind alle aktiv gemanagten Teilfonds der ICAV aufgeführt.

Teilfonds	Auflegungsdatum	Funktionale Währung	Anteilsklasse	Strategie
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF	31. Okt. 2023	EUR	EUR ausschüttende Anteile	Aktiv gemanagt
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	19. Juni 2018	EUR	EUR ausschüttende Anteile	Aktiv gemanagt
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	24. Apr. 2023	EUR	EUR thesaurierende Anteile	Aktiv gemanagt
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	29. Apr. 2019	EUR	EUR thesaurierende Anteile	Aktiv gemanagt
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF	31. Okt. 2023	EUR	EUR thesaurierende Anteile	Aktiv gemanagt
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF	31. Okt. 2023	EUR	EUR thesaurierende Anteile	Aktiv gemanagt
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	19. Juni 2018	USD	USD ausschüttende Anteile	Aktiv gemanagt

# ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

## Börsennotierungen

Die Teilfonds der ICAV sind zum 30. Juni 2024 an den folgenden Börsen notiert:

Teilfonds	Basiswährung	London Stock Exchange*	Deutsche Börse Xetra	Borsa Italiana	SIX Swiss Exchange	Euronext Amsterdam Stock Exchange
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	USD	09. Sep. 2022	07. Sep. 2022	09. Sep. 2022	11. Jan. 2024	-
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	1. Juli 2022	28. Juni 2022	30. Juni 2022	11. Jan. 2024	-
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	19. Okt. 2017	18. Okt. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	-
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF	EUR	02. Nov. 2023	01. Nov. 2023	16. Nov. 2023	-	-
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	27. Juni 2018	26. Juni 2018	14. Sep. 2018	26. Sep. 2018	-
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	EUR	08. Sep. 2017	07. Sep. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	-
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	USD	01. Okt. 2018	28. Sep. 2018	01. Okt. 2018	01. Okt. 2018	-
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	07. Juni 2019	05. Juni 2019	07. Juni 2019	19. Juni 2019	15. Sep. 2021
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	07. Juni 2019	05. Juni 2019	07. Juni 2019	19. Juni 2019	15. Sep. 2021
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF	USD	26. Juni 2024	25. Juni 2024	26. Juni 2024	-	-
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	28. Juni 2019	26. Juni 2019	28. Juni 2019	28. Juni 2019	15. Sep. 2021
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	07. Juni 2019	05. Juni 2019	07. Juni 2019	19. Juni 2019	15. Sep. 2021
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	23. März 2022	22. März 2022	23. März 2022	11. Jan. 2024	-
Franklin Future of Food UCITS ETF	USD	07. Juli 2023	06. Juli 2023	6. Juli 2023	11. Jan. 2024	-
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF	USD	07. Juli 2023	06. Juli 2023	6. Juli 2023	11. Jan. 2024	-
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	08. Sep. 2017	07. Sep. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	15. Sep. 2021
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	USD	08. Sep. 2017	07. Sep. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	-
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	17. Juni 2022	15. Juni 2022	21. Juni 2022	11. Jan. 2024	-
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	14. März 2023	10. März 2023	14. März 2023	11. Jan. 2024	-
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF	USD	26. Apr. 2024	25. Apr. 2024	9. Mai 2024	-	-
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	31. Juli 2020	30. Juli 2020	31. Juli 2020	16. Nov. 2020	15. Sep. 2021
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	31. Juli 2020	30. Juli 2020	31. Juli 2020	16. Nov. 2020	15. Sep. 2021
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	02. Mai 2019	30. Apr. 2019	02. Mai 2019	19. Juni 2019	15. Sep. 2021
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF	EUR	02. Nov. 2023	01. Nov. 2023	16. Nov. 2023	-	-
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF	EUR	02. Nov. 2023	01. Nov. 2023	16. Nov. 2023	-	-
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	08. Sep. 2017	07. Sep. 2017	31. Jan. 2018	26. Feb. 2018	-
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	27. Juni 2018	26. Juni 2018	14. Sep. 2018	26. Sep. 2018	-

\* zum Handel zugelassen.



# ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

## Börsennotierungen (Fortsetzung)

Jeder der indexnachbildenden Teilfonds soll die nachstehend aufgeführten Referenzindizes nachbilden.

Teilfonds	Referenzindex („Index“)
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	Solactive Global Metaverse Innovation Index
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	LibertyQ Emerging Markets Index
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	LibertyQ European Dividend Index
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	Linked FTSE Asia ex Japan ex China 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 Developed World UCITS ETF	FTSE Developed Index
Franklin FTSE India UCITS ETF	FTSE India 30/18 Capped Index
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	FTSE Korea 30/18 Capped Index
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	FTSE Taiwan 30/18 Capped Index
Franklin Future of Food UCITS ETF	Solactive Sustainable Food Index
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF	Solactive Sustainable Health and Wellness Index
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	LibertyQ Global Equity SRI Index
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	LibertyQ Global Dividend Index
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	MSCI China Paris Aligned Climate Net Total Return Index
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate Index
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF	MSCI World Catholic Principles ESG Universal and Low Carbon 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 U.S. Equity UCITS ETF	Linked Franklin US Equity Index

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, unabhängig davon, 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. Bei aktiv verwalteten Teilfonds hat der Anlageverwalter einen größeren Ermessensspielraum hinsichtlich der Zusammensetzung des Teilfondsportfolios, jeweils vorbehaltlich der im betreffenden Nachtragsprospekt angegebenen Anlageziele und der Anlagepolitik. Ein aktiv gemanagter Teilfonds strebt nicht danach, die Wertentwicklung eines Index abzubilden.

# BERICHT DER GESCHÄFTSLEITUNG FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR PER 30. JUNI 2024

Der Verwaltungsrat der ICAV legt hiermit seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 30. Februar 2024 beendete Geschäftsjahr vor. Der Jahresabschluss der ICAV wurde in Übereinstimmung mit dem Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), den irischen gesetzlichen Vorschriften einschließlich des Irish Collective Asset-Management Vehicles Act 2015 (das „ICAV-Gesetz“) und den OGAW-Vorschriften erstellt.

## Rückblick auf das Geschäft

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

Die Jahresergebnisse sind auf den Seiten 58 bis 64 aufgeführt. Ein detaillierter Überblick über die Wertentwicklung der ICAV ist im Bericht der Anlageverwaltung auf den Seiten 13 bis 44 enthalten. Die ICAV fungiert, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, weiterhin als Anlagevehikel.

Der Jahresabschluss wurde auf der Grundlage der Annahme der Unternehmensfortführung erstellt, da dem Verwaltungsrat keine Anhaltspunkte bekannt geworden sind, die darauf hindeuten, dass die Teilfonds für einen Zeitraum von mindestens 12 Monaten ab dem Datum der Genehmigung dieses Jahresabschlusses (der „Beurteilungszeitraum“) nicht weiterbestehen können. Der Jahresabschluss des Franklin European Equity UCITS ETF wurde nicht auf der Grundlage der Unternehmensfortführung erstellt, da dieser Teilfonds seine Geschäftstätigkeit am 16. November 2023 eingestellt hat.

## Grundsätze der Unternehmensführung

### Entsprechenserklärung zu den Grundsätzen der Unternehmensführung

Die ICAV hat die Bestimmungen des Irish Funds Industry Association Corporate Governance Code for Collective Investment Management Schemes and Management Companies („der Kodex“) übernommen und angewandt, dessen Wortlaut auf der Website von Irish Funds verfügbar ist: [www.irishfunds.ie](http://www.irishfunds.ie). Die ICAV hat den Kodex für das am 30. Juni 2024 endende Jahr vollständig erfüllt.

### Erklärung zu den Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Jahresberichts und des Jahresabschlusses der Teilfonds der ICAV in Übereinstimmung mit den geltenden Gesetzen und Vorschriften verantwortlich.

Nach dem ICAV-Gesetz ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jeden Veranlagungszeitraum einen Abschluss zu erstellen. Gemäß diesem Gesetz hat der Verwaltungsrat den Jahresabschluss gemäß dem für das Vereinigte Königreich und die Republik Irland maßgeblichen Rechnungslegungsstandard FRS 102 erstellt.

Der Jahresabschluss muss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Teilfonds der ICAV zum Jahresende sowie des Ergebnisses der Teilfonds der ICAV für das betreffende Jahr vermitteln. Nach irischem Recht darf der Verwaltungsrat den Jahresabschluss nur genehmigen, wenn er davon überzeugt ist, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der ICAV zum Jahresende und des Ergebnisses der ICAV für das betreffende Jahr vermittelt. Bei der Erstellung dieses Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

- geeignete Rechnungslegungsvorschriften auswählen und diese dann konsequent anwenden,
- angemessene und umsichtige Beurteilungen und Schätzungen vornehmen,
- angeben ob, vorbehaltlich wesentlicher Abweichungen, die im Jahresabschluss offengelegt und erläutert werden, die anwendbaren Rechnungslegungsstandards befolgt wurden, und
- den Jahresabschluss auf der Grundlage der Annahme der Unternehmensfortführung erstellen, es sei denn, die Annahme, dass der Teilfonds seine Geschäfte fortführt, ist nicht aufrechtzuerhalten.

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

- die Transaktionen der ICAV korrekt aufzuzeichnen und erläutern,
- jederzeit mit angemessener Genauigkeit die Vermögens-, Finanz- und Ertragslage und das Ergebnis der Teilfonds der ICAV offenzulegen, und
- sicherzustellen, dass der Verwaltungsrat die Einhaltung des ICAV-Gesetzes und der OGAW-Verordnung gewährleisten und eine Prüfung dieses Jahresabschlusses ermöglichen kann.

# BERICHT DER GESCHÄFTSLEITUNG FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR PER 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Erklärung zu den Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Zu diesem Zweck haben die Verwaltungsratsmitglieder Franklin Templeton International Services S.à r.l. (die „Verwaltungsgesellschaft“) ernannt, die die Verantwortung für die Führung der Buchhaltungsunterlagen der Teilfonds und die Erfüllung zusätzlicher Verwaltungsaufgaben an den Verwalter, State Street Fund Services (Ireland) Limited (der „Verwalter“), delegiert hat. Die Buchhaltungsunterlagen werden von State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin, Irland, geführt. Die Verwaltungsratsmitglieder tragen die allgemeine Verantwortung für die Ergreifung von Maßnahmen, die ihnen nach vernünftigem Ermessen möglich sind, um das Vermögen der Teilfonds der ICAV zu schützen. Zu diesem Zweck haben sie die Vermögenswerte der Teilfonds der Verwahrstelle zur Verwahrung anvertraut. Die Verwaltungsratsmitglieder sind generell dafür verantwortlich, alle ihnen zumutbaren Maßnahmen zu ergreifen, um Betrug und andere Unregelmäßigkeiten zu verhindern und aufzudecken. Die Verwaltungsratsmitglieder sind auch für die Erstellung eines Berichts der Geschäftsleitung verantwortlich, der den Anforderungen des ICAV-Gesetzes entspricht.

Die Jahresabschlüsse werden auf der Website [www.franklintempleton.com](http://www.franklintempleton.com) veröffentlicht. Der Verwaltungsrat ist zusammen mit dem Manager für die Pflege und Integrität der auf dieser Website enthaltenen Finanzinformationen verantwortlich. Die für die Erstellung und Veröffentlichung von Abschlüssen geltenden Rechtsvorschriften in Irland können von den Rechtsvorschriften anderer Länder abweichen.

## Ausschüttungen

Die für das am 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 endende Jahr erklärten Ausschüttungen sind in Anhang 12 des Jahresabschlusses aufgeführt.

## Finanzinstrumente

Einzelheiten über die Verwendung von Finanzinstrumenten durch die ICAV, einschließlich übertragbarer Wertpapiere und derivativer Finanzinstrumente, sind in den Anhangziffern 1, 6 und 11 zum Jahresabschluss aufgeführt. Eine vollständige Liste der von den Teilfonds zum Jahresende gehaltenen übertragbaren Wertpapiere und derivativen Finanzinstrumente ist in der Anlagenübersicht des jeweiligen Teilfonds aufgeführt.

## Risikomanagement – Ziele und Richtlinien

Nähere Angaben zu den Risikomanagementzielen und Richtlinien der ICAV und dem Marktrisiko, Ausfallrisiko, Kontrahenten- und Liquiditätsrisiko der Teilfonds zum Jahresende sind im Anhang 6 zum Jahresabschluss aufgeführt.

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

## Wichtige Leistungskennzahlen

Der Verwaltungsrat schätzt die Veränderung des Nettoinventarwerts („NIW“) je Anteil als wichtige Kennzahl für die Wertentwicklung der ICAV ein. Zu den wichtigsten vom Verwaltungsrat für jeden Teilfonds überwachten Leistungskennzahlen gehören die monatlichen Veränderungen des NIV je Anteil, der Vergleich der Wertentwicklung jedes Teilfonds mit der Wertentwicklung des maßgeblichen Index und die Veränderungen des gezeichneten Kapitals.

## Transaktionen mit nahestehenden Personen

Regulation 41(1) der Central Bank UCITS Regulations sieht vor, dass „eine verantwortliche Person sicherzustellen hat, dass alle Geschäfte zwischen einem OGAW und einer verbundenen Person (a) zu üblichen Marktbedingungen und (b) im besten Interesse der Anteilinhaber des OGAW durchgeführt werden“.

Gemäß den Anforderungen von Regulation 81(4) der Central Bank UCITS Regulations haben sich die Verwaltungsratsmitglieder davon überzeugt, dass durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, die sicherstellen, dass die durch Regulation 41(1) vorgeschriebenen Pflichten auf alle Geschäfte mit verbundenen Personen angewendet werden, und dass alle Geschäfte mit verbundenen Personen, die während des Jahres abgeschlossen wurden, auf das sich der Bericht bezieht, den durch Regulation 41(1) vorgeschriebenen Pflichten entsprechen.

Die Verwaltungsratsmitglieder haben sich davon überzeugt, dass (i) Vorkehrungen getroffen wurden, die durch schriftliche Verfahren belegt sind, um sicherzustellen, dass die in Ziffer 43(1) der Central Bank UCITS Regulations vorgeschriebenen Pflichten auf alle Geschäfte mit verbundenen Parteien (laut Definition in Regulation 42 der Central Bank UCITS Regulations) angewendet werden, und (ii) alle Geschäfte mit verbundenen Parteien, die während des Zeitraums abgeschlossen wurden, auf den sich der Bericht bezieht, den durch Regulation 43(1) der Central Bank UCITS Regulations vorgeschriebenen Pflichten entsprechen.

## Geschäfte mit verbundenen Parteien

Alle Transaktionen mit verbundenen Parteien während des Jahres sind in Anhang 10 des Jahresabschlusses aufgeführt.

# BERICHT DER GESCHÄFTSLEITUNG FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Getrennte Haftung

Die ICAV ist ein Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds; daher bleiben die Vermögenswerte eines Teilfonds nach irischem Recht von der Haftung anderer Teilfonds der ICAV unberührt.

Die getrennte Haftung stellt sicher, dass Verbindlichkeiten eines Teilfonds nur aus den Vermögenswerten dieses Teilfonds bedient werden und dass zur Befriedigung dieser Verbindlichkeiten generell keine Rückgriffsmöglichkeit auf andere Teilfonds besteht.

Jeder Teilfonds trägt ungeachtet seiner Rentabilität seine eigenen Gebühren und Kosten. Ungeachtet des Vorstehenden kann nicht garantiert werden, dass die getrennte Haftung der Teilfonds im Fall einer Klage gegen die ICAV vor einem Gericht eines anderen Landes Bestand hat.

## Mitarbeiter

Die ICAV hatte in dem am 30. Juni 2024 und dem am 30. Juni 2023 endenden Jahr keine Mitarbeiter.

## Diversität

Die Ernennung von Verwaltungsratsmitgliedern erfolgt aufgrund ihrer Verdienste und unter gebührender Berücksichtigung der Anforderungen der irischen Zentralbank und des Kodex der Irish Funds Industry Association in Bezug auf u. a. die Zusammensetzung, Unabhängigkeit, Sachkenntnis, Erfahrung, Eignung und Redlichkeit des Verwaltungsrats. Bei künftigen Ernennungen verfolgt der Verwaltungsrat die Strategie, bei der Auswahl und Ernennung die Vorteile der Vielfalt (einschließlich Alter, Geschlecht, Ausbildung und beruflicher Hintergrund) zu berücksichtigen. Der Verwaltungsrat ist jedoch nach wie vor bestrebt, Kandidaten mit den am besten geeigneten Fähigkeiten und Erfahrungen zu ernennen, wobei die Vielfalt zwar berücksichtigt, aber nicht in den Vordergrund gestellt wird. Daher wurden keine formellen Ziele oder Vorgaben für die Vielfalt festgelegt, über die zu berichten wäre.

## Wichtige Ereignisse im Jahresverlauf

Einzelheiten zu wichtigen, die ICAV betreffenden Ereignissen im Jahresverlauf siehe Anhang 15 zum Jahresabschluss.

## Wichtige Ereignisse seit Jahresende

Einzelheiten zu wichtigen, die ICAV betreffenden Ereignissen seit Jahresende siehe Anhang 16 zum Jahresabschluss.

## Verwaltungsratsmitglieder

Name und Nationalität der Personen, die während des am 30. Juni 2024 zu Ende gehenden Jahres Verwaltungsratsmitglieder waren, sind nachstehend aufgeführt:

Joseph Carrier (USA)  
Fionnuala Doris (Irland)\*  
Joseph Keane (Irland)\*  
Joseph Larocque (USA) (Vorsitzender)  
Jaspal Sagger (UK)  
Jane Trust (USA) (zurückgetreten am 21. Februar 2024)  
Craig Tyle (USA) (ernannt am 27. Juli 2023)  
William Jackson (UK) (zurückgetreten am 17. Juli 2023)

\* Unabhängige Verwaltungsratsmitglieder.

## Secretary

Das Amt des Secretary hatte bis 1. April 2024 Matsack Trust inne, an diesem Datum wurde es von OGS Corporate Governance Limited übernommen.

## Beteiligung der Verwaltungsratsmitglieder und des ICAV Secretary an Anteilen und Verträgen

Weder die Verwaltungsratsmitglieder noch der Company Secretary hatten während des Jahres oder zum Jahresende eine wesentliche wirtschaftliche oder nichtwirtschaftliche Beteiligung am Grundkapital der ICAV oder eine Vereinbarung oder Regelung mit der ICAV.

## Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Die im Laufe des Jahres verdienten und zum Jahresende zahlbaren Verwaltungsrats honorare sind in Anhang 5 des Jahresabschlusses aufgeführt.

# BERICHT DER GESCHÄFTSLEITUNG FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR PER 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Politische Spenden

Die ICAV hat weder im laufenden Jahr noch im Vorjahr politische Spenden getätigt.

## Relevante Prüfungsinformationen

Die Verwaltungsratsmitglieder sind der Ansicht, dass sie alle notwendigen Schritte unternommen haben, um sich über alle relevanten Prüfungsinformationen zu informieren, und dass sie sich vergewissert haben, dass die gesetzlichen Abschlussprüfer der ICAV von diesen Informationen Kenntnis haben. Soweit ihnen bekannt ist, gibt es keine relevanten Prüfungsinformationen, die den Abschlussprüfern des ICAV nicht bekannt sind.

## Unabhängige Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers, Chartered Accountants, wurden am 13. Juni 2017 als unabhängige Abschlussprüfer der ICAV ernannt und haben ihre Bereitschaft erklärt, ihr Amt gemäß § 125 des ICAV-Gesetzes von 2015 weiterzuführen.

## Für den Verwaltungsrat

**Joseph Keane**  
Verwaltungsratsmitglied

**Fionnuala Doris**  
Verwaltungsratsmitglied

---

Datum: 18. Oktober 2024

## Wirtschafts- und Marktüberblick für den Bericht der Anlageverwaltung

### Berichtszeitraum zwölf Monate zum 30. Juni 2024

Im zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 verzeichneten globale Aktien deutliche Kursgewinne. Nach der Volatilität von August bis Oktober 2023 tendierten Aktien in den übrigen Monaten des Geschäftsjahres weltweit nach oben. Ausschlaggebend dafür waren die Begeisterung für künstliche Intelligenz (KI), die sich allgemein verbessernden Wirtschaftsaussichten, der mögliche Beginn von Zinssenkungen in Europa im Juni und die Hoffnung auf Zinssenkungen in den Vereinigten Staaten und im Vereinigten Königreich in der zweiten Jahreshälfte 2024. Die Anleger waren jedoch weiterhin besorgt über den anhaltenden Krieg zwischen Russland und der Ukraine, den Ausbruch des Kriegs zwischen Israel und der Hamas und verschiedene politische Entwicklungen in Europa während des Superwahljahres 2024. Gemessen an den MSCI-Indizes in US-Dollar (USD) entwickelten sich Aktien aus Industrieländern aufgrund der starken Performance von US-Werten besser als der globale Index, während Aktien aus Schwellenländern und Grenzmärkten deutlich schlechter abschnitten. In einer Gegenüberstellung der Anlagestile schnitten globale Wachstumswerte deutlich besser ab als globale Substanzaktien.

An den europäischen Anleihemärkten außerhalb der Eurozone waren die Renditen von Staatsanleihen im Berichtszeitraum sowohl in den Industrieländern als auch in den Schwellenländern generell höher. Die Rendite der 10-jährigen US-Staatsanleihe stieg im Berichtszeitraum um 56 Basispunkte (Bp) auf 4,40 %, da wirtschaftliche Entwicklungen in den Vereinigten Staaten die Erwartungen der Anleger auf Zinssenkungen dämpften. In der Eurozone war der Anstieg verhaltener – die Rendite der 10-jährigen deutschen Bundesanleihe stieg um 11 Bp auf 2,50 %. Außerhalb der Eurozone sanken die Staatsanleiherenditen in den europäischen Industrie- und Schwellenländern generell. Die Renditen von Staatsanleihen der asiatischen und lateinamerikanischen Schwellenländer waren im Berichtszeitraum überwiegend höher. In Japan stieg die Rendite der 10-jährigen Staatsanleihe im Berichtszeitraum aufgrund der Lockerung und der anschließenden Abschaffung der Renditekurvensteuerung das erste Mal seit 2012 auf über 1 %. Im Berichtszeitraum kletterte sie um 66 Bp auf 1,05 %.

US-Aktien entwickelten sich in dem zwölfmonatigen Berichtszeitraum in USD besser als Aktien aus Industrie- und Schwellenländern sowie Grenzmärkten. Nach den volatilen Monaten August bis Oktober 2023 erreichten die großen US-Indizes im weiteren Verlauf des Zeitraums immer wieder neue Höchststände, was auf die Begeisterung für künstliche Intelligenz, über den Erwartungen liegende Gewinnmeldungen und die Hoffnung auf Zinssenkungen in der zweiten Jahreshälfte 2024 zurückzuführen war. Nachdem die US-Notenbank (Fed) den Leitzins im Juli 2023 auf den höchsten Stand seit mehr als zwei Jahrzehnten angehoben hatte, legte sie für die übrige Zeit des Berichtszeitraums eine Pause ein, da sie auf weitere Daten wartete, die ihr mehr Vertrauen geben würden, dass sich die Inflation auf ihr langfristiges Ziel von 2,0 % zubewegt. Die jährliche Inflationsrate, gemessen am PCE-Preisindex für persönliche Konsumausgaben, dem von der US-Notenbank bevorzugten Inflationsmaßstab, stieg im Mai so langsam wie seit März 2021 nicht mehr, verharrte aber über dem Zielwert der Fed. Der US-Arbeitsmarkt kühlte sich im Berichtszeitraum ab, blieb aber widerstandsfähig. Unterdessen wuchs das Bruttoinlandsprodukt (BIP) im ersten Quartal 2024 mit einer deutlich geringeren Jahresrate als in den beiden vorangegangenen Quartalen. Das verarbeitende Gewerbe schrumpfte während des gesamten Zeitraums, abgesehen von einem leichten Anstieg im März 2024, während das Dienstleistungsgewerbe fast den ganzen Zeitraum über anstieg, mit Ausnahme von Rückgängen im April und Juni. Europäische Aktien legten in dem Zwölfmonatszeitraum zu, begünstigt durch das allgemein robuste Wirtschaftswachstum, die Zinssenkung der Europäischen Zentralbank (EZB) im Juni und den Optimismus der Anleger, dass die Bank of England (BoE) im August nachziehen könnte. Trotz der erhöhten Volatilität gegen Ende des Berichtszeitraums aufgrund der Ankündigung von vorgezogenen Neuwahlen in Frankreich und im Vereinigten Königreich beendeten alle Aktienmärkte in den Industrie- und Schwellenländern der Region den Berichtszeitraum mit Kursgewinnen (jeweils in USD). Aus wirtschaftlicher Perspektive ist das BIP der Eurozone im ersten Quartal 2024 mäßig gewachsen, nachdem es im Vorquartal geschrumpft war. Die Fertigungstätigkeit im Währungsblock ging im Juni den 24. Monat in Folge zurück, während die Aktivität im Dienstleistungsgewerbe den fünften Monat in Folge expandierte. Die EZB senkte ihren Hauptrefinanzierungssatz auf ihrer Juni-Sitzung, nachdem sie ihn neun Monate auf dem höchsten Stand seit zwei Jahrzehnten gehalten hatte. Im Vereinigten Königreich wuchs das BIP im ersten Quartal schrittweise, nachdem es zwei Quartale in Folge geschrumpft war. Dies deutet darauf hin, dass das Land eine technische Rezession hinter sich gelassen hat. Nach einem Rückgang im April kehrte das verarbeitende Gewerbe des Vereinigten Königreichs im Mai wieder auf den Wachstumspfad zurück und setzte sein Wachstum im Juni fort. Der Dienstleistungssektor legte im Juni den achten Monat in Folge zu. Nachdem die BoE ihren Leitzins im August 2023 angehoben hatte, ließ sie ihn für die übrige Zeit des Berichtszeitraums unverändert und hielt ihn auf dem höchsten Stand seit mehr als 16 Jahren.

Gestützt von Unternehmensreformen und ein Konjunkturpaket, das einige vorübergehende Steuersenkungen, Unterstützungszahlungen und Subventionen zur Stimulierung des Wirtschaftswachstums enthielt, stiegen japanische Aktien in diesem Zwölfmonatszeitraum an. Im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums ging der Yen jedoch auf das niedrigste Niveau gegenüber dem USD seit 1986 zurück; dies setzte die Aktien unter Druck und belastete die Verbraucherstimmung. Einer ersten Schätzung zufolge stagnierte das japanische BIP im vierten Quartal 2023 und ging im ersten Quartal 2024 zurück. Das verarbeitende Gewerbe verzeichnete im Mai wieder ein Wachstum (nachdem es 11 Monate in Folge geschrumpft war), stagnierte jedoch im Juni. Gleichzeitig schrumpfte der Dienstleistungssektor des Landes im Juni, nachdem er 21 Monate in Folge gewachsen war. Im Anschluss an frühere Lockerungsmaßnahmen beendete die Bank of Japan bei ihrer Sitzung im März 2024 ihre Zinskurvenkontrolle und hob den Leitzins auf ein noch immer lockeres Niveau an. Später ließ die BoJ ihren Leitzins auf ihren Sitzungen im April und Juni unverändert.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

Die Aktien der Schwellenländer stiegen im Zwölfmonatszeitraum insgesamt an, blieben jedoch deutlich hinter den Aktien der Industrieländer zurück, während sie die Aktien der Frontier-Märkte leicht übertrafen (alle in USD). Nach einem Rückgang in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums legten chinesische Aktien zu und beendeten den Zwölfmonatszeitraum im Plus, da die Regierung Maßnahmen zur Unterstützung des Immobiliensektors ergriff und die Wirtschaft des Landes Anzeichen einer Verbesserung zeigte, wobei das BIP im ersten Quartal 2024 schneller stieg als in den drei vorangegangenen Quartalen. Die Fertigungstätigkeit in China ging im Juni den zweiten Monat in Folge zurück, während die Aktivität in den anderen Branchen den 18. Monat in Folge expandierte. Die People's Bank of China senkte die einjährige Loan Prime Rate (LPR; wird für Unternehmens- und Haushaltskredite verwendet) im August 2023 auf ein Rekordtief und die fünfjährige LPR (wird als Referenz für Hypotheken verwendet) im Februar 2024 auf ein Rekordtief und ließ beide während des restlichen Zeitraums unverändert. Die Zentralbanken der Schwellenländer, die die Zinssätze frühzeitig angehoben hatten, konnten auch im Abwärtszyklus als erste Zinssenkungen vornehmen. Eine Reihe lateinamerikanischer Zentralbanken begann in der zweiten Jahreshälfte 2023 mit Zinssenkungen, ebenso einige osteuropäische Zentralbanken.

## Überblick über die Wertentwicklung

Die nachstehende Tabelle enthält Einzelheiten zur Wertentwicklung der indexnachbildenden Teilfonds.

Teilfonds*	Basiswährung des Teilfonds	Rendite des Teilfonds auf Basis des Nettoinventarwerts für das am 30. Juni 2024 endende Jahr -1 Jahresrendite	Benchmark-Rendite für das am 30. Juni 2024 endende Jahr -1 Jahresrendite
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	USD	29,25%	29,55%
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	4,65%	4,72%
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	14,73%	15,60%
Franklin European Equity UCITS ETF	EUR	-	-
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	EUR	16,22%	15,83%
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	USD	19,48%	21,61%
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	-7,30%	-6,54%
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	-2,71%	-2,68%
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF**	USD	0,16%	0,12%
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	33,84%	38,94%
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	9,78%	9,80%
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	34,36%	34,75%
Franklin Future of Food UCITS ETF**	USD	-4,50%	-4,41%
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF**	USD	6,15%	6,26%
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	9,40%	9,39%
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	USD	16,20%	16,07%
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	-14,31%	-14,11%
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	7,45%	8,37%
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF**	USD	6,20%	6,17%
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	26,78%	26,62%
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	12,12%	12,04%
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	15,50%	15,40%

Die nachstehende Tabelle enthält Einzelheiten zur Wertentwicklung der aktiv verwalteten Teilfonds.

Teilfonds*	Basiswährung des Teilfonds	Rendite des Teilfonds auf Basis des Nettoinventarwerts für das am 30. Juni 2024 endende Jahr -1 Jahresrendite	Benchmark-Rendite für das am 30. Juni 2024 endende Jahr -1 Jahresrendite
	EUR	5,80%	5,66%
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	4,39%	3,71%
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	4,91%	4,00%
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF**	EUR	4,64%	4,80%

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

Teilfonds*	Basiswahrung des Teilfonds	Rendite des Teilfonds auf Basis des Nettoinventarwerts fur das am 30. Juni 2024 endende Jahr -1 Jahresrendite	Benchmark-Rendite fur das am 30. Juni 2024 endende Jahr -1 Jahresrendite
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF**	EUR	6,12%	5,67%
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	4,25%	4,63%

\* Die Wertentwicklung des Teilfonds wird einschlielich der Gesamtkostenquote (TER) nach Abzug von Gebuhren und Kosten berechnet und berucksichtigt die bei der Ausgabe und Rucknahme von Aktien anfallenden Provisionen und Kosten nicht. Die Wertentwicklung beruht auf dem Nettoinventarwert (NIW) des ETF, der gegebenenfalls vom jeweiligen Marktkurs abweichen kann. Der Nettoinventarwert enthalt gegebenenfalls eine Ruckstellung fur die Kapitalertragssteuer auf Portfoliobestande, die Benchmark enthalt keine derartige Ruckstellung. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie fur zukunftige Ergebnisse.

\*\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

## Tracking Error

Die Teilfonds des Franklin Templeton ICAV, die passiv gemanagt werden, sollen die Wertentwicklung ihres jeweiligen systematischen, regelbasierten, proprietaren Index wie im Verkaufsprospekt beschrieben so genau wie moglich nachbilden. Das Instrument, mit dem die Erreichung dieses Ziels ublicherweise gemessen wird, ist der realisierte Tracking Error.

Der realisierte Tracking Error ist die Standardabweichung der erzielten uberschussrendite uber einen Jahreszeitraum. Er ist ein Ma fur die Bestandigkeit der Renditen im Vergleich zum Referenzindex uber einen bestimmten Zeitraum.

Der realisierte Tracking Error kann von mehreren Faktoren beeinflusst werden, unter anderem von der Gesamtkostenquote („TER“) des Teilfonds, dem Zeitpunkt der Transaktionen bei der Neugewichtung des Index, den Techniken fur ein effizientes Portfoliomanagement, die beim Versuch der Nachbildung der Benchmark-Renditen eingesetzt werden, und dem Steuersatz, der auf die vom Teilfonds erhaltenen Dividenden oder Zinsen angewandt wird, im Gegensatz zu dem Steuersatz, der bei der Berechnung der Gesamrendite der Benchmark angenommen wird.



# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

In der nachstehenden Tabelle wird der erwartete Tracking Error der Teilfonds (wie im Prospekt auf Ex-ante-Basis angegeben) mit dem tatsächlich realisierten Tracking Error der Teilfonds zum 30. Juni 2024 verglichen:

Teilfonds	Erwarteter Tracking Error	Annualisierter realisierter Tracking Error
Franklin AI, Metaverse und Blockchain UCITS ETF*	1,00%	0,03%
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*	1,00%	0,27%
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	0,80%	0,38%
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	0,80%	0,22%
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	0,80%	0,46%
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	2,00%	1,18%
Franklin FTSE China UCITS ETF	0,80%	0,15%
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF**	1,00%	#k. A.
Franklin FTSE India UCITS ETF	1,00%	1,66%
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	0,50%	0,25%
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	1,00%	0,87%
Franklin Future of Food UCITS ETF**	1,00%	0,05%
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF**	1,00%	0,02%
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	0,50%	0,11%
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	0,50%	0,17%
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*	1,00%	0,05%
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF*	1,00%	0,17%
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF**	1,00%	0,00%
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	0,20%	0,05%
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	0,50%	0,14%
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	0,50%	0,30%

\* Der realisierte Tracking Error wird in der Regel aus den Renditen von 36 Monaten berechnet. Die Renditeentwicklung des Teilfonds ist zu kurz, um einen statistisch signifikanten Tracking Error zu ermitteln.

\*\* Der Teilfonds wurden nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Im Berichtszeitraum erzielten die Teilfonds und ihre jeweiligen Referenzindizes die im Bericht der Anlageverwaltung angegebene Wertentwicklung. Die Über- bzw. Unterperformance eines Teilfonds im Vergleich zu seinem jeweiligen Referenzindex ist in erster Linie auf die Unterschiede im Timing der Transaktionen bei der Neugewichtung des Index, auf die vom Teilfonds getragene Gesamtkostenquote („TER“) und auf den Steuersatz zurückzuführen, der auf die vom Teilfonds erhaltenen Dividenden oder Zinsen im Gegensatz zu dem bei der Berechnung der Gesamterrendite der Benchmark angenommenen Steuersatz angewendet wird. Der größere Tracking Error und die Unterperformance des Franklin FTSE India UCITS ETF gegenüber dem Index sind auf die Auswirkungen der Besteuerung von Kapitalgewinnen in diesem Markt zurückzuführen. Der Franklin FTSE Developed World UCITS ETF wurde am 24. Juni 2024 aufgelegt, so dass der Verlauf nicht ausreicht, um den Tracking Error zu berechnen.

Franklin Advisers, Inc.  
 Franklin Templeton Institutional, LLC  
 Franklin Templeton Investment Management Limited  
 Franklin Advisory Services LLC  
 17. Oktober 2024

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

## Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Informationstechnologie, Finanzdienstleistungen und Kommunikationsdienste am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten NVIDIA, Coinbase Global und MicroStrategy.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren zyklische Konsumgüter, Immobilien und das Gesundheitswesen. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Beyond, Unity Software und EXP World.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds strebt ein Aktienengagement in börsennotierten Unternehmen auf der ganzen Welt an, die im Metaverse tätig sind. Der Fonds zielt darauf ab, die Entwicklung des Solactive Global Metaverse Innovation Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob er steigt oder fällt. Der Teilfonds zielt darauf ab, den zugrundeliegenden Index nachzubilden, indem er alle seine Wertpapiere in einem Verhältnis hält, das ihren Gewichtungen im Index entspricht. Die Bestände des zugrundeliegenden Index umfassen globale Aktienwerte, die von Unternehmen emittiert werden, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie in erheblichem Maße an der Bereitstellung von Produkten und/oder Dienstleistungen beteiligt sind, die zum Metaverse beitragen, oder bei denen dies zu erwarten ist.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
NVIDIA Corp.	4,81
Apple, Inc.	4,42
Meta Platforms, Inc.	4,34
Alphabet, Inc.	4,26
Microsoft Corp.	4,24
Adobe, Inc.	4,14
CrowdStrike Holdings, Inc.	4,13
Intel Corp.	3,99
Accenture PLC	3,86
International Business Machines Corp.	3,80

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Technologie	68,05
Kommunikation	15,12
Finanzen	8,46
Nichtzyklische Konsumgüter	4,79
Industrie	3,12
Zyklische Konsumgüter	0,39

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
USA	77,57
Cayman-Inseln	8,17
Irland	3,86
Niederlande	2,21
Japan	1,61
Luxemburg	1,53
Südkorea	1,31
Taiwan	1,24
Kanada	0,88
Australien	0,83
Sonstige	0,72

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trug die lokale Marktallokation des Teilfonds durch eine Übergewichtung des sich überdurchschnittlich entwickelnden Markts im Euroraum und eine Untergewichtung im sich unterdurchschnittlich entwickelnden US-Markt zur relativen Performance bei. Die Durations- und Renditekurvenpositionierung in US-Anleihen verbesserte ebenfalls die relativen Ergebnisse.

Die Sektorallokation und die Titelauswahl des Teilfonds, vor allem die Positionierung in auf Euro lautenden chilenischen Anleihen und auf US-Dollar lautenden israelischen Schuldtiteln, beeinträchtigten die relativen Renditen. Das fehlende Engagement in auf Euro lautenden israelischen Anleihen führte jedoch zu einer relativen Wertsteigerung, ebenso wie die Auswahl in auf US-Dollar lautenden ungarischen, peruanischen und kolumbianischen Anleihen. Die Währungspositionierung, vor allem Positionen in Euro und US-Dollar, wirkte sich negativ auf die relative Wertentwicklung des Teilfonds aus.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds soll ein Engagement in auf Euro und US-Dollar lautenden Staatsanleihen von Schwellenländern bieten. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob er steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Das Engagement in jedem Land ist auf 10 % des zugrundeliegenden Index begrenzt und wird aus dem dem ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index (Anlageuniversum) ausgewählt, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapierebene zu minimieren.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Internationale Staatsanleihen Brasilien 2,88 %	4,75
Internationale Staatsanleihen Kolumbien 7,38 %	4,37
Internationale Staatsanleihen Rumänien 4,63 %	4,31
Internationale Staatsanleihen Rumänien 5,25 %	4,08
Internationale Staatsanleihen Republik Südafrika 5,88 %	3,72

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Internationale Staatsanleihen Chile 0,56 %	3,67
Internationale Staatsanleihen Peru 2,78 %	3,53
Internationale Staatsanleihen Israel 2,75 %	3,30
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 1,13%	3,21

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Staatsanleihen	94,80

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Rumänien	10,73
Chile	9,30
Philippinen	8,31
Brasilien	7,70
Polen	7,33
Kolumbien	5,77
Dominikanische Republik	5,34
Peru	5,33
Israel	5,12
Südafrika	4,83
Sonstige	25,04

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Finanzwerte, Informationstechnologie und Energie am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Fonds steigerten, gehörten MediaTek, Coal India und KB Financial.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren Kommunikationsdienste, Basiskonsumgüter und das Gesundheitswesen. Einzelpositionen die die absolute Rendite des Fonds beeinträchtigten, waren Sociedad Quimica y Minera de Chile, Ambev und PT Astra International.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Schwellenländern weltweit. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des Emerging Markets Equity Index (der zugrundeliegende Index) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds zielt darauf ab, den zugrundeliegenden Index nachzubilden, indem er alle seine Wertpapiere in einem Verhältnis hält, das ihren Gewichtungen im Index entspricht. Das Portfolio des zugrundeliegenden Index umfasst das obere Quartil der Aktien aus dem MSCI Emerging Markets Index (Anlageuniversum). Hierbei wird ein transparenter, auf mehreren Faktoren aufgebauter Auswahlprozess angewandt, der vier Anlagestile (Qualität, Wertpotenzial, Dynamik und geringe Volatilität) einbezieht.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
MediaTek, Inc.	1,21
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	1,17
Kia Corp.	1,15
ASE Technology Holding Co. Ltd.	1,12
Quanta Computer, Inc.	1,12
Infosys Ltd.	1,12
HCL Technologies Ltd.	1,11
United Microelectronics Corp.	1,06
Nestle India Ltd.	1,05

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	22,51
Nichtzyklische Konsumgüter	15,58
Energie	14,64
Technologie	12,93
Zyklische Konsumgüter	10,34
Grundstoffe	6,91
Kommunikation	6,72
Industrie	6,45
Versorgungsunternehmen	3,42

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
China	22,27
Indien	15,60
Taiwan	11,35
Südkorea	9,10
Brasilien	7,12
Saudi-Arabien	4,79
Türkei	4,43
Südafrika	3,06
Mexiko	2,85
Indonesien	2,54
Sonstige	16,39

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

## Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF

Im Zeitraum seit der Auflegung (31. Oktober 2023 bis 30. Juni 2024) trugen die Wertpapierauswahl und die Sektorallokation des Teilfonds, vor allem die Positionierung in Investment-Grade-Unternehmensanleihen aus dem Finanz- und Industriesektor, zur relativen Performance bei. Die Duration und die Renditekurvenpositionierung in Anleihen der Eurozone sowie das Engagement in Zinsderivaten wirkten sich jedoch negativ auf die relativen Ergebnisse aus.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds zielt darauf ab, Erträge am Markt für europäische Unternehmensanleihen zu erzielen und gleichzeitig das Kapital zu erhalten. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er vornehmlich in auf Euro lautende Schuldtitel von Unternehmen mit Investment-Grade-Rating investiert.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Commerzbank AG 5,13 %	1,71
Ceska sporitelna AS 5,74 %	1,70
Leasys SpA 4,50 %	1,66
Ibercaja Banco SA 4,38 %	1,66
Barry Callebaut Services NV 4,00 %	1,65
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 3,25 %	1,64
Netflix, Inc. 3,63 %	1,64
Engie SA 3,88 %	1,63
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3,50 %	1,63

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	49,34
Nichtzyklische Konsumgüter	16,78
Versorgungsunternehmen	9,55
Kommunikation	6,34
Zyklische Konsumgüter	5,56
Industrie	4,63
Grundstoffe	2,44
Technologie	1,68
Energie	0,74

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Frankreich	20,82
Niederlande	16,08
USA	11,56
Vereinigtes Königreich	7,79
Spanien	6,46
Luxemburg	5,52
Deutschland	4,78
Belgien	4,17
Schweden	3,30
Dänemark	3,16
Sonstige	13,42

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektorallokation und die Titelauswahl des Teilfonds, vor allem Positionen in Investment-Grade-Finanztitel von Unternehmen aus der Eurozone, zur relativen Performance bei.

Die entsprechenden Industrietitel belasteten hingegen den relativen Wert. Die Währungspositionierung des Teilfonds, vor allem das Engagement im Euro, verbesserte ebenfalls die relativen Ergebnisse. Die Duration und die Renditekurvenpositionierung in Anleihen der Eurozone steigerten die relative Rendite des Fonds zusätzlich.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds soll laufende Erträge erzielen und gleichzeitig die Gesamterträge am Markt für auf Euro lautende kurzfristige festverzinsliche Wertpapiere maximieren.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in:

- kurzfristige fest- und variabel verzinsliche auf Euro lautende Schuldtitel mit Investment Grade von staatlichen und privaten Emittenten einschließlich nichteuropäischer Emittenten

Der Teilfonds kann in geringerem Umfang investieren in:

- Schuldtitel von niedrigerer Qualität wie z. B. Wertpapiere ohne Investment Grade oder notleidende Wertpapiere (begrenzt auf 20 % des Teilfondsvermögens)
- Derivate zur Absicherung, für ein effizientes Portfoliomanagement und/oder zu Anlagezwecken

Der Teilfonds verfolgt eine aktiv verwaltete Anlagestrategie. Daher hält der Teilfonds ein Portfolio mit aktiv ausgewählten und verwalteten Anlagen, statt die Entwicklung eines Referenzindex nachzubilden. Jeglicher erwähnte Referenzindex ist ein Bezugspunkt für die Messung der Wertentwicklung des Teilfonds. Die Wertpapiere, in die der Teilfonds investiert, werden gemäß den in den OGAW-Vorschriften vorgegebenen Grenzen vornehmlich an anerkannten Märkten weltweit notiert oder gehandelt.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Schatzanleihen Österreich -	14,44
Internationale Staatsanleihen Dänemark 2,50 %	9,60
Bundesobligation -	9,11
Europäische Union -	7,85
Schatzanleihen Königreich Belgien -	7,78

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Instituto de Credito Oficial 1,30 %	2,13
Mercedes-Benz International Finance BV 4,11 %	1,33
Kreditanstalt für Wiederaufbau 0,25 %	1,19
NatWest Markets PLC 4,49 %	1,12

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Staatsanleihen	57,67
Finanzen	30,93
Nichtzyklische Konsumgüter	4,19
Industrie	2,19
Zyklische Konsumgüter	1,85
Versorgungsunternehmen	1,00
Kommunikation	0,73

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Belgien	15,63
Österreich	14,44
Deutschland	14,24
Dänemark	12,23
Frankreich	6,66
Niederlande	6,47
Vereinigtes Königreich	4,32
Spanien	3,96
Luxemburg	2,89
Schweden	2,86
Sonstige	14,86

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG (Fortsetzung)

## Franklin European Quality Dividend UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Finanzwerte, Energie und Industriewerte am meisten zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Fonds steigerten, gehörten BAE Systems, BE Semiconductor Industries und Admiral Group.

Im gleichen Zeitraum war der einzige Sektor, der die absolute Performance des Teilfonds beeinträchtigte, der Versorgungssektor. Zu den Einzeltiteln, die die absolute Rendite des Fonds beeinträchtigten, gehörten Yara International, Snam und Elisa Oyj.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in qualitativ hochwertige Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung mit hohen und anhaltenden Dividendenerträgen aus Industrieländern in Europa. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des LibertyQ European Dividend Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds zielt darauf ab, den zugrundeliegenden Index nachzubilden, indem er alle seine Wertpapiere in einem Verhältnis hält, das ihrer Gewichtung im zugrundeliegenden Index entspricht. Das Portfolio des zugrundeliegenden Index umfasst 50 Aktien, die aus dem MSCI Europe IMI exREITS Index (Anlageuniversum) ausgewählt werden. Hierbei wird ein transparenter Auswahlprozess verwendet, bei dem zunächst eine Vorauswahl nach anhaltenden Dividenden und Renditen und anschließend eine systematische Auswahl nach Qualität erfolgt.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Tryg AS	3,16
Novartis AG	3,15
Imperial Brands PLC	3,15
Koninklijke KPN NV	3,14
Hannover Rueck SE	3,13
Zurich Insurance Group AG	3,13
Swisscom AG	3,13
Elisa OYJ	3,07
Equinor ASA	3,03
Sanofi SA	3,01

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	31,20
Kommunikation	16,61
Nichtzyklische Konsumgüter	14,00
Versorgungsunternehmen	11,33
Energie	9,38
Industrie	8,54
Grundstoffe	7,71

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Vereinigtes Königreich	17,34
Schweiz	14,36
Spanien	12,55
Frankreich	10,10
Italien	8,78
Finnland	7,89
Norwegen	7,72
Deutschland	7,38
Dänemark	6,33
Niederlande	3,14
Sonstige	3,18

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Informationstechnologie, Finanzdienstleistungen und zyklische Konsumgüter am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Fonds steigerten, gehörten TSMC, Hon Hai Precision Industry und SK Hynix.

Im gleichen Zeitraum war der einzige Sektor, der die absolute Performance des Teilfonds beeinträchtigte, der Immobiliensektor. Einzelne Positionen, die die absolute Rendite des Fonds beeinträchtigten, waren ITC, AIA Group und Sun Hung Kai Properties.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in Asien, mit Ausnahme von China und Japan. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des FTSE Asia ex Japan ex China Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds zielt darauf ab, den zugrundeliegenden Index nachzubilden, indem er alle seine Wertpapiere in einem Verhältnis hält, das ihren Gewichtungen im Index entspricht. In Fällen, in denen eine vollständige Nachbildung des Index nach vernünftigem Ermessen nicht möglich ist (beispielsweise aufgrund der Anzahl der Wertpapiere oder der Liquidität bestimmter Wertpapiere im Index), wendet der Teilfonds stattdessen die Optimierungsmethode für die Auswahl von Indexwertpapieren an, um ein repräsentatives Portfolio zusammenzustellen, das eine Rendite bietet, die mit der des Index vergleichbar ist, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Demzufolge hält der Teilfonds in bestimmten Phasen gegebenenfalls nur einen Teil der Indexwertpapiere.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	13,80
Samsung Electronics Co. Ltd.	5,46
Reliance Industries Ltd.	2,41
HDFC Bank Ltd.	2,19
SK Hynix, Inc.	1,78
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	1,53
AIA Group Ltd.	1,48
Infosys Ltd.	1,28
MediaTek, Inc.	1,24
DBS Group Holdings Ltd.	1,01

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Technologie	31,16
Finanzen	23,89
Industrie	12,05
Zyklische Konsumgüter	8,98
Nichtzyklische Konsumgüter	7,94
Energie	4,48
Grundstoffe	4,40
Kommunikation	4,10
Versorgungsunternehmen	3,03

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Indien	33,00
Taiwan	28,51
Südkorea	18,23
Hongkong	4,95
Singapur	4,36
Malaysia	2,58
Indonesien	2,57
Thailand	2,54
Cayman-Inseln	1,70
Philippinen	0,91
Sonstige	0,68

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.



# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 war der Energiesektor der einzige, der einen Beitrag zur absoluten Performance des Teilfonds leistete. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten Petrobras, JBS und BRF.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren Finanzwerte, Industrietitel und Versorger. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren B3, Banco Bradesco und Localiza Rent A Car.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Brasilien. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des FTSE Brazil 30/18 Capped Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Keine der Beteiligungen, die aus dem FTSE Emerging Index (Anlageuniversum) ausgewählt werden, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapierenebene zu minimieren, darf mehr als 30 % des zugrundeliegenden Index ausmachen; die maximal zulässige Gewichtung des nächstgrößten Unternehmens beträgt 18 %.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Vale SA ADR	10,74
Petroleo Brasileiro SA ADR (Vorzugsaktien)	9,68
Itau Unibanco Holding SAADR	7,17
Petroleo Brasileiro SA ADR	6,61
WEG SA	3,06
Banco Bradesco SA ADR	2,97
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	2,78
Itausa SA	2,59
Ambev SA ADR	2,31
Centrais Eletricas Brasileiras SA	2,29

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	25,80
Energie	22,07
Grundstoffe	16,17
Nichtzyklische Konsumgüter	10,21
Versorgungsunternehmen	10,02
Industrie	6,63
Zyklische Konsumgüter	4,35
Kommunikation	1,68
Technologie	0,66

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Brasilien	97,59

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen Finanzwerte, Energie und Kommunikationsdienste am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten Tencent, PDD und PetroChina.

Die Sektoren, die im gleichen Zeitraum am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds beitrugen, waren das Gesundheitswesen, zyklische Konsumgüter und Basiskonsumgüter. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Alibaba, Ping An Insurance und Li Auto.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in China. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des FTSE China 30/18 Capped Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Die Bestände des zugrundeliegenden Index umfassen auf Basis der Marktkapitalisierung chinesische Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung, die im Universum der FTSE Global Equity Index Series enthalten sind.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Tencent Holdings Ltd.	14,48
Alibaba Group Holding Ltd.	7,41
PDD Holdings, Inc. ADR	4,53
Meituan	3,66
China Construction Bank Corp. Anteilsklasse H	3,32
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Anteilsklasse H	2,26
Bank of China Ltd. Anteilsklasse H	1,99
NetEase, Inc.	1,64
JD.com, Inc.	1,52
Xiaomi Corp.	1,50

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Kommunikation	38,95
Finanzen	19,63
Zyklische Konsumgüter	9,63
Nichtzyklische Konsumgüter	9,62
Industrie	6,60
Energie	4,83
Technologie	3,56
Grundstoffe	3,41
Versorgungsunternehmen	2,80

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Cayman-Inseln	50,91
China	43,56
Hongkong	2,80
Bermuda	0,92
USA	0,57
Singapur	0,27

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF

Der Teilfonds wurde am 24. Juni 2024 aufgelegt.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Industrieländern weltweit. Der Teilfonds zielt darauf ab, die FTSE Developed Index NR Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Der zugrundeliegende Index setzt sich aus Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus Industrieländern zusammen, die im Universum der FTSE Global Equity Index Series enthalten sind.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Microsoft Corp.	4,92
Apple, Inc.	4,53
NVIDIA Corp.	4,35
Amazon.com, Inc.	2,66
Meta Platforms, Inc.	1,64
Alphabet, Inc. Anteilsklasse A	1,59
Alphabet, Inc.	1,34
Eli Lilly & Co.	1,14
Berkshire Hathaway, Inc.	1,10
Broadcom, Inc.	1,08

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Technologie	24,67
Nichtzyklische Konsumgüter	18,40
Finanzen	16,52
Kommunikation	12,08
Zyklische Konsumgüter	9,29
Industrie	9,29
Energie	4,15
Grundstoffe	3,12
Versorgungsunternehmen	2,41

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
USA	67,44
Japan	6,50
Vereinigtes Königreich	3,56
Schweiz	2,71
Frankreich	2,52
Kanada	2,52
Deutschland	2,12
Australien	1,97
Niederlande	1,77
Irland	1,62
Sonstige	7,20

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren zyklische Konsumgüter, Industrietitel und Finanzwerte am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten Reliance Industries, Bharti Airtel und Infosys.

Im gleichen Zeitraum beeinträchtigte kein Sektor die absolute Performance des Teilfonds. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren HDFC Bank, Hindustan Unilever und Asian Paints.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Indien. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des FTSE India 30/18 Capped Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Die Bestände des zugrundeliegenden Index umfassen indische Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung, die aus dem FTSE All-World Index abgeleitet sind, auf Basis der Marktkapitalisierung des Streubesitzes.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Reliance Industries Ltd.	7,34
HDFC Bank Ltd.	6,68
Infosys Ltd.	3,87
Tata Consultancy Services Ltd.	2,84
Bharti Airtel Ltd.	2,70
ICICI Bank Ltd.	2,67
Axis Bank Ltd.	2,04
Mahindra & Mahindra Ltd.	1,96
Larsen & Toubro Ltd.	1,68

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	24,47
Nichtzyklische Konsumgüter	13,19
Industrie	12,32
Zyklische Konsumgüter	12,13
Technologie	10,69
Energie	10,45
Grundstoffe	6,46
Versorgungsunternehmen	5,68
Kommunikation	5,25

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Indien	100,64

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Informationstechnologie, Finanzwerte und zyklische Konsumgüter am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten SK Hynix, Samsung Electronics und Hyundai Motor.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren Grundstoffe, Industrietitel und Kommunikationsdienste. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Samsung SDI, LG Chem und LG Energy Solution.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Südkorea. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des FTSE Korea 30/18 Capped Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Die Bestände des zugrundeliegenden Index umfassen südkoreanische Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung, die vom FTSE All-World Index abgeleitet sind, auf Basis der Marktkapitalisierung des Streubesitzes.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Samsung Electronics Co. Ltd.	26,39
SK Hynix, Inc.	10,32
Samsung Electronics Co. Ltd. (Vorzugsaktien)	3,56
Hyundai Motor Co.	3,17
Kia Corp.	2,60
POSCO Holdings, Inc.	2,19
KB Financial Group, Inc.	2,14
Celltrion, Inc.	2,05
Shinhan Financial Group Co. Ltd.	1,94
NAVER Corp.	1,84

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Technologie	43,23
Zyklische Konsumgüter	14,99
Finanzen	11,41
Industrie	9,92
Nichtzyklische Konsumgüter	8,37
Grundstoffe	6,16
Kommunikation	3,49
Energie	1,60
Versorgungsunternehmen	0,51

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Südkorea	99,68

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Informationstechnologie, Finanzwerte und Industrietitel am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten TSMC, Hon Hai Precision Industry und MediaTek.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren Grundstoffe, zyklische Konsumgüter und Energie. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Nan Ya Plastics, Formosa Plastics und Chailease Holding.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds soll ein Engagement in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Taiwan bieten. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des FTSE Taiwan 30/18 Capped Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Keine der Beteiligungen, die aus dem FTSE Emerging Index (Anlageuniversum) ausgewählt werden, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapiererebene zu minimieren, darf mehr als 30 % des zugrundeliegenden Index ausmachen; die maximal zulässige Gewichtung des nächstgrößten Unternehmens beträgt 18 %.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	30,52
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	6,88
MediaTek, Inc.	5,57
Delta Electronics, Inc.	2,26
Quanta Computer, Inc.	2,23
CTBC Financial Holding Co. Ltd.	1,85
United Microelectronics Corp.	1,76
Fubon Financial Holding Co. Ltd.	1,65
ASE Technology Holding Co. Ltd.	1,54
Cathay Financial Holding Co. Ltd.	1,46

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Technologie	53,44
Industrie	19,15
Finanzen	15,15
Zyklische Konsumgüter	3,84
Kommunikation	3,07
Grundstoffe	2,91
Nichtzyklische Konsumgüter	1,63
Energie	0,24

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Taiwan	97,15
Cayman-Inseln	2,28

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Future of Food UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Industrie und Informationstechnologie am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten Hitachi, Ecolab und SalMar ASA.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren das Gesundheitswesen, Basiskonsumgüter und Versorger. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Bayer, FMC Corporation und Energy Recovery.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds zielt darauf ab, eine Beteiligung an Unternehmen sicherzustellen, die sich weltweit in der gesamten Lebensmittelindustrie mit nachhaltigen Praktiken beschäftigen. Der Teilfonds ist bestrebt, die Performance des Index so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der Index steigt oder fällt. Dabei versucht er, den Tracking Error zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und derjenigen des Index so weit wie möglich zu minimieren. Der Index setzt sich aus globalen Aktienwerten zusammen, die von Unternehmen aus Industrieländern ausgegeben werden, und soll die Aktienperformance von Unternehmen aus der Lebensmittelbranche messen, die Technologien, effiziente Produktions- und Lieferpraktiken einsetzen und/oder Innovationen mit dem Ziel vorweisen können, ein nachhaltiges Lebensmittelökosystem zu schaffen.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Hitachi Ltd.	5,01
DuPont de Nemours, Inc.	4,53
Unilever PLC	4,46
Xylem, Inc.	4,07
Deere & Co.	4,00
Dow, Inc.	3,88
American Water Works Co., Inc.	3,86
Nutrien Ltd.	3,77
Bayer AG	3,65
Danone SA	3,59

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Industrie	32,82
Nichtzyklische Konsumgüter	28,31
Grundstoffe	26,39
Versorgungsunternehmen	10,77
Energie	0,99
Zyklische Konsumgüter	0,58

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
USA	50,71
Vereinigtes Königreich	11,84
Japan	8,87
Norwegen	5,44
Schweiz	3,99
Kanada	3,77
Deutschland	3,65
Frankreich	3,59
Cayman-Inseln	2,34
Irland	1,99
Sonstige	3,67

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Industriewerte und Basiskonsumgüter am meisten zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten Emeis, Eli Lilly & Co und Novo Nordisk.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren Informationstechnologie, Industrietitel und Basiskonsumgüter. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Bristol-Myers Squibb, Sleep Number und Bayer.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds bietet ein Engagement in Unternehmen, die weltweit nachhaltige Produkte und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Gesundheit und Wohlergehen anbieten. Der Teilfonds soll, die Performance des Solactive Sustainable Health and Wellness Index (der „Index“) so genau wie möglich nachbilden, unabhängig davon, ob der Index steigt oder fällt, und dabei den Tracking Error zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und derjenigen des Index so weit wie möglich minimieren. Der Index besteht aus globalen Aktien von Unternehmen aus Industrieländern und ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung der Aktien von Unternehmen misst, die im Gesundheitswesen Technologien einsetzen und nachweislich innovativ sind, und von Unternehmen, die für breite Verbraucherschichten und auch ältere Menschen Zugang zu Pflege, Gesundheit oder Wohlergehen ermöglichen.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Eli Lilly & Co.	4,04
AstraZeneca PLC	3,99
Novo Nordisk AS	3,86
Intuitive Surgical, Inc.	3,21
Merck & Co., Inc.	3,12
Abbott Laboratories	3,00
AbbVie, Inc.	2,98
Roche Holding AG	2,91
Thermo Fisher Scientific, Inc.	2,89
Pfizer, Inc.	2,75

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Nichtzyklische Konsumgüter	91,05
Zyklische Konsumgüter	3,45
Technologie	2,61
Industrie	1,79
Kommunikation	1,01

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
USA	63,84
Schweiz	6,09
Dänemark	5,39
Vereinigtes Königreich	4,66
Frankreich	4,34
Deutschland	4,25
Australien	2,87
Japan	2,30
Irland	2,23
Spanien	1,09
Sonstige	2,85

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.



# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Finanzwerte, Informationstechnologie und zyklische Konsumgüter am meisten zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds erhöhten, gehörten Novo Nordisk, TSMC und Sumitomo Mitsui Financial.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren Basiskonsumgüter, das Gesundheitswesen und Versorger. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Astellas Pharma, Sociedad Quimica y Minera de Chile und Biogen.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Industrie- und Schwellenländern weltweit, die als umweltfreundlich und sozial verantwortlich angesehen werden. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des Global Equity SRI Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Fonds zielt darauf ab, den zugrundeliegenden Index nachzubilden, indem er alle seine Wertpapiere in einem Verhältnis hält, das ihrer Gewichtung im zugrundeliegenden Index entspricht. Das Portfolio des zugrundeliegenden Index umfasst 230 Aktien, die aus dem MSCI ACWI SRI Index ausgewählt werden. Hierbei wird ein transparenter, auf mehrere Faktoren aufgebauter Auswahlprozess verwendet, der vier Anlagestilfaktoren (Qualität, Wertpotenzial, Dynamik und niedrige Volatilität) anwendet.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
NVIDIA Corp.	1,31
Adobe, Inc.	1,16
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	1,16
Lam Research Corp.	1,13
Electronic Arts, Inc.	1,10
Applied Materials, Inc.	1,09
Novo Nordisk AS	1,08
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	1,07
RELX PLC	1,06
Verizon Communications, Inc.	1,05

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	23,47
Nichtzyklische Konsumgüter	20,08
Zyklische Konsumgüter	16,15
Technologie	10,29
Industrie	8,44
Grundstoffe	7,06
Kommunikation	7,05
Energie	4,45
Versorgungsunternehmen	2,77

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
USA	40,74
Japan	9,00
Kanada	8,08
Vereinigtes Königreich	5,98
Schweiz	3,56
Südkorea	2,63
Frankreich	2,44
Niederlande	2,34
Taiwan	2,23
Indien	2,11
Sonstige	20,65

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Finanzwerte, Informationstechnologie und Industriewerte am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds erhöhten, gehörten Broadcom, Qualcomm und Eaton.

Im gleichen Zeitraum war der einzige Sektor, der die absolute Performance des Teilfonds beeinträchtigte, der Bereich der Kommunikationsdienstleistungen. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren United Parcel Service, Pfizer und Emirates Telecommunications.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Fonds investiert in qualitativ hochwertige Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung und hohen und beständigen Dividendenerträgen aus Industrie- und Schwellenländern weltweit. Er zielt darauf ab, die Entwicklung des Global Dividend Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob er steigt oder fällt. Der Fonds zielt darauf ab, den zugrundeliegenden Index nachzubilden, indem er alle seine Wertpapiere in einem Verhältnis hält, das ihrer Gewichtung im zugrundeliegenden Index entspricht. Das Portfolio des zugrundeliegenden Index umfasst 100 Aktien, die aus dem MSCI ACWI exREITS Index (das Anlageuniversum) ausgewählt werden. Hierbei wird ein transparenter Auswahlprozess verwendet, bei dem zunächst eine Vorauswahl nach anhaltenden Dividenden und Renditen und anschließend eine systematische Auswahl nach Qualität erfolgt.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Broadcom, Inc.	2,29
Tokio Marine Holdings, Inc.	2,29
AbbVie, Inc.	2,11
Commonwealth Bank of Australia	2,10
Kimberly-Clark Corp.	2,07
Novartis AG	2,07
Al Rajhi Bank	2,07
Roche Holding AG	2,06
Zurich Insurance Group AG	2,06
Cisco Systems, Inc.	2,03

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	25,11
Nichtzyklische Konsumgüter	24,42
Industrie	13,96
Technologie	11,17
Kommunikation	8,47
Energie	8,35
Zyklische Konsumgüter	4,93
Grundstoffe	2,98
Versorgungsunternehmen	0,51

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
USA	51,83
Japan	12,36
Schweiz	11,25
Australien	3,21
Saudi-Arabien	2,96
Deutschland	2,71
Vereinigtes Königreich	2,02
Kanada	2,01
Irland	1,86
Indien	1,86
Sonstige	7,83

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen nur die Sektoren Kommunikationsdienste und Versorgungsunternehmen zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten Tencent, PDD und Trip.com.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren Informationstechnologie, das Gesundheitswesen und zyklische Konsumgüter. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Baidu, Alibaba und Wuxi Biologics.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Ziel des Teilfonds ist ein Engagement in chinesischen Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung, die auf den Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft ausgerichtet sind. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des MSCI China Paris Aligned Climate Net Total Return Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrunde liegende Index steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Keine der Beteiligungen, die aus dem MSCI China Index (Anlageuniversum) ausgewählt werden, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und die Konzentration auf Wertpapierebene zu minimieren, darf mehr als 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds des zugrundeliegenden Index enthalten.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Tencent Holdings Ltd.	18,84
Alibaba Group Holding Ltd.	9,29
PDD Holdings, Inc. ADR	4,58
Kweichow Moutai Co. Ltd.	2,55
Li Auto, Inc.	2,51
NetEase, Inc.	2,30
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd.	2,29
Baidu, Inc.	2,08
Meituan	1,99

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Kommunikation	42,94
Nichtzyklische Konsumgüter	18,04
Finanzen	10,20
Technologie	9,13
Zyklische Konsumgüter	8,09
Industrie	4,50
Energie	3,47
Versorgungsunternehmen	2,45
Grundstoffe	0,28

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Cayman-Inseln	53,10
China	42,30
USA	1,67
Hongkong	1,26
Bermuda	0,77

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Informationstechnologie, Finanzdienstleistungen und Kommunikationsdienste am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds erhöhten, gehörten TSMC, Bharat Electronics und MediaTek.

Die Sektoren, die im gleichen Zeitraum am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds beitrugen, waren Grundstoffe, Gesundheitswesen und Versorger. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Samsung SDI, LONGi Green Energy Technology und JA Solar Technology.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Ziel des Teilfonds ist ein Engagement in Schwellenländeraktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung, die auf den Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft ausgerichtet sind.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	12,01
Tencent Holdings Ltd.	4,66
Bharat Electronics Ltd.	2,42
Delta Electronics, Inc.	2,00
Infosys Ltd.	1,76
Samsung Electronics Co. Ltd.	1,68
Alibaba Group Holding Ltd.	1,59
Ecopro Co. Ltd.	1,48
MediaTek, Inc.	1,38
Suzlon Energy Ltd.	1,32

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	23,21
Technologie	21,88
Industrie	15,15
Kommunikation	13,94
Nichtzyklische Konsumgüter	10,21
Zyklische Konsumgüter	6,27
Grundstoffe	4,69
Versorgungsunternehmen	3,21
Energie	1,43

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Indien	21,61
Taiwan	19,63
Cayman-Inseln	12,22
Südkorea	9,44
China	8,46
Brasilien	5,58
Saudi-Arabien	5,10
Mexiko	3,04
Polen	2,46
Südafrika	2,42
Sonstige	10,03

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF

Im Zeitraum seit Auflegung (24. April 2024 bis 30. Juni 2024) trug der Sektor Informationstechnologie am meisten zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten NVIDIA, Broadcom und Adobe.

Die Sektoren, die im gleichen Zeitraum am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds beitrugen, waren Finanzwerte, Industriewerte und Grundstoffe. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren AIA Group und LVMH.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds soll ein Engagement in Aktien von Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Industrieländern weltweit bieten, die als umweltbewusst und sozialverträglich gelten. Der Teilfonds soll die Performance des MSCI World Select Catholic Principles ESG Universal and Low Carbon Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachbilden, unabhängig davon, ob der Index steigt oder fällt, und dabei den Tracking Error zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und derjenigen des Index so weit wie möglich minimieren. Der Index basiert auf dem MSCI World Index (der „übergeordnete Index“), der sich aus Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung in vielen Industrieländern zusammensetzt.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
NVIDIA Corp.	13,20
Broadcom, Inc.	2,40
ASML Holding NV	2,25
Mastercard, Inc.	2,00
Home Depot, Inc.	1,85
Advanced Micro Devices, Inc.	1,43
Adobe, Inc.	1,35
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1,14
Visa, Inc.	1,13
Applied Materials, Inc.	1,06

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Technologie	33,59
Finanzen	24,43
Nichtzyklische Konsumgüter	9,81
Zyklische Konsumgüter	9,57
Industrie	9,41
Kommunikation	6,20
Grundstoffe	3,73
Energie	1,71
Versorgungsunternehmen	1,47

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
USA	64,74
Japan	5,32
Frankreich	4,26
Niederlande	4,19
Kanada	3,65
Schweiz	3,26
Vereinigtes Königreich	2,90
Deutschland	1,54
Schweden	1,54
Australien	1,46
Sonstige	7,06

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

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

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Informationstechnologie, Kommunikationsdienstleistungen und Finanzwerte am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten NVIDIA, Alphabet und Microsoft.

Im gleichen Zeitraum beeinträchtigte kein Sektor die absolute Performance des Teilfonds. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Tesla, United Parcel Service und Bristol-Myers Squibb.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds soll ein Engagement in US-Wertpapieren mit großer Marktkapitalisierung bieten, die auf den Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft ausgerichtet sind. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des S&P 500 Paris-Aligned Climate Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob er steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Keine der Beteiligungen, die aus dem S&P 500 Index (Anlageuniversum) ausgewählt werden, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapierenebene zu minimieren, darf mehr als 5 % des zugrundeliegenden Index ausmachen.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Microsoft Corp.	7,03
Apple, Inc.	6,05
NVIDIA Corp.	5,01
Amazon.com, Inc.	3,65
Visa, Inc.	2,88
Alphabet, Inc. Anteilsklasse A	2,76
Meta Platforms, Inc.	2,44
Alphabet, Inc.	2,32
UnitedHealth Group, Inc.	1,95
Tesla, Inc.	1,93

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Technologie	31,72
Nichtzyklische Konsumgüter	22,18
Kommunikation	17,29
Finanzen	14,14
Zyklische Konsumgüter	7,43
Industrie	5,11
Grundstoffe	1,62
Versorgungsunternehmen	0,40
Energie	0,03

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
USA	97,87
Irland	1,32
Schweiz	0,41
Jersey	0,16
Bermuda	0,11
Liberia	0,05

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Finanzwerte, Industriewerte und Gesundheitswesen am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten Novo Nordisk, ASML Holding und SAP.

Die Sektoren, die die absolute Performance des Teilfonds im selben Zeitraum am stärksten belasteten, waren Basiskonsumgüter, zyklische Konsumgüter und Versorger. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren LVMH, Kering und Diageo.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds soll ein Engagement in europäischen Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung bieten, die auf den Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft ausgerichtet sind. Der Teilfonds zielt darauf ab, die Entwicklung des STOXX Europe 600 Paris-Aligned Benchmark Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob er steigt oder fällt. Der Teilfonds wählt die im zugrundeliegenden Index enthaltenen Wertpapiere aus, um ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das eine mit dem Index vergleichbare Rendite bietet, den Index jedoch nicht mit derselben Genauigkeit nachbildet wie es möglicherweise bei einem Anlagevehikel der Fall ist, das den gesamten Index nachbildet. Keine der Beteiligungen, die aus dem STOXX 600 Europe Index (Anlageuniversum) ausgewählt werden, um eine Diversifizierung zu gewährleisten und Konzentrationen auf Wertpapiererebene zu minimieren, darf mehr als 4,5 % des zugrundeliegenden Index ausmachen.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Novo Nordisk AS	4,66
ASML Holding NV	4,53
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	4,43
AstraZeneca PLC	4,33
SAP SE	3,54
Novartis AG	3,47
Nestlé SA	2,61
L'Oreal SA	2,46
Hermès International SCA	2,36
London Stock Exchange Group PLC	2,16

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Nichtzyklische Konsumgüter	34,30
Zyklische Konsumgüter	15,80
Finanzen	14,24
Technologie	11,50
Industrie	7,51
Kommunikation	7,25
Grundstoffe	5,99
Versorgungsunternehmen	2,26
Energie	0,84

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Frankreich	21,60
Vereinigtes Königreich	17,27
Schweiz	16,10
Deutschland	12,41
Niederlande	9,46
Dänemark	7,79
Spanien	5,11
Schweden	3,24
Belgien	1,39
Italien	1,36
Sonstige	3,96

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS

## Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Duration und die Renditekurvenpositionierung des Teilfonds in Anleihen der Eurozone zur relativen Performance bei, während das Engagement in Zinsderivaten den relativen Wert schmälerte. Die Wertpapierauswahl und die Sektorallokation des Teilfonds, insbesondere die Positionierung in staatsbezogenen Schuldtiteln, konnten die relativen Renditen weiter steigern. Eine Übergewichtung von Staatsanleihen schmälerte jedoch die relativen Ergebnisse, obwohl dies bis zu einem gewissen Grad durch den positiven Einfluss der Selektion in diesem Bereich ausgeglichen wurde. Die lokale Marktallokation des Teilfonds, insbesondere das Engagement auf dem britischen Markt, unterstützte die relative Performance.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds zielt darauf ab, bei gleichzeitiger Maximierung der Gesamtergebnisse ein Engagement am europäischen Markt für grüne Anleihen zu bieten.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in:

- Auf europäische Währungen lautende Anleihen mit grünem Label

Der Teilfonds kann in geringerem Umfang investieren in:

- Anleihen, die im Einklang mit dem Klimaschutz stehen
- Derivate zur Absicherung, für ein effizientes Portfoliomanagement und/oder zu Anlagezwecken

Der Teilfonds verfolgt eine aktiv verwaltete Anlagestrategie. Daher hält der Teilfonds ein Portfolio mit aktiv ausgewählten und verwalteten Anlagen, statt die Entwicklung eines Referenzindex nachzubilden. Jeglicher erwähnte Referenzindex ist ein Bezugspunkt für die Messung der Wertentwicklung des Teilfonds. Die Wertpapiere, in die der Teilfonds investiert, werden gemäß den in den OGAW-Vorschriften vorgegebenen Grenzen vornehmlich an anerkannten Märkten weltweit notiert oder gehandelt.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fondsvermögens
Europäische Union 2,75 %	6,60
Schatzanleihen Österreich -	6,18
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,80 %	5,56
Staatsanleihen Niederlande 0,50 %,	4,53
Staatsanleihen des Königreichs Belgien 1,25 %	4,39
Staatsanleihen Spanien, 1,00 %,	3,53
Gilts, Vereinigtes Königreich 0,88 %	3,39

Wertpapiername	in Prozent des Fondsvermögens
Staatsanleihen Irland 1,35 %	3,26
Bundesobligation -	2,49
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF	2,46

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fondsvermögens
Staatsanleihen	54,39
Finanzen	19,99
Versorgungsunternehmen	12,66
Industrie	3,35
Investmentfonds	2,80
Zyklische Konsumgüter	2,58
Kommunikation	2,00
Nichtzyklische Konsumgüter	0,66
Energie	0,62

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fondsvermögens
Belgien	15,96
Deutschland	12,85
Niederlande	11,72
Frankreich	9,99
Spanien	8,15
Irland	7,46
Österreich	7,04
Vereinigtes Königreich	5,05
Schweden	3,38
Italien	3,19
Sonstige	14,26

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.



# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF

Im Zeitraum seit der Auflegung (31. Oktober 2023 bis 30. Juni 2024) beeinträchtigten die Wertpapierauswahl und die Sektorallokation des Teilfonds die relative Performance, insbesondere die Positionierung in Investment-Grade-Finanzanleihen von Unternehmen und in nachrangigen Schuldtiteln (ohne Banken und Versicherungen).

Allerdings trugen die Duration und die Renditekurvenpositionierung in Anleihen der Eurozone zu den relativen Ergebnissen bei. Die lokale Marktallokation trug durch das Engagement am britischen Markt ebenfalls zum relativen Wert bei.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds soll durch ein Engagement vorrangig am europäischen Markt für grüne Unternehmensanleihen mit einer kurzen bis mittleren Duration von weniger als 5 Jahren ein nachhaltiges Anlageziel verfolgen und gleichzeitig die Gesamtrenditen maximieren. Um sein Anlageziel zu erreichen, ist der Teilfonds bestrebt, mindestens 90 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen zu investieren. Bei diesen Investitionen handelt es sich vorrangig um Anleihen, die wie nachstehend beschrieben als „grün“ eingestuft werden und auf europäische Währungen lauten und von Unternehmensemitteln herausgegeben werden.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Kreditanstalt für Wiederaufbau 3,25 %	3,71
Instituto de Credito Oficial 3,05 %	3,59
Telia Co. AB 1,38 %	1,81
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,00 %	1,74
BNP Paribas SA 4,38 %	1,68
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU 1,66 %	1,67
Sparebank 1 Oestlandet 1,75 %	1,67
EDP – Energias de Portugal SA 3,88 %	1,66
ASR Nederland NV 3,63 %	1,65

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	61,55
Versorgungsunternehmen	14,62
Zyklische Konsumgüter	4,98
Staatsanleihen	3,59
Kommunikation	3,24
Energie	2,47
Industrie	1,67
Grundstoffe	1,53

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fonds- vermögens
Spanien	16,63
Frankreich	15,49
Niederlande	11,14
Schweden	9,06
Deutschland	7,68
Italien	5,81
USA	4,80
Norwegen	4,27
Irland	3,40
Dänemark	2,53
Sonstige	12,84

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF

Im Zeitraum seit Auflegung (31. Oktober 2023 bis 30. Juni 2024) trug die Durationspositionierung des Teilfonds in Anleihen der Eurozone zu den relativen Ergebnissen bei. Die Wertpapierauswahl und die Sektorallokation trugen ebenfalls zur Steigerung der relativen Rendite bei, insbesondere die Allokation in französische Staatsanleihen und die Auswahl niederländischer Staatsanleihen.

Allerdings beeinträchtigte das Engagement in italienischen Staatsanleihen die relative Performance. Die lokale Marktallokation trug durch das Engagement am britischen Markt ebenfalls zum relativen Wert bei.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds soll durch ein Engagement vorrangig am europäischen Markt für grüne Staatsanleihen ein nachhaltiges Anlageziel verfolgen und gleichzeitig die Gesamrenditen maximieren. Anlagepolitik. Um sein Anlageziel zu erreichen, ist der Teilfonds bestrebt, mindestens 90 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen zu investieren. Bei diesen Investitionen handelt es sich vorrangig um Anleihen, die von SSA (staatliche und staatsnahe sowie supranationale Emittenten und Agenturen) herausgegeben werden.

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fondsvermögens
Belgien	24,02
Deutschland	23,99
Niederlande	12,34
Spanien	7,49
Frankreich	7,37
Österreich	7,00
Irland	6,31
Vereinigtes Königreich	5,50
Rumänien	2,10
Island	2,00
Sonstige	1,19

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fondsvermögens
Staatsanleihen Niederlande 0,50 %	10,33
Kreditanstalt für Wiederaufbau 2,75 %	9,55
Europäische Union 2,75 %	9,30
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,30 %	7,19
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,80 %	6,60
Staatsanleihen Irland 1,35 %	6,31
Staatsanleihen Spanien, 1,00 %	6,04
Europäische Union 0,40%	5,43
Staatsanleihen des Königreichs Belgien 1,25 %	5,29
Staatsanleihen der Republik Österreich 1,85 %	4,50

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fondsvermögens
Staatsanleihen	84,66
Finanzen	10,20
Versorgungsunternehmen	2,45
Industrie	2,00

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF

Im Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 trugen die Sektoren Informationstechnologie, Industrietitel und Gesundheitswesen am meisten zur absoluten Performance des Teilfonds bei. Zu den Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds steigerten, gehörten Meta Platforms, KLA und Qualcomm.

Im gleichen Zeitraum war der einzige Sektor, der die absolute Performance des Teilfonds beeinträchtigte, der Immobiliensektor. Einzelpositionen, die die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigten, waren Bristol-Myers Squibb, United Parcel Service und Hershey.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Teilfonds investiert in Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in den USA. Dabei zielt er darauf ab, die Wertentwicklung des Linked Franklin US Equity Index (der „zugrundeliegende Index“) so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob der zugrundeliegende Index steigt oder fällt. Der Fonds zielt darauf ab, den zugrundeliegenden Index nachzubilden, indem er alle seine Wertpapiere in einem Verhältnis hält, das ihrer Gewichtung im zugrundeliegenden Index entspricht. Das Portfolio des zugrundeliegenden Index umfasst 250 Aktien, die aus dem Russell 1000® Index (Anlageuniversum) ausgewählt werden. Hierbei wird ein transparenter, auf mehrere Faktoren aufgebauter Auswahlprozess verwendet, der vier Anlagestilfaktoren (Qualität, Wertpotenzial, Dynamik und niedrige Volatilität) anwendet, um die Aktien mit dem höchsten Rating in all diesen Faktoren auszuwählen.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fondsvermögens
Broadcom, Inc.	1,20
Lam Research Corp.	1,13
Applied Materials, Inc.	1,09
Apple, Inc.	1,09
Eli Lilly & Co.	1,09
KLA Corp.	1,08
Microsoft Corp.	1,07
Accenture PLC	1,07
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	1,07
Meta Platforms, Inc.	1,06

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fondsvermögens
Nichtzyklische Konsumgüter	26,30
Zyklische Konsumgüter	17,28
Technologie	16,08
Industrie	11,06
Energie	9,31
Finanzen	8,68
Kommunikation	7,69
Grundstoffe	3,27
Versorgungsunternehmen	0,07

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

Ländergewichtung	in Prozent des Fondsvermögens
USA	96,87
Irland	1,46
Niederlande	0,48
Jersey	0,42
Bermuda	0,21
Guernsey	0,16
Schweiz	0,14

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

Für das Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 hat die Titelauswahl die relativen Renditen im Berichtszeitraum nur geringfügig beeinträchtigt. Zur Performance beigetragen haben unter anderem die Bank UBS, der Hausbauer MDC Holdings und Takeda Pharmaceuticals. Im Gegensatz dazu wurden die Titel der Midstream-Energieversorger Williams und MPLX sowie des Gesundheitsunternehmens Elevance Health negativ bewertet. Die Branchenallokation wirkte sich ebenfalls negativ auf die Performance aus, vor allem die Übergewichtung von US-Treasuries, die bei steigenden Spreads unterdurchschnittliche Ergebnisse erzielten. Dies wurde teilweise durch eine Untergewichtung der Sektoren Investitionsgüter und Banken und eine Übergewichtung des Versicherungssegments ausgeglichen, was der relativen Performance zugute kam. Die Renditekurve und die Durationspositionierung des Teilfonds wirkten sich im Laufe des Jahres negativ auf die Performance aus. Während die Gesamtduration gegenüber dem Referenzindex nahezu neutral blieb, waren die Renditeveränderungen in bestimmten Teilen der Kurve negativ.

### Zusammenfassung des Anlageziels/ der Anlagepolitik

Der Fonds zielt darauf ab, Erträge am Markt für auf USD lautende festverzinsliche Wertpapiere zu erzielen und gleichzeitig das Kapital zu bewahren.

Der Teilfonds investiert vornehmlich in:

- auf US-Dollar lautende fest- und variabel verzinsliche Unternehmensschuldtitle mit Investment Grade und von US-Unternehmen begebene Anlagen

Der Teilfonds kann in geringerem Umfang investieren in:

- Wertpapiere von außerhalb der USA einschließlich solcher von Emittenten aus Schwellenländern
- Derivate zur Absicherung, für ein effizientes Portfoliomanagement und/oder zu Anlagezwecken

Der Teilfonds verfolgt eine aktiv verwaltete Anlagestrategie. Daher hält der Teilfonds ein Portfolio mit aktiv ausgewählten und verwalteten Anlagen, statt die Entwicklung eines Referenzindex nachzubilden. Jeglicher erwähnte Referenzindex ist ein Bezugspunkt für die Messung der Wertentwicklung des Teilfonds. Die Wertpapiere, in die der Teilfonds investiert, werden gemäß den in den OGAW-Vorschriften vorgegebenen Grenzen vornehmlich an anerkannten Märkten weltweit notiert oder gehandelt.

### Die 10 größten Positionen

30. Juni 2024

Wertpapiername	in Prozent des Fonds- vermögens
Danske Bank AS 5,43 %	2,41
Morgan Stanley 3,59 %	2,24
Citigroup, Inc. 3,67 %	2,14
BNP Paribas SA 3,38 %	2,11
Enel Finance International NV 3,50 %	2,00
UBS Group AG 2,10 %	1,94
EDP FINANCE BV 1,71 %	1,89
Verizon Communications, Inc. 2,85 %	1,80
Toronto-Dominion Bank 1,15 %	1,69

### Die 10 wichtigsten Sektoren

30. Juni 2024

Sektor	in Prozent des Fonds- vermögens
Finanzen	32,09
Nichtzyklische Konsumgüter	21,13
Kommunikation	12,11
Versorgungsunternehmen	8,06
Energie	6,49
Industrie	6,17
Technologie	5,77
Zyklische Konsumgüter	3,58
Grundstoffe	2,07
Staatsanleihen	1,23

# BERICHT DER ANLAGEVERWALTUNG – AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

### Die 10 größten Länderpositionen\*

30. Juni 2024

<b>Ländergewichtung</b>	<b>in Prozent des Fonds- vermögens</b>
USA	76,38
Niederlande	3,89
Frankreich	3,19
Kanada	2,95
Dänemark	2,41
Schweiz	1,94
Vereinigtes Königreich	1,52
Irland	1,49
Norwegen	1,47
Bermuda	0,88
Sonstige	2,58

\*Der Indexanbieter kann eine Klassifizierung auf der Grundlage verschiedener Kriterien vornehmen.

# BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILSINHABER

In unserer Eigenschaft als Verwahrstelle des ICAV haben wir das Verhalten der Franklin Templeton ICAV (die „ICAV“) für das Geschäftsjahr per 30. Juni 2024 untersucht. Der vorliegende Bericht einschließlich des Gutachtens wurde ausschließlich für die Anteilseigner der Teilfonds der ICAV erstellt. Dieser Bericht wurde gemäß Vorschrift 34, (1), (3) und (4), Teil 5 der „European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019“ in der geänderten Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) erstellt und dient keinem anderen Zweck. Mit der Abgabe dieses Bestätigungsvermerks übernehmen wir keine Verantwortung für einen anderen Zweck oder gegenüber einer anderen Person, der dieser Bericht gezeigt wird.

## **Verantwortlichkeiten der Verwahrstelle**

Unsere Pflichten und Verantwortlichkeiten sind in Vorschrift 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der OGAW-Vorschriften dargelegt. Eine dieser Pflichten ist die Prüfung des Verhaltens der ICAV in jeder jährlichen Rechnungslegungsperiode und der Bericht darüber an die Anteilseigner.

Unser Bericht legt dar, ob die ICAV in diesem Zeitraum unserer Auffassung nach unter Einhaltung der Bestimmungen der Gründungsdokumente der ICAV sowie OGAW-Vorschriften geleitet wurde. Es liegt in der Gesamtverantwortung der ICAV, diese Bestimmungen zu erfüllen. Bei Nichteinhaltung durch die ICAV müssen wir als Verwahrstelle die Gründe dafür angeben und die Schritte darlegen, die wir unternommen haben, um die Situation zu bereinigen.

## **Grundlage des Bestätigungsvermerks der Verwahrstelle**

Die Verwahrstelle führt die Überprüfungen durch, die sie nach vernünftigem Ermessen für erforderlich hält, um ihren Pflichten gemäß Vorschrift 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der OGAW-Vorschriften nachzukommen und um sicherzustellen, dass die ICAV in allen wesentlichen Belangen wie folgt geführt wurde:

- (i) in Übereinstimmung mit den Beschränkungen, die ihren Anlage- und Kreditaufnahmebefugnissen durch die Gründungsdokumente und die entsprechenden Vorschriften auferlegt werden; und
- (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Gründungsdokumenten der ICAV (die „Gründungsurkunde“) und den entsprechenden Vorschriften.

## **Gutachten**

Aus unserer Sicht ist die ICAV während des Geschäftsjahrs in allen wesentlichen Aspekten wie folgt geführt worden:

- (i) in Übereinstimmung mit den Beschränkungen, die den Anlage- und Kreditaufnahmebefugnissen der ICAV durch die Gründungsurkunde und die OGAW-Vorschriften der Zentralbank auferlegt werden, und
- (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde, den OGAW-Vorschriften und den OGAW-Vorschriften der Zentralbank.

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

**Datum: 18. Oktober 2024**

# Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Anteilseigner der Teilfonds der Franklin Templeton ICAV

## Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

### Prüfungsurteil

Wir sind zu der Auffassung gelangt, dass der Jahresabschluss der Franklin Templeton ICAV:

- ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Teilfonds zum 30. Juni 2024 sowie der Ergebnisse für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr vermittelt,
- ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit der Generally Accepted Accounting Practice in Irland (vom Financial Reporting Council des Vereinigten Königreichs herausgegebene Rechnungslegungsstandards, einschließlich Financial Reporting Standard 102 „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ und irisches Recht) erstellt worden ist, und
- in Übereinstimmung mit den Anforderungen des Irish Collective Asset-management Vehicles Act 2015 und der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) ordnungsgemäß erstellt worden ist.

Wir haben den Jahresabschluss geprüft, der Teil des Jahresberichts ist, und Folgendes umfasst:

- die Bilanz zum 30. Juni 2024,
- die Gesamtergebnisrechnung für das an diesem Datum abgelaufene Geschäftsjahr,
- die Aufstellung über die Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr,
- das Anlagenverzeichnis für jeden der Teilfonds zum 30. Juni 2024, und
- den Anhang zum Jahresabschluss für jeden der Teilfonds nebst Beschreibung der Rechnungslegungsgrundsätze.

Unsere Stellungnahme steht im Einklang mit unserer Berichterstattung an den Verwaltungsrat.

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung unter Beachtung der International Standards on Auditing (Irland) („ISAs (Irland)“) und des geltenden Rechts durchgeführt.

Unsere Verantwortlichkeiten gemäß den ISAs (Irland) sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses“ unseres Berichts weiter beschrieben. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

### Unabhängigkeit

Wir blieben von der ICAV unabhängig in Übereinstimmung mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Jahresabschlusses in Irland relevant sind, wozu auch der Ethical Standard der IAASA in der für börsennotierte Unternehmen von öffentlichem Interesse anwendbaren Form gehört, und wir haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir erklären nach bestem Wissen und Gewissen, dass für die ICAV keine nach dem Ethischen Standard der IAASA verbotenen prüfungsfremden Leistungen erbracht wurden.

Wir haben im Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis zum 30. Juni 2024 keine prüfungsfremden Leistungen für die ICAV erbracht.


### Hervorhebung eines Sachverhalts – Jahresabschluss, der auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde

Bei unserem Prüfungsurteil zum Jahresabschluss, das sich nicht ändert, weisen wir auf Erläuterung 1 zum Abschluss hin, in dem die Gründe genannt sind, warum der Jahresabschluss des Franklin European Equity UCITS ETF auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde.

### Unser Prüfungsansatz

#### Überblick

	<p>Wesentlichkeit</p> <ul style="list-style-type: none"><li>· Wesentlichkeit für den Abschluss als Ganzes: 50 Basispunkte (2023: 50 Basispunkte) des Nettoinventarwerts („NAV“) zum 30. Juni 2024 (2023: 30. Juni 2023) für jeden Teilfonds der ICAV.</li><li>· Toleranzwesentlichkeit: 75 % der Wesentlichkeit für den Abschluss als Ganzes.</li></ul>
--	---

	
	<p>Prüfungsumfang</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Die ICAV ist eine offene Investment-ICAV mit variablem Kapital und beauftragt Franklin Templeton International Services S.à r.l (die „Verwaltungsgesellschaft“) mit der Wahrnehmung bestimmter Aufgaben und Verantwortlichkeiten im Hinblick auf die laufende Verwaltung der ICAV. Wir haben den Umfang unserer Prüfung unter Berücksichtigung der Anlagearten innerhalb der Teilfonds, der Beteiligung der umseitig genannten Dritten, der Rechnungslegungsverfahren und -kontrollen sowie der Branche, in der die ICAV tätig ist, angepasst. Wir betrachten jeden einzelnen Teilfonds individuell.</li> </ul>
	<p>Wesentliche Prüfungsaspekte</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Bewertung der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</li> <li>Existenz ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte</li> </ul>

### Umfang unserer Prüfung

Im Rahmen der Planung unserer Prüfung haben wir die Wesentlichkeit bestimmt und die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen im Jahresabschluss bewertet. Insbesondere untersuchten wir, wo die Verwaltungsratsmitglieder subjektive Beurteilungen vorgenommen haben, z. B. bei der Auswahl von Quellen für die Kursermittlung zur Bewertung des Anlageportfolios. Wie bei allen unseren Prüfungen befassten wir uns auch mit dem Risiko, dass das Management die internen Kontrollen außer Kraft setzt, und bewerteten, ob es Anzeichen für eine Voreingenommenheit der Verwaltungsratsmitglieder gab, die ein Risiko wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von Betrug darstellen.

### Wesentliche Prüfungsaspekte

Wesentliche Prüfungsaspekte sind Sachverhalte, die nach dem pflichtgemäßen Ermessen des Abschlussprüfers bei der Prüfung des Jahresabschlusses des aktuellen Prüfungszeitraums am bedeutsamsten waren, einschließlich wichtigsten geprüften Risiken wesentlicher falscher Darstellungen (ob durch Betrug oder nicht), die die Prüfer identifiziert haben, einschließlich derjenigen, die die größten Auswirkungen hatten auf: die gesamte Prüfstrategie, die Zuweisung von Ressourcen bei der Prüfung und die Leitung der Tätigkeit des Prüfungsteams. Diese Sachverhalte und alle Kommentare, die wir zu den Ergebnissen unserer diesbezüglichen Verfahren abgeben, wurden im Rahmen unserer Prüfung des Jahresabschlusses als Ganzes und bei der Bildung unseres Prüfungsurteils hierzu berücksichtigt, und wir geben kein gesondertes Prüfungsurteil zu diesen Sachverhalten ab. Die vorliegende Liste enthält nicht alle während unserer Prüfung festgestellten Risiken.

<b>Wesentliche Prüfungsaspekte</b>	<b>Vorgehen unserer Prüfung in Bezug auf den wesentlichen Prüfungsaspekt</b>
<p><i>Bewertung der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</i></p> <p>Weitere Einzelheiten siehe Rechnungslegungsgrundsätze 1(c) des Jahresabschlusses. Die ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte, die in der Bilanz der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2024 enthalten sind, werden in Übereinstimmung mit dem Financial Reporting Standard 102 zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Dies wird als ein wesentlicher Prüfungsaspekt angesehen, da er das Hauptelement des Jahresabschlusses darstellt.</p>	<p>Wir haben das Anlageportfolio der einzelnen Teilfonds geprüft, indem wir die Bewertung der Anlagen unabhängig von Drittanbietern überprüft haben.</p> <p>Bei einigen Aktienpositionen, für die wir keine Kurse von unabhängigen Drittanbietern ermitteln konnten, haben wir die Quellen für die Kursermittlung des Managements bestätigt.</p> <p>Bei der Durchführung dieser Verfahren wurden keine wesentlichen Sachverhalte festgestellt.</p>
<p><i>Existenz ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte</i></p> <p>Weitere Einzelheiten siehe Rechnungslegungsgrundsatz 1(c) des Jahresabschlusses der ICAV. Die ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte, die in der Bilanz der einzelnen Teilfonds enthalten sind, werden zum 30. Juni 2024 im Namen des Teilfonds gehalten. Dies wird als wesentlicher Prüfungsaspekt angesehen, da er das Hauptelement des Jahresabschlusses darstellt.</p>	<p>Wir haben von der Verwahrstelle und den Gegenparteien eine unabhängige Bestätigung des Anlageportfolios jedes Teilfonds zum 30. Juni 2024 erhalten und die Bestätigungen der Verwahrstelle und der Gegenpartei mit den Buchhaltungsunterlagen abgeglichen.</p> <p>Für einige Devisenterminkontrakte, für die wir keine Bestätigungen der Gegenpartei erhalten haben und die bereits fällig geworden sind, haben wir diese anhand von Bankauszügen liquidiert, um zu überprüfen, ob sie zum 30. Juni 2024 noch bestanden.</p> <p>Bei der Durchführung dieser Verfahren wurden keine wesentlichen Sachverhalte festgestellt.</p>



## **Anpassung des Prüfungsumfangs**

Wir haben den Umfang unserer Prüfung angepasst, um sicherzustellen, dass unsere Tätigkeit ausreicht, um ein Urteil über den Jahresabschluss als Ganzes abgeben zu können. Dabei haben wir die Struktur der ICAV, die Rechnungslegungsverfahren und -kontrollen sowie die Branche, in der sie tätig ist, berücksichtigt.

Die Verwaltungsratsmitglieder kontrollieren die Geschäfte der ICAV und sind für die von ihnen festgelegte allgemeine Anlagepolitik verantwortlich. Die ICAV beauftragt die Verwaltungsgesellschaft mit der Wahrnehmung bestimmter Aufgaben und Verantwortlichkeiten im Hinblick auf die tägliche Verwaltung der ICAV. Die Verwaltungsgesellschaft hat bestimmte Aufgaben an Franklin Advisers, Inc, Franklin Templeton Institutional, LLC, Franklin Templeton Investment Management Limited und Franklin Advisory Services LLC (die „Anlageverwalter“) sowie an State Street Fund Services (Ireland) Limited (der „Administrator“) delegiert. Die Jahresabschlüsse, die weiterhin in der Verantwortung des Verwaltungsrats liegen, werden vom Administrator in dessen Namen erstellt. Die ICAV hat State Street Custodial Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) als Verwahrstelle für das Vermögen des ICAV bestellt. Bei der Festlegung des Gesamtansatzes für unsere Prüfung haben wir das Risiko wesentlicher falscher Darstellungen auf Teilfondsebene unter Berücksichtigung der Art, der Wahrscheinlichkeit und des möglichen Ausmaßes falscher Darstellungen bewertet. Im Rahmen unserer Risikobewertung haben wir die Interaktion der ICAV mit dem Administrator untersucht und das beim Administrator bestehende Kontrollumfeld bewertet.

## **Wesentlichkeit**

Der Umfang unserer Prüfung wurde durch die Anwendung des Grundsatzes der Wesentlichkeit beeinflusst. Wir legen bestimmte quantitative Schwellenwerte für die Wesentlichkeit fest. Zusammen mit qualitativen Erwägungen halfen uns diese bei der Festlegung des Umfangs unserer Prüfung sowie der Art, der zeitlichen Planung und des Umfangs unserer Prüfungshandlungen in Bezug auf die einzelnen Posten und Angaben des Jahresabschlusses sowie bei der Beurteilung der Auswirkung falscher Darstellungen, sowohl einzeln als auch auf den Jahresabschluss als Ganzes.

Auf der Grundlage unseres fachlichen Urteils haben wir die Wesentlichkeit für die Jahresabschlüsse der einzelnen Teilfonds der ICAV wie folgt bestimmt:

<b>Wesentlichkeit für den Abschluss als Ganzes und wie wir sie bestimmt haben</b>	50 Basispunkte (2023: 50 Basispunkte) des Nettoinventarwerts („NAV“) zum 30. Juni 2024 (2023: 30. Juni 2023) für jeden Teilfonds der ICAV.
<b>Begründung für die angewandte Benchmark</b>	Wir haben diese Benchmark angewandt, da das Hauptziel der ICAV darin besteht, den Anlegern eine Gesamtrendite auf Teilfondsebene zu bieten, die die Kapital- und Ertragsrenditen berücksichtigt.

Wir verwenden die Toleranzwesentlichkeit, um die Wahrscheinlichkeit, dass die Summe der unkorrigierten und unentdeckten falschen Angaben die Wesentlichkeit für den Abschluss als Ganzes übersteigt, auf ein angemessenes Maß zu reduzieren. Insbesondere verwenden wir die Toleranzwesentlichkeit bei der Festlegung des Prüfungsumfangs und der Art und des Umfangs unserer Prüfungen von Kontensalden, Kategorien von Vorgängen und Angaben, z. B. bei der Bestimmung des Stichprobenumfangs. Unsere Toleranzwesentlichkeit betrug 75 % der Wesentlichkeit für den Abschluss als Ganzes.

Bei der Bestimmung der Toleranzwesentlichkeit haben wir eine Reihe von Faktoren berücksichtigt - die Falschdarstellungen in der Vergangenheit, die Risikobewertung und das Aggregationsrisiko sowie die Wirksamkeit der Kontrollen - und sind zu dem Schluss gekommen, dass ein Betrag am oberen Ende unserer normalen Spanne angemessen ist.

Wir haben mit dem Verwaltungsrat vereinbart, dass wir ihm während unserer Prüfung festgestellte falsche Angaben über 5 Basispunkte des Nettoinventarwerts jedes Teilfonds melden, wenn sich die Unterschiede auf den Nettoinventarwert pro Anteil auswirken (2023: 5 Basispunkte des Nettoinventarwerts der einzelnen Teilfonds für Unterschiede, die sich auf den Nettoinventarwert pro Aktie auswirken) sowie Falschdarstellungen unterhalb dieses Betrags, die unserer Ansicht nach aus qualitativen Gründen gemeldet werden sollten.

## **Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung**

Mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, für den eine andere Rechnungslegungsgrundlage als die der Unternehmensfortführung gewählt wurde, wie im obigen Abschnitt „Hervorhebung eines Sachverhalts - Jahresabschluss, der auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde“ dargelegt, umfasste unsere Bewertung die Einschätzung der Verwaltungsratsmitglieder hinsichtlich der Fähigkeit der Teilfonds, weiterhin die Rechnungslegungsgrundlage der Unternehmensfortführung anzuwenden:

- Wir haben uns ein Bild von den Schlüsselindikatoren gemacht, die im Hinblick auf die Annahme der Unternehmensfortführung und die Zukunftspläne des Managements für die ICAV und die Teilfonds für den Zeitraum der Unternehmensfortführung (12 Monate ab dem Datum der Genehmigung des Jahresabschlusses) überwacht werden,
- Wir haben die verfügbaren Protokolle des Verwaltungsrats im Prüfungszeitraum und die bis zum Datum dieses Berichts verfügbaren Protokolle geprüft,
- Wir haben die Kapitalaktivitäten nach dem Jahresende durch Überprüfung der zugrunde liegenden Buchhaltungsunterlagen untersucht,
- Wir haben uns bei der Geschäftsleitung über geplante wesentliche Rücknahmen erkundigt, über die sie informiert worden ist, und
- Wir haben die Techniken zur Steuerung des Liquiditätsrisikos geprüft, die der ICAV und den Teilfonds zur Verfügung stehen.

Mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, bei dem ein anderer Grundsatz als das Fortführungsprinzip zugrunde gelegt wurde, wie oben in „Hervorhebung eines Sachverhalts - Jahresabschluss, der auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde“ erläutert, haben wir auf der Grundlage unserer Prüfungshandlungen keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fortführungsfähigkeit der Teilfonds für mindestens die nächsten zwölf Monate ab dem Datum, an dem der Abschluss zur Veröffentlichung freigegeben wurde, aufwerfen könnten.

Mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, bei dem ein anderer Grundsatz als das Fortführungsprinzip zugrunde gelegt wurde, wie oben in „Hervorhebung eines Sachverhalts - Jahresabschluss, der auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde“ erläutert, sind wir bei der Prüfung des Jahresabschlusses zu dem Schluss gelangt, dass die Anwendung des Fortführungsprinzips bei der Erstellung des Abschlusses durch den Verwaltungsrat angemessen ist.

Da jedoch nicht alle zukünftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhergesagt werden können, ist diese Schlussfolgerung keine Garantie für die Fähigkeit der Teilfonds zur Fortführung des Unternehmens.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten der Directors in Bezug auf die Unternehmensfortführung sind in den entsprechenden Abschnitten dieses Berichts beschrieben.

---

## **Berichterstattung über andere Informationen**

Die sonstigen Informationen umfassen alle Informationen des Jahresberichts, die nicht den Jahresabschluss und den Bestätigungsvermerk des Abschlussprüfers betreffen. Für die übrigen Informationen sind die Geschäftsführer verantwortlich. Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt die sonstigen Informationen nicht ab, und dementsprechend geben wir kein Prüfungsurteil oder, sofern in diesem Bericht nicht ausdrücklich anders angegeben, keine Form der Zusicherung dazu ab. In Verbindung mit unserer Prüfung des Jahresabschlusses ist es unsere Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu berücksichtigen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Jahresabschluss oder zu unserem bei der Prüfung gewonnenen Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir eine offensichtliche wesentliche Unstimmigkeit oder eine wesentliche Fehldarstellung identifizieren, sind wir verpflichtet, Verfahren durchzuführen, um festzustellen, ob eine wesentliche Fehldarstellung des Abschlusses oder eine wesentliche Fehldarstellung der anderen Informationen vorliegt. Wenn wir auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfungshandlungen zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Fehldarstellung dieser anderen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, dies zu melden. Wir haben nichts zu berichten, was auf diesen Verantwortlichkeiten beruht.

Auf der Grundlage der oben beschriebenen Verantwortlichkeiten und unserer im Rahmen der Prüfung durchgeführten Arbeit sind wir gemäß Irish Collective Asset-management Vehicles Act 2015 verpflichtet, das Prüfungsurteil anzugeben, wie nachstehend beschrieben:

### ***Bericht des Verwaltungsrats***

- Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung durchgeführten Handlungen stimmen die Angaben im Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 mit dem Jahresabschluss überein.

---

## **Verantwortlichkeiten für den Jahresabschluss und die Abschlussprüfung**

### ***Verantwortlichkeiten der Directors für den Abschluss***

Wie in der Erklärung zu den Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats ausführlicher erläutert, sind die Mitglieder des Verwaltungsrats für die Erstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit dem geltenden Regelwerk verantwortlich und dafür, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt.

Die Direktoren sind auch für die internen Kontrollen verantwortlich, die sie als notwendig erachten, um die Erstellung eines Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen Fehlaussagen ist, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Fehler zurückzuführen sind.

Bei der Aufstellung des Abschlusses sind die Verwaltungsratsmitglieder dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Teilfonds zur Fortführung der Geschäftstätigkeit zu beurteilen, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung der Geschäftstätigkeit - sofern zutreffend - anzugeben sowie dafür, den Rechnungslegungsgrundsatz der Fortführung der Geschäftstätigkeit anzuwenden, es sei denn, die Verwaltungsratsmitglieder beabsichtigen entweder, die ICAV zu liquidieren oder den Geschäftsbetrieb einzustellen, oder haben keine realistische Alternative dazu, dies zu tun.

### ***Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses***

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist, und einen Bestätigungsvermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit den ISAs (Irland) durchgeführte Prüfung immer eine wesentliche falsche Darstellung aufdeckt, wenn diese vorhanden ist. Falsche Darstellungen können aus Betrug oder Irrtum resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen der Leserschaft beeinflussen.

Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, sind Fälle von Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften. In Übereinstimmung mit unseren oben beschriebenen Verantwortlichkeiten entwickeln wir Verfahren zur Aufdeckung wesentlicher falscher Angaben in Bezug auf Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug. Inwieweit unsere Verfahren geeignet sind, Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufzudecken, wird im Folgenden erläutert.

Auf der Grundlage unserer Kenntnisse über die ICAV und die Branche haben wir die wichtigsten Risiken der Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften im Zusammenhang mit Verstößen gegen irische Gesetze und Vorschriften der Central Bank of Ireland ermittelt und geprüft, inwieweit sich die Nichteinhaltung wesentlich auf den Jahresabschluss auswirken könnte. Wir haben auch die Gesetze und Verordnungen berücksichtigt, die sich unmittelbar auf die Erstellung des Jahresabschlusses auswirken, wie z. B. den Irish Collective Asset-management Vehicles Act 2015 und die European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der jeweils geltenden Fassung). Wir bewerteten die Anreize und Möglichkeiten der Geschäftsleitung zur betrügerischen Manipulation des Jahresabschlusses (einschließlich des Risikos der Umgehung von Kontrollen) und stellten fest, dass die Hauptrisiken mit der Umgehung von Kontrollen durch die Geschäftsleitung zusammenhängen.

Das Prüfungsteam führte unter anderem folgende Prüfungshandlungen durch:

- Befragung der Geschäftsleitung zur Feststellung von Verstößen gegen Gesetze und Vorschriften,
- Identifizierung und Prüfung von Journalbuchungen, die unsere spezifischen risikobasierten Kriterien erfüllen,
- Prüfung von Schätzungen und Ermessensentscheidungen bei der Rechnungslegung und Berücksichtigung des Potenzials für Verzerrungen durch die Geschäftsleitung,
- Konzeption von Prüfungsverfahren, um Unvorhersehbarkeiten in Bezug auf Art, Zeitpunkt oder Umfang unserer Prüfungen zu berücksichtigen,
- Prüfung der Protokolle der Verwaltungsratssitzungen, und
- Überprüfung der Angaben in den Jahresabschlüssen und Abgleich mit den entsprechenden Belegen, um die Einhaltung der geltenden Gesetze und Vorschriften zu beurteilen.

Die oben beschriebenen Prüfungsverfahren sind mit gewissen Einschränkungen verbunden. Dass wir auf Verstöße gegen Gesetze und Vorschriften aufmerksam werden, die nicht in engem Zusammenhang mit den im Jahresabschluss wiedergegebenen Ereignissen und Transaktionen stehen, ist weniger wahrscheinlich. Auch ist das Risiko, dass eine wesentliche falsche Darstellung aufgrund von Betrug nicht aufgedeckt wird, höher als das Risiko, dass eine falsche Darstellung aufgrund von Irrtum nicht aufgedeckt wird, da Betrug eine vorsätzliche Verschleierung beinhalten kann, z. B. durch Fälschung oder absichtliche Falschdarstellung oder durch geheime Absprachen.

Unsere Prüfung könnte die Prüfung kompletter Populationen bestimmter Transaktionen und Salden beinhalten, möglicherweise unter Verwendung von Datenprüfungstechniken. Dabei wird jedoch typischerweise eine begrenzte Anzahl von Items zum Testen ausgewählt, anstatt komplette Populationen zu testen. Wir werden oft versuchen, bestimmte Posten aufgrund ihres Umfangs oder ihrer Risikomerkmale gezielt zu testen. In anderen Fällen verwenden wir Stichproben, um eine Aussage über die Grundgesamtheit treffen zu können, aus der die Stichprobe ausgewählt wird.

Eine weitere Beschreibung unserer Verantwortlichkeiten für die Abschlussprüfung finden Sie auf der Website der IAASA 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 Teil unseres Bestätigungsvermerks.

### *Verwendung dieses Berichts*

Dieser Bericht, einschließlich des Bestätigungsvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilseigner jedes Teilfonds als Gremium gemäß Section 120 des Irish Collective Asset-management Vehicles Act 2015 und für keinen anderen Zweck erstellt. Mit der Abgabe dieser Stellungnahmen übernehmen wir keine Verantwortung für einen anderen Zweck oder gegenüber einer anderen Person, der dieser Bericht gezeigt wird oder in deren Hände er gelangt, es sei denn, wir haben dem vorher ausdrücklich schriftlich zugestimmt.

---

## **Andere erforderliche Berichte**

---

### **Ausnahmeberichterstattung laut Irish Collective Asset-management Vehicles Act 2015**

#### *Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats*

Gemäß dem Irish Collective Asset-management Vehicles Act 2015 sind wir verpflichtet, Ihnen Bericht zu erstatten, wenn unserer Meinung nach die in Section 117 dieses Gesetzes vorgeschriebenen Angaben zu den Vergütungen und Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder nicht gemacht wurden. Wir haben keine Ausnahmen zu berichten, die sich aus dieser Verantwortung ergeben.

---

#### *Ernennung*

Wir wurden vom Verwaltungsrat am 22. Juni 2018 mit der Prüfung des Jahresabschlusses für das am 30. Juni 2018 endende Geschäftsjahr und die nachfolgenden Geschäftsjahre beauftragt. Die Dauer des gesamten ununterbrochenen Mandats beträgt 7 Jahre und erstreckt sich auf die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2018 bis zum 30. Juni 2024.

David Pickerill  
für und im Namen von PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants and Statutory Audit Firm  
Dublin  
18. Oktober 2024

# BILANZ

Zum 30. Juni 2024

	Hinweis	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emer- ging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emer- ging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF* EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Equity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Quality Dividend UCITS ETF EUR
Umlaufvermögen								
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Übertragbare Wertpapiere .....	1(c)	3.757.649	48.535.408	43.646.949	11.804.515	373.213.121	-	63.212.816
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	-	645	-	-	-	-
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	1(d), 7	839	2.039.072	2.937.194	98.380	3.045.205	-	119.193
Sonstige Forderungen .....	8	2.683	637.880	430.599	260.523	2.438.929	-	688.694
<b>Gesamtumlaufvermögen.....</b>		<b>3.761.171</b>	<b>51.212.360</b>	<b>47.015.387</b>	<b>12.163.418</b>	<b>378.697.255</b>	<b>-</b>	<b>64.020.703</b>
Kurzfristige passiva								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	-	-	-	-	-	(8.984)
Sonstige Verbindlichkeiten.....	9	(916)	(14.720)	(3.147.358)	(1.374)	(46.090)	-	(13.035)
<b>Summe der Verbindlichkeiten abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist.....</b>		<b>(916)</b>	<b>(14.720)</b>	<b>(3.147.358)</b>	<b>(1.374)</b>	<b>(46.090)</b>	<b>-</b>	<b>(22.019)</b>
<b>Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen („Nettovermögen“)</b> .....		<b>3.760.255</b>	<b>51.197.640</b>	<b>43.868.029</b>	<b>12.162.044</b>	<b>378.651.165</b>	<b>-</b>	<b>63.998.684</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE Developed World UCITS ETF* USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD
Umlaufvermögen								
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Übertragbare Wertpapiere .....	1(c)	56.324.507	29.619.140	529.982.559	7.547.506	933.315.279	813.220.514	12.504.465
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	13.381	-	-	273.079	50.196	180
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	1(d), 7	142.938	288.235	1.293.055	3.620	16.901.534	817.925	66.054
Sonstige Forderungen .....	8	198.123	436.423	4.082.580	2.026	4.872.537	1.821.016	35.677
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>56.665.568</b>	<b>30.357.179</b>	<b>535.358.194</b>	<b>7.553.152</b>	<b>955.362.429</b>	<b>815.909.651</b>	<b>12.606.376</b>
Kurzfristige passiva								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	-	(119.143)	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(360.322)	(5.990)	(87.192)	(112)	(27.946.326)	(58.250)	(29.913)
<b>Summe der Verbindlichkeiten abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist .....</b>		<b>(360.322)</b>	<b>(5.990)</b>	<b>(206.335)</b>	<b>(112)</b>	<b>(27.946.326)</b>	<b>(58.250)</b>	<b>(29.913)</b>
<b>Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>56.305.246</b>	<b>30.351.189</b>	<b>535.151.859</b>	<b>7.553.040</b>	<b>927.416.103</b>	<b>815.851.401</b>	<b>12.576.463</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin Future of Food UCITS ETF* USD	Franklin Future of Health & Well- ness UCITS ETF* USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF* USD
Umlaufvermögen								
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Übertragbare Wertpapiere .....	1(c)	2.375.958	2.618.188	19.279.528	47.066.754	5.162.298	5.455.009	48.698.631
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	1(d), 7	-	1.517	31.779	4.833	26.380	29.780	21.918
Sonstige Forderungen .....	8	4.915	1.549	68.226	64.146	22.940	14.477	28.578
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>2.380.873</b>	<b>2.621.254</b>	<b>19.379.533</b>	<b>47.135.733</b>	<b>5.211.618</b>	<b>5.499.266</b>	<b>48.749.127</b>
Kurzfristige passiva								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	-	(241)	-	(1.040)	-	-
Kontokorrentkredit .....		(1.078)	-	-	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(593)	(652)	(53.743)	(24.139)	(1.410)	(43.883)	(9.894)
<b>Summe der Verbindlichkeiten abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist .....</b>		<b>(1.671)</b>	<b>(652)</b>	<b>(53.984)</b>	<b>(24.139)</b>	<b>(2.450)</b>	<b>(43.883)</b>	<b>(9.894)</b>
<b>Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>2.379.202</b>	<b>2.620.602</b>	<b>19.325.549</b>	<b>47.111.594</b>	<b>5.209.168</b>	<b>5.455.383</b>	<b>48.739.233</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sustain- able Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Sustain- able Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF* EUR	Franklin Sustain- able Euro Green Sovereign UCITS ETF* EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Umlaufvermögen								
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Übertragbare Wertpapiere .....	1(c)	349.289.603	48.886.700	318.492.886	28.418.836	55.323.622	96.023.810	9.237.545
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	-	33.000	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	10.171	-	-	-	-
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	1(d), 7	154.951	68.036	3.975.002	1.574.619	809.536	681.675	8.105
Sicherheiten .....		-	-	316.000	-	-	-	-
Sonstige Forderungen .....	8	129.799	3.859.988	3.036.912	358.238	396.945	11.033.353	116.054
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>349.574.353</b>	<b>52.814.724</b>	<b>325.863.971</b>	<b>30.351.693</b>	<b>56.530.103</b>	<b>107.738.838</b>	<b>9.361.704</b>
Kurzfristige passiva								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	(1.400)	(55.350)	-	(16.660)	(3.474)	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	(277.101)	(3.118)	(35.770)	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(19.141)	(3.777.130)	(3.992.351)	(4.313)	(770.627)	(11.465.128)	(2.718)
<b>Summe der Verbindlichkeiten abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist .....</b>		<b>(19.141)</b>	<b>(3.778.530)</b>	<b>(4.324.802)</b>	<b>(7.431)</b>	<b>(823.057)</b>	<b>(11.468.602)</b>	<b>(2.718)</b>
<b>Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>349.555.212</b>	<b>49.036.194</b>	<b>321.539.169</b>	<b>30.344.262</b>	<b>55.707.046</b>	<b>96.270.236</b>	<b>9.358.986</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Joseph Keane

Director

Fionnuala Doris

Director

Datum: 18. Oktober 2024

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

	Hinweis	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emer- ging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emer- ging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Equity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Quality Dividend UCITS ETF EUR	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD
Umlaufvermögen								
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Übertragbare Wertpapiere .....	1(c)	2.905.321	56.888.680	37.832.830	481.726.301	5.008.754	46.032.550	10.300.374
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	-	-	526.875	-	2.200	-
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	1(d), 7	2.651	4.503.540	26.385	22.630.896	4.490	36.037	51.714
Sonstige Forderungen .....	8	3.331	766.665	525.216	6.654.675	28.000	470.109	152.918
<b>Gesamtumlaufvermögen</b> .....		<b>2.911.303</b>	<b>62.158.885</b>	<b>38.384.431</b>	<b>511.538.747</b>	<b>5.041.244</b>	<b>46.540.896</b>	<b>10.505.006</b>
Kurzfristige passiva								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	-	(3.480)	-	(102)	-	(1.370)
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	(2)	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(1.832)	(20.792)	(135.722)	(30.470)	(7.065)	(9.867)	(32.462)
<b>Summe der Verbindlichkeiten abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist</b> .....		<b>(1.832)</b>	<b>(20.792)</b>	<b>(139.204)</b>	<b>(30.470)</b>	<b>(7.167)</b>	<b>(9.867)</b>	<b>(33.832)</b>
<b>Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen („Nettovermögen“)</b> .....		<b>2.909.471</b>	<b>62.138.093</b>	<b>38.245.227</b>	<b>511.508.277</b>	<b>5.034.077</b>	<b>46.531.029</b>	<b>10.471.174</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.



# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Hinweis	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 Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD
Umlaufvermögen								
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Übertragbare Wertpapiere .....	1(c)	32.029.116	259.813.958	267.054.868	447.748.053	4.618.673	28.127.826	47.522.583
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	25.907	19.825	-	30	227	-
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	1(d), 7	315.402	622.915	701.721	776.466	16.911	47.212	-
Sonstige Forderungen .....	8	491.524	5.708.267	7.525.052	1.242.778	58.325	109.832	108.830
<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>28.285.097</b>	<b>47.631.413</b>
Kurzfristige passiva								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	1(c)	(914)	(32.948)	-	(8.585)	-	-	-
Kontokorrentkredit .....		-	-	-	-	-	-	(21.983)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(93.144)	(4.406.151)	(10.047.766)	(34.505)	(14.115)	(23.183)	(30.644)
<b>Summe der Verbindlichkeiten abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist .....</b>		<b>(94.058)</b>	<b>(4.439.099)</b>	<b>(10.047.766)</b>	<b>(43.090)</b>	<b>(14.115)</b>	<b>(23.183)</b>	<b>(52.627)</b>
<b>Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes 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>28.261.914</b>	<b>47.578.786</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin S&P 500 Paris Aligned Cli- mate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sustain- able Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
<b>Umlaufvermögen</b>								
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Übertragbare Wertpapiere .....	1(c)	16.130.868	5.074.736	155.539.117	30.224.706	250.176.823	128.432.379	9.208.438
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten .....	1(c)	-	-	7.283	-	97.912	2.139	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	-	-	2.124	-	-
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	1(d), 7	36.466	8.153	633.591	19.113	6.435.436	42.941	37.178
Barguthaben bei Brokern .....		-	-	-	-	278.000	-	-
Sonstige Forderungen .....	8	42.186	18.888	28.860.370	38.308	4.140.688	140.520	96.613
<b>Gesamtumlaufvermögen .....</b>		<b>16.209.520</b>	<b>5.101.777</b>	<b>185.040.361</b>	<b>30.282.127</b>	<b>261.130.983</b>	<b>128.617.979</b>	<b>9.342.229</b>
<b>Kurzfristige passiva</b>								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	1(c)	(415)	-	-	(204)	(19.950)	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten .....	1(c)	-	-	-	-	(250.303)	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9	(3.019)	(23.653)	(29.252.583)	(3.702)	(2.032.943)	(27.263)	(3.105)
<b>Summe der Verbindlichkeiten abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist .....</b>		<b>(3.434)</b>	<b>(23.653)</b>	<b>(29.252.583)</b>	<b>(3.906)</b>	<b>(2.303.196)</b>	<b>(27.263)</b>	<b>(3.105)</b>
<b>Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen („Nettovermögen“) .....</b>		<b>16.206.086</b>	<b>5.078.124</b>	<b>155.787.778</b>	<b>30.278.221</b>	<b>258.827.787</b>	<b>128.590.716</b>	<b>9.339.124</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

	Hinweis	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catho- lic Principles Emerging Mar- kets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emer- ging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF* EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Equity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Quality Dividend UCITS ETF EUR
Erträge								
Dividendenerträge .....	1(f)	18.590	-	2.057.183	-	-	6.510	2.829.332
Zinserträge.....	1(f)	41	3.129.032	113	228.631	11.001.641	52	2.550
Nettogewinn/(-verlust) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten..	1(b), 1(c), 4	843.737	(194.830)	3.897.117	266.343	6.213.035	131.846	6.045.840
<b>Gesamter Kapitalertrag .....</b>		<b>862.368</b>	<b>2.934.202</b>	<b>5.954.413</b>	<b>494.974</b>	<b>17.214.676</b>	<b>138.408</b>	<b>8.877.722</b>
Aufwendungen								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(9.629)	(204.646)	(207.062)	(8.823)	(385.410)	-	(145.579)
<b>Nettoertrag .....</b>		<b>852.739</b>	<b>2.729.556</b>	<b>5.747.351</b>	<b>486.151</b>	<b>16.829.266</b>	<b>138.408</b>	<b>8.732.143</b>
Finanzierungskosten:								
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	12	-	-	-	(254.638)	(8.413.267)	-	(2.666.540)
Zinsaufwendungen .....	1(f)	-	(220)	(1.063)	-	-	(5.357)	(291)
Besteuerung:								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(1.955)	135	(228.175)	(1.220)	(9.760)	(981)	(156.893)
Kapitalertragssteuer .....	2	-	-	(156.836)	-	-	-	-
<b>Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist.....</b>		<b>850.784</b>	<b>2.729.471</b>	<b>5.361.277</b>	<b>230.293</b>	<b>8.406.239</b>	<b>132.070</b>	<b>5.908.419</b>

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Gewinne und Verluste sind ausschließlich aus der Anlagetätigkeit und den fortgeführten Aktivitäten entstanden, mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, dessen Abschluss nicht auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit erstellt wurde. Es gab keine Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE Developed World UCITS ETF* USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD
<b>Erträge</b>								
Dividendenerträge .....	1(f)	567.927	2.413.474	11.121.040	2.478	6.417.691	10.548.724	167.659
Zinserträge.....	1(f)	1.317	1.952	20.399	-	1.387	22.104	141
Nettogewinn/(-verlust) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten..	1(b), 1(c), 4	3.335.411	(4.769.153)	(7.144.057)	8.029	166.478.643	50.007.878	2.754.408
<b>Summe Kapitalertrag/(-verlust) .....</b>		<b>3.904.655</b>	<b>(2.353.727)</b>	<b>3.997.382</b>	<b>10.507</b>	<b>172.897.721</b>	<b>60.578.706</b>	<b>2.922.208</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(73.390)	(64.678)	(613.188)	(112)	(1.165.777)	(507.489)	(14.594)
<b>Nettoertrag/(-verlust) .....</b>		<b>3.831.265</b>	<b>(2.418.405)</b>	<b>3.384.194</b>	<b>10.395</b>	<b>171.731.944</b>	<b>60.071.217</b>	<b>2.907.614</b>
<b>Finanzierungskosten:</b>								
Zinsaufwendungen .....	1(f)	(1.742)	(132)	(80)	-	(4.670)	(22.284)	-
<b>Besteuerung:</b>								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(72.410)	(202.727)	(697.389)	(447)	(1.303.999)	(1.794.511)	(35.561)
Kapitalertragssteuer .....	2	(251.492)	-	-	-	(21.553.965)	-	-
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist .....</b>		<b>3.505.621</b>	<b>(2.621.264)</b>	<b>2.686.725</b>	<b>9.948</b>	<b>148.869.310</b>	<b>58.254.422</b>	<b>2.872.053</b>

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Gewinne und Verluste sind ausschließlich aus der Anlagetätigkeit und den fortgeführten Aktivitäten entstanden, mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, dessen Abschluss nicht auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit erstellt wurde. Es gab keine Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin Future of Food UCITS ETF* USD	Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF* USD	Franklin Glo- bal Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI World Catho- lic Principles UCITS ETF* USD
<b>Erträge</b>								
Dividendenerträge .....	1(f)	59.494	36.341	647.170	1.560.293	181.826	119.602	111.270
Zinserträge.....	1(f)	9	21	1.077	1.494	181	289	1.748
Nettogewinn/(-verlust) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten..	1(b), 1(c), 4	(157.202)	128.102	634.978	4.852.448	(2.436.999)	317.838	778.490
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen.....</b>		<b>(97.699)</b>	<b>164.464</b>	<b>1.283.225</b>	<b>6.414.235</b>	<b>(2.254.992)</b>	<b>437.729</b>	<b>891.508</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(7.093)	(7.321)	(65.526)	(137.163)	(25.324)	(13.979)	(13.407)
<b>Nettoertrag (-verlust).....</b>		<b>(104.792)</b>	<b>157.143</b>	<b>1.217.699</b>	<b>6.277.072</b>	<b>(2.280.316)</b>	<b>423.750</b>	<b>878.101</b>
<b>Finanzierungskosten:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	12	-	-	-	(1.145.910)	-	-	-
Zinsaufwendungen .....	1(f)	-	-	(838)	(172)	(396)	(32)	-
<b>Besteuerung:</b>								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(6.978)	(5.683)	(80.903)	(225.970)	(10.689)	(15.305)	(15.214)
Kapitalertragssteuer .....	2	-	-	(486)	(2.023)	-	(31.154)	-
<b>(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist .....</b>		<b>(111.770)</b>	<b>151.460</b>	<b>1.135.472</b>	<b>4.902.997</b>	<b>(2.291.401)</b>	<b>377.259</b>	<b>862.887</b>

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Gewinne und Verluste sind ausschließlich aus der Anlagetätigkeit und den fortgeführten Aktivitäten entstanden, mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, dessen Abschluss nicht auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit erstellt wurde. Es gab keine Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sus- tainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Sus- tainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF* EUR	Franklin Sus- tainable Euro Green Sovereign UCITS ETF* EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
<b>Erträge</b>								
Dividendenerträge .....	1(f)	3.031.890	1.134.801	-	-	-	3.674.523	-
Zinserträge.....	1(f)	10.175	1.357	7.521.907	667.603	760.193	6.481	466.910
Nettogewinn aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten.....	1(b), 1(c), 4	54.514.119	4.395.105	4.098.829	530.269	229.310	19.133.939	42.155
<b>Gesamter Kapitalertrag .....</b>		<b>57.556.184</b>	<b>5.531.263</b>	<b>11.620.736</b>	<b>1.197.872</b>	<b>989.503</b>	<b>22.814.943</b>	<b>509.065</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(157.798)	(61.977)	(455.950)	(31.198)	(43.883)	(384.041)	(37.139)
<b>Nettoertrag .....</b>		<b>57.398.386</b>	<b>5.469.286</b>	<b>11.164.786</b>	<b>1.166.674</b>	<b>945.620</b>	<b>22.430.902</b>	<b>471.926</b>
<b>Finanzierungskosten:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	12	-	-	-	-	-	-	(396.215)
Zinsaufwendungen .....	1(f)	-	-	-	-	-	(1.202)	-
<b>Besteuerung:</b>								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(473.438)	(117.970)	(7.320)	(4.880)	-	(556.938)	-
<b>Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist.....</b>		<b>56.924.948</b>	<b>5.351.316</b>	<b>11.157.466</b>	<b>1.161.794</b>	<b>945.620</b>	<b>21.872.762</b>	<b>75.711</b>

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Gewinne und Verluste sind ausschließlich aus der Anlagetätigkeit und den fortgeführten Aktivitäten entstanden, mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF, dessen Abschluss nicht auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit erstellt wurde. Es gab keine Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Hinweis	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF* USD	Franklin Catho- lic Principles Emerging Mar- kets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emer- ging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Equity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Quality Dividend UCITS ETF EUR	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD
<b>Erträge</b>								
Dividendenerträge .....	1(f)	10.605	-	2.414.409	-	275.818	2.551.286	494.878
Zinserträge.....	1(f)	6	2.909.819	12.140	6.966.909	-	849	884
Nettogewinn/(-verlust) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten..	1(b), 1(c), 4	520.224	2.831.424	74.835	(188.962)	619.992	(1.004.181)	(108.628)
<b>Gesamter Kapitalertrag .....</b>		<b>530.835</b>	<b>5.741.243</b>	<b>2.501.384</b>	<b>6.777.947</b>	<b>895.810</b>	<b>1.547.954</b>	<b>387.134</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(5.822)	(202.841)	(154.750)	(298.113)	(13.432)	(96.450)	(30.497)
<b>Nettoertrag .....</b>		<b>525.013</b>	<b>5.538.402</b>	<b>2.346.634</b>	<b>6.479.834</b>	<b>882.378</b>	<b>1.451.504</b>	<b>356.637</b>
<b>Finanzierungskosten:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	12	-	-	-	(6.320.080)	-	(2.103.855)	-
Zinsaufwendungen .....	1(f)	-	(232)	(1.251)	(261.117)	(714)	(1.179)	(215)
<b>Besteuerung:</b>								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(908)	(175)	(289.658)	2.934	(25.581)	(140.673)	(65.549)
Kapitalertragssteuer .....	2	-	-	(38.947)	-	-	-	(11.621)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist .....</b>		<b>524.105</b>	<b>5.537.995</b>	<b>2.016.778</b>	<b>(98.429)</b>	<b>856.083</b>	<b>(794.203)</b>	<b>279.252</b>

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

Die Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus der Anlage- und der laufenden Geschäftstätigkeit mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF. Es gab keine Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Hinweis	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 Glo- bal Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD
<b>Erträge</b>								
Dividendenerträge .....	1(f)	3.004.108	5.556.539	2.964.235	9.475.963	132.738	1.004.844	1.763.698
Zinserträge.....	1(f)	-	10.520	34.558	4.834	5	862	1.635
Nettogewinn/(-verlust) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten..	1(b), 1(c), 4	5.026.228	(44.114.659)	21.186.342	34.983.105	139.640	2.980.990	1.682.500
<b>Summe Kapitalertrag/(-verlust) .....</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>3.986.696</b>	<b>3.447.833</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(52.815)	(470.907)	(350.592)	(344.553)	(4.257)	(115.663)	(204.306)
<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>3.871.033</b>	<b>3.243.527</b>
<b>Finanzierungskosten:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	12	-	-	-	-	-	-	(1.358.120)
Zinsaufwendungen .....	1(f)	(1.470)	(188)	(6.331)	(308)	-	(347)	(811)
<b>Besteuerung:</b>								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(164.931)	(412.735)	(609.336)	(1.436.603)	(28.505)	(140.600)	(231.584)
Kapitalertragssteuer .....	2	-	-	(2.861.646)	-	-	(7.647)	(12.845)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist .....</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>3.722.439</b>	<b>1.640.167</b>

Die Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus der Anlage- und der laufenden Geschäftstätigkeit mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF. Es gab keine Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.



# GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sus- tainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
<b>Erträge</b>								
Dividendenerträge .....	1(f)	133.353	60.856	1.765.245	694.124	-	2.976.332	-
Zinserträge .....	1(f)	1.222	(48)	2.483	398	3.405.761	2.355	433.054
Nettogewinn/(-verlust) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten..	1(b), 1(c), 4	(1.812.551)	83.097	22.289.093	2.949.848	(7.453.004)	13.331.590	(288.725)
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b> .....		<b>(1.677.976)</b>	<b>143.905</b>	<b>24.056.821</b>	<b>3.644.370</b>	<b>(4.047.243)</b>	<b>16.310.277</b>	<b>144.329</b>
<b>Aufwendungen</b>								
Betriebliche Aufwendungen .....	5	(12.776)	(2.790)	(78.973)	(31.819)	(458.295)	(291.112)	(44.622)
<b>Nettoertrag/(-verlust)</b> .....		<b>(1.690.752)</b>	<b>141.115</b>	<b>23.977.848</b>	<b>3.612.551</b>	<b>(4.505.538)</b>	<b>16.019.165</b>	<b>99.707</b>
<b>Finanzierungskosten:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	12	-	-	-	-	-	-	(329.385)
Zinsaufwendungen .....	1(f)	(1.174)	(48)	(807)	(63)	(37.238)	-	-
<b>Besteuerung:</b>								
Quellensteuer .....	1(j), 2	(7.875)	(7.264)	(275.502)	(75.281)	-	(452.924)	-
Kapitalertragssteuer .....	2	-	(18.342)	-	-	-	-	-
<b>(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b> .....		<b>(1.699.801)</b>	<b>115.461</b>	<b>23.701.539</b>	<b>3.537.207</b>	<b>(4.542.776)</b>	<b>15.566.241</b>	<b>(229.678)</b>

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

Die Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus der Anlage- und der laufenden Geschäftstätigkeit mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF. Es gab keine Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# ENTWICKLUNG DES AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

	Hinweis	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catho- lic Principles Emerging Mar- kets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emer- ging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF* EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Equity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Quality Dividend UCITS ETF EUR
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzu- rechnendes Nettovermögen zu Beginn des Jahres.....		2.909.471	62.138.093	38.245.227	-	511.508.277	5.034.077	46.531.029
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operati- ven Geschäft zuzurechnen ist .....		850.784	2.729.471	5.361.277	230.293	8.406.239	132.070	5.908.419
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtig- ten Anteilen .....	3	-	-	2.711.124	11.931.751	137.162.660	-	32.140.351
Auszahlung (Rücknahme) von rückkaufbaren gewinnberech- tigten Anteilen .....	3	-	(13.669.924)	(2.449.599)	-	(278.426.011)	(5.166.147)	(20.581.115)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aufgrund von Akti- entransaktionen .....		-	(13.669.924)	261.525	11.931.751	(141.263.351)	(5.166.147)	11.559.236
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Jahres .....</b>		<b>3.760.255</b>	<b>51.197.640</b>	<b>43.868.029</b>	<b>12.162.044</b>	<b>378.651.165</b>	<b>-</b>	<b>63.998.684</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# ENTWICKLUNG DES AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE Developed World UCITS ETF* USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Jahres.....		10.471.174	32.741.984	261.731.948	-	265.253.700	449.724.207	4.679.824
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist .....		3.505.621	(2.621.264)	2.686.725	9.948	148.869.310	58.254.422	2.872.053
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	42.328.451	7.684.648	322.364.883	7.543.092	521.251.082	349.815.329	7.799.592
Auszahlung (Rücknahme) von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	3	-	(7.454.179)	(51.631.697)	-	(7.957.989)	(41.942.557)	(2.775.006)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aufgrund von Aktientransaktionen .....		42.328.451	230.469	270.733.186	7.543.092	513.293.093	307.872.772	5.024.586
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Jahres .....</b>		<b>56.305.246</b>	<b>30.351.189</b>	<b>535.151.859</b>	<b>7.553.040</b>	<b>927.416.103</b>	<b>815.851.401</b>	<b>12.576.463</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# ENTWICKLUNG DES AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin Future of Food UCITS ETF* USD	Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF* USD	Franklin Glo- bal Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI World Catho- lic Principles UCITS ETF* USD
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzu- rechnendes Nettovermögen zu Beginn des Jahres.....		-	-	28.261.914	47.578.786	16.206.086	5.078.124	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operati- ven Geschäft zuzurechnen ist .....		(111.770)	151.460	1.135.472	4.902.997	(2.291.401)	377.259	862.887
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberech- tigten Anteilen .....	3	2.490.972	2.469.142	-	3.378.908	2.086.487	-	47.876.346
Auszahlung (Rücknahme) von rückkaufbaren gewinnberech- tigten Anteilen .....	3	-	-	(10.071.837)	(8.749.097)	(10.792.004)	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aufgrund von Akti- entransaktionen .....		2.490.972	2.469.142	(10.071.837)	(5.370.189)	(8.705.517)	-	47.876.346
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Jahres .....</b>		<b>2.379.202</b>	<b>2.620.602</b>	<b>19.325.549</b>	<b>47.111.594</b>	<b>5.209.168</b>	<b>5.455.383</b>	<b>48.739.233</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# ENTWICKLUNG DES AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sus- tainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Sus- tainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF* EUR	Franklin Sus- tainable Euro Green Sovereign UCITS ETF* EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Jahres.....		155.787.778	30.278.221	258.827.787	-	-	128.590.716	9.339.124
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist .....		56.924.948	5.351.316	11.157.466	1.161.794	945.620	21.872.762	75.711
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	162.134.612	17.045.485	163.805.205	29.182.468	55.818.885	79.145.290	4.666.644
Auszahlung (Rücknahme) von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	3	(25.292.126)	(3.638.828)	(112.251.289)	-	(1.057.459)	(133.338.532)	(4.722.493)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aufgrund von Aktientransaktionen .....		136.842.486	13.406.657	51.553.916	29.182.468	54.761.426	(54.193.242)	(55.849)
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Jahres .....</b>		<b>349.555.212</b>	<b>49.036.194</b>	<b>321.539.169</b>	<b>30.344.262</b>	<b>55.707.046</b>	<b>96.270.236</b>	<b>9.358.986</b>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# ENTWICKLUNG DES AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023

	Hinweis	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF* USD	Franklin Catho- lic Principles Emerging Mar- kets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emer- ging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Equity UCITS ETF EUR	Franklin Euro- pean Quality Dividend UCITS ETF EUR	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzu- rechnendes Nettovermögen zu Beginn des Jahres.....		-	29.851.589	31.528.323	672.845.051	5.839.568	31.034.287	5.144.978
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operati- ven Geschäft zuzurechnen ist .....		524.105	5.537.995	2.016.778	(98.429)	856.083	(794.203)	279.252
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtig- ten Anteilen .....	3	2.385.366	42.482.473	4.700.126	230.390.905	1.556.647	18.829.312	5.046.944
Auszahlung (Rücknahme) von rückkaufbaren gewinnberech- tigten Anteilen .....	3	-	(15.733.964)	-	(391.629.250)	(3.218.221)	(2.538.367)	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aufgrund von Akti- entransaktionen .....		2.385.366	26.748.509	4.700.126	(161.238.345)	(1.661.574)	16.290.945	5.046.944
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Jahres .....</b>		<b>2.909.471</b>	<b>62.138.093</b>	<b>38.245.227</b>	<b>511.508.277</b>	<b>5.034.077</b>	<b>46.531.029</b>	<b>10.471.174</b>

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

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# ENTWICKLUNG DES AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Hinweis	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 Glo- bal Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Jahres.....		27.282.986	241.165.019	122.416.418	291.261.525	2.082.954	25.222.243	40.334.173
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist .....		7.811.120	(39.431.430)	20.357.230	42.682.438	239.621	3.722.439	1.640.167
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	6.298.521	107.267.570	125.823.559	124.570.167	2.357.249	12.758.923	11.580.847
Auszahlung (Rücknahme) von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	3	(8.650.643)	(47.269.211)	(3.343.507)	(8.789.923)	-	(13.441.691)	(5.976.401)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aufgrund von Aktientransaktionen .....		(2.352.122)	59.998.359	122.480.052	115.780.244	2.357.249	(682.768)	5.604.446
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Jahres .....</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>28.261.914</b>	<b>47.578.786</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.

# ENTWICKLUNG DES AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 (Fortsetzung)

	Hinweis	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sus- tainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Jahres.....		2.578.067	-	109.374.448	14.243.032	83.936.003	94.049.290	13.105.918
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist .....		(1.699.801)	115.461	23.701.539	3.537.207	(4.542.776)	15.566.241	(229.678)
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen .....	3	15.327.820	4.962.663	67.841.349	12.497.982	209.508.367	39.525.865	-
Auszahlung (Rücknahme) von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen .....	3	-	-	(45.129.558)	-	(30.073.807)	(20.550.680)	(3.537.116)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aufgrund von Aktientransaktionen .....		15.327.820	4.962.663	22.711.791	12.497.982	179.434.560	18.975.185	(3.537.116)
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Jahres .....</b>		<b>16.206.086</b>	<b>5.078.124</b>	<b>155.787.778</b>	<b>30.278.221</b>	<b>258.827.787</b>	<b>128.590.716</b>	<b>9.339.124</b>

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

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Jahresberichts.



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR

## 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

Die Grundsätze wurden, sofern nicht anders angegeben, konsequent auf alle dargestellten Jahre angewandt. Die zur Erstellung des Abschlusses angewendeten wichtigsten Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind unten dargelegt. Einzelheiten zur Struktur des ICAV finden Sie im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ des Jahresabschlusses.

Dieser geprüfte Jahresabschluss des ICAV wurde für das Jahr bis zum 30. Juni 2024 erstellt.

### a) Grundlage der Aufstellung

Der Jahresabschluss des ICAV wurde in Übereinstimmung mit dem Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), dem irischen Gesetz, das den Irish Collective Asset-Management Vehicles Act 2015 (in seiner geänderten Fassung) (das „ICAV-Gesetz“) umfasst, und den OGAW-Vorschriften erstellt.

Der Abschluss ist nach dem Prinzip der historischen Kosten erstellt, das durch die Neubewertung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten werden, modifiziert wurde.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit FRS 102 muss das ICAV bestimmte Schätzungen und Annahmen vornehmen. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen und Annahmen abweichen. Der Verwaltungsrat ist der Ansicht, dass die bei der Erstellung des Jahresabschlusses verwendeten Schätzungen angemessen und sorgfältig sind. Kritische Schätzungen bei der Rechnungslegung sind diejenigen, die die komplexesten oder subjektivsten Beurteilungen oder Bewertungen beinhalten. Die Geschäftsbereiche des ICAV, die typischerweise solche Schätzungen erfordern, sind die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten.

Bestimmte Anpassungen wurden an früher ausgewiesenen Beträgen vorgenommen, um sie an die Darstellung des aktuellen Zeitraums anzupassen, was keine Auswirkungen auf das ausgewiesene Nettovermögen hatte.

Die Jahresabschlüsse aller Teilfonds mit Ausnahme des Franklin European Equity UCITS ETF wurden unter der Annahme der Fortführung der Geschäftstätigkeit erstellt, da die Verwaltungsratsmitglieder der Ansicht sind, dass das ICAV in den zwölf Monaten ab dem Datum der Genehmigung dieses Jahresabschlusses („Bewertungszeitraum“) weiterbestehen wird. Der Jahresabschluss des Franklin European Equity UCITS ETF wurde nicht auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit erstellt, da dieser Teilfonds seine Geschäftstätigkeit am 16. November 2023 eingestellt hat.

Das ICAV macht von der Ausnahmeregelung für offene Investmentfonds gemäß FRS 102 Gebrauch und legt keine Kapitalflussrechnung vor.

### Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten

Der im Vereinigten Königreich und in Irland geltende Rechnungslegungsstandard FRS 102 schreibt vor, dass ein berichtendes Unternehmen bei der Bilanzierung seiner Finanzinstrumente entweder a) die vollständigen Bestimmungen von Abschnitt 11 „Grundlegende Finanzinstrumente“ und Abschnitt 12 „Sonstige Finanzinstrumente“ von FRS 102, b) die Ansatz- und Bewertungsbestimmungen von IAS 39 „Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung“ anwendet und nur die Angabepflichten der Abschnitte 11 und 12 des FRS 102; oder c) die Ansatz- und Bewertungsvorschriften der International Financial Reporting Standards („IFRS“) 9, „Finanzinstrumente“ und/oder IAS 39 (in der nach der Veröffentlichung von IFRS 9 geänderten Fassung) und nur die Angabepflichten der Abschnitte 11 und 12 des FRS 102. Das ICAV hat sich dafür entschieden, die Ansatz- und Bewertungsvorschriften des IAS 39 und nur die Offenlegungsvorschriften der Abschnitte 11 und 12 umzusetzen.

### b) Leit- und Darstellungswährung

Alle Posten, die in den Abschlussunterlagen der einzelnen Teilfonds ausgewiesen sind, werden unter Verwendung der Währung ihres primären wirtschaftlichen Umfelds bewertet, in dem der jeweilige Teilfonds tätig ist (die „Leitwährung“). Die Leit- bzw. Basiswährung der einzelnen Teilfonds ist im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ angegeben. Das ICAV hat diese Leitwährungen auch als Darstellungswährung für jeden der Teilfonds angenommen.

Transaktionen in Fremdwährungen werden zu dem am Tag der Transaktion geltenden Wechselkurs in die Leitwährung umgerechnet. Monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zum Berichtszeitpunkt auf Fremdwährungen lauten, werden zu dem an diesem Datum geltenden Wechselkurs in die Leitwährung des Teilfonds umgerechnet.

Nicht monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf Fremdwährungen lauten und zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, werden zum Wechselkurs des Tages, an dem der beizulegende Zeitwert ermittelt wurde, in die Leitwährung des Teilfonds umgerechnet.

Alle Währungsdifferenzen, die sich aus der Umrechnung ergeben, werden in der verkürzten Gesamtergebnisrechnung im Nettogewinn/(-verlust) aus Investitionstätigkeiten erfasst, einschließlich derjenigen, die sich aus erfolgswirksam zum

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden (Fortsetzung)

### b) Leit- und Darstellungswährung (Fortsetzung)

beizulegenden Zeitwert bewerteten Finanzinstrumenten („FVTPL“) ergeben, die als Bestandteil des Nettogewinns/(-verlusts) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Investitionstätigkeiten erfasst werden.

### c) Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

#### Klassifikation

Die zum FVTPL ausgewiesenen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten umfassen zwei Unterkategorien: zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten und solche, die von der Geschäftsleitung bei der Gründung als FVTPL eingestuft werden.

Alle Instrumente im Anlagenportfolio der Teilfonds sind als FVTPL klassifiziert. Gewinne und Verluste aus Änderungen des beizulegenden Zeitwerts von finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten der Kategorie FVTPL werden in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten ausgewiesen.

#### Ansatz und Ausbuchung

##### Ansatz und erstmalige Bewertung

Käufe und Verkäufe von Anlagen werden an dem Tag verbucht, an dem die Transaktion stattfindet (Handelstag), d. h. an dem Tag, an dem sich der Teilfonds zum Kauf oder Verkauf des Vermögenswerts verpflichtet. Sonstige finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden zu dem Zeitpunkt erfasst, an dem sie entstanden sind. Wertpapiere werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert angesetzt, wobei die entstehenden Transaktionskosten sämtlicher Finanzanlagen, die zum FVTPL ausgewiesen werden, sofort als Aufwand verbucht werden. Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, die nicht zum FVTPL ausgewiesen werden, werden beim anfänglichen Ansatz zum beizulegenden Zeitwert zuzüglich der Transaktionskosten erfasst, die direkt mit ihrem Erwerb oder ihrer Ausgabe verbunden sind.

##### Ausbuchung

Wertpapiere werden ausgebucht, wenn der Anspruch auf Cashflows aus dem Wertpapier erloschen ist oder der jeweilige Teilfonds so gut wie alle Risiken und Erträge aus dem Besitz des Wertpapiers übertragen hat. Bei der Ausbuchung eines finanziellen Vermögenswerts wird die Differenz zwischen dem Buchwert des Vermögenswerts und dem erhaltenen Entgelt in der Gesamtergebnisrechnung nach der Durchschnittskostenmethode erfasst. Finanzielle Verbindlichkeiten werden ausgebucht, wenn die vertraglichen Verpflichtungen erfüllt, aufgehoben oder ausgelaufen sind.

##### Erwartete Kreditverluste

Zum 30. Juni 2024 und zum 30. Juni 2023 werden alle sonstigen Forderungen/Barmittel bei gut kapitalisierten Gegenparteien gehalten und sind innerhalb eines Jahres zu begleichen. Das Management schätzte die Wahrscheinlichkeit eines Zahlungsausfalls als nahezu Null ein. Folglich wurde keine Wertberichtigung auf der Grundlage der erwarteten 12-Monats-Kreditverluste vorgenommen, da eine solche Wertminderung für das ICAV völlig unbedeutend wäre.

##### Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts

Der beizulegende Zeitwert ist der Preis, der im Rahmen eines gewöhnlichen Geschäftsvorfalles zwischen Marktteilnehmern am Bewertungsstichtag auf dem Hauptmarkt oder, in Ermangelung eines solchen, auf dem vorteilhaftesten Markt, zu dem der betreffende Teilfonds zu diesem Zeitpunkt Zugang hat, für den Verkauf eines Vermögenswerts erzielt oder für die Übertragung einer Verbindlichkeit gezahlt würde.

##### i) Übertragbare Wertpapiere

Wenn verfügbar, bewerten die Teilfonds den beizulegenden Zeitwert einer Anlage anhand des notierten Kurses auf einem aktiven Markt für dieses Instrument. Ein Markt gilt als „aktiv“, wenn Transaktionen für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit mit ausreichender Häufigkeit und ausreichendem Volumen stattfinden, um laufend Preisinformationen zu liefern. Die Teilfonds bewerten Instrumente, die an einem aktiven Markt notiert sind, im Falle von Aktieninstrumenten zu einem zuletzt gehandelten Kurs und im Falle von Unternehmens- und Staatsanleihen zu einem mittleren Marktkurs, da dieser Kurs eine angemessene Annäherung an den Ausstiegskurs darstellt.

Wenn es keinen notierten Kurs auf einem aktiven Markt gibt, verwendet der Teilfonds Bewertungstechniken, die die Verwendung relevanter beobachtbarer Eingabewerte maximieren und die Verwendung nicht beobachtbarer Eingabewerte minimieren. Die gewählte Bewertungsmethode berücksichtigt alle Faktoren, die Marktteilnehmer bei der Preisfindung für eine Transaktion berücksichtigen würden. Der Teilfonds erfasst Umschichtungen zwischen den Stufen der Bemessungshierarchie zum Ende des Berichtsjahres, in dem die Änderung eingetreten ist.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden (Fortsetzung)

### c) Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

#### Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

##### ii) Devisenterminkontrakte

Ein Teilfonds kann Devisenterminkontrakte abschließen, um sich gegen das Wechselkursrisiko abzusichern, oder, im Falle von aktiv verwalteten Teilfonds, Währungspositionen eingehen, die die Ansichten der Portfoliomanager widerspiegeln. Ein Devisenterminkontrakt ermöglicht es den Teilfonds, eine bestimmte Währung an einem zukünftigen Datum zu einem zum Zeitpunkt des Vertragsabschlusses festgelegten Preis zu kaufen oder zu verkaufen. Die Wertentwicklung kann durch Wechselkursschwankungen erheblich beeinflusst werden, da die von einem Teilfonds gehaltenen Währungspositionen möglicherweise nicht mit der Währung der Wertpapiere übereinstimmen, in die er investiert.

Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust aus Devisentermingeschäften wird als Differenz zwischen dem Vertragspreis und dem Kassakurs am Ende des Berichtszeitraums berechnet. Alle Änderungen des beizulegenden Zeitwerts werden in der Gesamtergebnisrechnung als Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten ausgewiesen. Alle realisierten Gewinne und Verluste bei Fälligkeit von Devisenterminkontrakten werden auf der Grundlage der Vertragsbasis der Anlage in Landeswährung berechnet und sind in der Gesamtergebnisrechnung in den Nettogewinnen/(-verlusten) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagetätigkeiten enthalten.

##### iii) Futures

Terminkontrakte sind Verpflichtungen zum Kauf oder Verkauf eines bestimmten Finanzinstruments, einer Währung, einer Ware oder eines Index zu einem bestimmten Termin in der Zukunft zu einem bestimmten Preis und können in bar oder durch einen anderen finanziellen Vermögenswert erfüllt werden. Futures sind standardisierte börsengehandelte Kontrakte. Die Einschusszahlungen für Termingeschäfte werden in bar oder anderen Instrumenten geleistet, und die Änderungen der künftigen Vertragswerte werden täglich abgerechnet.

Tägliche Schwankungen im Wert eines Terminkontrakts werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste und als realisierte Gewinne oder Verluste bei Schließung der Position verbucht. Realisierte Gewinne und Verluste werden nach der First-In-First-Out-Methode („FIFO“) erfasst. Alle Änderungen des beizulegenden Zeitwerts werden in der Gesamtergebnisrechnung als Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten ausgewiesen.

### d) Fortgeführte Anschaffungskosten

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, die nicht zum FVTPL bewertet werden, werden zu fortgeführten Anschaffungskosten ausgewiesen. Die fortgeführten Anschaffungskosten eines finanziellen Vermögenswertes oder einer finanziellen Verbindlichkeit sind der Betrag, mit dem der finanzielle Vermögenswert oder die finanzielle Verbindlichkeit beim erstmaligen Ansatz bewertet wurde, abzüglich Tilgungen, zuzüglich oder abzüglich der kumulierten Amortisation einer etwaigen Differenz zwischen dem ursprünglich angesetzten Betrag und dem bei Endfälligkeit rückkaufbaren Betrag unter Anwendung der Effektivzinsmethode sowie abzüglich etwaiger Wertminderungen.

##### i) Barmittel und Barmitteläquivalente, Kontokorrentkredite und Margin-Barguthaben

Die Barmittel umfassen laufende Guthaben bei Banken und Kontokorrentkredite. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente sind kurzfristige, hochliquide Anlagen mit einer Fälligkeit von höchstens drei Monaten, die leicht in bekannte Zahlungsmittelbeträge umgewandelt werden können, einem unbedeutenden Wertschwankungsrisiko unterliegen und zur Erfüllung kurzfristiger Barmittelverpflichtungen und nicht für Investitions- oder andere Zwecke gehalten werden. Barmittel und Barmitteläquivalente werden bei State Street Custodial Services (Ireland) Limited verwahrt und zum Marktwert ausgewiesen. Zum 30. Juni 2024 werden die Margin-Barguthaben bei J.P. Morgan gehalten (30. Juni 2023: Margin-Barguthaben wurden bei J.P. Morgan gehalten) und sind in Anmerkung 7 enthalten. Kontokorrentkredite werden bei State Street Custodial Services (Ireland) Limited gehalten und zum Nennwert bewertet, gegebenenfalls zusammen mit aufgelaufenen Zinsen.

##### ii) Schuldner und Gläubiger

Schuldner werden zum beizulegenden Zeitwert zuzüglich der Transaktionskosten, die direkt mit dem Erwerb zusammenhängen, erfasst. Gläubiger werden zunächst zum beizulegenden Zeitwert zuzüglich der Transaktionskosten, die direkt mit dem Erwerb verbunden sind, erfasst. In der Folge werden sie zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

### e) Verrechnungsrecht

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten werden miteinander saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, und zwar nur dann, wenn das ICAV oder die Teilfonds einen Rechtsanspruch auf Verrechnung der Beträge haben, und falls die Absicht besteht, auf Nettobasis abzuschließen, oder die Aktiva zu realisieren (verkaufen) und gleichzeitig

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden (Fortsetzung)

### e) Verrechnungsrecht

Einen Ausgleich für die Verbindlichkeiten zu finden. Erträge und Aufwendungen werden auf Nettobasis für Gewinne und Verluste aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Finanzinstrumenten und für Wechselkursgewinne und -verluste dargestellt. Die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des ICAV sind nicht Gegenstand von Aufrechnungsvereinbarungen, durchsetzbaren Globalverrechnungsverträgen und ähnlichen Vereinbarungen.

### f) Kapitalerträge

Die Teilfonds erhalten Kapitalerträge aus den gehaltenen Vermögenswerten und Anlagen. Die Bewertung und Ausweisung der Einkommensart wird im Folgenden erläutert:

#### i) Dividendenerträge

Dividendenerträge aus den zugrunde liegenden Aktienanlagen der Teilfonds werden am Ex-Dividenden-Tag als Erträge des betreffenden Teilfonds verbucht. Die Erträge werden einschließlich nicht rückerstattungsfähiger Quellensteuern, die getrennt in der Gesamtergebnisrechnung erscheinen, und nach Abzug aller Steuergutschriften ausgewiesen.

#### ii) Zinserträge/Zinsaufwendungen

Zinserträge/Zinsaufwendungen, die die Aufzinsung von Disagio und die Amortisation von Agio beinhalten, werden in der Gesamtergebnisrechnung als Erträge/Aufwendungen des betreffenden Teilfonds des ICAV auf Effektivzinsbasis in Übereinstimmung mit den Vertragsbedingungen ausgewiesen.

### g) Aufwendungen

Alle Aufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung nach dem Prinzip der Periodenabgrenzung erfasst. Anmerkung 5 enthält weitere Einzelheiten zu den Gebühren und Aufwendungen der Teilfonds.

Aufwendungen, die bei der Veräußerung von Kapitalanlagen entstehen, werden von den Veräußerungserlösen abgezogen.

### h) Realisierte Gewinne und Verluste

Realisierte Gewinne und Verluste aus dem Verkauf von Anlagen werden auf der Grundlage der durchschnittlichen Buchkosten der Anlage in Landeswährung berechnet und in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten ausgewiesen.

#### i) Nicht realisierte Gewinne und Verluste

Nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Kapitalanlagen sind die Differenz zwischen den ursprünglichen Anschaffungskosten der Anlage und ihrem Wert am Ende des Berichtszeitraums und werden in der Gesamtergebnisrechnung als Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten ausgewiesen.

#### j) Besteuerung

Die von den Teilfonds vereinnahmten Dividenden- und Zinserträge können einer Quellensteuer im Herkunftsland unterliegen. Die Kapitalerträge werden brutto ausgewiesen, und die entsprechende Quellensteuer wird als Steueraufwand verbucht. Rückforderungen von Quellensteuern werden in der Bilanz als sonstige Forderungen ausgewiesen.

Viele der ausländischen Länder, in denen die Teilfonds investieren, haben Steuergesetze, die darauf hindeuten, dass Kapitalertragssteuern auf Gebietsfremde, wie das ICAV, anwendbar sein können. Jeder relevante Teilfonds realisiert bei der Veräußerung von Wertpapieren Kapitalgewinne oder -verluste. Im Falle von Kapitalgewinnen kann der Teilfonds einer Kapitalertragssteuer auf dem zugrunde liegenden Markt unterliegen.

#### k) Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile

Die Teilfonds geben für jeden Teilfonds rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile aus, die nach Wahl des Inhabers zurückgenommen werden können und als finanzielle Verbindlichkeiten eingestuft werden. Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile können jederzeit gegen Bargeld, Wertpapiere oder eine Kombination aus Bargeld und Wertpapieren in Höhe eines proportionalen Anteils am Nettoinventarwert des Teilfonds gemäß dem Verkaufsprospekt an den betreffenden Teilfonds zurückgegeben werden.

Der Nettoinventarwert pro Anteil des Teilfonds wird berechnet, indem das den gewinnberechtigten Aktionären mit Recht auf Rückkauf zurechenbare Nettovermögen durch die Gesamtzahl der im Umlauf befindlichen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile geteilt wird. Anlagepositionen werden gemäß der im Prospekt dargelegten Bewertungsmethode bewertet, um den Nettoinventarwert pro Anteil für Zeichnungen und Rücknahmen zu ermitteln.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden (Fortsetzung)

### l) Transaktionskosten

Transaktionskosten werden als zusätzliche Kosten definiert, die unmittelbar dem Erwerb, der Emission oder der Veräußerung eines finanziellen Vermögenswerts oder einer finanziellen Verbindlichkeit zurechenbar sind. Zusätzliche Kosten sind solche, die nicht entstanden wären, wenn das Finanzinstrument nicht erworben, begeben oder veräußert worden wäre. Beim anfänglichen Ansatz eines finanziellen Vermögenswertes oder einer finanziellen Verbindlichkeit hat ein Unternehmen diese erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewerten, zuzüglich der Transaktionskosten, die direkt dem Erwerb oder der Emission des finanziellen Vermögenswertes oder der finanziellen Verbindlichkeit zuzurechnen sind. Die Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe von Wertpapieren und anderen Anlagen sind im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten in der Gesamtergebnisrechnung enthalten. Separat identifizierbare Transaktionskosten der Verwahrstelle werden von der Verwaltungsgesellschaft über die TER der Teilfonds des ICAV getragen, wie in Anmerkung 5 beschrieben.

### m) Vertriebspolitik

Jeder Teilfonds kann sowohl ausschüttende als auch thesaurierende Anteilsklassen ausgeben. Der Verwaltungsrat kann in Bezug auf Anteile an ausschüttenden Klassen Dividenden aus dem Nettoertrag (einschließlich Dividenden- und Zinserträge) und/oder dem Überschuss der realisierten und nicht realisierten Kapitalgewinne über den realisierten und nicht realisierten Kapitalverlusten aus den Anlagen des Teilfonds erklären. Bei Teilfonds der thesaurierenden Klassen hat der Verwaltungsrat bestimmt, sämtliche Nettoerträge (einschließlich Dividenden- und Zinserträge) und/oder den Überschuss der realisierten und nicht realisierten Kapitalgewinne über den realisierten und nicht realisierten Kapitalverlusten aus den Anlagen des Fonds, die solchen thesaurierenden Klassen zuzurechnen sind, zu akkumulieren, und beabsichtigt daher nicht, für die Anteile dieser Klassen Dividenden zu erklären.

### n) Wesentliche buchhalterische Schätzungen und Ermessensentscheidungen

Kritische Schätzungen bei der Rechnungslegung sind diejenigen, die die komplexesten oder subjektivsten Beurteilungen oder Bewertungen beinhalten. Die Geschäftsbereiche des ICAV und der Teilfonds, die in der Regel solche Schätzungen erfordern, sind die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts von finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten, wie in Anmerkung 1(a) dargelegt. Ermessensentscheidungen, die bei der Erstellung dieses Abschlusses angewandt wurden, beziehen sich auf die Bestimmung der Fortführung der Geschäftstätigkeit als Grundlage der Erstellung, wie in Anmerkung 1(a) dargelegt, die Leit- und die Darstellungswährung, wie in Anmerkung 1(b) dargelegt, Rückstellungen für Kapitalertragssteuern, wie in Anmerkung 1(j) und Anmerkung 2 erörtert, und erwartete Kreditverluste, wie in Anmerkung 1(c) dargelegt.

Die wichtigsten Schätzungen, die bei der Erstellung dieses Jahresabschlusses verwendet wurden, beziehen sich auf den beizulegenden Zeitwert der Investitionen. Einzelheiten zu den spezifischen Schätzungen, die in diesem Jahresabschluss verwendet wurden, sind in Anmerkung 6 (f) enthalten. Die Schätzungen der Rechnungslegung und die zugrunde liegenden Annahmen werden laufend überprüft. Änderungen von Schätzungen werden in der Periode erfasst, in der die Schätzung geändert wird, wenn die Änderung nur diese Periode betrifft, oder in der Periode der Änderung und in zukünftigen Perioden, wenn die Änderung sowohl die aktuelle als auch zukünftige Perioden betrifft.

### Bewertung des beizulegenden Zeitwerts von nicht auf einem aktiven Markt notierten Derivaten und Kapitalanlagen

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 Preisagenturen) oder indikativer Preise von Marktmachern bestimmt werden. Maklerangebote, die von den Preisquellen stammen, können indikativ sein und sind nicht ausführbar oder verbindlich. Wenn keine Marktdaten verfügbar sind, können das ICAV und die Teilfonds die Positionen anhand eigener Modelle bewerten, die in der Regel auf in der Branche allgemein anerkannten Bewertungsmethoden und -techniken beruhen. Die zur Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Modelle werden von erfahrenen Mitarbeitern der Anlageverwalter validiert und regelmäßig überprüft, unabhängig von der Partei, die sie erstellt hat.

Die Modelle verwenden, soweit möglich, beobachtbare Daten. In Bereichen wie dem Kreditrisiko (eigenes Risiko und Gegenparteiisiko), Volatilitäten und Korrelationen müssen die Anlageverwalter jedoch Schätzungen vornehmen. Änderungen der Annahmen über diese Faktoren könnten sich auf den ausgewiesenen beizulegenden Zeitwert der Investitionen auswirken. Die Teilfonds betrachten beobachtbare Daten als Marktdaten, die leicht verfügbar sind, regelmäßig verbreitet und aktualisiert werden, verlässlich und überprüfbar sind, nicht proprietär sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt werden, die aktiv an dem betreffenden Markt beteiligt sind.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 1. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden (Fortsetzung)

### o) Ertragsausgleich

Für jeden Teilfonds gelten Ertragsausgleichsvereinbarungen. Die Regelungen sollen sicherstellen, dass der Ertrag je Anteil, der für den Ausschüttungszeitraum ausgeschüttet wird, nicht durch Änderungen der Anzahl der während des Jahres ausgegebenen Anteile beeinflusst wird. Die Vereinbarungen haben keine Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der einzelnen Anteilklassen. Die Berechnung des Ausgleichs erfolgt auf der Grundlage des gesamten kumulierten, nicht ausgeschütteten Nettogewinns. Der Ertragsausgleich ist in den Erlösen aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile und den Zahlungen für die Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens, das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zusteht, enthalten.

## 2. Besteuerung

Das ICAV ist ein Investmentunternehmen im Sinne von Abschnitt 739B des Taxes Consolidation Act, 1997, in seiner geänderten Fassung (das „TCA“). Auf dieser Grundlage unterliegt das ICAV mit seinen Erträgen und Gewinnen nicht der irischen Steuer, sofern das ICAV steuerlich in Irland ansässig ist. Das ICAV gilt als in Irland steuerlich ansässig, sofern es von der irischen Zentralbank zugelassen ist und in Irland zentral verwaltet und kontrolliert wird.

Die irische Steuer kann jedoch bei Eintritt eines „steuerpflichtigen Ereignisses“ beim ICAV anfallen. Ein steuerpflichtiges Ereignis tritt bei jeder Ausschüttung, Rücknahme, jedem Rückkauf, jeder Annullierung, jeder Übertragung von Anteilen oder dem Ende eines „relevanten Zeitraums“ ein. Ein relevanter Zeitraum ist ein Zeitraum von acht Jahren, der mit dem Erwerb der Anteile durch den Aktionär beginnt und jeder weitere Zeitraum von acht Jahren, der unmittelbar nach dem vorangegangenen relevanten Zeitraum beginnt. Ein steuerpflichtiges Ereignis liegt nicht vor:

- (i) Transaktionen in Bezug auf Anteile, die in einem anerkannten Clearing-System gehalten werden, das durch eine Anordnung der irischen Steuerbehörde (Revenue Commissioners of Ireland) bestimmt wurde; oder
- (ii) ein Umtausch von Anteilen eines Teilfonds in einen anderen Teilfonds des ICAV; oder
- (iii) ein Tausch von Anteilen, der bei einer qualifizierten Verschmelzung oder Umstrukturierung des ICAV mit einem anderen Fonds erfolgt;  
oder
- (iv) bestimmte Anteiltauschvorgänge zwischen Ehegatten und früheren Ehegatten.

Es fällt keine irische Steuer bei steuerpflichtigen Ereignissen in Bezug auf einen Anteilinhaber an, der ein steuerbefreiter irischer Anleger (gemäß der Definition in Abschnitt 739D TCA) ist, oder in Bezug auf einen Anteilinhaber, der zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses weder in Irland ansässig ist noch seinen gewöhnlichen Aufenthalt in Irland hat, sofern eine entsprechende Erklärung (gemäß Anhang 2B des TCA) vorliegt und das ICAV nicht im Besitz von Informationen ist, die vernünftigerweise darauf hindeuten würden, dass die darin enthaltenen Informationen im Wesentlichen nicht mehr richtig sind.

Liegt keine entsprechende Erklärung vor, ist das ICAV bei Eintritt eines steuerpflichtigen Ereignisses für die irische Steuer haftbar, und das ICAV behält sich das Recht vor, diese Steuern von den betreffenden Anteilinhabern einzubehalten. Im Berichtszeitraum traten keine steuerpflichtigen Ereignisse ein.

Das ICAV muss eine Steuerverbindlichkeit ausweisen, wenn es wahrscheinlich ist, dass die Steuergesetze ausländischer Länder eine Steuerverbindlichkeit für die Kapitalgewinne des Teilfonds, die aus einem solchen Land stammen, vorschreiben, wobei davon ausgegangen wird, dass die zuständigen Steuerbehörden alle Fakten und Umstände kennen. Die Steuerschuld wird dann mit dem Betrag bewertet, der voraussichtlich an die zuständigen Steuerbehörden zu zahlen ist, und zwar auf der Grundlage der Steuergesetze und Steuersätze, die am Ende des Berichtszeitraums in Kraft sind oder in Kürze in Kraft treten werden. Manchmal besteht Unsicherheit darüber, wie das geltende Steuerrecht auf Offshore-Investmentfonds angewendet wird. Dies schafft Unsicherheit darüber, ob eine Steuerschuld letztendlich vom Fonds gezahlt wird oder nicht. Bei der Bewertung von unsicheren Steuerverbindlichkeiten berücksichtigt die Geschäftsleitung daher alle relevanten Fakten und Umstände, die zu diesem Zeitpunkt verfügbar sind und die die Wahrscheinlichkeit einer Zahlung beeinflussen könnten, einschließlich aller formellen oder informellen Praktiken der zuständigen Steuerbehörden.

Dividenden, Zinsen und Kapitalgewinne (falls zutreffend) aus Anlagen des ICAV können einer Quellensteuer unterliegen, die von ausländischen Ländern erhoben wird, aus denen die Anlageerträge/-gewinne stammen, und diese Steuern können vom ICAV und seinen Anteilseignern möglicherweise nicht zurückgefordert werden. Quellensteuer und Rückforderungen auf Dividenden werden am Ex-Datum verbucht. Dividendenforderungen werden in der verkürzten Bilanz nach Abzug etwaiger Quellensteuerverbindlichkeiten ausgewiesen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 2. Besteuerung (Fortsetzung)

Das ICAV kann Steuern auf realisierte und nicht realisierte Gewinne aus Wertpapieren bestimmter ausländischer Länder, in die das ICAV investiert, unterliegen. Die Erträge/Gewinne werden vereinnahmt, und diese Steuern können vom ICAV und seinen Anteilseignern möglicherweise nicht zurückgefordert werden. Viele dieser ausländischen Länder haben Steuergesetze, die darauf hinweisen, dass Kapitalertragssteuern auf Nichtansässige, wie das ICAV, anwendbar sein können. In der Regel müssen diese Kapitalertragssteuern auf der Grundlage einer Selbstveranlagung ermittelt werden; daher dürfen solche Steuern vom Broker des ICAV nicht auf einer „Quellensteuer“-Basis abgezogen werden. Der ausländische Steueraufwand wird gegebenenfalls periodengerecht verbucht und ist in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung unter „Steuern auf Veräußerungsgewinne“ ausgewiesen. Die Kapitalertragssteuer für das am 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 endende Jahr wurde auf Gewinne des Franklin FTSE India UCITS ETF, Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF, Franklin Emerging Markets UCITS ETF, Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF, Franklin Global Equity SRI UCITS ETF und Franklin MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned UCITS ETF erhoben. Der Betrag der gegebenenfalls geschuldeten ausländischen Steuer ist in der verkürzten Bilanz unter „Zu zahlende Kapitalertragssteuer“ enthalten. Erhaltene Kapitalerträge, Dividenden und Zinsen können der vom Herkunftsland erhobenen Quellensteuer unterliegen, und diese Steuern können vom ICAV oder seinen Aktionären möglicherweise nicht zurückgefordert werden. Die Quellensteuer auf Dividenden für das am 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 endende Jahr wird in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Die auf nicht realisierte Gewinne zu zahlende Kapitalertragssteuer für das am 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 endende Jahr ist in der verkürzten Bilanz ausgewiesen.

Das ICAV betrachtet Zinsen und Strafen auf damit verbundene Steuerverbindlichkeiten als einen untrennbaren Bestandteil der Steuerverbindlichkeiten und verbucht Zinsen und Strafen. Diese Beträge wären in der Steuerzeile der verkürzten Gesamtergebnisrechnung enthalten, und die Verbindlichkeit wäre, falls vorhanden, in der Einkommensteuerverbindlichkeit der verkürzten Bilanz enthalten.

Für die am 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 endenden Jahre hat das ICAV unsichere Steuerverbindlichkeiten und damit verbundene Zinsen und Strafen in Bezug auf ausländische Kapitalertragssteuern mit Null bewertet. Obwohl dies die beste Schätzung der Geschäftsleitung ist, kann der geschätzte Wert erheblich von dem letztendlich zu zahlenden Betrag abweichen.

### Status des Reporting Fund

Das ICAV hat von der britischen Steuerbehörde HM Revenue & Customs (HMRC) die Bestätigung erhalten, dass sie mit Wirkung ab dem Auflegungsdatum aller Teilfonds für britische Steuerzwecke den Status eines UK Reporting Fund erhalten hat.

## 3. Anteilkapital und Nettoinventarwert je Anteil

### In Großbritannien

Das autorisierte Anteilkapital des ICAV besteht aus 500.000.000.002 nennwertlosen Anteilen, die in 2 nennwertlose Zeichneranteile und 500.000.000.000 rückzahlbare gewinnberechtigte und nennwertlose Anteile aufgeteilt sind. Der Verwaltungsrat ist befugt, sämtliche Anteile des ICAV zu den von ihm als angemessen erachteten Bedingungen auszugeben.

### Zeichneranteile

Das ICAV hat die 2 nennwertlosen Zeichneranteile zu je 1 EUR zum Zweck der Registrierung des ICAV ausgegeben. Die Zeichneranteile berechtigen ihre Inhaber zur Teilnahme und Ausübung ihres Stimmrechts auf Hauptversammlungen des ICAV, sie berechtigen die Inhaber jedoch nicht zu einem Anteil am Gewinn oder am Vermögen des ICAV, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Liquidation. Sie sind nicht Teil des Nettoinventarwerts des ICAV und werden daher in den Finanzausweisen nur in dieser Anmerkung angegeben.

### Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile

Jeder Anteil berechtigt den Inhaber zur Teilnahme und Ausübung seines Stimmrechts auf allen Hauptversammlungen des ICAV und zu gleichen Teilen am Gewinn und am Vermögen des Teilfonds, auf den sich die Anteile beziehen, zu partizipieren, jeweils vorbehaltlich etwaiger Differenzen hinsichtlich der für verschiedene Klassen geltenden Gebühren, Kosten und Aufwendungen. Jeder Inhaber hat eine Stimme je gehaltenem Anteil. Die Haftung des Inhabers beschränkt sich auf den Betrag, der gegebenenfalls für die von ihnen gehaltenen Anteile nicht gezahlt wurde, und die Inhaber haften nicht für die Schulden des Teilfonds. Die Mindestbeträge für die Auflegung und Rücknahme von Anteilen sind in der entsprechenden Ergänzung für jeden Teilfonds angegeben.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert je Anteil zum 30. Juni 2024 stellen sich wie folgt dar:

	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF* EUR Ausschüttende Anteile	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Thesaurierend Anteile	Franklin European Equity UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	100.000	2.350.000	1.600.000	-	18.530.000	1.917.016	150.000
Ausgegebene Anteile .....	-	-	100.000	470.000	3.723.211	1.616.279	
Zurückgekaufte Anteile .....	-	(500.000)	(100.000)	-	(9.801.430)	(1.177.097)	(150.000)
Ausgegebene Anteile am Ende des Jahres .....	100.000	1.850.000	1.600.000	470.000	12.451.781	2.356.198	-
Nettoinventarwert .....	3.760.255	51.197.640	43.868.029	12.162.044	316.426.047	62.225.118	-
Nettoinventarwert je Anteil .....	37,60	27,67	27,42	25,88	25,41	26,41	-
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	-	-	2.711.124	11.931.751	94.815.094	42.347.566	
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	-	(13.669.924)	(2.449.599)	-	(248.374.493)	(30.051.518)	(5.166.147)

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert je Anteil zum 30. Juni 2024 stellen sich wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE China UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Developed World UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE India UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	1.900.000	500.000	1.300.000	11.800.000	-	7.750.000	14.100.000
Ausgegebene Anteile .....	1.250.000	1.750.000	300.000	15.400.000	300.000	12.700.000	10.600.000
Zurückgekaufte Anteile .....	(800.000)	-	(300.000)	(2.400.000)	-	(200.000)	(1.400.000)
Ausgegebene Anteile am Ende des Jahres .....	2.350.000	2.250.000	1.300.000	24.800.000	300.000	20.250.000	23.300.000
Nettoinventarwert .....	63.998.684	56.305.246	30.351.189	535.151.859	7.553.040	927.416.103	815.851.401
Nettoinventarwert je Anteil .....	27,23	25,02	23,35	21,58	25,18	45,80	35,02
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	32.140.351	42.328.451	7.684.648	322.364.883	7.543.092	521.251.082	349.815.329
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	(20.581.115)	-	(7.454.179)	(51.631.697)	-	(7.957.989)	(41.942.557)

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert je Anteil zum 30. Juni 2024 stellen sich wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Future of Food UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	200.000	-	-	800.000	1.600.000	800.000	200.000
Ausgegebene Anteile .....	300.000	100.000	100.000	-	100.000	100.000	-
Zurückgekaufte Anteile .....	(100.000)	-	-	(300.000)	(300.000)	(600.000)	-
Ausgegebene Anteile am Ende des Jahres .....	400.000	100.000	100.000	500.000	1.400.000	300.000	200.000
Nettoinventarwert .....	12.576.463	2.379.202	2.620.602	19.325.549	47.111.594	5.209.168	5.455.383
Nettoinventarwert je Anteil .....	31,44	23,79	26,21	38,65	33,65	17,36	27,28
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	7.799.592	2.490.972	2.469.142	-	3.378.908	2.086.487	-
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	(2.775.006)	-	-	(10.071.837)	(8.749.097)	(10.792.004)	-

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert je Anteil zum 30. Juni 2024 stellen sich wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF* EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF* EUR Thesaurierende Anteile	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	-	4.350.000	900.000	11.890.000	-	-	2.700.000
Ausgegebene Anteile .....	1.800.000	4.000.000	500.000	7.210.000	1.160.000	2.140.000	1.550.000
Zurückgekaufte Anteile .....	-	(650.000)	(100.000)	(5.020.000)	-	(40.000)	(2.500.000)
Ausgegebene Anteile am Ende des Jahres .....	1.800.000	7.700.000	1.300.000	14.080.000	1.160.000	2.100.000	1.750.000
Nettoinventarwert .....	48.739.233	349.555.212	49.036.194	321.539.169	30.344.262	55.707.046	96.270.236
Nettoinventarwert je Anteil .....	27,08	45,40	37,72	22,84	26,16	26,53	55,01
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	47.876.346	162.134.612	17.045.485	163.805.205	29.182.468	55.818.885	79.145.290
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	-	(25.292.126)	(3.638.828)	(112.251.289)	-	(1.057.459)	(133.338.532)

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert je Anteil zum 30. Juni 2024 stellen sich wie folgt dar: (Fortsetzung)

	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	400.000
Ausgegebene Anteile .....	200.000
Zurückgekaufte Anteile .....	(200.000)
Ausgegebene Anteile am Ende des Jahres .....	400.000
Nettoinventarwert .....	9.358.986
Nettoinventarwert je Anteil .....	23,40
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	4.666.644
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	(4.722.493)

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

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

	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF** EUR Thesaurierende Anteile	Franklin European Equity UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	-	1.200.000	1.400.000	26.920.000	-	200.000	1.250.000
Ausgegebene Anteile .....	100.000	1.750.000	200.000	7.170.000	2.005.887	50.000	750.000
Zurückgekaufte Anteile .....	-	(600.000)	-	(15.560.000)	(88.871)	(100.000)	(100.000)
Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile .....	100.000	2.350.000	1.600.000	18.530.000	1.917.016	150.000	1.900.000
Nettoinventarwert .....	2.909.471	62.138.093	38.245.227	463.551.668	47.956.609	5.034.077	46.531.029
Nettoinventarwert je Anteil .....	29,09	26,44	23,90	25,02	25,02	33,56	24,49
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	2.385.366	42.482.473	4.700.126	179.687.680	50.703.225	1.556.647	18.829.312
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	-	(15.733.964)	-	(389.382.773)	(2.246.477)	(3.218.221)	(2.538.367)

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2022 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilsklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

\*\* Die Anteilsklasse wurde im Laufe des Geschäftsjahres aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Informationen zum Auflegungsdatum dieser Anteilsklasse finden Sie in Anmerkung 15.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

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

	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	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 Global Equity SRI UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	250.000	1.400.000	9.000.000	4.050.000	10.200.000	100.000	800.000
Ausgegebene Anteile .....	250.000	300.000	4.600.000	3.800.000	4.200.000		400.000
Zurückgekaufte Anteile .....	-	(400.000)	(1.800.000)	(100.000)	(300.000)	100.000-	(400.000)
Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile .....	500.000	1.300.000	11.800.000	7.750.000	14.100.000	200.000	800.000
Nettoinventarwert .....	10.471.174	32.741.984	261.731.948	265.253.700	449.724.207	4.679.824	28.261.914
Nettoinventarwert je Anteil .....	20,94	25,19	22,18	34,22	31,90	23,40	35,33
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	5.046.944	6.298.521	107.267.570	125.823.559	124.570.167	2.357.249	12.758.923
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	-	(8.650.643)	(47.269.211)	(3.343.507)	(8.789.923)	-	(13.441.691)

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

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

	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	1.400.000	100.000	-	3.700.000	500.000	3.740.000	2.250.000
Ausgegebene Anteile .....	400.000	700.000	200.000	2.150.000	400.000	9.530.000	900.000
Zurückgekaufte Anteile .....	(200.000)	-	-	(1.500.000)	-	(1.380.000)	(450.000)
Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile .....	1.600.000	800.000	200.000	4.350.000	900.000	11.890.000	2.700.000
Nettoinventarwert .....	47.578.786	16.206.086	5.078.124	155.787.778	30.278.221	258.827.787	128.590.716
Nettoinventarwert je Anteil .....	29,74	20,26	25,39	35,81	33,64	21,77	47,63
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	11.580.847	15.327.820	4.962.663	67.841.349	12.497.982	209.508.367	39.525.865
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	(5.976.401)	-	-	(45.129.558)	-	(30.073.807)	(20.550.680)

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

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

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

	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	550.000
Ausgegebene Anteile .....	-
Zurückgekaufte Anteile .....	(150.000)
Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile .....	400.000
Nettoinventarwert .....	9.339.124
Nettoinventarwert je Anteil .....	23,35
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	-
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	(3.537.116)



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

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

	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin European Equity UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	-	1.400.000	2.390.000	300.000	900.000	250.000	900.000
Ausgegebene Anteile .....	1.200.000	-	24.530.000	-	550.000	-	900.000
Zurückgekaufte Anteile .....	-	-	-	(100.000)	(200.000)	-	(400.000)
Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile .....	1.200.000	1.400.000	26.920.000	200.000	1.250.000	250.000	1.400.000
Nettoinventarwert .....	29.851.589	31.528.323	672.845.051	5.839.568	31.034.287	5.144.978	27.282.986
Nettoinventarwert je Anteil .....	24,88	22,52	24,99	29,20	24,83	20,58	19,49
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	30.300.000	-	616.091.440	-	14.325.318	-	18.922.112
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	-	-	-	(3.070.358)	(5.195.223)	-	(8.576.144)

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

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

	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 Global Equity SRI UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	5.000.000	2.250.000	14.900.000	-	600.000	1.200.000	-
Ausgegebene Anteile .....	5.200.000	1.800.000	700.000	100.000	200.000	2.200.000	100.000
Zurückgekaufte Anteile .....	(1.200.000)	-	(5.400.000)	-	-	(2.000.000)	-
Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile .....	9.000.000	4.050.000	10.200.000	100.000	800.000	1.400.000	100.000
Nettoinventarwert .....	241.165.019	122.416.418	291.261.525	2.082.954	25.222.243	40.334.173	2.578.067
Nettoinventarwert je Anteil .....	26,80	30,23	28,56	20,83	31,53	28,81	25,78
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	158.463.210	58.959.850	28.153.790	2.559.376	7.062.064	74.124.771	2.419.917
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	(33.146.387)	-	(212.249.826)	-	-	(63.453.318)	-

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

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

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

	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Ausgegebene Anteile zu Jahresbeginn .....	1.350.000	300.000	4.060.000	2.400.000	600.000
Ausgegebene Anteile .....	2.850.000	300.000	1.720.000	450.000	200.000
Zurückgekaufte Anteile .....	(500.000)	(100.000)	(2.040.000)	(600.000)	(250.000)
Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile .....	3.700.000	500.000	3.740.000	2.250.000	550.000
Nettoinventarwert .....	109.374.448	14.243.032	83.936.003	94.049.290	13.105.918
Nettoinventarwert je Anteil .....	29,56	28,49	22,44	41,80	23,83
Aufgelegte Anteile im Laufe des Jahres .....	102.998.326	9.755.364	43.005.516	20.311.209	5.636.533
Rücknahmen im Laufe des Jahres .....	(17.251.071)	(2.816.118)	(51.604.984)	(27.193.585)	(7.104.476)

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 4. Nettogewinne/(-verluste) aus Investitionstätigkeit

Jahreszeitraum bis zum 30. Juni 2024	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF* EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR
Gewinn- und Verlustaufstellung:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	571.769	362.499	(1.445.481)	98.122	(321.509)	495.190	1.942.392
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) von Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	271.968	(557.329)	5.342.598	168.221	6.534.544	(363.344)	4.103.448
Nettogewinne/(-verluste) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	843.737	(194.830)	3.897.117	266.343	6.213.035	131.846	6.045.840

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Jahreszeitraum bis zum 30. Juni 2024	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE Developed World UCITS ETF* USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD
Gewinn- und Verlustaufstellung:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	11.526	125.019	(20.994.647)	2.623	3.720.217	(5.915.592)	449.519
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) von Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	3.323.885	(4.894.172)	13.850.590	5.406	162.758.426	55.923.470	2.304.889
Nettogewinne/(-verluste) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	3.335.411	(4.769.153)	(7.144.057)	8.029	166.478.643	50.007.878	2.754.408

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 4. Nettogewinn/(-verlust) aus Investitionstätigkeit (Fortsetzung)

Jahreszeitraum bis zum 30. Juni 2024	Franklin Future of Food UCITS ETF* USD	Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF* USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF* USD
Gewinn- und Verlustaufstellung:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	(27.977)	46.833	160.394	(702.208)	(2.886.584)	(99.107)	(14.635)
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) von Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	(129.225)	81.269	474.584	5.554.656	449.585	416.945	793.125
Nettogewinne/(-verluste) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	(157.202)	128.102	634.978	4.852.448	(2.436.999)	317.838	778.490

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Jahreszeitraum bis zum 30. Juni 2024	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF* EUR	Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF* EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Gewinn- und Verlustaufstellung:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	22.236.354	1.753.511	(7.666.438)	86.593	34.990	18.672.437	(520.420)
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) von Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	32.277.765	2.641.594	11.765.267	443.676	194.320	461.502	562.575
Nettogewinne/(-verluste) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	54.514.119	4.395.105	4.098.829	530.269	229.310	19.133.939	42.155

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 4. Nettogewinn/(-verlust) aus Investitionstätigkeit (Fortsetzung)

	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD
<b>Jahreszeitraum bis zum 30. Juni 2023</b>							
Gewinn- und Verlustaufstellung:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	128.279	515.828	(1.348.022)	(230.952)	347.000	(333.567)	(337.438)
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) von Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	391.945	2.315.596	1.422.857	41.990	272.992	(670.614)	228.810
Nettogewinne/(-verluste) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	520.224	2.831.424	74.835	(188.962)	619.992	(1.004.181)	(108.628)
	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 Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD
<b>Jahreszeitraum bis zum 30. Juni 2023</b>							
Gewinn- und Verlustaufstellung:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	(1.212.954)	(15.184.902)	151.271	(5.647.764)	(1.418)	337.495	(1.163.256)
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) von Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	6.239.182	(28.929.757)	21.035.071	40.630.869	141.058	2.643.495	2.845.756
Nettogewinne/(-verluste) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	5.026.228	(44.114.659)	21.186.342	34.983.105	139.640	2.980.990	1.682.500

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 4. Nettogewinn/(-verlust) aus Investitionstätigkeit (Fortsetzung)

	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
<b>Jahreszeitraum bis zum 30. Juni 2023</b>							
Gewinn- und Verlustaufstellung:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	(221.586)	14.905	(10.671.448)	(178.495)	(3.517.589)	2.710.423	(1.420.636)
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) von Kapitalanlagen und Fremdwährungen .....	(1.590.965)	68.192	32.960.541	3.128.343	(3.935.415)	10.621.167	1.131.911
Nettogewinne/(-verluste) aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten/Verbindlichkeiten .....	(1.812.551)	83.097	22.289.093	2.949.848	(7.453.004)	13.331.590	(288.725)

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 5. Betriebliche Aufwendungen

### a) Gesamtkostenquote („TER“)

Sämtliche in Bezug auf einen Teilfonds fälligen Gebühren und Auslagen werden über eine einzige Gebühr gezahlt. Dies wird als die Gesamtkostenquote („TER“) bezeichnet. Die folgenden Gebühren und Auslagen werden über die TER beglichen:

- die Gebühren und Auslagen des Managers, Abschlussprüfers, Anlageverwalters (einschließlich die Kosten und Auslagen eines Anlageberaters, der vom Anlageverwalter bestellt wird), Rechtsberaters, Secretary, Verwalters und der Verwahrstelle sowie Honorare der Verwaltungsratsmitglieder (Einzelheiten zu gezahlten Honoraren finden Sie auf Seite 97)
- die Kosten für die Registrierung eines Teilfonds zum Verkauf in einem Land, die Notierung von Anteilen und die Aufrechterhaltung der Notierung an einer notierende Börse
- die Kosten für die Einberufung und Abhaltung von Sitzungen des Verwaltungsrats und der Anteilinhaber
- die Honorare und Auslagen für rechtliche und andere Beratungsdienste
- die Kosten und Auslagen für die Erstellung, den Druck, die Veröffentlichung und Verteilung von Verkaufsprospekten, Nachträgen, Jahres- und Halbjahresberichten und anderen Dokumenten für Anleger und Anlageinteressenten
- die Kosten und Auslagen für die Lizenzierung oder sonstige Gebühren, die an einen Indexanbieter oder sonstigen Lizenzgeber von geistigem Eigentum, Warenzeichen oder Dienstleistungsmarken, die vom ICAV verwendet werden, zu entrichten sind
- die Gebühren einer lokalen Zahl-, Zentralisierungs-, Register- oder ähnlichen Stelle (die marktüblichen Gebühren entsprechen müssen)
- sämtliche Gründungskosten des Fonds und der Teilfonds, und
- alle sonstigen Kosten und Auslagen (außer Einmal- und Sonderkosten und -auslagen), die bisweilen entstehen können und vom Verwaltungsrat als notwendig oder zweckmäßig für den weiteren Betrieb des ICAV oder eines Teilfonds genehmigt werden

Die TER erstreckt sich nicht auf Sonderkosten und gewisse Transaktionskosten (einschließlich, jedoch ohne Beschränkung auf, Transaktionsgebühren, Stempelabgaben oder sonstige Steuern auf die Anlagen des Teilfonds, einschließlich Abgaben und Gebühren für Portfolioumschichtungen, Quellensteuern, bezüglich der Anlagen des Teilfonds angefallene Provisionen und Vermittlungsgebühren, Zinsen auf Kredite und Bankgebühren für die Aushandlung, Bereitstellung oder Änderung der Bedingungen für solche Kredite, von Intermediären berechnete Provisionen im Zusammenhang mit einer Anlage im Teilfonds sowie Sonder- oder außerordentliche Kosten und Auslagen (falls zutreffend), die bisweilen entstehen können, darunter wesentliche Rechtsstreitigkeiten bezüglich eines Teilfonds oder des Fonds), die bisweilen entstehen können und die separat aus dem Vermögen des jeweiligen Teilfonds gezahlt werden. Je nach geltenden Gesetzen und Bestimmungen kann der Manager oder Anlageverwalter einen Teil oder sämtliche seiner Gebühren an eine Person zahlen, die im ICAV investiert oder Dienstleistungen für den ICAV oder hinsichtlich eines Teilfonds erbringt.

Die TER wird täglich auf Basis des Nettoinventarwerts jedes Teilfonds berechnet. Sie fällt täglich an und ist monatlich nachträglich zu entrichten. Die TER jedes Teilfonds des ICAV ist im jeweiligen Nachtrag aufgeführt. Wenn die Auslagen eines Teilfonds die TER in Bezug auf den Betrieb des jeweiligen Teilfonds überschreiten, trägt der Manager den Fehlbetrag aus seinem eigenen Vermögen.



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 5. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

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

Die für die einzelnen Teilfonds zu zahlende TER ist nachstehend aufgeführt.

Teilfonds	Anteilsklasse	TER	TER
		(% des Nettoinventarwerts) 30. Juni 2024	(% des Nettoinventarwerts) 30. Juni 2023
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,30%	0,30%
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,35%	0,35%
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,45%	0,45%
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF*	EUR Ausschüttende Anteile	0,15%**	-
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR Ausschüttende Anteile	0,15%***	0,05%
	EUR Thesaurierende Anteile	0,15%***	0,05%
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	EUR Ausschüttende Anteile	0,25%	0,25%
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,14%****	0,40%
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,19%	0,19%
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,19%	0,19%
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF*	USD Thesaurierende Anteile	0,09%	-
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,19%	0,19%
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,09%	0,09%
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,19%	0,19%
Franklin Future of Food UCITS ETF*	USD Thesaurierende Anteile	0,30%	-
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF*	USD Thesaurierende Anteile	0,30%	-
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,30%*****	0,40%
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	USD Ausschüttende Anteile	0,30%*****	0,45%
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,22%	0,22%
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,18%	0,18%
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF*	USD Thesaurierende Anteile	0,27%	-
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,07%	0,07%
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR Thesaurierende Anteile	0,15%	0,15%
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	EUR Thesaurierende Anteile	0,18%*****	0,18%
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF*	EUR Thesaurierende Anteile	0,18%*****	-
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF*	EUR Thesaurierende Anteile	0,18%*****	-
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD Thesaurierende Anteile	0,25%	0,25%
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD Ausschüttende Anteile	0,35%	0,35%

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilsklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

\*\* Für die TER gilt ein Gebührenverzicht von 0,03 %. Der TER-Gebührenverzicht gilt bis zum 1. November 2024.

\*\*\* Die TER stieg am 1. Januar 2024 von 0,05 % auf 0,15 %.

\*\*\*\* Die TER stieg am 1. Dezember 2023 von 0,40 % auf 0,14 %.

\*\*\*\*\* Die TER sank am 1. August 2023 von 0,40 % auf 0,30 %.

\*\*\*\*\* Die TER sank am 1. August 2023 von 0,45 % auf 0,30 %.

\*\*\*\*\* Für die TER gilt ein Gebührenverzicht von 0,12 %. Der TER-Gebührenverzicht lief am 1. Januar 2025 aus.

\*\*\*\*\* Für die TER gilt ein Gebührenverzicht von 0,07 %. Der TER-Gebührenverzicht gilt bis zum 1. November 2024.

\*\*\*\*\* Für die TER gilt ein Gebührenverzicht von 0,02 %. Der TER-Gebührenverzicht gilt bis zum 1. November 2024.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 5. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

### Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

In dem am 30. Juni 2024 endenden Jahr erhielten die Verwaltungsratsmitglieder Honorare in Höhe von 54.104 EUR (30. Juni 2023: EUR 88.293). Diese Honorare wurden bereits bezahlt. Die Franklin Templeton-Gruppe stellt Mitarbeiter zur Verfügung, die als Verwaltungsratsmitglieder des ICAV fungieren (diese Verwaltungsratsmitglieder erhalten kein Honorar).

### Honorar des unabhängigen Wirtschaftsprüfers

Das Honorar für alle von der Abschlussprüfungsgesellschaft für das am 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 endende Jahr durchgeführten Arbeiten stellt sich wie folgt dar:

	30. Juni 2024 EUR	30. Juni 2023 EUR
Gesetzliche Abschlussprüfung	245.535	175.780
Gesamt	245.535	175.780

Die in der obigen Tabelle aufgeführten Honorare für die gesetzliche Abschlussprüfung verstehen sich zuzüglich Mehrwertsteuer und einschließlich Auslagen. Es wurden keine Honorare für andere Bestätigungsleistungen oder andere prüfungsfremde Leistungen für das laufende Geschäftsjahr oder das vorangegangene Geschäftsjahr in Rechnung gestellt.

### Transaktionskosten

Transaktionskosten sind alle Gebühren und Aufwendungen, die beim Kauf und Verkauf der von den Teilfonds gehaltenen Anlagen anfallen, z. B. Maklerkosten und -provisionen sowie Korrespondenzgebühren für die Übertragung von Wertpapieren oder Anlagen oder sonstigen Beteiligungen, sofern in den entsprechenden Ergänzungen zum Verkaufsprospekt nichts anderes angegeben ist.

Die Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe von Aktienanlagen und andere Terminkontrakte im Laufe des Jahres sind im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten in der Gesamtergebnisrechnung enthalten. Die Transaktionskosten beim Kauf und Verkauf von Unternehmensanleihen und Staatsanleihen sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Sie können nicht praktisch oder zuverlässig erfasst werden, da sie in den Kosten der Anlage eingepreist sind und nicht separat geprüft oder ausgewiesen werden können. Separat ausgewiesene Transaktionskosten der Verwahrstelle werden von der Verwaltungsgesellschaft über die TER der Teilfonds des ICAV getragen.

In den Teilfonds sind in den Jahren bis zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 insgesamt folgende Transaktionskosten entstanden:

Teilfonds	Währung	30. Juni 2024 Kosten	30. Juni 2023 Kosten
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	USD	156	597
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	-	-
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	7.521	8.013
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF*	EUR	150	-
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	6.316	12.863
Franklin European Equity UCITS ETF	EUR	458	666
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	EUR	3.948	2.296
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	USD	9.891	1.836
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	6.970	6.794
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	71.722	36.689
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF*	USD	301	-
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	121.958	31.170
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	84.540	42.087
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	3.073	681
Franklin Future of Food UCITS ETF*	USD	252	-
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF*	USD	340	-
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	1.783	3.964
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	USD	4.005	4.327
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	3.562	3.813

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 5. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

### Transaktionskosten (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	30. Juni 2024	30. Juni 2023
		Kosten	Kosten
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	407	3.369
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF*	USD	2.874	-
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	8.326	6.817
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	2.065	1.564
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	1.482	1.550
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF*	EUR	248	-
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF*	EUR	413	-
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	9.770	2.665
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	-	-

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

## 6. Risikomanagementrichtlinien und Offenlegung

### Einführung und Überblick

Jeder Teilfonds von Franklin Templeton ICAV ist bei der Verfolgung seines erklärten Anlageziels und seiner Anlagepolitik einer Reihe finanzieller Risiken ausgesetzt, wie z. B. dem Kredit- und Kontrahentenrisiko, dem Liquiditätsrisiko und dem Marktrisiko (das wiederum das Währungsrisiko, das Zinsrisiko und das Kursrisiko umfasst). Das ICAV geht bestimmte dieser Risiken ein, um mit seinem Portfolio Anlagerenditen zu erzielen, wenngleich diese Risiken auch zu einer Verringerung des Nettovermögens des ICAV führen können. Der Anlageverwalter wird sich nach besten Kräften bemühen, die potenziell nachteiligen Auswirkungen dieser Risiken auf die Wertentwicklung der Teilfonds zu minimieren, soweit dies möglich ist, und gleichzeitig die Anlagen der Teilfonds in einer Weise verwalten, die mit dem Anlageziel und der Anlagepolitik der Teilfonds vereinbar ist.

Die Fähigkeit eines indexnachbildenden Teilfonds (Franklin und FTSE-Kategorien der Franklin-Teilfonds), eine signifikante Korrelation zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und des von ihm nachgebildeten Index zu erzielen, kann durch Veränderungen an den Wertpapiermärkten, Veränderungen in der Zusammensetzung des Index, Geldflüsse in den und aus dem Teilfonds sowie die Gebühren und Aufwendungen des Teilfonds beeinträchtigt werden. Der Teilfonds ist bestrebt, die Renditen des Index nachzubilden, unabhängig von der aktuellen oder prognostizierten Performance des Index oder der im Index enthaltenen Wertpapiere. Infolgedessen kann die Wertentwicklung des Teilfonds weniger günstig ausfallen als die eines Portfolios, das mit einer aktiven Anlagestrategie verwaltet wird. Die Struktur und die Zusammensetzung des Index wirken sich auf die Wertentwicklung, die Volatilität und das Risiko des Index (in absoluten Zahlen und im Vergleich zu anderen Indizes) und folglich auch auf die Wertentwicklung, die Volatilität und das Risiko des Teilfonds aus.

Bei Teilfonds, in denen Anlagen aktiv verwaltet werden (wie in den „Allgemeinen Informationen“ auf Seite 6 dargestellt), verwendet der Anlageverwalter einen Anlageansatz, der typischerweise Research wie etwa Fundamentalanalysen, mikro- und makroökonomische Analysen und/oder technische Analysen umfasst, anstatt zu versuchen, die Wertentwicklung eines Index zu erzielen, da er davon überzeugt ist, dass eine aktive Auswahl von Anlagen ein besseres Ergebnis liefern kann als eine Beteiligung am gesamten Markt. Diesen Teilfonds könnten Verluste entstehen, wenn sich das Urteil des Anlageverwalters in Bezug auf Märkte, die zukünftige Volatilität, Zinssätze, Branchen, Sektoren und Regionen oder die Attraktivität, relativen Werte, Liquidität, Effektivität oder potenzielle Wertsteigerung bestimmter für einen Teilfonds getätigter Anlagen als unzutreffend herausstellt.

Die Risikominderungstechniken, die bei indexnachbildenden Teilfonds angewandt werden, unterscheiden sich von denen, die traditionell bei aktiv verwalteten Teilfonds eingesetzt werden. Diese Teilfonds sind bestrebt, eine Rendite zu erzielen, die der Rendite eines Index oder einer maßgeschneiderten Benchmark entspricht oder diese nachbildet. Die indexnachbildenden Teilfonds werden nicht aktiv verwaltet und versuchen nicht, unter allen Marktbedingungen defensive Positionen einzunehmen. Daher wird ein Teilfonds mit Indexnachbildung durch einen allgemeinen Rückgang der durch seinen Index abgebildeten Wertpapiere und Anlageklassen negativ beeinflusst. Die Währungs- und Zinsrisiken werden ebenfalls durch den Index bestimmt. Die Wertentwicklung eines solchen Teilfonds mit Indexnachbildung könnte daher geringer ausfallen als die von Fonds, die ihr Portfoliovermögen aktiv verlagern können, um sich Marktchancen zunutze zu machen oder die Auswirkungen eines Marktabschwungs oder eines Wertverlusts bei einem oder mehreren Emittenten zu verringern.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko bezeichnet das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments oder seine künftigen Kapitalströme aufgrund von Änderungen der Kurs am Markt schwanken. Jeder Teilfonds, der Aktienanlagen hält, ist direkt von den Bewegungen der Marktkurse betroffen.

Das Management des Marktrisikos wird durch die Allokation und Diversifizierung der Vermögenswerte auf der Grundlage des Anlageziels des Teilfonds sowie durch den vom Anlageverwalter entwickelten Anlageprozess beeinflusst. Für die aktiv verwalteten Teilfonds umfasst dies ein gründliches Research sowie eine monatliche Analyse der investierten Unternehmen und der makroökonomischen Situation in den investierten Bereichen. Bei passiv verwalteten Teilfonds kann dies faktorbasierte oder gewichtsbezogene Diversifizierungsregeln beinhalten, die in den nachgebildeten Index integriert sind.

Das maximale Risiko, das sich aus einer Anlage in ein Finanzinstrument ergibt, wird durch den beizulegenden Zeitwert der Finanzinstrumente bestimmt, außer bei Short-Positionen in Derivaten und Wertpapieren, bei denen der Verlust potenziell unbegrenzt sein kann. Der Wert des Marktpreisrisikos, dem die Teilfonds zum 30. Juni 2024 und 2023 ausgesetzt sind, entspricht dem beizulegenden Zeitwert der Anlagen, wie er im Anlageportfolio des jeweiligen Teilfonds angegeben ist.

### Kurssensibilitätsanalyse

Wäre der Kurs jeder von den Teilfonds gehaltenen Aktienanlage zum 30. Juni 2024 um 10 % gestiegen (30. Juni 2023: 5 %), wobei alle anderen Variablen konstant blieben, hätte dies das Nettovermögen der Teilfonds wie in der nachstehenden Tabelle angegeben erhöht. Ein Rückgang um 10 % am 30. Juni 2024 (30. Juni 2023: 5 %) hätte einen gleichen und gegenteiligen Effekt auf den Wert des Teilfonds.

Teilfonds	Währung	30. Juni 2024	30. Juni 2023
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	USD	375.765	145.266
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	4.853.541	2.844.434
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	4.364.695	1.891.642
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF*	EUR	1.180.452	-
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	37.321.312	24.086.315
Franklin European Equity UCITS ETF**	EUR	-	250.438
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	EUR	6.321.282	2.301.628
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	USD	5.632.451	515.019
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	2.961.914	1.601.456
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	52.998.256	12.990.698
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF*	USD	754.751	-
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	93.331.528	13.352.743
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	81.322.051	22.387.403
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	1.250.447	230.934
Franklin Future of Food UCITS ETF*	USD	237.596	-
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF*	USD	261.819	-
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	1.927.953	1.406.391
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	USD	4.706.675	2.376.129
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	516.230	806.543
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	545.501	253.737
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF*	USD	4.869.863	-
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	34.928.960	7.776.956
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	4.888.670	1.511.235
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	31.849.289	12.508.841
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF*	EUR	2.841.884	-
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF*	EUR	5.532.362	-
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	9.602.381	6.421.619

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### Kursensibilitätsanalyse (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	30. Juni 2024	30. Juni 2023
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	923.755	460.422

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

\*\* Der Teilfonds wurde im Geschäftsjahr, das zum 30. Juni 2024 endete, aufgelöst. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

### b) Fremdwährungsrisiko

Das Fremdwährungsrisiko bezeichnet das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder künftige Kapitalströme eines Finanzinstruments aufgrund von Wechselkursschwankungen fluktuieren. Jeder Teilfonds ist einem Währungsrisiko ausgesetzt, da die monetären Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Teilfonds auf eine andere Währung als die Leitwährung der Teilfonds lauten können.

Die Schwankungen des Wechselkurses zwischen der Währung, auf die der Vermögenswert oder die Verbindlichkeit lautet, und der Leitwährung könnten zu einer Aufwertung oder Abwertung des beizulegenden Zeitwerts dieses Vermögenswerts führen.

Bei den aktiv verwalteten Teilfonds überwacht der Anlageverwalter das Währungsrisiko jedes Teilfonds regelmäßig, und der Anlageverwalter kann versuchen, dieses Risiko durch den Einsatz von Finanzderivaten zu mindern.

Bei passiven Strategien werden das Fremdwährungsengagement und das entsprechende Risiko durch Attributionsberichte beobachtet. Da die Strategien passiv sind, kann es keine Risikominderung geben. Das Fremdwährungsrisiko wird von Managern und Anteilsinhabern akzeptiert.

Ein Teilfonds kann Finanzderivate im Namen einer bestimmten Klasse einsetzen, um das Wechselkursrisiko der betreffenden Klasse teilweise oder gänzlich abzusichern. Ein Teilfonds, der das Wechselkursrisiko einer Klasse absichert, kann Devisenterminkontrakte abschließen, um das Wechselkursrisiko für die jeweilige Klasse ganz oder teilweise abzusichern. In dem Maße, in dem die Absicherung (Hedging) erfolgreich ist, wird sich die Wertentwicklung der betreffenden Klasse wahrscheinlich im Einklang mit der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Vermögenswerte entwickeln. Die Verwendung von abgesicherten Währungsklassen kann die Vorteile für die Inhaber der betreffenden Klassen erheblich einschränken, wenn die Währung jeder dieser Klassen gegenüber der Basiswährung und/oder der Währung, auf die die Vermögenswerte des Teilfonds lauten, fällt.

Das Fremdwährungsrisiko und die Währungssensibilitätsanalyse, die die ungefähre Erhöhung oder Verringerung des Nettovermögens, das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnbringender Anteile jedes relevanten Teilfonds zuzurechnen ist, wenn der Wechselkurs der Basiswährung um 5 % im Verhältnis zum Nicht-Basis-Exposure für jeden Teilfonds zum 30. Juni 2024 und 2023 steigt oder fällt, sind in den nachstehenden Tabellen für die Teilfonds mit wesentlichem Exposure aufgeführt.

Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungssensibilität USD
Australischer Dollar .....	4	14.693	14.697	735
Britisches Pfund .....	1	7.743	7.744	387
Kanadischer Dollar .....	65	30.977	31.042	1.552
Euro .....	29	83.287	83.316	4.166
Hongkong-Dollar .....	499	160.330	160.829	8.041
Japanischer Yen .....	-	60.438	60.438	3.022
Südkoreanischer Won .....	90	49.134	49.224	2.461
Schwedische Krone .....	43	19.655	19.698	985
Taiwan-Dollar .....	1.291	71.982	73.273	3.664
	2.022	498.239	500.261	25.013

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs-sensibilität USD
Euro .....	17.700.032	-	17.700.032	885.002
	17.700.032	-	17.700.032	885.002

Franklin Emerging Markets UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs-sensibilität USD
Brasilianischer Real .....	63.897	2.377.436	2.441.333	122.067
Chilenischer Peso .....	3.465	598.805	602.270	30.114
Chinesischer Yuan Renminbi .....	52.726	3.373.050	3.425.776	171.289
Tschechische Krone .....	11.881	262.472	274.353	13.718
Ägyptisches Pfund .....	-	104.792	104.792	5.240
Euro .....	13.205	641.215	654.420	32.721
Hongkong-Dollar .....	165.432	7.737.969	7.903.401	395.170
Ungarischer Forint .....	27.627	600.434	628.061	31.403
Indische Rupie .....	(235.931)	6.844.031	6.608.100	330.405
Indonesische Rupiah .....	12.317	1.115.234	1.127.551	56.378
Kuwait-Dinar .....	5.270	100.156	105.426	5.271
Malaysischer Ringgit .....	5.291	251.665	256.956	12.848
Mexikanischer Peso .....	2.162	1.250.567	1.252.729	62.636
Neue Türkische Lira .....	1.166	1.944.544	1.945.710	97.286
Philippinischer Peso .....	674	311.453	312.127	15.606
Polnischer Zloty .....	14.871	486.449	501.320	25.066
Katar-Rial .....	510	467.820	468.330	23.417
Russischer Rubel .....	143	-	143	7
Saudi-Riyal .....	8.380	2.099.996	2.108.376	105.419
Südafrikanischer Rand .....	6.279	1.341.324	1.347.603	67.380
Südkoreanischer Won .....	29.510	3.992.118	4.021.628	201.081
Taiwan-Dollar .....	14.588	4.980.498	4.995.086	249.754
Thailändischer Baht .....	501	812.236	812.737	40.637
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	3.298	909.218	912.516	45.626
	207.262	42.603.482	42.810.744	2.140.539

Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	Monetäre EUR	Nicht-monetäre EUR	Gesamt EUR	Währungs-sensibilität EUR
Britisches Pfund .....	81.677	11.376.034	11.457.711	572.886
Dänische Krone .....	67.765	4.053.981	4.121.746	206.087
Norwegische Krone .....	147.437	5.104.867	5.252.304	262.615
Schwedische Krone .....	-	1.302.543	1.302.543	65.127
Schweizer Franken .....	-	9.191.995	9.191.995	459.600
	296.879	31.029.420	31.326.299	1.566.315

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF</b>				
Chinesischer Yuan Renminbi .....	(20)	-	(20)	(1)
Euro .....	(1)	-	(1)	-
Hongkong-Dollar .....	33.513	3.731.872	3.765.385	188.269
Indische Rupie .....	(244.100)	18.578.561	18.334.461	916.723
Indonesische Rupiah .....	6.567	1.445.860	1.452.427	72.621
Malaysischer Ringgit .....	5.716	1.453.467	1.459.183	72.959
Philippinischer Peso .....	9.316	513.519	522.835	26.142
Singapur-Dollar .....	4.259	2.459.995	2.464.254	123.213
Südkoreanischer Won .....	52.190	10.267.057	10.319.247	515.962
Taiwan-Dollar .....	62.284	16.339.078	16.401.362	820.068
Thailändischer Baht .....	7.072	1.397.865	1.404.937	70.247
	(63.204)	56.187.274	56.124.070	2.806.203
<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>				
	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
Brasilianischer Real .....	376.865	16.882.381	17.259.246	862.962
Euro .....	107	-	107	5
	376.972	16.882.381	17.259.353	862.967
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>				
	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
Chinesischer Yuan Renminbi .....	(876.285)	98.892.472	98.016.187	4.900.809
Chinesischer Yuan Renminbi (Offshore) .....	1.184.060	-	1.184.060	59.203
Euro .....	237	-	237	12
Hongkong-Dollar .....	3.508.951	391.352.464	394.861.415	19.743.071
Singapur-Dollar .....	839	1.435.115	1.435.954	71.798
	3.817.802	491.680.051	495.497.853	24.774.893

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin FTSE Developed World UCITS ETF*	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
Australischer Dollar .....	123	153.689	153.812	7.691
Britisches Pfund .....	210	298.058	298.268	14.913
Kanadischer Dollar .....	142	190.105	190.247	9.512
Dänische Krone .....	-	69.970	69.970	3.499
Euro .....	61	620.527	620.588	31.029
Hongkong-Dollar .....	51	39.414	39.465	1.973
Japanischer Yen .....	505	491.199	491.704	24.585
Neuer israelischer Shekel .....	-	11.314	11.314	566
Neuseeland-Dollar .....	9	6.385	6.394	320
Norwegische Krone .....	-	12.343	12.343	617
Polnischer Zloty .....	7	7.039	7.046	352
Singapur-Dollar .....	-	24.403	24.403	1.220
Südkoreanischer Won .....	(408)	105.024	104.616	5.231
Schwedische Krone .....	-	64.049	64.049	3.202
Schweizer Franken .....	-	180.593	180.593	9.030
	700	2.274.112	2.274.812	113.740

Franklin FTSE India UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
Euro .....	507	-	507	25
Indische Rupie .....	(8.459.555)	933.315.279	924.855.724	46.242.786
	(8.459.048)	933.315.279	924.856.231	46.242.811

Franklin FTSE Korea UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
Euro .....	30	-	30	2
Südkoreanischer Won .....	2.260.146	813.220.514	815.480.660	40.774.033
	2.260.176	813.220.514	815.480.690	40.774.035



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
Euro .....	136	-	136	7
Taiwan-Dollar .....	59.724	12.504.465	12.564.189	628.209
	59.860	12.504.465	12.564.325	628.216

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin Future of Food UCITS ETF*</b>				
Australischer Dollar .....	9	24.134	24.143	1.207
Britisches Pfund .....	1.980	281.732	283.712	14.186
Kanadischer Dollar .....	58	89.636	89.694	4.485
Euro .....	57	280.297	280.354	14.018
Hongkong-Dollar .....	1.331	34.070	35.401	1.770
Japanischer Yen .....	806	211.129	211.935	10.597
Norwegische Krone .....	611	129.465	130.076	6.504
Schwedische Krone .....	12	26.567	26.579	1.329
Schweizer Franken .....	-	23.365	23.365	1.168
	4.864	1.100.395	1.105.259	55.264

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin Future of Health &amp; Wellness UCITS ETF*</b>				
Australischer Dollar .....	5	75.188	75.193	3.760
Britisches Pfund .....	86	122.045	122.131	6.107
Dänische Krone .....	90	141.241	141.331	7.067
Euro .....	142	270.502	270.644	13.532
Hongkong-Dollar .....	-	21.478	21.478	1.074
Japanischer Yen .....	612	60.171	60.783	3.039
Neuseeland-Dollar .....	2	11.407	11.409	570
Schweizer Franken .....	378	159.567	159.945	7.997
	1.315	861.599	862.914	43.146

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
Australischer Dollar .....	(1.447)	423.920	422.473	21.124
Brasilianischer Real .....	5.578	113.388	118.966	5.948
Britisches Pfund .....	8.543	1.181.990	1.190.533	59.527
Kanadischer Dollar .....	1.137	1.561.175	1.562.312	78.116
Chilenischer Peso .....	5	80.654	80.659	4.033
Chinesischer Yuan Renminbi .....	895	63.911	64.806	3.240
Kolumbianischer Peso .....	-	6.829	6.829	341
Tschechische Krone .....	260	18.356	18.616	931
Dänische Krone .....	7.786	320.572	328.358	16.418
Euro .....	15.666	1.607.750	1.623.416	81.171
Hongkong-Dollar .....	5.709	673.758	679.467	33.973
Ungarischer Forint .....	1.468	27.818	29.286	1.464
Indische Rupie .....	(5.299)	407.964	402.665	20.133
Indonesische Rupiah .....	258	11.548	11.806	590
Japanischer Yen .....	11.613	1.738.977	1.750.590	87.530
Malaysischer Ringgit .....	200	47.803	48.003	2.400
Mexikanischer Peso .....	6.806	143.807	150.613	7.531
Neuer israelischer Shekel .....	32	-	32	2
Neue Türkische Lira .....	-	27.724	27.724	1.386
Neuseeland-Dollar .....	1	-	1	-
Norwegische Krone .....	8.825	42.367	51.192	2.560
Philippinischer Peso .....	18	-	18	1
Polnischer Zloty .....	396	33.779	34.175	1.709
Katar-Rial .....	140	18.260	18.400	920
Singapur-Dollar .....	1	72.843	72.844	3.642
Südafrikanischer Rand .....	(664)	404.882	404.218	20.211
Südkoreanischer Won .....	(1.906)	507.392	505.486	25.274
Schwedische Krone .....	44	146.685	146.729	7.336
Schweizer Franken .....	(1.817)	597.125	595.308	29.765
Taiwan-Dollar .....	720	431.353	432.073	21.604
Thailändischer Baht .....	(1.572)	156.714	155.142	7.757
	63.396	10.869.344	10.932.740	546.637

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität USD</b>
Australischer Dollar .....	22	1.512.570	1.512.592	75.630
Brasilianischer Real .....	432	39.884	40.316	2.016
Britisches Pfund .....	80	950.424	950.504	47.525
Kanadischer Dollar .....	5.471	944.621	950.092	47.505
Chinesischer Yuan Renminbi .....	1.217	151.203	152.420	7.621
Dänische Krone .....	6.037	-	6.037	302
Euro .....	20.550	2.136.539	2.157.089	107.854
Hongkong-Dollar .....	8	312.032	312.040	15.602
Indische Rupie .....	(6.183)	873.971	867.788	43.389
Japanischer Yen .....	3.222	5.824.258	5.827.480	291.374
Malaysischer Ringgit .....	938	63.461	64.399	3.220
Neue Türkische Lira .....	12	181.852	181.864	9.093
Neuseeland-Dollar .....	13	143.480	143.493	7.175
Norwegische Krone .....	5.825	117.372	123.197	6.160
Katar-Rial .....	53	301.059	301.112	15.056
Saudi-Riyal .....	97	1.392.846	1.392.943	69.647
Schweizer Franken .....	234	4.536.478	4.536.712	226.836
Taiwan-Dollar .....	179	615.803	615.982	30.799
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	25	404.414	404.439	20.222
	<b>38.232</b>	<b>20.502.267</b>	<b>20.540.499</b>	<b>1.027.026</b>

<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität USD</b>
Chinesischer Yuan Renminbi .....	(528.528)	1.702.977	1.174.449	58.722
Chinesischer Yuan Renminbi (Offshore) .....	538.610	-	538.610	26.931
Hongkong-Dollar .....	18.891	2.957.049	2.975.940	148.797
	<b>28.973</b>	<b>4.660.026</b>	<b>4.688.999</b>	<b>234.450</b>

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
Brasilianischer Real .....	3.884	304.468	308.352	15.418
Chilenischer Peso .....	839	70.239	71.078	3.554
Chinesischer Yuan Renminbi .....	3.020	303.860	306.880	15.344
Kolumbianischer Peso .....	-	2.978	2.978	149
Tschechische Krone .....	264	22.314	22.578	1.129
Euro .....	66	28.981	29.047	1.452
Hongkong-Dollar .....	5.717	741.353	747.070	37.354
Ungarischer Forint .....	755	22.278	23.033	1.152
Indische Rupie .....	(39.469)	1.179.155	1.139.686	56.984
Indonesische Rupiah .....	828	32.307	33.135	1.657
Kuwait-Dinar .....	587	18.855	19.442	972
Malaysischer Ringgit .....	1.535	44.699	46.234	2.312
Mexikanischer Peso .....	1.559	166.004	167.563	8.378
Neue Türkische Lira .....	91	18.524	18.615	931
Philippinischer Peso .....	822	1.750	2.572	129
Polnischer Zloty .....	684	148.673	149.357	7.468
Katar-Rial .....	137	31.520	31.657	1.583
Saudi-Riyal .....	957	277.958	278.915	13.946
Südafrikanischer Rand .....	775	176.726	177.501	8.875
Südkoreanischer Won .....	393	515.156	515.549	25.777
Taiwan-Dollar .....	7.846	1.101.516	1.109.362	55.468
Thailändischer Baht .....	17	105.224	105.241	5.262
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate .....	-	4.988	4.988	249
	(8.693)	5.319.526	5.310.833	265.543

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF*</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität USD</b>
Australischer Dollar .....	1.257	776.333	777.590	38.880
Britisches Pfund .....	8.653	1.418.443	1.427.096	71.355
Kanadischer Dollar .....	2.915	1.779.407	1.782.322	89.116
Dänische Krone .....	184	254.233	254.417	12.721
Euro .....	3.770	6.064.433	6.068.203	303.410
Hongkong-Dollar .....	673	406.924	407.597	20.380
Japanischer Yen .....	1.775	2.593.210	2.594.985	129.749
Neuer israelischer Shekel .....	89	31.662	31.751	1.588
Neuseeland-Dollar .....	85	51.647	51.732	2.587
Norwegische Krone .....	432	121.728	122.160	6.108
Singapur-Dollar .....	140	297.802	297.942	14.897
Schwedische Krone .....	134	748.404	748.538	37.427
Schweizer Franken .....	224	1.295.851	1.296.075	64.804
	<b>20.331</b>	<b>15.840.077</b>	<b>15.860.408</b>	<b>793.022</b>

<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität USD</b>
Euro .....	446	-	446	22
	<b>446</b>	<b>-</b>	<b>446</b>	<b>22</b>

<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Monetäre EUR</b>	<b>Nicht-monetäre EUR</b>	<b>Gesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensibilität EUR</b>
Britisches Pfund .....	24.941	9.104.925	9.129.866	456.493
Dänische Krone .....	7.961	3.822.238	3.830.199	191.510
Norwegische Krone .....	3.946	229.646	233.592	11.680
Polnischer Zloty .....	75	47.154	47.229	2.361
Schwedische Krone .....	1.417	1.597.637	1.599.054	79.953
Schweizer Franken .....	1.997	7.618.506	7.620.503	381.025
US-Dollar .....	4.746	-	4.746	237
	<b>45.083</b>	<b>22.420.106</b>	<b>22.465.189</b>	<b>1.123.259</b>

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	Monetäre EUR	Nicht- monetäre EUR	Devisentermin- geschäfte EUR	Gesamt EUR	Währungs- sensibilität EUR
Britisches Pfund .....	23.147.476	-	(23.060.311)	87.165	4.358
	23.147.476	-	(23.060.311)	87.165	4.358

Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF*	Monetäre EUR	Nicht- monetäre EUR	Devisentermin- geschäfte EUR	Gesamt EUR	Währungs- sensibilität EUR
Britisches Pfund .....	295.105	-	(271.035)	24.070	1.204
	295.105	-	(271.035)	24.070	1.204

Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF*	Monetäre EUR	Nicht- monetäre EUR	Devisentermin- geschäfte EUR	Gesamt EUR	Währungs- sensibilität EUR
Britisches Pfund .....	3.088.709	-	(3.112.182)	(23.473)	(1.174)
US-Dollar .....	153	-	-	153	8
	3.088.862	-	(3.112.182)	(23.320)	(1.166)

Franklin U.S. Equity UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
Euro .....	809	-	809	40
	809	-	809	40

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>				
Euro .....	68	-	68	3
	68	-	68	3

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Details finden Sie unter Teilfonds und Anteilsklassen in den Allgemeinen Informationen.

Zum 30. Juni 2024 waren der Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF und der Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF keinem Fremdwährungsrisiko ausgesetzt, weshalb für diese Teilfonds keine Daten vorgelegt werden.

Die Teilfonds, die zum 30. Juni 2023 ein wesentliches Fremdwährungsrisiko aufweisen, sind in den nachstehenden Tabellen aufgeführt:

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF</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
	2.560	546.854	549.414	27.471

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>				
Euro .....	23.483.827	-	23.483.827	1.174.191
	23.483.827	-	23.483.827	1.174.191

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin Emerging Markets UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht- monetäre USD	Devisentermin- geschäfte USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
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	394.839
Ungarischer 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
Kuwait-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 Zloty .....	7.071	355.868	-	362.939	18.147
Katar-Rial .....	140	447.671	-	447.811	22.391
Russischer Rubel .....	138	-	-	138	7
Saudi-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	1.857.247

Franklin European Equity UCITS ETF	Monetäre EUR	Nicht-monetäre EUR	Gesamt EUR	Währungs- sensibilität EUR
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
	14.977	2.407.699	2.422.676	121.134



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>	<b>Monetäre EUR</b>	<b>Nicht-monetäre EUR</b>	<b>Gesamt EUR</b>	<b>Währungs- sensibilität EUR</b>
Britisches Pfund .....	27.537	10.812.753	10.840.290	542.017
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	1.092.660

<b>Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität 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

<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität USD</b>
Brasilianischer Real .....	240.886	19.200.288	19.441.174	972.059
Euro .....	109	-	109	5
	240.995	19.200.288	19.441.283	972.064

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität 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
	(2.521.518)	246.604.075	244.082.557	12.204.128

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>				
Euro .....	199	-	199	10
Indische Rupie .....	(8.853.016)	267.054.868	258.201.852	12.910.093
	(8.852.817)	267.054.868	258.202.051	12.910.103

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>				
Euro .....	62.683	-	62.683	3.134
Südkoreanischer Won .....	1.648.939	447.748.053	449.396.992	22.469.850
	1.711.622	447.748.053	449.459.675	22.472.984

	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität USD
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
Taiwan-Dollar .....	58.607	4.618.673	4.677.280	233.864
	58.607	4.618.673	4.677.280	233.864

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Gesamt USD	Währungs- sensibilität 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	129.928
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	134.912
Hongkong-Dollar .....	4.661	746.640	751.301	37.565
Ungarischer 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	131.499
Kuwait-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 Shekel .....	33	-	33	2
Neue Türkische Lira .....	10	13.455	13.465	673
Neuseeland-Dollar .....	1	-	1	-
Norwegische Krone .....	7.279	154.816	162.095	8.105
Philippinischer Peso .....	19	-	19	1
Katar-Rial .....	213	32.430	32.643	1.632
Saudi-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	823.642

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität 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
Kuwait-Dinar .....	13	-	13	1
Malaysischer Ringgit .....	549	57.247	57.796	2.890
Neue Türkische Lira .....	-	64.453	64.453	3.223
Neuseeland-Dollar .....	1	168.293	168.294	8.415
Norwegische Krone .....	3.985	100.521	104.506	5.225
Katar-Rial .....	-	234.735	234.735	11.737
Saudi-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	215.313
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>1.200.854</b>

<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>Monetäre USD</b>	<b>Nicht-monetäre USD</b>	<b>Gesamt USD</b>	<b>Währungs- sensibilität 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	509.651
	<b>53.616</b>	<b>15.124.698</b>	<b>15.178.314</b>	<b>758.914</b>

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	Monetäre USD	Nicht-monetäre USD	Devisentermingeschäfte USD	Gesamt USD	Währungs-sensibilität 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
Ungarischer 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
Kuwait-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 Zloty .....	67	83.056	-	83.123	4.156
Katar-Rial .....	12	33.839	440	34.291	1.715
Saudi-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

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Monetäre EUR	Nicht-monetäre EUR	Gesamt EUR	Währungs-sensibilität EUR
Britisches Pfund .....	14.847	5.469.006	5.483.853	274.194
Dänische Krone .....	1.737	2.246.000	2.247.737	112.387
Norwegische Krone .....	3.090	117.110	120.200	6.010
Polnischer Zloty .....	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
	21.672	13.179.686	13.201.358	660.070

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	Monetäre EUR	Nicht- monetäre EUR	Devisentermin- geschäfte EUR	Gesamt EUR	Währungs- sensibilität EUR
Britisches Pfund .....	10.292.505	-	(10.381.502)	(88.997)	(4.450)
	10.292.505	-	(10.381.502)	(88.997)	(4.450)

Per 30. Juni 2022 hatten 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 keine Exposition in Fremdwährungsrisiken, daher sind für diese Fonds keine Daten ausgewiesen.

Die nachstehende Tabelle analysiert die Devisenterminkontrakte des Teilfonds, die auf Brutto-Basis in relevanten Fälligkeitsgruppierungen abgerechnet werden, und zwar auf Grundlage des verbleibenden Zeitraums bis zum vertraglichen Fälligkeitsdatum am Bilanzstichtag.

Zum 30. Juni 2023 sind 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 keinem Fremdwährungsrisiko ausgesetzt, daher werden für diese Teilfonds keine Daten vorgelegt.

In der nachstehenden Tabelle werden die Devisenterminkontrakte des Teilfonds, die auf Bruttobasis abgewickelt werden, in entsprechende Fälligkeitsgruppen auf der Grundlage der zum Bilanzstichtag verbleibenden Zeit bis zum vertraglichen Fälligkeitsdatum unterteilt.

<b>Zum 30. Juni 2024</b>	<b>Weniger als 1 Monat EUR</b>
<b>Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF</b>	
Zuflüsse .....	23.743.842
Abflüsse .....	(24.010.772)
<b>Zum 30. Juni 2024</b>	<b>Weniger als 1 Monat EUR</b>
<b>Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF</b>	
Zuflüsse .....	264.799
Abflüsse .....	(267.917)
<b>Zum 30. Juni 2024</b>	<b>Weniger als 1 Monat EUR</b>
<b>Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF</b>	
Zuflüsse .....	3.040.640
Abflüsse .....	(3.076.411)
<b>Zum 30. Juni 2023</b>	<b>Weniger als 1 Monat EUR</b>
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	
Zuflüsse .....	5.256
Abflüsse .....	(5.254)
<b>Zum 30. Juni 2023</b>	<b>Weniger als 1 Monat EUR</b>
<b>Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	
Zuflüsse .....	440
Abflüsse .....	(440)

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2023

Weniger als 1 Monat  
EUR

#### Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF

Zuflüsse .....	9.885.143
Abflüsse .....	(10.133.322)

### c) Zinsrisiko

Das Zinsrisiko bezeichnet das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder künftige Kapitalströme eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Zinssätze am Markt schwanken wird.

Das ICAV unterliegt einem Zinsrisiko bei Schuldtiteln und Barmitteln und kann einem indirekten Zinsrisiko durch Anlagen in derivativen Finanzinstrumenten ausgesetzt sein, bei denen der Wert des zugrunde liegenden Vermögenswerts infolge einer Änderung der Zinssätze schwanken kann. Grundsätzlich ändert sich der Wert von festverzinslichen Wertpapieren in umgekehrter Richtung zu den Zinssätzen, wobei der Effekt umso größer ist, je länger die Laufzeit des Wertpapiers ist. Bei den aktiv verwalteten festverzinslichen Teilfonds wird das Zinsrisiko durch Szenario-Stresstests gesteuert. Zu den berücksichtigten Maßnahmen gehören die Ergebnisse einer Parallelverschiebung in den IR-Kurven um mehr als 200 Basispunkte und die Ergebnisse einer proportionalen Verschiebung der Creditspreads um mehr als 100 %. Die Ergebnisse dieser Stresstests und ihre Entwicklung werden monatlich beobachtet.

Da die passiv verwalteten Teilfonds Aktienindizes oder benutzerdefinierte Benchmarks nachbilden, wird davon ausgegangen, dass die Sensitivität dieser Teilfonds gegenüber dem Zinsrisiko von begrenzter Bedeutung ist. Darüber hinaus wird das Marktrisiko (einschließlich des Zinsrisikos) bei indexnachbildenden Teilfonds im Allgemeinen nicht gemindert, da es durch die Absicht, einen Marktindex nachzubilden, akzeptiert wird. Das Marktrisiko wird jedoch regelmäßig durch die Beobachtung von Stresstests überwacht, die für die Portfolios der Vermögenswerte durchgeführt werden.

Im Folgenden ist das Zinsänderungsrisiko für jeden Teilfonds zum 30. Juni 2024 dargestellt:

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	3.757.649	3.757.649
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	839	-	839
Sonstige Forderungen .....	-	-	2.683	2.683
Gesamtwert der Aktiva .....	-	839	3.760.332	3.761.171
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(916)	(916)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(916)	(916)
Gesamtnettovermögen .....				3.760.255
*5 % Zinssensitive Lücke .....				42

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	48.535.408	-	-	48.535.408
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	2.039.072	-	2.039.072
Sonstige Forderungen .....	-	-	637.880	637.880
Gesamtwert der Aktiva .....	48.535.408	2.039.072	637.880	51.212.360
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(14.720)	(14.720)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(14.720)	(14.720)
Gesamtnettvermögen .....				51.197.640
*5 % Zinssensitive Lücke .....				2.528.724

Franklin Emerging Markets UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	43.646.949	43.646.949
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	2.937.194	-	2.937.194
Finanzderivate .....	-	-	645	645
Sonstige Forderungen .....	-	-	430.599	430.599
Gesamtwert der Aktiva .....	-	2.937.194	44.078.193	47.015.387
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.147.358)	(3.147.358)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(3.147.358)	(3.147.358)
Gesamtnettvermögen .....				43.868.029
*5 % Zinssensitive Lücke .....				146.860



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF**</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Zinsfrei EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Aktiva</b>				
Übertragbare Wertpapiere .....	7.963.480	3.841.035	-	11.804.515
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	98.380	-	98.380
Sonstige Forderungen .....	-	-	260.523	260.523
<b>Gesamtwert der Aktiva .....</b>	<b>7.963.480</b>	<b>3.939.415</b>	<b>260.523</b>	<b>12.163.418</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(1.374)	(1.374)
<b>Gesamtwert der Passiva .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(1.374)</b>	<b>(1.374)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>12.162.044</b>
<b>*5 % Zinssensitive Lücke .....</b>				<b>595.145</b>

<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz EUR</b>	<b>Variabler Zinssatz EUR</b>	<b>Zinsfrei EUR</b>	<b>Gesamtwert EUR</b>
<b>Aktiva</b>				
Übertragbare Wertpapiere .....	303.423.740	69.789.381	-	373.213.121
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	3.045.205	-	3.045.205
Sonstige Forderungen .....	-	-	2.438.929	2.438.929
<b>Gesamtwert der Aktiva .....</b>	<b>303.423.740</b>	<b>72.834.586</b>	<b>2.438.929</b>	<b>378.697.255</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(46.090)	(46.090)
<b>Gesamtwert der Passiva .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(46.090)</b>	<b>(46.090)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>378.651.165</b>
<b>*5 % Zinssensitive Lücke .....</b>				<b>18.812.916</b>

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	63.212.816	63.212.816
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	119.193	-	119.193
Sonstige Forderungen .....	-	-	688.694	688.694
Gesamtwert der Aktiva .....	-	119.193	63.901.510	64.020.703
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(8.984)	(8.984)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(13.035)	(13.035)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(22.019)	(22.019)
Gesamtnettvermögen .....				63.998.684
*5 % Zinssensitive Lücke .....				5.960
	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	56.324.507	56.324.507
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	142.938	-	142.938
Sonstige Forderungen .....	-	-	198.123	198.123
Gesamtwert der Aktiva .....	-	142.938	56.522.630	56.665.568
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(360.322)	(360.322)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(360.322)	(360.322)
Gesamtnettvermögen .....				56.305.246
*5 % Zinssensitive Lücke .....				7.147

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	29.619.140	29.619.140
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	288.235	-	288.235
Finanzderivate .....	-	-	13.381	13.381
Sonstige Forderungen .....	-	-	436.423	436.423
Gesamtwert der Aktiva .....	-	288.235	30.068.944	30.357.179
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(5.990)	(5.990)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(5.990)	(5.990)
Gesamtnettvermögen .....				30.351.189
*5 % Zinssensitive Lücke .....				14.412
	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	529.982.559	529.982.559
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	1.293.055	-	1.293.055
Sonstige Forderungen .....	-	-	4.082.580	4.082.580
Gesamtwert der Aktiva .....	-	1.293.055	534.065.139	535.358.194
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(119.143)	(119.143)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(87.192)	(87.192)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(206.335)	(206.335)
Gesamtnettvermögen .....				535.151.859
*5 % Zinssensitive Lücke .....				64.653

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Developed World UCITS ETF**</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	7.547.506	7.547.506
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	3.620	-	3.620
Sonstige Forderungen .....	-	-	2.026	2.026
Gesamtwert der Aktiva .....	-	3.620	7.549.532	7.553.152
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(112)	(112)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(112)	(112)
Gesamtnettovermögen .....				7.553.040
*5 % Zinssensitive Lücke .....				181

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	933.315.279	933.315.279
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	16.901.534	-	16.901.534
Finanzderivate .....	-	-	273.079	273.079
Sonstige Forderungen .....	-	-	4.872.537	4.872.537
Gesamtwert der Aktiva .....	-	16.901.534	938.460.895	955.362.429
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(27.946.326)	(27.946.326)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(27.946.326)	(27.946.326)
Gesamtnettovermögen .....				927.416.103
*5 % Zinssensitive Lücke .....				845.077

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	813.220.514	813.220.514
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	817.925	-	817.925
Finanzderivate .....	-	-	50.196	50.196
Sonstige Forderungen .....	-	-	1.821.016	1.821.016
Gesamtwert der Aktiva .....	-	817.925	815.091.726	815.909.651
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(58.250)	(58.250)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(58.250)	(58.250)
Gesamtnettovermögen .....				815.851.401
*5 % Zinssensitive Lücke .....				40.896
	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	12.504.465	12.504.465
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	66.054	-	66.054
Finanzderivate .....	-	-	180	180
Sonstige Forderungen .....	-	-	35.677	35.677
Gesamtwert der Aktiva .....	-	66.054	12.540.322	12.606.376
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(29.913)	(29.913)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(29.913)	(29.913)
Gesamtnettovermögen .....				12.576.463
*5 % Zinssensitive Lücke .....				3.303

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Future of Food UCITS ETF**</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	2.375.958	2.375.958
Sonstige Forderungen .....	-	-	4.915	4.915
Gesamtwert der Aktiva .....	-	-	2.380.873	2.380.873
Verbindlichkeiten				
Kontokorrentkredit .....	-	(1.078)	-	(1.078)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(593)	(593)
Gesamtwert der Passiva .....	-	(1.078)	(593)	(1.671)
Gesamtnettovermögen .....				2.379.202
*5 % Zinssensitive Lücke .....				(54)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Future of Health &amp; Wellness UCITS ETF**</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	2.618.188	2.618.188
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	1.517	-	1.517
Sonstige Forderungen .....	-	-	1.549	1.549
Gesamtwert der Aktiva .....	-	1.517	2.619.737	2.621.254
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(652)	(652)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(652)	(652)
Gesamtnettovermögen .....				2.620.602
*5 % Zinssensitive Lücke .....				76

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	19.279.528	19.279.528
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	31.779	-	31.779
Sonstige Forderungen .....	-	-	68.226	68.226
Gesamtwert der Aktiva .....	-	31.779	19.347.754	19.379.533
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(241)	(241)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(53.743)	(53.743)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(53.984)	(53.984)
Gesamtnettvermögen .....				19.325.549
*5 % Zinssensitive Lücke .....				1.589
	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	47.066.754	47.066.754
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	4.833	-	4.833
Sonstige Forderungen .....	-	-	64.146	64.146
Gesamtwert der Aktiva .....	-	4.833	47.130.900	47.135.733
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(24.139)	(24.139)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(24.139)	(24.139)
Gesamtnettvermögen .....				47.111.594
*5 % Zinssensitive Lücke .....				242

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	5.162.298	5.162.298
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	26.380	-	26.380
Sonstige Forderungen .....	-	-	22.940	22.940
Gesamtwert der Aktiva .....	-	26.380	5.185.238	5.211.618
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(1.040)	(1.040)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(1.410)	(1.410)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(2.450)	(2.450)
Gesamtnettvermögen .....				5.209.168
*5 % Zinssensitive Lücke .....				1.319

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	5.455.009	5.455.009
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	29.780	-	29.780
Sonstige Forderungen .....	-	-	14.477	14.477
Gesamtwert der Aktiva .....	-	29.780	5.469.486	5.499.266
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(43.883)	(43.883)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(43.883)	(43.883)
Gesamtnettvermögen .....				5.455.383
*5 % Zinssensitive Lücke .....				1.489



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF**</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	48.698.631	48.698.631
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	21.918	-	21.918
Sonstige Forderungen .....	-	-	28.578	28.578
Gesamtwert der Aktiva .....	-	21.918	48.727.209	48.749.127
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(9.894)	(9.894)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(9.894)	(9.894)
Gesamtnettovermögen .....				48.739.233
*5 % Zinssensitive Lücke .....				1.096

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	349.289.603	349.289.603
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	154.951	-	154.951
Sonstige Forderungen .....	-	-	129.799	129.799
Gesamtwert der Aktiva .....	-	154.951	349.419.402	349.574.353
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(19.141)	(19.141)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(19.141)	(19.141)
Gesamtnettovermögen .....				349.555.212
*5 % Zinssensitive Lücke .....				7.748

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	8.886.700	8.886.700
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	68.036	-	68.036
Sonstige Forderungen .....	-	-	3.859.988	3.859.988
Gesamtwert der Aktiva .....	-	68.036	52.746.688	52.814.724
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(1.400)	(1.400)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.777.130)	(3.777.130)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(3.778.530)	(3.778.530)
Gesamtnettvermögen .....				49.036.194
*5 % Zinssensitive Lücke .....				3.402

Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	250.008.085	59.477.169	9.007.632	318.492.886
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	3.975.002	-	3.975.002
Sicherheiten .....	-	316.000	-	316.000
Finanzderivate .....	-	-	43.171	43.171
Sonstige Forderungen .....	-	-	3.036.912	3.036.912
Gesamtwert der Aktiva .....	250.008.085	63.768.171	12.087.715	325.863.971
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(332.451)	(332.451)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.992.351)	(3.992.351)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(4.324.802)	(4.324.802)
Gesamtnettvermögen .....				321.539.169
*5 % Zinssensitive Lücke .....				15.688.813

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF**</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	17.705.031	10.713.805	-	28.418.836
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	1.574.619	-	1.574.619
Sonstige Forderungen .....	-	-	358.238	358.238
Gesamtwert der Aktiva .....	17.705.031	12.288.424	358.238	30.351.693
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(3.118)	(3.118)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(4.313)	(4.313)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(7.431)	(7.431)
Gesamtnettvermögen .....				30.344.262
*5 % Zinssensitive Lücke .....				1.499.673

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF**</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	54.961.125	362.497	-	55.323.622
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	809.536	-	809.536
Sonstige Forderungen .....	-	-	396.945	396.945
Gesamtwert der Aktiva .....	54.961.125	1.172.033	396.945	56.530.103
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(52.430)	(52.430)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(770.627)	(770.627)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(823.057)	(823.057)
Gesamtnettvermögen .....				55.707.046
*5 % Zinssensitive Lücke .....				2.806.658

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	96.023.810	96.023.810
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	681.675	-	681.675
Sonstige Forderungen .....	-	-	11.033.353	11.033.353
Gesamtwert der Aktiva .....	-	681.675	107.057.163	107.738.838
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(3.474)	(3.474)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(11.465.128)	(11.465.128)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(11.468.602)	(11.468.602)
Gesamtnettvermögen .....				96.270.236
*5 % Zinssensitive Lücke .....				34.084

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	7.498.593	1.738.952	-	9.237.545
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	8.105	-	8.105
Sonstige Forderungen .....	-	-	116.054	116.054
Gesamtwert der Aktiva .....	7.498.593	1.747.057	116.054	9.361.704
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(2.718)	(2.718)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(2.718)	(2.718)
Gesamtnettvermögen .....				9.358.986
*5 % Zinssensitive Lücke .....				462.283

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

\*\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Im Folgenden ist das Zinsänderungsrisiko für jeden Teilfonds zum 30. Juni 2023 dargestellt:

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	2.905.321	2.905.321
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	2.651	-	2.651
Sonstige Forderungen .....	-	-	3.331	3.331
Gesamtwert der Aktiva .....	-	2.651	2.908.652	2.911.303
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(1.832)	(1.832)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(1.832)	(1.832)
Gesamtnettvermögen .....				2.909.471
*5 % Zinssensitive Lücke .....				133
	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	56.888.680	-	-	56.888.680
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	4.503.540	-	4.503.540
Sonstige Forderungen .....	-	-	766.665	766.665
Gesamtwert der Aktiva .....	56.888.680	4.503.540	766.665	62.158.885
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(20.792)	(20.792)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(20.792)	(20.792)
Gesamtnettvermögen .....				62.138.093
*5 % Zinssensitive Lücke .....				3.069.611

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	37.832.830	37.832.830
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	26.385	-	26.385
Sonstige Forderungen .....	-	-	525.216	525.216
Gesamtwert der Aktiva .....	-	26.385	38.358.046	38.384.431
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(3.482)	(3.482)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(24.255)	(24.255)
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(111.467)	(111.467)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(139.204)	(139.204)
Gesamtnettovermögen .....				38.245.227
*5 % Zinssensitive Lücke .....				1.319

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	414.835.771	66.890.530	-	481.726.301
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	22.630.896	-	22.630.896
Finanzderivate .....	-	-	526.875	526.875
Sonstige Forderungen .....	-	-	6.654.675	6.654.675
Gesamtwert der Aktiva .....	414.835.771	89.521.426	7.181.550	511.538.747
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(30.470)	(30.470)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(30.470)	(30.470)
Gesamtnettovermögen .....				511.508.277
*5 % Zinssensitive Lücke .....				25.217.860

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	5.008.754	5.008.754
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	4.490	-	4.490
Sonstige Forderungen .....	-	-	28.000	28.000
Gesamtwert der Aktiva .....	-	4.490	5.036.754	5.041.244
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(102)	(102)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(7.065)	(7.065)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(7.167)	(7.167)
Gesamtnettvermögen .....				5.034.077
*5 % Zinssensitive Lücke .....				225

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	46.032.550	46.032.550
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	36.037	-	36.037
Finanzderivate .....	-	-	2.200	2.200
Sonstige Forderungen .....	-	-	470.109	470.109
Gesamtwert der Aktiva .....	-	36.037	46.504.859	46.540.896
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(9.867)	(9.867)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(9.867)	(9.867)
Gesamtnettvermögen .....				46.531.029
*5 % Zinssensitive Lücke .....				1.802

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	10.300.374	10.300.374
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	51.714	-	51.714
Sonstige Forderungen .....	-	-	152.918	152.918
Gesamtwert der Aktiva .....	-	51.714	10.453.292	10.505.006
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(1.370)	(1.370)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.466)	(3.466)
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(28.996)	(28.996)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(33.832)	(33.832)
Gesamtnettovermögen .....				10.471.174
*5 % Zinssensitive Lücke .....				2.586

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	32.029.116	32.029.116
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	315.402	-	315.402
Sonstige Forderungen .....	-	-	491.524	491.524
Gesamtwert der Aktiva .....	-	315.402	32.520.640	32.836.042
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(914)	(914)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(93.144)	(93.144)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(94.058)	(94.058)
Gesamtnettovermögen .....				32.741.984
*5 % Zinssensitive Lücke .....				15.770



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Zinsfrei USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Aktiva</b>				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	259.813.958	259.813.958
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	622.915	-	622.915
Finanzderivate .....	-	-	25.907	25.907
Sonstige Forderungen .....	-	-	5.708.267	5.708.267
<b>Gesamtwert der Aktiva .....</b>	<b>-</b>	<b>622.915</b>	<b>265.548.132</b>	<b>266.171.047</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(32.948)	(32.948)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(4.406.151)	(4.406.151)
<b>Gesamtwert der Passiva .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(4.439.099)</b>	<b>(4.439.099)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>261.731.948</b>
<b>*5 % Zinssensitive Lücke .....</b>				<b>31.146</b>

<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Zinsfrei USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Aktiva</b>				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	267.054.868	267.054.868
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	701.721	-	701.721
Finanzderivate .....	-	-	19.825	19.825
Sonstige Forderungen .....	-	-	7.525.052	7.525.052
<b>Gesamtwert der Aktiva .....</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)
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(3.108.936)	(3.108.936)
<b>Gesamtwert der Passiva .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(10.047.766)</b>	<b>(10.047.766)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>265.253.700</b>
<b>*5 % Zinssensitive Lücke .....</b>				<b>35.086</b>

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	447.748.053	447.748.053
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	776.466	-	776.466
Sonstige Forderungen .....	-	-	1.242.778	1.242.778
Gesamtwert der Aktiva .....	-	776.466	448.990.831	449.767.297
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(8.585)	(8.585)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(34.505)	(34.505)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(43.090)	(43.090)
Gesamtnettovermögen .....				449.724.207
*5 % Zinssensitive Lücke .....				38.823

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	4.618.673	4.618.673
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	16.911	-	16.911
Finanzderivate .....	-	-	30	30
Sonstige Forderungen .....	-	-	58.325	58.325
Gesamtwert der Aktiva .....	-	16.911	4.677.028	4.693.939
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(14.115)	(14.115)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(14.115)	(14.115)
Gesamtnettovermögen .....				4.679.824
*5 % Zinssensitive Lücke .....				846

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Zinsfrei USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Aktiva</b>				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	28.127.826	28.127.826
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	47.212	-	47.212
Finanzderivate .....	-	-	227	227
Sonstige Forderungen .....	-	-	109.832	109.832
<b>Gesamtwert der Aktiva .....</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)
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(4.435)	(4.435)
<b>Gesamtwert der Passiva .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(23.183)</b>	<b>(23.183)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>28.261.914</b>
<b>*5 % Zinssensitive Lücke .....</b>				<b>2.361</b>

<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>	<b>Fester Zinssatz USD</b>	<b>Variabler Zinssatz USD</b>	<b>Zinsfrei USD</b>	<b>Gesamtwert USD</b>
<b>Aktiva</b>				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	47.522.583	47.522.583
Sonstige Forderungen .....	-	-	108.830	108.830
<b>Gesamtwert der Aktiva .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>47.631.413</b>	<b>47.631.413</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Kontokorrentkredit .....	-	(21.983)	-	(21.983)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(18.483)	(18.483)
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(12.161)	(12.161)
<b>Gesamtwert der Passiva .....</b>	<b>-</b>	<b>(21.983)</b>	<b>(30.644)</b>	<b>(52.627)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>47.578.786</b>
<b>*5 % Zinssensitive Lücke .....</b>				<b>(1.099)</b>

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	16.130.868	16.130.868
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	36.466	-	36.466
Sonstige Forderungen .....	-	-	42.186	42.186
Gesamtwert der Aktiva .....	-	36.466	16.173.054	16.209.520
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(415)	(415)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.019)	(3.019)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(3.434)	(3.434)
Gesamtnettovermögen .....				16.206.086
*5 % Zinssensitive Lücke .....				1.823

Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	5.074.736	5.074.736
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	8.153	-	8.153
Sonstige Forderungen .....	-	-	18.888	18.888
Gesamtwert der Aktiva .....	-	8.153	5.093.624	5.101.777
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(5.403)	(5.403)
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(18.250)	(18.250)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(23.653)	(23.653)
Gesamtnettovermögen .....				5.078.124
*5 % Zinssensitive Lücke .....				408

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	155.539.117	155.539.117
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	633.591	-	633.591
Finanzderivate .....			7.283	7.283
Sonstige Forderungen .....	-	-	28.860.370	28.860.370
Gesamtwert der Aktiva .....	-	633.591	184.406.770	185.040.361
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(29.252.583)	(29.252.583)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(29.252.583)	(29.252.583)
Gesamtnettvermögen .....				155.787.778
*5 % Zinssensitive Lücke .....				31.680

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	30.224.706	30.224.706
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	19.113	-	19.113
Sonstige Forderungen .....	-	-	38.308	38.308
Gesamtwert der Aktiva .....	-	19.113	30.263.014	30.282.127
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(204)	(204)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(3.702)	(3.702)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(3.906)	(3.906)
Gesamtnettvermögen .....				30.278.221
*5 % Zinssensitive Lücke .....				956

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	197.782.144	52.394.679	-	250.176.823
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	6.435.436	-	6.435.436
Finanzderivate .....	-	-	100.036	100.036
Sonstige Forderungen .....	-	-	4.140.688	4.140.688
Barguthaben bei Brokern .....	-	278.000	-	278.000
Gesamtwert der Aktiva .....	197.782.144	59.108.115	4.240.724	261.130.983
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzverbindlichkeiten .....	-	-	(270.253)	(270.253)
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(2.032.943)	(2.032.943)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(2.303.196)	(2.303.196)
Gesamtnettovermögen .....				258.827.787
*5 % Zinssensitive Lücke .....				12.844.513

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Zinsfrei EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>				
Aktiva				
Übertragbare Wertpapiere .....	-	-	128.432.379	128.432.379
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	42.941	-	42.941
Finanzderivate .....	-	-	2.139	2.139
Sonstige Forderungen .....	-	-	140.520	140.520
Gesamtwert der Aktiva .....	-	42.941	128.575.038	128.617.979
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	-	-	(27.263)	(27.263)
Gesamtwert der Passiva .....	-	-	(27.263)	(27.263)
Gesamtnettovermögen .....				128.590.716
*5 % Zinssensitive Lücke .....				2.147

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Zinsfrei USD	Gesamtwert USD
<b>Aktiva</b>				
Übertragbare Wertpapiere .....	7.423.605	1.784.833	-	9.208.438
Barmittel und Barmitteläquivalente .....	-	37.178	-	37.178
Sonstige Forderungen .....	-	-	96.613	96.613
<b>Gesamtwert der Aktiva .....</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>Gesamtwert der Passiva .....</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(3.105)</b>	<b>(3.105)</b>
<b>Gesamtnettovermögen .....</b>				<b>9.339.124</b>
<b>*5 % Zinssensitive Lücke .....</b>				<b>462.281</b>

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

### d) Kreditrisiko und Gegenparteirisiko

Das Kreditrisiko ist das wahrscheinliche Risiko eines Verlusts, das sich daraus ergibt, dass ein Kreditnehmer einen Kredit nicht zurückzahlt oder seinen vertraglichen Verpflichtungen nicht nachkommt. Anlagen in Aktienpapiere sind keinem Kreditrisiko ausgesetzt. Die Teilfonds tragen das Kreditrisiko für alle gehaltenen Schuldtitel. Das Kreditrisiko umfasst im Allgemeinen das Ausfallrisiko, das Spreadrisiko, das Gegenparteirisiko und das Erfüllungsrisiko. Das Kreditrisiko der Schuldtitel der Teilfonds zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 wird vom Anlageverwalter überwacht.

Der Anlageverwalter kann Devisenterminkontrakte zur Absicherung gegen Fremdwährungsrisiken einsetzen. Diese haben ein ähnliches Kredit- oder Ausfallrisiko wie ein reguläres Devisenkassageschäft. Devisenterminkontrakte werden „außerbörslich“ gehandelt und sind daher mit einem Gegenparteirisiko behaftet, das sich daraus ergibt, dass die Gegenparteien ihren Verpflichtungen aus dem Vertrag oder der Vereinbarung möglicherweise nicht nachkommen.

Das Kontrahentenrisiko ist eine Untergruppe des Kreditrisikos und bezeichnet das Risiko für jede Vertragspartei, dass die Gegenpartei ihren vertraglichen Verpflichtungen nicht nachkommt. Die Teilfonds sind dem Kontrahentenrisiko bei bilateralen Vereinbarungen ausgesetzt, wie z. B. bei außerbörslichen Derivatetransaktionen, bei denen beide Seiten ein Kreditrisiko tragen (z. B. Devisenterminkontrakte).

Derivate, Margin-Barguthaben oder andere ähnliche Anlagen/Gelder, die von den Teilfonds bei einer Gegenpartei, einer Optionsbörse, einem Clearing-Broker oder anderen Parteien hinterlegt oder im Namen der Teilfonds abgeschlossen wurden, werden nicht innerhalb des Verwahrstellennetzes von State Street gehalten. Die Verwahrstelle haftet daher in keiner Weise für den Ausfall einer Gegenpartei.

Franklin Templeton Investment Management Limited als Anlageberater verfügt über einen Ausschuss für Kontrahentenkredite (Counterparty Credit Committee), der regelmäßig zusammentritt, um die Liste der zugelassenen Kontrahenten zu überprüfen und zu aktualisieren, die Risikolimits und den Zulassungsstatus der Kontrahenten zu ändern. Der Ausschuss ist befugt, den Handel mit einer bestimmten Gegenpartei zu unterbinden, wenn er der Meinung ist, dass das Risiko gegenüber dieser Gegenpartei zu hoch ist. Die gesamten unternehmensweiten Engagements gegenüber jeder Gegenpartei sowie das Kreditrating jeder Gegenpartei, der Credit-Default-Swap-Spread und die Aktienkursbewegungen werden ebenfalls überwacht und den Handels- und Portfoliomanagement-Teams wöchentlich gemeldet.

Zum 30. Juni 2024 war das für Citibank NA vergebene Rating „A+“ (30. Juni 2023: „A+“) und für JPMorgan Securities Inc lag es bei „A+“ (30. Juni 2023: „A+“).

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### d) Kreditrisiko und Gegenparteiisiko (Fortsetzung)

Die Verwahrstelle des ICAV ist State Street Custodial Services (Ireland) Limited. Im Wesentlichen werden alle Vermögenswerte und Barmittel der Teilfonds innerhalb des Verwahrstellennetzes der Verwahrstelle gehalten. Die Rechte der Teilfonds an ihren von der Verwahrstelle gehaltenen Anagen können durch Konkurs oder Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle oder ihrer Muttergesellschaft State Street Corporation verzögert oder eingeschränkt werden. Das Kreditrating der State Street Corporation betrug zum 30. Juni 2024 „A“ (30. Juni 2023: „A“).

Das Kreditrisiko der Schuldtitel des Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 setzt sich wie folgt zusammen:

Portfolio nach Ratingkategorien Rating*	30. Juni 2024 %	30. Juni 2023 %
Investment Grade .....	62,15	66,10
Unterhalb von Investment Grade .....	37,85	33,90
Gesamt .....	100,00	100,00

\* Die Quelle für das Rating ist Standard & Poor's. Sofern diese nicht verfügbar ist, werden Moody's Ratings und bei Nichtverfügbarkeit dieser wiederum die Fitch Ratings verwendet. In Fällen, in denen kein Emittentenrating verfügbar war, wurde das Länderrating verwendet.

Das Kreditrisiko der Schuldtitel des Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF zum 30. Juni 2024 lässt sich wie folgt zusammenfassen:

Portfolio nach Ratingkategorien Rating*	30. Juni 2024** %
Investment Grade .....	99,15
Unterhalb von Investment Grade .....	0,85
Gesamt .....	100,00

\* Die Quelle für das Rating ist Standard & Poor's. Sofern diese nicht verfügbar ist, werden Moody's Ratings und bei Nichtverfügbarkeit dieser wiederum die Fitch Ratings verwendet. In Fällen, in denen kein Emittentenrating verfügbar war, wurde das Länderrating verwendet.

\*\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Das Kreditrisiko der Schuldtitel des Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 wird wie folgt zusammengefasst:

Portfolio nach Ratingkategorien Rating*	30. Juni 2024 %	30. Juni 2023 %
Investment Grade .....	99,13	79,19
Unterhalb von Investment Grade .....	0,87	1,14
Nicht bewertet .....	-	19,67
Gesamt .....	100,00	100,00

\* Die Quelle für das Rating ist Standard & Poor's. Sofern diese nicht verfügbar ist, werden Moody's Ratings und bei Nichtverfügbarkeit dieser wiederum die Fitch Ratings verwendet. In Fällen, in denen kein Emittentenrating verfügbar war, wurde das Länderrating verwendet.



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### d) Kreditrisiko und Gegenparteiisiko (Fortsetzung)

Das Kreditrisiko der Schuldtitel des Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 wird wie folgt zusammengefasst:

Portfolio nach Ratingkategorien Rating*	30. Juni 2024 %	30. Juni 2023 %
Investment Grade .....	95,47	82,11
Unterhalb von Investment Grade .....	4,53	5,07
Nicht bewertet .....	-	12,82
Gesamt .....	100,00	100,00

\* Die Quelle für das Rating ist Standard & Poor's. Sofern diese nicht verfügbar ist, werden Moody's Ratings und bei Nichtverfügbarkeit dieser wiederum die Fitch Ratings verwendet. In Fällen, in denen kein Emittentenrating verfügbar war, wurde das Länderrating verwendet.

Das Kreditrisiko der Schuldtitel des Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 wird wie folgt zusammengefasst:

Portfolio nach Ratingkategorien Rating*	30. Juni 2024** %
Investment Grade .....	95,34
Unterhalb von Investment Grade .....	4,66
Gesamt .....	100,00

\* Die Quelle für das Rating ist Standard & Poor's. Sofern diese nicht verfügbar ist, werden Moody's Ratings und bei Nichtverfügbarkeit dieser wiederum die Fitch Ratings verwendet. In Fällen, in denen kein Emittentenrating verfügbar war, wurde das Länderrating verwendet.

\*\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Das Kreditrisiko der Schuldtitel des Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 wird wie folgt zusammengefasst:

Portfolio nach Ratingkategorien Rating*	30. Juni 2024** %
Investment Grade .....	100,00
Gesamt .....	100,00

\* Die Quelle für das Rating ist Standard & Poor's. Sofern diese nicht verfügbar ist, werden Moody's Ratings und bei Nichtverfügbarkeit dieser wiederum die Fitch Ratings verwendet. In Fällen, in denen kein Emittentenrating verfügbar war, wurde das Länderrating verwendet.

\*\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### d) Kreditrisiko und Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Das Kreditrisiko der Schuldtitel des Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 wird wie folgt zusammengefasst:

Portfolio nach Ratingkategorien	30. Juni 2024	30. Juni 2023
Rating*	%	%
Investment Grade.....	99,45	95,66
Unterhalb von Investment Grade.....	0,55	-
Nicht bewertet.....	-	4,34
Gesamt .....	100,00	100,00

\* Die Quelle für das Rating ist Standard & Poor's. Sofern diese nicht verfügbar ist, werden Moody's Ratings und bei Nichtverfügbarkeit dieser wiederum die Fitch Ratings verwendet. In Fällen, in denen kein Emittentenrating verfügbar war, wurde das Länderrating verwendet.

### e) Liquiditätsrisiko

Das Vermögen der Teilfonds besteht im Allgemeinen aus hochliquiden Schuld- und Aktienwerten. Bei aktiv verwalteten Teilfonds ist die Liquidität ein Faktor, den der Anlageverwalter bei der Anlage in ein Finanzinstrument berücksichtigt. Bei indexnachbildenden Teilfonds werden die Finanzinstrumente, in die investiert wird, durch den jeweiligen nachgebildeten Index bestimmt.

Die wichtigste finanzielle Verbindlichkeit der Teilfonds ist die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen. Da es sich bei den Teilfonds um offene Fonds handelt, ist der betreffende Teilfonds verpflichtet, die Anteile auf Antrag der Inhaber zu einem Preis zurückzunehmen, der dem Nettoinventarwert je Anteil entspricht, vorbehaltlich der im Verkaufsprospekt festgelegten Abrechnungs- und Handelsbeschränkungen.

Der Anlageverwalter verwaltet die Liquiditätsposition der einzelnen Teilfonds auf täglicher Basis. Außerdem kann der Anlageverwalter aufgrund der Bestimmungen im Prospekt die Bearbeitung von Rücknahmen in erheblichem Umfang aufschieben, um eine geordnete Veräußerung von Wertpapieren zu erleichtern und so die Interessen der verbleibenden Anteilinhaber zu schützen. Die Höchstzahl der rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteile, die an einem bestimmten Tag zur Rücknahme zur Verfügung stehen, kann auf 10 % der Gesamtzahl der im Umlauf befindlichen Anteile des betreffenden Teilfonds beschränkt werden. Falls der Fonds die Rücknahme von Anteilen aus diesem Grund verweigert, können die Rücknahmeanträge an diesem Tag anteilig verringert werden und sie werden bearbeitet, als ob sie an jedem folgenden Handelstag eingegangen wären, bis alle Anteile, für die der ursprüngliche Antrag gestellt wurde, zurückgenommen sind. Hierbei ist der Fonds nicht verpflichtet, mehr als 10 % der Anzahl der Anteile eines bestimmten Teilfonds, die an einem Handelstag im Umlauf sind, zurückzunehmen, solange nicht alle Anteile des Teilfonds, für die der ursprüngliche Antrag gestellt wurde, zurückgenommen sind.

Das Liquiditätsprofil der finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. Juni 2024 sieht wie folgt aus:

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	916	-	-	916
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	3.760.255	-	-	3.760.255
Gesamtwert der Passiva .....	3.761.171	-	-	3.761.171

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	14.720	-	-	14.720
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	51.197.640	-	-	51.197.640
Gesamtwert der Passiva .....	51.212.360	-	-	51.212.360

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.147.358	-	-	3.147.358
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	43.868.029	-	-	43.868.029
Gesamtwert der Passiva .....	47.015.387	-	-	47.015.387

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF*</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	1.374	-	-	1.374
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	12.162.044	-	-	12.162.044
Gesamtwert der Passiva .....	12.163.418	-	-	12.163.418

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	46.090	-	-	46.090
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	378.651.165	-	-	378.651.165
Gesamtwert der Passiva .....	378.697.255	-	-	378.697.255

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	8.984	-	8.984
Sonstige Verbindlichkeiten .....	13.035	-	-	13.035
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	63.998.684	-	-	63.998.684
Gesamtwert der Passiva .....	64.011.719	8.984	-	64.020.703

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	360.322	-	-	360.322
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	56.305.246	-	-	56.305.246
Gesamtwert der Passiva .....	56.665.568	-	-	56.665.568

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	5.990	-	-	5.990
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	30.351.189	-	-	30.351.189
Gesamtwert der Passiva .....	30.357.179	-	-	30.357.179

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	119.143	-	119.143
Sonstige Verbindlichkeiten .....	87.192	-	-	87.192
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	535.151.859	-	-	535.151.859
Gesamtwert der Passiva .....	535.239.051	119.143	-	535.358.194
<b>Franklin FTSE Developed World UCITS ETF*</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	112	-	-	112
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	7.553.040	-	-	7.553.040
Gesamtwert der Passiva .....	7.553.152	-	-	7.553.152
<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	27.946.326	-	-	27.946.326
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	927.416.103	-	-	927.416.103
Gesamtwert der Passiva .....	955.362.429	-	-	955.362.429
<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	58.250	-	-	58.250
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	815.851.401	-	-	815.851.401
Gesamtwert der Passiva .....	815.909.651	-	-	815.909.651
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	29.913	-	-	29.913
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	12.576.463	-	-	12.576.463
Gesamtwert der Passiva .....	12.606.376	-	-	12.606.376
<b>Franklin Future of Food UCITS ETF*</b>				
Kontokorrentkredit .....	1.078	-	-	1.078
Sonstige Verbindlichkeiten .....	593	-	-	593
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	2.379.202	-	-	2.379.202
Gesamtwert der Passiva .....	2.380.873	-	-	2.380.873

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Future of Health &amp; Wellness UCITS ETF*</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	652	-	-	652
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	2.620.602	-	-	2.620.602
Gesamtwert der Passiva .....	2.621.254	-	-	2.621.254
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	241	-	241
Sonstige Verbindlichkeiten .....	53.743	-	-	53.743
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	19.325.549	-	-	19.325.549
Gesamtwert der Passiva .....	19.379.292	241	-	19.379.533
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	24.139	-	-	24.139
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	47.111.594	-	-	47.111.594
Gesamtwert der Passiva .....	47.135.733	-	-	47.135.733
<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	1.040	-	1.040
Sonstige Verbindlichkeiten .....	1.410	-	-	1.410
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	5.209.168	-	-	5.209.168
Gesamtwert der Passiva .....	5.210.578	1.040	-	5.211.618
<b>Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	43.883	-	-	43.883
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	5.455.383	-	-	5.455.383
Gesamtwert der Passiva .....	5.499.266	-	-	5.499.266
<b>Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF*</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9.894	-	-	9.894
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	48.739.233	-	-	48.739.233
Gesamtwert der Passiva .....	48.749.127	-	-	48.749.127

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	19.141	-	-	19.141
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	349.555.212	-	-	349.555.212
Gesamtwert der Passiva .....	349.574.353	-	-	349.574.353

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	1.400	-	1.400
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.777.130	-	-	3.777.130
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	49.036.194	-	-	49.036.194
Gesamtwert der Passiva .....	52.813.324	1.400	-	52.814.724

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	55.350	-	55.350
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten .....	277.101	-	-	277.101
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.992.351	-	-	3.992.351
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	321.539.169	-	-	321.539.169
Gesamtwert der Passiva .....	325.808.621	55.350	-	325.863.971

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF*</b>				
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten .....	3.118	-	-	3.118
Sonstige Verbindlichkeiten .....	4.313	-	-	4.313
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	30.344.262	-	-	30.344.262
Gesamtwert der Passiva .....	30.351.693	-	-	30.351.693

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF*</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	16.660	-	16.660
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten .....	35.770	-	-	35.770
Sonstige Verbindlichkeiten .....	770.627	-	-	770.627
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	55.707.046	-	-	55.707.046
Gesamtwert der Passiva .....	56.513.443	16.660	-	56.530.103

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	3.474	-	3.474
Sonstige Verbindlichkeiten .....	11.465.128	-	-	11.465.128
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	96.270.236	-	-	96.270.236
Gesamtwert der Passiva .....	107.735.364	3.474	-	107.738.838

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	2.718	-	-	2.718
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	9.358.986	-	-	9.358.986
Gesamtwert der Passiva .....	9.361.704	-	-	9.361.704

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Das Liquiditätsprofil der finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. Juni 2023 sieht wie folgt aus:

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	1.832	-	-	1.832
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	2.909.471	-	-	2.909.471
Gesamtwert der Passiva .....	2.911.303	-	-	2.911.303

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 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
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	62.138.093	-	-	62.138.093
Gesamtwert der Passiva .....	62.158.885	-	-	62.158.885

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	3.480	-	3.480
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten .....	2	-	-	2
Sonstige Verbindlichkeiten .....	24.255	-	-	24.255
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	111.467	-	-	111.467
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	38.245.227	-	-	38.245.227
Gesamtwert der Passiva .....	38.380.951	3.480	-	38.384.431

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	30.470	-	-	30.470
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	511.508.277	-	-	511.508.277
Gesamtwert der Passiva .....	511.538.747	-	-	511.538.747
<b>Franklin European Equity UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	102	-	102
Sonstige Verbindlichkeiten .....	7.065	-	-	7.065
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	5.034.077	-	-	5.034.077
Gesamtwert der Passiva .....	5.041.142	102	-	5.041.244
<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	9.867	-	-	9.867
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	46.531.029	-	-	46.531.029
Gesamtwert der Passiva .....	46.540.896	-	-	46.540.896
<b>Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	1.370	-	1.370
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.466	-	-	3.466
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	28.996	-	-	28.996
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	10.471.174	-	-	10.471.174
Gesamtwert der Passiva .....	10.503.636	1.370	-	10.505.006
<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	914	-	914
Sonstige Verbindlichkeiten .....	93.144	-	-	93.144
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	32.741.984	-	-	32.741.984
Gesamtwert der Passiva .....	32.835.128	914	-	32.836.042



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	32.948	-	32.948
Sonstige Verbindlichkeiten .....	4.406.151	-	-	4.406.151
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	261.731.948	-	-	261.731.948
Gesamtwert der Passiva .....	266.138.099	32.948	-	266.171.047

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	6.938.830	-	-	6.938.830
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	3.108.936	-	-	3.108.936
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	265.253.700	-	-	265.253.700
Gesamtwert der Passiva .....	275.301.466	-	-	275.301.466

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	8.585	-	8.585
Sonstige Verbindlichkeiten .....	34.505	-	-	34.505
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	449.724.207	-	-	449.724.207
Gesamtwert der Passiva .....	449.758.712	8.585	-	449.767.297

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	14.115	-	-	14.115
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	4.679.824	-	-	4.679.824
Gesamtwert der Passiva .....	4.693.939	-	-	4.693.939

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	18.748	-	-	18.748
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	4.435	-	-	4.435
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	28.261.914	-	-	28.261.914
Gesamtwert der Passiva .....	28.285.097	-	-	28.285.097

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Kontokorrentkredit .....	21.983	-	-	21.983
Sonstige Verbindlichkeiten .....	18.483	-	-	18.483
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	12.161	-	-	12.161
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	47.578.786	-	-	47.578.786
Gesamtwert der Passiva .....	47.631.413	-	-	47.631.413

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	415	-	415
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.019	-	-	3.019
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	16.206.086	-	-	16.206.086
Gesamtwert der Passiva .....	16.209.105	415	-	16.209.520

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	5.403	-	-	5.403
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	18.250	-	-	18.250
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	5.078.124	-	-	5.078.124
Gesamtwert der Passiva .....	5.101.777	-	-	5.101.777

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 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
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	155.787.778	-	-	155.787.778
Gesamtwert der Passiva .....	185.040.361	-	-	185.040.361

	Geringer als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	204	-	204
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.702	-	-	3.702
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	30.278.221	-	-	30.278.221
Gesamtwert der Passiva .....	30.281.923	204	-	30.282.127

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Geringer als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
<b>Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF</b>				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten .....	-	19.950	-	19.950
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten .....	250.303	-	-	250.303
Sonstige Verbindlichkeiten .....	2.032.943	-	-	2.032.943
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	258.827.787	-	-	258.827.787
Gesamtwert der Passiva .....	261.111.033	19.950	-	261.130.983

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	27.263	-	-	27.263
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	128.590.716	-	-	128.590.716
Gesamtwert der Passiva .....	128.617.979	-	-	128.617.979

	Geringer als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>				
Sonstige Verbindlichkeiten .....	3.105	-	-	3.105
Auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen .....	9.339.124	-	-	9.339.124
Gesamtwert der Passiva .....	9.342.229	-	-	9.342.229

### f) Bemessungshierarchie

Das ICAV muss die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert im Rahmen einer Bemessungshierarchie klassifizieren, die die Signifikanz von Eingabewerten reflektiert, die bei einer Bewertung zum beizulegenden Zeitwert herangezogenen werden.

Der Standard schreibt vor, dass ein Unternehmen eine quantitative und qualitative Analyse der zum beizulegenden Zeitwert erfassten Instrumente auf der Grundlage einer dreistufigen Bemessungshierarchie vornimmt. Die Bemessungshierarchie kennt folgende Stufen:

- Stufe 1 - auf aktiven Märkten notierte Kurse (nicht bereinigt) für identische Vermögenswerte/Verbindlichkeiten.
- Stufe 2 - andere Eingabewerte als die in Stufe 1 enthaltenen notierten Kurse, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (d. h. als Kurse) oder indirekt (d. h. abgeleitet von Kursen) beobachtbar sind.
- Stufe 3 - Eingabewerte für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten beruhen (d. h. nicht beobachtbare Eingabewerte).

Darüber hinaus verlangt die Änderung bei Instrumenten mit signifikanten nicht beobachtbaren Eingabewerten (Stufe 3) Angaben zu den Übertragungen in und aus Stufe 3, eine Überleitung der Eröffnungs- und Schlussalden, die Gesamtgewinne und -verluste für das Jahr, aufgeteilt in solche, die in der Gesamtergebnisrechnung erfasst werden, und solche, die in der Aufstellung der insgesamt erfassten Gewinne und Verluste erfasst werden, sowie Käufe, Verkäufe und Abwicklungen. Die Stufe in der Bemessungshierarchie, in die die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert in ihrer Gesamtheit eingestuft wird, wird auf der Grundlage des Eingabewerts der niedrigsten Stufe bestimmt, der für die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert in ihrer Gesamtheit wesentlich ist.

Zu diesem Zweck wird die Bedeutung eines Eingabewerts im Hinblick auf die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert in seiner Gesamtheit beurteilt. Wenn bei der Bewertung des beizulegenden Zeitwerts beobachtbare Parameter verwendet werden, die eine erhebliche Anpassung auf der Grundlage nicht beobachtbarer Parameter erfordern, handelt es sich um eine Bewertung der Stufe 3. Die Beurteilung der Bedeutsamkeit eines bestimmten Eingabewerts für die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert in seiner Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen unter Berücksichtigung der für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifischen Faktoren.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

Die Bestimmung dessen, was „beobachtbar“ ist, erfordert ein erhebliches Urteilsvermögen der Teilfonds. Die Teilfonds betrachten beobachtbare Daten als solche Marktdaten, die leicht verfügbar sind, regelmäßig verbreitet oder aktualisiert werden, zuverlässig und überprüfbar sind, nicht proprietär sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt werden, die aktiv an dem betreffenden Markt beteiligt sind. Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die nicht zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, werden zu fortgeführten Anschaffungskosten ausgewiesen, da ihr Buchwert einen angemessenen Näherungswert für den beizulegenden Zeitwert darstellt.

Die folgenden Tabellen schlüsseln die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. Juni 2024 gemäß den Bewertungsstufen auf.

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	3.757.649	-	-	3.757.649
	3.757.649	-	-	3.757.649
<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Staatsanleihen .....	-	48.535.408	-	48.535.408
	-	48.535.408	-	48.535.408
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	43.527.692	119.257	-	43.646.949
Futures-Kontrakte* .....	645	-	-	645
	43.528.337	119.257	-	43.647.594
<b>Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF**</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	11.804.515	-	11.804.515
	-	11.804.515	-	11.804.515
<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	161.991.755	-	161.991.755
Staatsanleihen .....	-	191.688.199	-	191.688.199
Kurzfristige Anlagen .....	-	19.533.167	-	19.533.167
	-	373.213.121	-	373.213.121
<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	63.212.816	-	-	63.212.816
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(8.984)	-	-	(8.984)
	63.203.832	-	-	63.203.832

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	56.268.565	55.942	-	56.324.507
	56.268.565	55.942	-	56.324.507
<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	29.619.140	-	-	29.619.140
Futures-Kontrakte* .....	13.381	-	-	13.381
	29.632.521	-	-	29.632.521
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	529.806.447	-	176.112	529.982.559
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(119.143)	-	-	(119.143)
	529.687.304	-	176.112	529.863.416
<b>Franklin FTSE Developed World UCITS ETF**</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	7.547.506	-	-	7.547.506
	7.547.506	-	-	7.547.506
<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	930.740.836	2.574.443	-	933.315.279
Futures-Kontrakte* .....	273.079	-	-	273.079
	931.013.915	2.574.443	-	933.588.358
<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	813.220.514	-	-	813.220.514
Futures-Kontrakte* .....	50.196	-	-	50.196
	813.270.710	-	-	813.270.710
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	12.504.465	-	-	12.504.465
Futures-Kontrakte* .....	180	-	-	180
	12.504.645	-	-	12.504.645

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin Future of Food UCITS ETF**</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	2.375.958	-	-	2.375.958
	2.375.958	-	-	2.375.958
<b>Franklin Future of Health &amp; Wellness UCITS ETF**</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	2.618.188	-	-	2.618.188
	2.618.188	-	-	2.618.188
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	19.279.528	-	-	19.279.528
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(241)	-	-	(241)
	19.279.287	-	-	19.279.287
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	47.066.754	-	-	47.066.754
	47.066.754	-	-	47.066.754
<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	5.162.298	-	-	5.162.298
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(1.040)	-	-	(1.040)
	5.161.258	-	-	5.161.258
<b>Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	5.455.009	-	-	5.455.009
	5.455.009	-	-	5.455.009
<b>Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF**</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	48.698.631	-	-	48.698.631
	48.698.631	-	-	48.698.631

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Gesamt
<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>	<b>USD</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	349.289.603	-	-	349.289.603
	349.289.603	-	-	349.289.603
<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	48.886.700	-	-	48.886.700
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(1.400)	-	-	(1.400)
	48.885.300	-	-	48.885.300
<b>Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Organismen für gemeinsame Anlagen .....	9.007.632	-	-	9.007.632
Unternehmensanleihen .....	-	155.354.037	-	155.354.037
Devisenterminkontrakte* .....	-	10.171	-	10.171
Futures-Kontrakte* .....	33.000	-	-	33.000
Staatsanleihen .....	-	154.131.217	-	154.131.217
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte* .....	-	(277.101)	-	(277.101)
Futures-Kontrakte* .....	(55.350)	-	-	(55.350)
	8.985.282	309.218.324	-	318.203.606
<b>Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF**</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	27.328.475	-	27.328.475
Staatsanleihe .....	-	1.090.361	-	1.090.361
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte* .....	-	(3.118)	-	(3.118)
	-	28.415.718	-	28.415.718
<b>Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF**</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	16.033.301	-	16.033.301
Staatsanleihen .....	-	39.290.321	-	39.290.321
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte* .....	-	(35.770)	-	(35.770)
Futures-Kontrakte* .....	(16.660)	-	-	(16.660)
	(16.660)	55.287.852	-	55.271.192

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	96.023.810	-	-	96.023.810
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(3.474)	-	-	(3.474)
	96.020.336	-	-	96.020.336
<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	9.122.357	-	9.122.357
Staatsanleihe .....	-	115.188	-	115.188
	-	9.237.545	-	9.237.545

\* Stellt den nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust) dar.

\*\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

Anlagen, deren Werte auf notierten Marktkursen in aktiven Märkten beruhen, werden in Stufe 1 eingestuft. Für das ICAV gehören dazu aktive börsennotierte Aktien und börsengehandelte Derivate.

Finanzinstrumente, die nicht börsennotiert sind, aber auf der Grundlage von notierten Marktkursen, Händlernotierungen oder alternativen Kursquellen, die sich auf beobachtbare Eingabewerte stützen, bewertet werden, werden in Stufe 2 eingestuft. Dazu gehören Anleihen.

Übertragungen zwischen den Stufen der Bemessungshierarchie gelten als zum Jahresende erfolgt. In dem am 30. Juni 2024 endenden Jahr gab es Übertragungen aus Stufe 1 in Stufe 2 (30. Juni 2023: keine). In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2024 und zum 30. Juni 2024 gab es Übertragungen aus Stufe 1 in Stufe 3.

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Es gab 17 Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von Null USD im Franklin Emerging Markets UCITS ETF, die zum 30. Juni 2024 als Stufe 3 klassifiziert wurden. Arosa PJSC, Gazprom PJSC, GMK Norilskiy Nickel PAO, Inter RAO UES PJSC, LUKOIL PJSC, Moscow Exchange MICEX-Rates PJSC, Novolipetsk Steel PJSC, PhosAgro PJSC Depositary Receipts, Polyus PJSC, Rosneft Oil Co. PJSC, Severstal PAO, Surgutneftegas PJSC, Surgutneftegas PJSC (Vorzugsaktien), Tatneft PJSC und United Co. RUSAL International PJSC setzten den Handel an der Moskauer Börse (MOEX) am 1. März 2022 aus und nahmen den Handel am 24. März 2022 für lokale Anleger wieder auf, blieben aber für alle „unfreundlichen“ ausländischen Investoren weiterhin unzugänglich. In Anbetracht der aktuellen Marktbedingungen und der Tatsache, dass der Teilfonds keinen Zugang zum lokalen Moskauer Aktienmarkt hat, werden die russischen Anlagen am 30. Juni 2024 mit Null bewertet. Die PhosAgro PJSC GDR und PhosAgro PJSC GDR Reg S werden von den internationalen Börsen, an denen diese Hinterlegungs-scheine gehandelt werden, weiterhin gesperrt und daher am 30. Juni 2024 mit Null bewertet.

Es gab zwei Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert im Franklin FTSE China UCITS ETF, die zum 30. Juni 2024 als Stufe 3 klassifiziert wurden. Die Yango Group Co. Ltd setzte den Handel an der Shenzhen Stock Exchange am 9. Juni 2023 aus und wurde am 16. August 2023 von der Börse genommen, da sich das Unternehmen derzeit in Liquidation befindet. Daher wurde es zum 30. Juni 2024 mit Null USD bewertet. Country Garden Holdings Co. Ltd. wurde zuletzt am 27. März 2024 an der Hongkonger Börse gehandelt, und die Aktie wurde zum Jahresende mit 0,291 HKD bewertet, was einem Abschlag von 40 % gegenüber dem zuletzt gehandelten Kurs entspricht.



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Es gab vier Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von Null USD in Franklin Global Equity SRI UCITS ETF, die zum 30. Juni 2024 als Stufe 3 klassifiziert wurden. PhosAgro PJSC und Polyus PJSC setzten den Handel an der Moskauer Börse (MOEX) am 1. März 2022 aus und nahmen den Handel am 24. März 2022 für lokale Anleger wieder auf, blieben aber weiterhin für alle „unfreundlichen“ ausländischen Investoren unzugänglich. In Anbetracht der aktuellen Marktbedingungen und der Tatsache, dass der Teilfonds keinen Zugang zum lokalen Moskauer Aktienmarkt hat, werden die russischen Anlagen am 30. Juni 2024 mit Null bewertet. Die PhosAgro PJSC GDR und PhosAgro PJSC GDR Reg S werden von den internationalen Börsen, an denen diese Hinterlegungsscheine gehandelt werden, weiterhin gesperrt und daher am 30. Juni 2024 mit Null bewertet.

Es gab ein Wertpapier mit einem beizulegenden Zeitwert von Null USD in Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF, das zum 30. Juni 2024 als Stufe 3 klassifiziert wurde. Tatneft PJSC setzte den Handel an der Moskauer Börse (MOEX) am 1. März 2022 aus und nahm den Handel am 24. März 2022 für lokale Anleger wieder auf, blieb jedoch für alle „unfreundlichen“ ausländischen Investoren unzugänglich. In Anbetracht der aktuellen Marktbedingungen und der Tatsache, dass der Teilfonds keinen Zugang zum lokalen Moskauer Aktienmarkt hat, werden die russischen Anlagen am 30. Juni 2024 mit Null bewertet.

#### Auswirkung der Änderung der wesentlichen Annahmen für Finanzinstrumente der Stufe 3

Die Gesellschaft ist der Ansicht, dass ihre Schätzungen des beizulegenden Zeitwerts angemessen sind. Die Verwendung von Abschlägen oder alternativen Annahmen könnte jedoch zu unterschiedlichen Bewertungen des beizulegenden Zeitwerts führen. Die nachstehende Tabelle zeigt die Auswirkungen auf den beizulegenden Zeitwert und den Nettoinventarwert, der den rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilseignern zuzurechnen ist, wenn die angegebenen Abschlagsprozentsätze angewandt würden.

Abschlag %	Aktualisierter beizulegender Zeitwert	Veränderung des Nettoinventarwerts, der den Anteilseignern von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist
	USD	USD
0%	5.330	2.665
25%	3.998	(1.332)
75%	1.332	(3.998)

Die folgenden Tabellen zeigen die Entwicklung der Stufe 3 der Bemessungshierarchie für das zum 30. Juni 2024 endenden Geschäftsjahr:

	30. Juni 2024
	USD
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	
Anfangsbestand	1.040
Realisierter Verlust im Jahresergebnis	(245.280)
Nicht realisierter Gewinn im Jahresergebnis	534.628
Verkäufe	(290.388)
Endsaldo	-

	30. Juni 2024
	USD
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	
Anfangsbestand	97.902
Realisierter Verlust im Jahresergebnis	(991.091)
Nicht realisierter Gewinn im Jahresergebnis	1.021.677
Verkäufe	(128.488)
Übertragungen in Stufe 3	176.112
Endsaldo	176.112

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

	30. Juni 2024
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	<b>USD</b>
Anfangsbestand	-
Nicht realisierter Gewinn im Jahresergebnis	72.631
Verkäufe	(72.631)
Endsaldo	-

	30. Juni 2024
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>	<b>USD</b>
Anfangsbestand	-
Nicht realisierter Gewinn im Jahresergebnis	343.159
Verkäufe	(343.159)
Endsaldo	-

Die folgenden Tabellen schlüsseln die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. Juni 2023 gemäß den Bewertungsstufen auf.

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	2.905.321	-	-	2.905.321
	2.905.321	-	-	2.905.321

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Staatsanleihe .....	-	56.888.680	-	56.888.680
	-	56.888.680	-	56.888.680

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

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Gesamt EUR
<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	261.847.621	-	261.847.621
Futures-Kontrakte* .....	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 European Equity UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	5.008.754	-	-	5.008.754
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(102)	-	-	(102)
	5.008.652	-	-	5.008.652
<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	46.032.550	-	-	46.032.550
Futures-Kontrakte* .....	2.200	-	-	2.200
	46.034.750	-	-	46.034.750
<b>Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	10.300.374	-	-	10.300.374
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(1.370)	-	-	(1.370)
	10.299.004	-	-	10.299.004
<b>Franklin FTSE Brazil UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	32.029.116	-	-	32.029.116
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(914)	-	-	(914)
	32.028.202	-	-	32.028.202

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	259.716.056	-	97.902	259.813.958
Futures-Kontrakte* .....	25.907	-	-	25.907
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(32.948)	-	-	(32.948)
	259.709.015	-	97.902	259.806.917
<b>Franklin FTSE India UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	267.054.868	-	-	267.054.868
Futures-Kontrakte* .....	19.825	-	-	19.825
	267.074.693	-	-	267.074.693
<b>Franklin FTSE Korea UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	447.748.053	-	-	447.748.053
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(8.585)	-	-	(8.585)
	447.739.468	-	-	447.739.468
<b>Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	4.618.673	-	-	4.618.673
Futures-Kontrakte* .....	30	-	-	30
	4.618.703	-	-	4.618.703
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	28.127.826	-	-	28.127.826
Futures-Kontrakte* .....	227	-	-	227
	28.128.053	-	-	28.128.053
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	47.522.583	-	-	47.522.583
	47.522.583	-	-	47.522.583

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	16.130.868	-	-	16.130.868
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(415)	-	-	(415)
	16.130.453	-	-	16.130.453
<b>Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	5.074.736	-	-	5.074.736
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte* .....	-	-	-	-
	5.074.736	-	-	5.074.736
<b>Franklin S&amp;P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	155.539.117	-	-	155.539.117
Futures-Kontrakte* .....	7.283	-	-	7.283
	155.546.400	-	-	155.546.400
<b>Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	30.224.706	-	-	30.224.706
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures-Kontrakte* .....	(204)	-	-	(204)
	30.224.502	-	-	30.224.502
<b>Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen .....	-	143.145.302	-	143.145.302
Devisenterminkontrakte* .....	-	2.124	-	2.124
Futures-Kontrakte* .....	97.912	-	-	97.912
Staatsanleihen .....	-	107.031.521	-	107.031.521
Finanzielle Verbindlichkeiten:				
Devisenterminkontrakte* .....	-	(250.303)	-	(250.303)
Futures-Kontrakte* .....	(19.950)	-	-	(19.950)
	77.962	249.928.644	-	250.006.606

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Gesamt USD
<b>Franklin U.S. Equity UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien .....	128.432.379	-	-	128.432.379
Futures-Kontrakte* .....	2.139	-	-	2.139
	128.434.518	-	-	128.434.518
<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Unternehmensanleihen	-	8.808.380	-	8.808.380
Staatsanleihen	-	400.058	-	400.058
	-	9.208.438	-	9.208.438

\* Stellt den nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust) dar.

Die folgenden Tabellen zeigen die Entwicklung der Stufe 3 der Bemessungshierarchie für das zum 30. Juni 2023 endenden Geschäftsjahr:

	30. Juni 2023 USD
<b>Franklin Emerging Markets UCITS ETF</b>	
Anfangsbestand	17.960
Realisierter Verlust im Jahresergebnis	(65.654)
Nicht realisierter Gewinn im Jahresergebnis	58.516
Käufe	79.420
Verkäufe	(89.202)
Endsaldo	1.040

	30. Juni 2023 USD
<b>Franklin FTSE China UCITS ETF</b>	
Anfangsbestand	298.623
Realisierter Verlust im Jahresergebnis	(910.375)
Nicht realisierter Gewinn im Jahresergebnis	814.112
Käufe	20.850
Verkäufe	(99.963)
Übertragungen in Stufe 3	2.655
Übertragungen aus der Stufe 3	(28.000)
Endsaldo	97.902

	30. Juni 2023 USD
<b>Franklin Global Equity SRI UCITS ETF</b>	
Anfangsbestand	-
Nicht realisierter Verlust im Jahresergebnis	(85)
Käufe	27.635
Verkäufe	(27.550)
Endsaldo	-

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 6. Grundsätze des Risikomanagements und Offenlegung (Fortsetzung)

### f) Bemessungshierarchie (Fortsetzung)

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

	30. Juni 2023
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>	<b>USD</b>
Anfangsbestand	4.167
Realisierter Verlust im Jahresergebnis	(13.110)
Nicht realisierter Gewinn im Jahresergebnis	10.553
Verkäufe	(1.610)
Endsaldo	-

### g) Globales Engagement und Hebelwirkung

Das Gesamtengagement und die Hebelwirkung der Teilfonds werden nach dem Commitment-Ansatz berechnet und überschreiten nicht 100 % des Nettoinventarwerts. Der Commitment-Ansatz wandelt die Finanzderivatpositionen jedes Teilfonds in entsprechende Positionen der jeweiligen Basiswerte um und soll sicherstellen, dass das mit Finanzderivaten verbundene Risiko im Hinblick auf bestehende oder mögliche künftige Verpflichtungen überwacht wird.

Jegliche Hebelwirkung, die sich aus dem Einsatz von Finanzderivaten und Techniken für ein effizientes Portfoliomanagement ergibt, steht im Einklang mit den Anforderungen der Zentralbank und wird 100 % des Nettoinventarwerts des betreffenden Teilfonds nicht überschreiten.

### 7. Barmittel und Barmitteläquivalente

Zum 30. Juni 2024 werden alle Barmittel und Barmitteläquivalente sowie Kontokorrentkredite bei State Street Custodial Services (Ireland) Limited gehalten, mit Ausnahme der nachstehend aufgeführten Margin-Barguthaben. Das langfristige Kreditrating der State Street Corporation, der obersten Muttergesellschaft der Verwahrstelle, betrug zum 30. Juni 2024 „A“ (30. Juni 2023: „A“). Alle Margin-Barguthaben wurden bei J.P. Morgan gehalten, dessen Kreditrating zum 30. Juni 2024 „A+“ war (30. Juni 2023: „A+“).

Die folgenden, zum 30. Juni 2024 und zum 30. Juni 2023 bei Brokern gehaltenen Margin-Barguthaben sind in der Bilanz in den Barmitteln und Barmitteläquivalenten enthalten:

Teilfonds	Währung	30. Juni 2024	30. Juni 2023
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	USD	-	-
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	USD	-	-
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	USD	6.230	12.444
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF	EUR	-	-
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	-	345.489
Franklin European Equity UCITS ETF	EUR	-	2.007
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	EUR	51.707	26.264
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	USD	-	6.755
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	132.987	131.006
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	543.246	181.336
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF	USD	-	-
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	607.397	38.875
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	165.296	145.438
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	USD	3.180	3.070
Franklin Future of Food UCITS ETF	USD	-	-
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF	USD	-	-
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	USD	2.551	5.248
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	USD	-	22
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	4.710	5.412

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 7. Barmittel und Barmitteläquivalente (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	30. Juni 2024	30. Juni 2023
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	-	-
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF	USD	-	-
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	-	30.006
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	9.650	3.981
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	282.900	360.560
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF	EUR	-	-
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF	EUR	136.631	-
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	USD	33.108	6.174
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	-	-



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 8. Sonstige Forderungen

	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF* EUR	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2024</b>							
Dividendenforderungen .....	2.683	-	257.948	-	-	688.694	118.513
Zinsforderungen .....	-	637.880	-	160.637	2.438.929	-	-
Diverse Forderungen .....	-	-	-	-	-	-	169
Forderungen aus ausgegebenen Aktien .....	-	-	-	-	-	-	-
Verkauf von Wertpapieren in Erwartung der Abwicklung .....	-	-	172.651	99.886	-	-	79.441
	<b>2.683</b>	<b>637.880</b>	<b>430.599</b>	<b>260.523</b>	<b>2.438.929</b>	<b>688.694</b>	<b>198.123</b>

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE Developed World UCITS ETF* USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD	Franklin Future of Food UCITS ETF* USD
<b>Zum 30. Juni 2024</b>							
Dividendenforderungen .....	430.630	4.067.794	2.026	1.836.592	1.821.016	35.450	4.915
Zinsforderungen .....	-	-	-	-	-	-	-
Diverse Forderungen .....	591	-	-	28.399	-	-	-
Forderungen aus ausgegebenen Aktien .....	-	-	-	-	-	-	-
Verkauf von Wertpapieren in Erwartung der Abwicklung .....	5.202	14.786	-	3.007.546	-	227	-
	<b>436.423</b>	<b>4.082.580</b>	<b>2.026</b>	<b>4.872.537</b>	<b>1.821.016</b>	<b>35.677</b>	<b>4.915</b>

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 8. Sonstige Forderungen (Fortsetzung)

	Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF* USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF* USD	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2024</b>							
Dividendenforderungen .....	1.549	67.654	64.146	22.940	14.242	28.578	129.799
Zinsforderungen .....	-	-	-	-	-	-	-
Diverse Forderungen .....	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus ausgegebenen Aktien .....	-	-	-	-	-	-	-
Verkauf von Wertpapieren in Erwartung der Abwicklung .....	-	572	-	-	235	-	-
	<u>1.549</u>	<u>68.226</u>	<u>64.146</u>	<u>22.940</u>	<u>14.477</u>	<u>28.578</u>	<u>129.799</u>

	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF* EUR	Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF* EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2024</b>						
Dividendenforderungen .....	65.422	-	-	-	146.084	-
Zinsforderungen .....	-	3.036.912	358.238	396.945	-	116.054
Diverse Forderungen .....	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus ausgegebenen Aktien .....	3.794.566	-	-	-	-	-
Verkauf von Wertpapieren in Erwartung der Abwicklung .....	-	-	-	-	10.887.269	-
	<u>3.859.988</u>	<u>3.036.912</u>	<u>358.238</u>	<u>396.945</u>	<u>11.033.353</u>	<u>116.054</u>

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 8. Sonstige Forderungen (Fortsetzung)

	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Dividendenforderungen .....	3.331	-	515.694	-	28.000	470.109	147.935
Zinsforderungen .....	-	766.665	-	2.798.515	-	-	-
Diverse Forderungen .....	-	-	572	-	-	-	627
Forderungen aus ausgegebenen Aktien .....	-	-	-	-	-	-	-
Verkauf von Wertpapieren in Erwartung der Abwicklung .....	-	-	8.950	3.856.160	-	-	4.356
	3.331	766.665	525.216	6.654.675	28.000	470.109	152.918

	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 Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Dividendenforderungen .....	490.933	1.242.071	532.657	1.242.778	53.337	109.386	108.830
Zinsforderungen .....	-	-	-	-	-	-	-
Diverse Forderungen .....	591	-	45.880	-	-	293	-
Forderungen aus ausgegebenen Aktien .....	-	4.441.866	6.869.498	-	-	-	-
Verkauf von Wertpapieren in Erwartung der Abwicklung .....	-	24.330	77.017	-	4.988	153	-
	491.524	5.708.267	7.525.052	1.242.778	58.325	109.832	108.830

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 8. Sonstige Forderungen (Fortsetzung)

	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Dividendenforderungen .....	40.846	16.933	81.244	38.308	-	140.520	-
Zinsforderungen .....	-	-	-	-	1.430.745	-	96.613
Diverse Forderungen .....	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus ausgegebenen Aktien .....	-	-	-	-	-	-	-
Verkauf von Wertpapieren in Erwartung der Abwicklung .....	1.340	1.955	28.779.126	-	2.709.943	-	-
	42.186	18.888	28.860.370	38.308	4.140.688	140.520	96.613

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 9. Sonstige Verbindlichkeiten

	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2024</b>							
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(250.948)	-	-	-	(274.564)
Zu zahlende Zinsen .....	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren .....	(916)	(14.720)	(15.599)	(1.374)	(46.090)	(13.035)	(6.317)
Noch nicht abgewickelte Käufe .....	-	-	(166.699)	-	-	-	(79.441)
Zahlbar für zurückgekaufte Anteile .....	-	-	(2.714.112)	-	-	-	-
	(916)	(14.720)	(3.147.358)	(1.374)	(46.090)	(13.035)	(360.322)

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE Developed World UCITS ETF* USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF USD	Franklin Future of Food UCITS ETF* USD
<b>Zum 30. Juni 2024</b>							
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	-	(24.806.001)	-	-	-
Zu zahlende Zinsen .....	(81)	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren .....	(4.648)	(87.192)	(112)	(132.779)	(58.250)	(1.682)	(593)
Noch nicht abgewickelte Käufe .....	(1.261)	-	-	(3.007.546)	-	(28.231)	-
Zahlbar für zurückgekaufte Anteile .....	-	-	-	-	-	-	-
	(5.990)	(87.192)	(112)	(27.946.326)	(58.250)	(29.913)	(593)

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF* USD	Franklin Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF* USD	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2024</b>							
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	(4.192)	(13.284)	-	(43.081)	-	-
Zu zahlende Zinsen .....	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren .....	(652)	(4.754)	(10.855)	(977)	(802)	(9.894)	(19.141)
Noch nicht abgewickelte Käufe .....	-	(44.797)	-	(433)	-	-	-
Zahlbar für zurückgekaufte Anteile .....	-	-	-	-	-	-	-
	(652)	(53.743)	(24.139)	(1.410)	(43.883)	(9.894)	(19.141)

	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF* EUR	Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF* EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2024</b>						
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	-	-	-	-
Zu zahlende Zinsen .....	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren .....	(5.623)	(46.011)	(4.313)	(8.088)	(36.990)	(2.718)
Noch nicht abgewickelte Käufe .....	(3.771.507)	(3.946.340)	-	(762.539)	(11.428.138)	-
Zahlbar für zurückgekaufte Anteile .....	-	-	-	-	-	-
	(3.777.130)	(3.992.351)	(4.313)	(770.627)	(11.465.128)	(2.718)

\* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt, daher gibt es keine Vergleichszahlen. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF USD	Franklin Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin European Equity UCITS ETF EUR	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF EUR	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(111.467)	-	-	-	(28.996)
Zu zahlende Zinsen .....	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren .....	(690)	(19.535)	(14.251)	(21.786)	(1.022)	(9.867)	(3.466)
Noch nicht abgewickelte Käufe .....	(1.052)	-	(10.004)	-	(6.043)	-	-
Diverse Verbindlichkeiten .....	(90)	(1.257)	-	(8.684)	-	-	-
	<b>(1.832)</b>	<b>(20.792)</b>	<b>(135.722)</b>	<b>(30.470)</b>	<b>(7.065)</b>	<b>(9.867)</b>	<b>(32.462)</b>

	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 Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	-	(3.108.936)	-	-	(4.435)	(12.161)
Zu zahlende Zinsen .....	(81)	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren .....	(4.999)	(40.982)	(38.552)	(33.520)	(642)	(9.165)	(17.465)
Noch nicht abgewickelte Käufe .....	(87.888)	(4.364.813)	(6.900.235)	-	(13.473)	(9.583)	-
Diverse Verbindlichkeiten .....	(176)	(356)	(43)	(985)	-	-	(1.018)
	<b>(93.144)</b>	<b>(4.406.151)</b>	<b>(10.047.766)</b>	<b>(34.505)</b>	<b>(14.115)</b>	<b>(23.183)</b>	<b>(30.644)</b>

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
<b>Zum 30. Juni 2023</b>							
Zu zahlende Kapitalertragssteuer .....	-	(18.250)	-	-	-	-	-
Zu zahlende Zinsen .....	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren .....	(2.996)	(755)	(8.736)	(3.702)	(37.191)	(26.092)	(2.998)
Noch nicht abgewickelte Käufe .....	-	(4.450)	(29.239.443)	-	(1.995.752)	-	-
Diverse Verbindlichkeiten .....	(23)	(198)	(4.404)	-	-	(1.171)	(107)
	<b>(3.019)</b>	<b>(23.653)</b>	<b>(29.252.583)</b>	<b>(3.702)</b>	<b>(2.032.943)</b>	<b>(27.263)</b>	<b>(3.105)</b>



# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 10. Angaben zu verbundenen Parteien

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, der Manager Franklin Templeton International Services S.à r.l., der Schweizer Vertreter Franklin Templeton Switzerland Limited und die deutsche Informationsstelle Franklin Templeton Investment Services GmbH gelten im Sinne der für das ICAV geltenden Rechnungslegungsvorschriften als verbundene Parteien. Die vom Anlageverwalter im Laufe des Jahres erwirtschafteten Beträge sind die Betriebskosten in der Gesamtergebnisrechnung.

### Transaktionen mit Mitgliedern des Managements in Schlüsselpositionen

Die Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder an nahestehenden Unternehmen und Personen stellen sich wie folgt dar:

Elinor Murray ist Vizepräsidentin der Abteilung Global Compliance bei Franklin Templeton. Ms. Murray war bis zur Übernahme durch Franklin Templeton im August 2020 Managing Director, Head of European Compliance bei Legg Mason Global Investors. Sie ist britische Staatsangehörige. Ernennung zum Mitglied des Verwaltungsrats am 1. November 2023.

Craig Tyle arbeitet als Senior Advisor für Franklin Templeton. Vor seiner jetzigen Tätigkeit hielt Herr Tyle die Position des Executive Vice President und General Counsel von Franklin Resources, Inc. Herr Tyle ist auch ein Verwaltungsratsmitglied der Fondsgesellschaft Franklin Templeton Luxembourg. Er ist US-amerikanischer Staatsbürger. Er wurde am 27. Juli 2023 zum Mitglied des Verwaltungsrats ernannt.

Die folgenden Mitglieder des Verwaltungsrats sind im Laufe des Jahres aus dem Verwaltungsrat ausgeschieden:

William Jackson ist Chief Administration Officer for Technology & Operations bei Franklin Templeton. Ebenso ist er ein Verwaltungsratsmitglied einer Reihe von Franklin Templeton-Unternehmen, einschließlich des Managers, und Fondsgesellschaften mit Sitz in Großbritannien und Luxemburg. Er ist ein britischer Staatsbürger. Er ist am 17. Juli 2023 aus dem Verwaltungsrat ausgetreten.

In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2024 und zum 30. Juni 2023 hat kein Verwaltungsratsmitglied oder eine mit einem Verwaltungsratsmitglied verbundene Person, abgesehen von den oben genannten Personen, ein wirtschaftliches oder nicht-wirtschaftliches Interesse am Anteilskapital des ICAV oder ein wesentliches Interesse am ICAV oder an einer Vereinbarung oder Regelung mit dem ICAV.

Jane Trust (bis zu ihrem Rücktritt), Jaspal Sagger, William Jackson (bis zu seinem Rücktritt), Craig Tyle und Elinor Murray sind Verwaltungsratsmitglieder des ICAV und sind auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter verbundener Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter und der Beauftragten. William Jackson und Jane Trust waren Verwaltungsratsmitglieder von FTIS (zum Zeitpunkt ihres jeweiligen Ausscheidens aus dem ICAV). Abgesehen von den oben genannten Ausnahmen hat bzw. hatte keiner der Verwaltungsratsmitglieder eine direkte oder indirekte Beteiligung an einem Vertrag oder einer Vereinbarung, der/die zum Zeitpunkt dieses Dokuments besteht und der/die in Bezug auf das Geschäft des ICAV von Bedeutung ist.

Einzelheiten zu den gezahlten Verwaltungsrats honoraren finden Sie auf Seite 97.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 10. Angaben zu verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

### Bedeutende Anteilseigner

In den folgenden Tabellen sind die Anzahl der Anteilseigner mit bedeutenden Beteiligungen (mindestens 20 %) an dem betreffenden Teilfonds und der Prozentsatz dieser Beteiligung zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 aufgeführt. Die wichtigsten Anteilseigner sind die zugelassenen Teilnehmer, die zum Berichtszeitpunkt 100 % der Teilfonds im primären Aktienregister halten, von denen die meisten auf dem Sekundärmarkt weiterverkauft werden. Das wirtschaftliche Eigentum an diesen Aktien wird dann von den zugelassenen Teilnehmern durch den Handel von Aktien auf dem Sekundärmarkt übertragen.

Teilfonds	Anzahl der bedeutenden Anteilseigner
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	1
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	1
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	2
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF*	2
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	2
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	1
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	1
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	3
Franklin FTSE China UCITS ETF	2
Franklin FTSE Developed World UCITS ETF*	1
Franklin FTSE India UCITS ETF	2
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	2
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	3
Franklin Future of Food UCITS ETF*	1
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF*	1
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	2
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	3
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	2
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	1
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF*	3
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	2
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	1
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	2
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF*	2
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF*	1
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	3
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	2

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilsklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 10. Angaben zu verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

### Bedeutende Anteilseigner (Fortsetzung)

Teilfonds	Anzahl der bedeutenden Anteilseigner
Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	1
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	1
Franklin Emerging Markets UCITS ETF	2
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	2
Franklin European Equity UCITS ETF	3
Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	2
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	2
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 Global Equity SRI UCITS ETF	3
Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	3
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	2
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	1
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	2
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	2
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	2
Franklin U.S. Equity UCITS ETF	2
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	2

## 11. Effizientes Portfoliomanagement

Das ICAV kann im Namen der einzelnen Teilfonds Techniken und Instrumente einsetzen, wie z. B. Finanzderivate, Pensionsgeschäfte und Wertpapierleihgeschäfte, um ein effizientes Portfoliomanagement zu gewährleisten, d. h. um das Risiko zu verringern, einschließlich des Risikos eines Tracking Error zwischen der Wertentwicklung eines Teilfonds und der Wertentwicklung des Index, den der betreffende passive Teilfonds nachbildet, die Verringerung der Kosten für die Teilfonds, die Erwirtschaftung von zusätzlichem Kapital oder Erträgen für den Teilfonds und die Absicherung gegen Marktbewegungen, Wechselkurs- oder Zinsrisiken unter Berücksichtigung des Risikoprofils der einzelnen Teilfonds und der allgemeinen Bestimmungen der OGAW-Verordnungen. Solche Transaktionen können Devisentransaktionen umfassen, die die Währungsbeziehungen der von den einzelnen Teilfonds gehaltenen übertragbaren Wertpapiere verändern. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 wurden keine Wertpapierleihgeschäfte getätigt.

## 12. Ausschüttungen

Die folgenden Ausschüttungen wurden von den Teilfonds während des am 30. Juni 2024 endenden Jahres erklärt:

Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF*	Wert EUR	Je Anteil EUR	Ex-Datum
EUR Ausschüttende Anteile .....	25.184	0,08	12. Dez. 2023
EUR Ausschüttende Anteile .....	229.454	0,49	12. Juni 2024
Gesamt .....	<b>254.638</b>		

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 12. Ausschüttungen (Fortsetzung)

	Wert EUR	Je Anteil EUR	Ex-Datum
<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>			
EUR Ausschüttende Anteile .....	8.413.267	0,66	12. Juni 2024
Gesamt .....	<b>8.413.267</b>		

	Wert EUR	Je Anteil EUR	Ex-Datum
<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>			
EUR Ausschüttende Anteile .....	549.900	0,28	12. Sep. 2023
EUR Ausschüttende Anteile .....	509.850	0,19	12. Dez. 2023
EUR Ausschüttende Anteile .....	328.680	0,15	12. März 2024
EUR Ausschüttende Anteile .....	1.278.110	0,56	12. Juni 2024
Gesamt .....	<b>2.666.540</b>		

	Wert USD	Je Anteil USD	Ex-Datum
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>			
USD Ausschüttende Anteile .....	286.350	0,19	12. Sep. 2023
USD Ausschüttende Anteile .....	218.270	0,17	12. Dez. 2023
USD Ausschüttende Anteile .....	178.490	0,14	12. März 2024
USD Ausschüttende Anteile .....	462.800	0,36	12. Juni 2024
Gesamt .....	<b>1.145.910</b>		

	Wert USD	Je Anteil USD	Ex-Datum
<b>Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF</b>			
USD Ausschüttende Anteile .....	201.015	0,45	12. Dez. 2023
USD Ausschüttende Anteile .....	195.200	0,49	12. Juni 2024
Gesamt .....	<b>396.215</b>		

Die von den Teilfonds in dem am 30. Juni 2023 endenden Jahr erklärten Ausschüttungen:

	Wert EUR	Je Anteil EUR	Ex-Datum
<b>Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF</b>			
EUR Ausschüttende Anteile .....	6.320.080	0,31	12. Juni 2023
Gesamt .....	<b>6.320.080</b>		

	Wert EUR	Je Anteil EUR	Ex-Datum
<b>Franklin European Quality Dividend UCITS ETF</b>			
EUR Ausschüttende Anteile .....	259.750	0,21	12. Sep. 2022
EUR Ausschüttende Anteile .....	266.895	0,2	12. Dez. 2022
EUR Ausschüttende Anteile .....	221.940	0,12	10. März 2023
EUR Ausschüttende Anteile .....	1.355.270	0,71	12. Juni 2023
Gesamt .....	<b>2.103.855</b>		

	Wert USD	Je Anteil USD	Ex-Datum
<b>Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF</b>			
USD Ausschüttende Anteile .....	306.180	0,22	12. Sep. 2022
USD Ausschüttende Anteile .....	240.600	0,16	12. Dez. 2022
USD Ausschüttende Anteile .....	181.900	0,11	10. März 2023
USD Ausschüttende Anteile .....	629.440	0,39	12. Juni 2023
Gesamt .....	<b>1.358.120</b>		

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 12. Ausschüttungen (Fortsetzung)

Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Wert USD	Je Anteil USD	Ex-Datum
USD Ausschüttende Anteile .....	182.985	0,33	12. Dez. 2022
USD Ausschüttende Anteile .....	146.400	0,37	12. Juni 2023
Gesamt .....	<b>329.385</b>		

## 13. Soft Commissions & Direktvermittlungsdienste

Der Anlageverwalter hat in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2024 und 30. Juni 2023 keine Soft-Commission-Vereinbarungen oder Direktvermittlungsdienste im Namen der Teilfonds abgeschlossen.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 14. Wechselkurse

Die zum 30. Juni 2024 geltenden Wechselkurse lauten wie folgt:

USD1 =	Währung	Prozentsatz	EUR1 =	Währung	Prozentsatz
	AED	3,6730		ALLE	100,1926
	AUD	1,4973		CHF	0,9631
	BRL	5,5545		DKK	7,4575
	CAD	1,3684		GBP	0,8478
	CHF	0,8986		NOK	11,4115
	CLP	943,9250		PLN	4,3085
	CNH	7,3009		SEK	11,3501
	CNY	7,2661		USD	1,0718
	COP	4.144,1500			
	CZK	23,3688			
	DKK	6,9582			
	EGP	48,0300			
	EUR	0,9331			
	GBP	0,7911			
	HKD	7,8074			
	HUF	368,4862			
	IDR	16.375,0000			
	ILS	3,7672			
	INR	83,3875			
	JPY	160,8600			
	KRW	1.376,5000			
	KWD	0,3068			
	MXN	18,2855			
	MYR	4,7175			
	NOK	10,6475			
	NZD	1,6411			
	PHP	58,6090			
	PLN	4,0201			
	QAR	3,6410			
	RUB	86,2500			
	SAR	3,7516			
	SEK	10,5902			
	SGD	1,3553			
	THB	36,6975			
	TRY	32,7835			
	TWD	32,4415			
	ZAR	18,2600			

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDENDE GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 14. Wechselkurse (Fortsetzung)

Die zum 30. Juni 2023 geltenden Wechselkurse lauten wie folgt:

USD1 =	Währung	Prozentsatz	EUR1 =	Währung	Prozentsatz
	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			

## 15. Bedeutende Ereignisse im Laufe des Jahres

### Änderungen im Verwaltungsrat

William Jackson ist am 17. Juli 2023 von seinem Amt als Verwaltungsratsmitglied zurückgetreten.

Craig Tyle wurde am 27. Juli 2023 zum Verwaltungsratsmitglied ernannt.

Elinor Murray wurde am 1. November 2023 zum Verwaltungsratsmitglied ernannt.

Jane Trust trat am 21. Februar 2024 als Verwaltungsratsmitglied zurück.

# ANHANG ZUM JAHRESABSCHLUSS FÜR DAS ZUM 30. JUNI 2024 ENDEnde GESCHÄFTSJAHR (Fortsetzung)

## 15. Wesentliche Ereignisse des Jahres (Fortsetzung)

### Änderungen im Teilfonds

Franklin Future of Food UCITS ETF und Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF wurden am 5. Juli 2023 aufgelegt.

Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF, Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF und Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF wurden am 31. Oktober 2023 aufgelegt.

Franklin European Equity UCITS ETF wurde am 16. November 2023 aufgelöst.

Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF wurde am 24. April 2024 aufgelegt.

Franklin FTSE Developed World UCITS ETF wurde am 24. Juni 2024 aufgelegt.

Die folgenden Namensänderungen der Teilfonds wurden im Laufe des Jahres wirksam:

Alter Name des Teilfonds	Aktueller Name des Teilfonds	Stichtag
Franklin European Dividend UCITS ETF	Franklin European Quality Dividend UCITS ETF	1. August 2023
Franklin Global Dividend UCITS ETF	Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF	1. August 2023
Franklin Euro Green Bond UCITS ETF	Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	1. November 2023
Franklin AC Asia ex Japan UCITS ETF	Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	1. Dezember 2023
Franklin Metaverse UCITS ETF	Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF	7. Juni 2024

Mit Wirkung vom 1. Dezember 2023 trat die folgende Änderung der Benchmark in Kraft:

Name des Teilfonds	Alte Benchmark	Aktuelle Benchmark
Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF	AC Asia ex Japan Index	Linked FTSE Asia ex Japan ex China Index

Der Franklin FTSE AC Asia ex China ex Japan UCITS ETF hat im Laufe des Jahres auch seine Hauptanlagestrategie geändert. Einzelheiten sind dem Bericht des Anlageverwalters zu entnehmen.

### Sonstige Änderungen

Mit Wirkung vom 1. April 2024 hat der Company Secretary gewechselt: An die Stelle von Matsack Trust Limited ist OGS Corporate Governance Limited getreten.

Im Laufe des Jahres gab es keine weiteren wichtigen Ereignisse, die eine Offenlegung im Jahresabschluss des ICAV erfordern.

## 16. Wesentliche Ereignisse seit Jahresende

Franklin FTSE Japan UCITS ETF, aufgelegt am 29. Juli 2024.

Jaspal Sagger wurde am 30. August 2024 zum Director to the Board of Directors bei FTIS ernannt.

Seit dem Jahresende sind keine weiteren wichtigen Ereignisse eingetreten, die eine Offenlegung im Jahresabschluss des ICAV erfordern.

## 17. Billigung des Jahresabschlusses

Die Jahresabschlüsse wurden vom Verwaltungsrat am 15. Oktober 2024 genehmigt.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024

## Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (30. Juni 2023: 99,86 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (30. Juni 2023: 99,86 %)</b>		
	<b>Australien: 0,83 % (30. Juni 2023: 0,41 %)</b>		
100.000	BrainChip Holdings Ltd. ....	14.693	0,39
1.470	Iris Energy Ltd. ....	16.596	0,44
		<u>31.289</u>	<u>0,83</u>
	<b>Kanada: 0,88 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
8.913	BlackBerry Ltd. ....	22.277	0,59
3.544	Hive Digital Technologies Ltd. ....	10.915	0,29
		<u>33.192</u>	<u>0,88</u>
	<b>Cayman-Inseln: 8,17 % (30. Juni 2023: 6,51 %)</b>		
4.200	AAC Technologies Holdings, Inc. ....	16.515	0,44
772	Ambarella, Inc. ....	41.649	1,11
15.000	Bairong, Inc. ....	17.099	0,46
7.601	Bit Digital, Inc. ....	24.171	0,64
23.762	Canaan, Inc. ADR ....	23.757	0,63
745	Galaxy Digital Holdings Ltd. ....	8.700	0,23
2.890	Himax Technologies, Inc. ADR ....	22.947	0,61
5.500	NetDragon Websoft Holdings Ltd. ....	8.313	0,22
6.200	NetEase, Inc. ....	118.403	3,15
6.390	Zhen Ding Technology Holding Ltd. ....	25.508	0,68
		<u>307.062</u>	<u>8,17</u>
	<b>Irland: 3,86 % (30. Juni 2023: 2,81 %)</b>		
478	Accenture PLC ....	145.030	3,86
		<u>145.030</u>	<u>3,86</u>
	<b>Japan: 1,61 % (30. Juni 2023: 0,58 %)</b>		
1.500	Appier Group, Inc. ....	11.264	0,30
2.400	COLOPL, Inc. ....	9.758	0,26
1.320	PKSHA Technology, Inc. ....	29.090	0,77
2.200	Wacom Co. Ltd. ....	10.326	0,28
		<u>60.438</u>	<u>1,61</u>
	<b>Luxemburg: 1,53 % (30. Juni 2023: 1,12 %)</b>		
323	Globant SA ....	57.578	1,53
		<u>57.578</u>	<u>1,53</u>
	<b>Niederlande: 2,21 % (30. Juni 2023: 3,04 %)</b>		
2.108	STMicroelectronics NV ....	83.287	2,21
		<u>83.287</u>	<u>2,21</u>
	<b>Norwegen: Null (30. Juni 2023: 0,65 %)</b>		
	<b>Südkorea: 1,31 % (30. Juni 2023: 6,09 %)</b>		
442	Motrex Co. Ltd. ....	4.165	0,11
299	Samsung SDS Co. Ltd. ....	32.257	0,86
206	Selvas AI, Inc. ....	2.215	0,06
8.673	Wysiwyg Studios Co. Ltd. ....	10.497	0,28
		<u>49.134</u>	<u>1,31</u>
	<b>Schweden: 0,52 % (30. Juni 2023: 0,74 %)</b>		
300	Mycronic AB ....	11.575	0,31
684	Surgical Science Sweden AB ....	8.080	0,21
		<u>19.655</u>	<u>0,52</u>
	<b>Taiwan: 1,24 % (30. Juni 2023: 2,15 %)</b>		
10.000	Career Technology MFG. Co. Ltd. ....	6.643	0,18
28.000	HTC Corp. ....	39.831	1,06
		<u>46.474</u>	<u>1,24</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin AI, Metaverse und Blockchain UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (30. Juni 2023: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (30. Juni 2023: 99,86 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 0,20 % (30. Juni 2023: 0,48 %)</b>		
14.515	S4 Capital PLC .....	7.743	0,20
		<u>7.743</u>	<u>0,20</u>
	<b>USA: 77,57 % (30. Juni 2023: 75,28 %)</b>		
280	Adobe, Inc. ....	155.551	4,14
874	Alphabet, Inc. ....	160.309	4,26
789	Apple, Inc. ....	166.179	4,42
3.782	Applied Digital Corp. ....	22.503	0,60
477	Beyond, Inc. ....	6.239	0,17
1.698	Block, Inc. ....	109.504	2,91
1.920	C3.ai, Inc. ....	55.603	1,48
8.320	Cerence, Inc. ....	23.546	0,63
935	CEVA, Inc. ....	18.036	0,48
1.081	Cleanspark, Inc. ....	17.242	0,46
635	Coinbase Global, Inc. ....	141.116	3,75
1.093	Consensus Cloud Solutions, Inc. ....	18.778	0,50
135	CorVel Corp. ....	34.327	0,91
405	CrowdStrike Holdings, Inc. ....	155.192	4,13
595	DigitalOcean Holdings, Inc. ....	20.676	0,55
1.973	eXp World Holdings, Inc. ....	22.265	0,59
779	Five9, Inc. ....	34.354	0,91
28.917	fuboTV, Inc. ....	35.857	0,95
1.540	Innodata, Inc. ....	22.838	0,61
4.846	Intel Corp. ....	150.081	3,99
826	International Business Machines Corp. ....	142.857	3,80
1.853	Marathon Digital Holdings, Inc. ....	36.782	0,98
2.781	Matterport, Inc. ....	12.431	0,33
324	Meta Platforms, Inc. ....	163.367	4,34
357	Microsoft Corp. ....	159.561	4,24
52	MicroStrategy, Inc. ....	71.629	1,91
2.383	Mitek Systems, Inc. ....	26.642	0,71
890	nCino, Inc. ....	27.991	0,74
1.463	NVIDIA Corp. ....	180.739	4,81
519	Perficient, Inc. ....	38.816	1,03
372	PTC, Inc. ....	67.581	1,80
623	QUALCOMM, Inc. ....	124.089	3,30
823	Riot Platforms, Inc. ....	7.522	0,20
2.076	ROBLOX Corp. ....	77.248	2,05
4.790	Snap, Inc. ....	79.562	2,12
7.920	SoundHound AI, Inc. ....	31.284	0,83
2.144	Stagwell, Inc. ....	14.622	0,39
156	Super Micro Computer, Inc. ....	127.819	3,40
911	TaskUS, Inc. ....	12.125	0,32
2.083	UiPath, Inc. ....	26.412	0,70
1.345	Unity Software, Inc. ....	21.870	0,58
151	Universal Display Corp. ....	31.748	0,84
1.400	Upstart Holdings, Inc. ....	33.026	0,88
578	Verint Systems, Inc. ....	18.612	0,50
1.053	Xerox Holdings Corp. ....	12.236	0,33
		<u>2.916.767</u>	<u>77,57</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>3.757.649</u>	<u>99,93</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>3.757.649</u>	<u>99,93</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin AI, Metaverse und Blockchain UCITS ETF (Fortsetzung)

	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>Anlagenportfolio</b>	3.757.649	99,93
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	2.606	0,07
<b>Nettovermögen</b>	<u>3.760.255</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	99,91
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	0,09
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 94,80 % (30. Juni 2023: 91,55 %)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 94,80 % (30. Juni 2023: 91,55 %)</b>		
	<b>Albanien: 0,43 % (30. Juni 2023: 0,18 %)</b>		
210.000	Staatsanleihen Albanien 3,50 % 16.06.2027 .....	218.275	0,43
		<u>218.275</u>	<u>0,43</u>
	<b>Armenien: 0,96 % (30. Juni 2023: 0,51 %)</b>		
600.000	Staatsanleihen Republik Armenien 3,60 % 02.02.2031 .....	489.446	0,96
		<u>489.446</u>	<u>0,96</u>
	<b>Benin: 0,18 % (30. Juni 2023: 0,13 %)</b>		
100.000	Staatsanleihen Benin 4,88 % 19.01.2032 .....	89.984	0,18
		<u>89.984</u>	<u>0,18</u>
	<b>Brasilien: 7,70 % (30. Juni 2023: 7,03 %)</b>		
2.100.000	Staatsanleihen Brasilien 4,75 % 14.01.2050 .....	1.511.161	2,95
2.500.000	Staatsanleihen Brasilien 2,88 % 06.06.2025 .....	2.430.462	4,75
		<u>3.941.623</u>	<u>7,70</u>
	<b>Bulgarien: 1,59 % (30. Juni 2023: 0,90 %)</b>		
500.000	Staatsanleihen Bulgarien 3,13 % 26.03.2035 .....	490.927	0,96
500.000	Staatsanleihen Bulgarien 1,38 % 23.09.2050 .....	321.781	0,63
		<u>812.708</u>	<u>1,59</u>
	<b>Chile: 9,30 % (30. Juni 2023: 10,68 %)</b>		
1.000.000	Staatsanleihen Chile 1,44 % 01.02.2029 .....	978.704	1,91
800.000	Staatsanleihen Chile 2,55 % 27.07.2033 .....	650.397	1,27
1.100.000	Staatsanleihen Chile 4,34 % 07.03.2042 .....	951.011	1,86
500.000	Staatsanleihen Chile 1,25 % 22.01.2051 .....	299.610	0,59
2.000.000	Staatsanleihen Chile 0,56 % 21.01.2029 .....	1.880.949	3,67
		<u>4.760.671</u>	<u>9,30</u>
	<b>Kolumbien: 5,77 % (30. Juni 2023: 5,60 %)</b>		
2.300.000	Staatsanleihen Kolumbien 7,38 % 18.09.2037 .....	2.236.909	4,37
1.100.000	Staatsanleihen Kolumbien 4,13 % 22.02.2042 .....	719.341	1,40
		<u>2.956.250</u>	<u>5,77</u>
	<b>Costa Rica: 2,46 % (30. Juni 2023: 1,68 %)</b>		
400.000	Staatsanleihen Costa Rica 6,13 % 19.02.2031 .....	403.000	0,79
950.000	Staatsanleihen Costa Rica 5,63 % 30.04.2043 .....	856.929	1,67
		<u>1.259.929</u>	<u>2,46</u>
	<b>Dominikanische Republik: 5,34 % (30. Juni 2023: 4,68 %)</b>		
1.000.000	Staatsanleihen Dominikanische Republik 5,88 % 30.01.2060 .....	850.932	1,66
1.400.000	Staatsanleihen Dominikanische Republik 6,00 % 19.07.2028 .....	1.388.921	2,71
550.000	Staatsanleihen Dominikanische Republik 4,88 % 23.09.2032 .....	493.697	0,97
		<u>2.733.550</u>	<u>5,34</u>
	<b>Ungarn: 2,66 % (30. Juni 2023: 1,88 %)</b>		
1.100.000	Staatsanleihen Ungarn 3,13 % 21.09.2051 .....	698.867	1,36
250.000	Staatsanleihen Ungarn 1,63 % 28.04.2032 .....	221.074	0,43
700.000	Staatsanleihen Ungarn 144A 3,13 % 21.09.2051 .....	444.720	0,87
		<u>1.364.661</u>	<u>2,66</u>
	<b>Israel: 5,12 % (30. Juni 2023: 5,23 %)</b>		
400.000	Staatsanleihen Israel 3,80 % 13.05.2060 .....	258.709	0,51
2.000.000	Staatsanleihen Israel 2,75 % 03.07.2030 .....	1.690.491	3,30
960.000	Staatsanleihen Israel 3,88 % 03.07.2050 .....	673.208	1,31
		<u>2.622.408</u>	<u>5,12</u>
	<b>Elfenbeinküste: 1,93 % (30. Juni 2023: 1,50 %)</b>		
300.000	Staatsanleihen Elfenbeinküste 6,88 % 17.10.2040 .....	269.374	0,53
800.000	Staatsanleihen Elfenbeinküste 4,88 % 30.01.2032 .....	719.327	1,40
		<u>988.701</u>	<u>1,93</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 94,80 % (30. Juni 2023: 91.55 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 94,80 % (30. Juni 2023: 91.55 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Kenia: 0,68 % (30. Juni 2023: 1,16 %)</b>		
400.000	Staatsanleihen Republik Kenia 8,00 % 22.05.2032 .....	348.654	0,68
		<u>348.654</u>	<u>0,68</u>
	<b>Mazedonien: 0,60 % (30. Juni 2023: 0,33 %)</b>		
330.000	Staatsanleihen Nordmazedonien 1,63 % 10.03.2028 .....	308.340	0,60
		<u>308.340</u>	<u>0,60</u>
	<b>Mongolei: 1,06 % (30. Juni 2023: 0,54 %)</b>		
600.000	Staatsanleihen Mongolei 3,50 % 07.07.2027 .....	540.900	1,06
		<u>540.900</u>	<u>1,06</u>
	<b>Montenegro: 0,38 % (30. Juni 2023: 0,15 %)</b>		
200.000	Staatsanleihen Montenegro 2,88 % 16.12.2027 .....	197.386	0,38
		<u>197.386</u>	<u>0,38</u>
	<b>Panama: 4,70 % (30. Juni 2023: 4,31 %)</b>		
600.000	Staatsanleihen Panama 3,16 % 23.01.2030 .....	507.496	0,99
1.100.000	Staatsanleihen Panama 2,25 % 29.09.2032 .....	792.870	1,55
1.500.000	Staatsanleihen Panama 3,87 % 23.07.2060 .....	858.949	1,68
250.000	Staatsanleihen Panama 4,00 % 22.09.2024 .....	248.375	0,48
		<u>2.407.690</u>	<u>4,70</u>
	<b>Paraguay: Null (30. Juni 2023: 0,90 %)</b>		
	<b>Peru: 5,33 % (30. Juni 2023: 5,11 %)</b>		
2.100.000	Staatsanleihen Peru 2,78 % 23.01.2031 .....	1.808.213	3,53
600.000	Staatsanleihen Peru 3,23 % 28.07.2121 .....	341.955	0,67
900.000	Staatsanleihen Peru 3,60 % 15.01.2072 .....	579.436	1,13
		<u>2.729.604</u>	<u>5,33</u>
	<b>Philippinen: 8,31 % (30. Juni 2023: 8,98 %)</b>		
200.000	Staatsanleihen Philippinen 3,95 % 20.01.2040 .....	170.195	0,33
2.000.000	Staatsanleihen Philippinen 3,70 % 02.02.2042 .....	1.620.545	3,17
1.400.000	Staatsanleihen Philippinen 3,00 % 01.02.2028 .....	1.304.961	2,55
800.000	Staatsanleihen Philippinen 1,65 % 10.06.2031 .....	636.836	1,24
600.000	Staatsanleihen Philippinen 1,20 % 28.04.2033 .....	520.071	1,02
		<u>4.252.608</u>	<u>8,31</u>
	<b>Polen: 7,33 % (30. Juni 2023: 10,03 %)</b>		
1.200.000	Staatsanleihen Republik Polen 2,75 % 25.05.2032 .....	1.224.855	2,39
1.600.000	Staatsanleihen Republik Polen 1,13 % 07.08.2026 .....	1.642.050	3,21
900.000	Staatsanleihen Republik Polen 1,00 % 25.10.2028 .....	887.836	1,73
		<u>3.754.741</u>	<u>7,33</u>
	<b>Rumänien: 10,73 % (30. Juni 2023: 9,70 %)</b>		
2.500.000	Staatsanleihen Rumänien 4,63 % 03.04.2049 .....	2.207.229	4,31
1.200.000	Staatsanleihen Rumänien 2,88 % 11.03.2029 .....	1.194.509	2,34
2.000.000	Staatsanleihen Rumänien 5,25 % 30.05.2032 .....	2.089.861	4,08
		<u>5.491.599</u>	<u>10,73</u>
	<b>Senegal: 1,65 % (30. Juni 2023: 1,31 %)</b>		
450.000	Staatsanleihen Senegal 6,25 % 23.05.2033 .....	378.465	0,74
600.000	Staatsanleihen Senegal 5,38 % 08.06.2037 .....	469.077	0,91
		<u>847.542</u>	<u>1,65</u>
	<b>Serbien: 1,92 % (30. Juni 2023: 1,48 %)</b>		
900.000	Staatsanleihen Serbien 1,50 % 26.06.2029 .....	820.406	1,60
200.000	Staatsanleihen Serbien 1,65 % 03.03.2033 .....	160.787	0,32
		<u>981.193</u>	<u>1,92</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 94,80 % (30. Juni 2023: 91.55 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 94,80 % (30. Juni 2023: 91.55 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südafrika: 4,83 % (30. Juni 2023: 3,87 %)</b>		
750.000	Staatsanleihen Republik Südafrika 5,75 % 30.09.2049 .....	567.583	1,11
2.000.000	Staatsanleihen Republik Südafrika 5,88 % 22.06.2030 .....	1.903.690	3,72
		<u>2.471.273</u>	<u>4,83</u>
	<b>Südkorea: 1,60 % (30. Juni 2023: 1,31 %)</b>		
900.000	Staatsanleihen Korea 2,50 % 19.06.2029 .....	817.985	1,60
		<u>817.985</u>	<u>1,60</u>
	<b>Uruguay: 2,24 % (30. Juni 2023: 2,37 %)</b>		
1.000.000	Staatsanleihen Uruguay 4,98 % 20.04.2055 .....	914.447	1,79
233.333	Staatsanleihen Uruguay 4,50 % 14.08.2024 .....	233.240	0,45
		<u>1.147.687</u>	<u>2,24</u>
	<b>Summe Staatsanleihen</b> .....	<u>48.535.408</u>	<u>94,80</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>48.535.408</u>	<u>94,80</u>
		<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	48.535.408	94,80
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>2.662.232</u>	<u>5,20</u>
	<b>Nettovermögen</b>	<u>51.197.640</u>	<u>100,00</u>
	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....		94,77
	Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		<u>5,23</u>
	Gesamtvermögen .....		<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,56 % (30. Juni 2023: 0,25 %)</b>		
128.000	Brilliance China Automotive Holdings Ltd. ....	134.600	0,31
6.900	Orient Overseas International Ltd. ....	111.975	0,25
		<u>246.575</u>	<u>0,56</u>
	<b>Brasilien: 7,12 % (30. Juni 2023: 8,32 %)</b>		
190.400	Ambev SA ADR .....	390.320	0,89
73.600	Banco do Brasil SA .....	353.925	0,81
38.400	BB Seguridade Participacoes SA .....	227.658	0,52
17.600	Caixa Seguridade Participacoes SA .....	45.343	0,10
89.600	Cia Energetica de Minas Gerais .....	159.538	0,36
9.600	CPFL Energia SA .....	56.569	0,13
8.000	Engie Brasil Energia SA .....	63.790	0,15
62.400	Gerdau SA .....	206.485	0,47
19.200	Lojas Renner SA .....	43.139	0,10
27.200	Petroleo Brasileiro SA .....	197.740	0,45
35.200	Petroleo Brasileiro SA (preferred stock) .....	241.133	0,55
33.600	PRIIO SA .....	264.713	0,60
16.000	Telefonica Brasil SA .....	130.605	0,30
33.600	TIM SA .....	96.061	0,22
3.171	Vale SA .....	35.521	0,08
31.613	Vale SA ADR .....	353.117	0,81
33.600	WEG SA .....	255.216	0,58
		<u>3.120.873</u>	<u>7,12</u>
	<b>Cayman-Inseln: 1,79 % (30. Juni 2023: 3,58 %)</b>		
23.000	C&D International Investment Group Ltd. ....	42.775	0,10
144.000	China Feihe Ltd. ....	66.583	0,15
704.000	GCL Technology Holdings Ltd. ....	104.598	0,24
6.400	Giant Biogene Holding Co. Ltd. ....	37.585	0,08
32.000	Haidilao International Holding Ltd. ....	57.545	0,13
20.000	Haitian International Holdings Ltd. ....	56.869	0,13
555	Horizon Construction Development Ltd. ....	108	0,00
4.448	Qifu Technology, Inc. ADR .....	87.759	0,20
64.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. ....	77.137	0,18
80.000	Topsports International Holdings Ltd. ....	42.524	0,10
8.016	Vipshop Holdings Ltd. ADR .....	104.368	0,24
176.000	Want Want China Holdings Ltd. ....	106.402	0,24
		<u>784.253</u>	<u>1,79</u>
	<b>Chile: 1,37 % (30. Juni 2023: 1,58 %)</b>		
1.612.688	Banco de Chile .....	179.409	0,41
791.424	Cia Sud Americana de Vapores SA .....	50.105	0,12
870.480	Enel Chile SA .....	48.968	0,11
4.831.008	Latam Airlines Group SA .....	65.715	0,15
6.320	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA .....	254.608	0,58
		<u>598.805</u>	<u>1,37</u>
	<b>China: 22,27 % (30. Juni 2023: 21,61 %)</b>		
6.400	37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co. Ltd. ....	11.440	0,03
132.800	Agricultural Bank of China Ltd. Anteilsklasse A .....	79.307	0,18
752.000	Agricultural Bank of China Ltd. Anteilsklasse H .....	321.705	0,73
1.600	AIMA Technology Group Co. Ltd. ....	5.989	0,01
9.600	Anhui Conch Cement Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	31.019	0,07
48.000	Anhui Conch Cement Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	114.353	0,26
3.800	Anhui Gujing Distillery Co. Ltd. Anteilsklasse B .....	56.547	0,13
1.600	Anhui Yingjia Distillery Co. Ltd. ....	12.601	0,03
1.600	Anker Innovations Technology Co. Ltd. ....	15.606	0,04
4.800	Avary Holding Shenzhen Co. Ltd. ....	26.141	0,06
56.000	Bank of Beijing Co. Ltd. ....	44.795	0,10

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 22,27 % (30. Juni 2023: 21,61 %) (Fortsetzung)</b>		
9.600	Bank of Changsha Co. Ltd. ....	10.756	0,02
8.000	Bank of Chengdu Co. Ltd. ....	16.645	0,04
27.200	Bank of China Ltd. Anteilsklasse A ....	17.212	0,04
864.000	Bank of China Ltd. Anteilsklasse H ....	426.057	0,97
94.400	Bank of Communications Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	96.587	0,22
352.000	Bank of Communications Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	276.374	0,63
8.000	Bank of Hangzhou Co. Ltd. ....	14.300	0,03
41.600	Bank of Jiangsu Co. Ltd. ....	42.336	0,10
25.600	Bank of Nanjing Co. Ltd. ....	36.432	0,08
35.200	Bank of Shanghai Co. Ltd. ....	35.003	0,08
48.000	Baoshan Iron & Steel Co. Ltd. ....	43.721	0,10
1.600	Beijing New Building Materials PLC ....	6.500	0,01
3.200	By-health Co. Ltd. ....	5.939	0,01
416.000	China CITIC Bank Corp. Ltd. ....	266.947	0,61
96.000	China Coal Energy Co. Ltd. ....	112.140	0,26
96.000	China Communications Services Corp. Ltd. ....	51.766	0,12
4.800	China Construction Bank Corp., Anteilsklasse A ....	4.865	0,01
592.000	China Construction Bank Corp., Anteilsklasse H ....	437.513	1,00
121.600	China Everbright Bank Co. Ltd., Anteilsklasse A ....	52.798	0,12
144.000	China Everbright Bank Co. Ltd., Anteilsklasse H ....	44.819	0,10
240.000	China Life Insurance Co. Ltd. ....	339.370	0,77
91.200	China Minsheng Banking Corp. Ltd. Anteilsklasse A ....	47.344	0,11
272.000	China Minsheng Banking Corp. Ltd. Anteilsklasse H ....	94.065	0,21
89.600	China Pacific Insurance Group Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	218.738	0,50
49.600	China Petroleum & Chemical Corp. Anteilsklasse A ....	42.936	0,10
608.000	China Petroleum & Chemical Corp. Anteilsklasse H ....	394.047	0,90
160.000	China Railway Group Ltd. ....	88.326	0,20
2.080	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co. Ltd. ....	12.131	0,03
9.600	China Shenhua Energy Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	58.343	0,13
83.733	China Shenhua Energy Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	385.557	0,88
91.200	China State Construction Engineering Corp. Ltd. ....	66.331	0,15
60.800	China Vanke Co. Ltd. ....	36.212	0,08
48.000	China Yangtze Power Co. Ltd. ....	190.137	0,43
48.000	China Zheshang Bank Co. Ltd. ....	18.146	0,04
1.200	Chongqing Brewery Co. Ltd. ....	9.977	0,02
24.000	Chongqing Rural Commercial Bank Co. Ltd. ....	16.502	0,04
4.800	Chongqing Zhifei Biological Products Co. Ltd. ....	18.429	0,04
11.200	CNOOC Energy Technology & Services Ltd. ....	6.320	0,01
41.600	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	88.262	0,20
161.000	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	281.689	0,64
128.000	CRRC Corp. Ltd. ....	82.629	0,19
3.200	CSPC Innovation Pharmaceutical Co. Ltd. ....	11.058	0,03
40.000	Daqin Railway Co. Ltd. ....	39.228	0,09
36.800	Focus Media Information Technology Co. Ltd. ....	30.545	0,07
22.400	Foxconn Industrial Internet Co. Ltd. ....	84.067	0,19
1.160	Goneo Group Co. Ltd. ....	12.253	0,03
6.400	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai ....	34.381	0,08
17.600	Guanghui Energy Co. Ltd. ....	16.152	0,04
3.200	Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co. Ltd. ....	9.323	0,02
3.200	Heilongjiang Agriculture Co. Ltd. ....	5.474	0,01
6.400	Henan Shenhua Coal Industry & Electricity Power Co. Ltd. ....	17.734	0,04
9.600	Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd. ....	31.256	0,07
1.600	Hisense Home Appliances Group Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	7.065	0,02
6.000	Hisense Home Appliances Group Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	19.751	0,05
1.600	Hisense Visual Technology Co. Ltd. ....	5.422	0,01
9.600	HLA Group Corp. Ltd. ....	12.150	0,03
8.000	Huaibei Mining Holdings Co. Ltd. ....	18.343	0,04

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,50 % (30. Juni 2023: 98.92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,50 % (30. Juni 2023: 98.92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 22,27 % (30. Juni 2023: 21.61 %) (Fortsetzung)</b>		
35.200	Huaxia Bank Co. Ltd. ....	30.857	0,07
3.200	Huayu Automotive Systems Co. Ltd. ....	7.179	0,02
3.200	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co. Ltd. ....	13.899	0,03
16.000	Hunan Valin Steel Co. Ltd. ....	9.708	0,02
300	Imeik Technology Development Co. Ltd. ....	7.072	0,02
41.600	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Anteilsklasse A ....	32.478	0,07
688.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Anteilsklasse H ....	408.884	0,93
27.200	Industrial Bank Co. Ltd. ....	65.645	0,15
6.400	Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp. Ltd. ....	18.496	0,04
17.600	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co. Ltd. ....	8.895	0,02
48.000	Inner Mongolia Yitai Coal Co. Ltd. ....	86.208	0,20
1.600	Jason Furniture Hangzhou Co. Ltd. ....	7.076	0,02
42.000	Jiangsu Expressway Co. Ltd. ....	44.811	0,10
3.200	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd. ....	20.250	0,05
750	Jiangsu Pacific Quartz Co. Ltd. ....	3.042	0,01
3.200	Jiangsu Phoenix Publishing & Media Corp. Ltd. ....	4.804	0,01
3.200	Jiangsu Yanghe Distillery Co. Ltd. ....	35.389	0,08
4.800	Jinduicheng Molybdenum Co. Ltd. ....	6.844	0,02
9.600	Jizhong Energy Resources Co. Ltd. ....	8.810	0,02
3.200	Kingnet Network Co. Ltd. ....	4.186	0,01
1.900	Kweichow Moutai Co. Ltd. ....	381.879	0,87
3.200	Luzhou Laojiao Co. Ltd. ....	62.892	0,14
6.400	Meihua Holdings Group Co. Ltd. ....	8.784	0,02
4.800	Midea Group Co. Ltd. ....	42.406	0,10
4.800	New China Life Insurance Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	19.743	0,05
35.200	New China Life Insurance Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	67.177	0,15
924	Ningbo Deye Technology Co. Ltd. ....	9.409	0,02
76.800	Nongfu Spring Co. Ltd. ....	364.454	0,83
19.200	People's Insurance Co. Group of China Ltd. Anteilsklasse A ....	13.544	0,03
384.000	People's Insurance Co. Group of China Ltd. Anteilsklasse H ....	131.813	0,30
24.000	PetroChina Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	33.925	0,08
416.000	PetroChina Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	420.934	0,96
256.000	PICC Property & Casualty Co. Ltd. ....	318.057	0,73
3.200	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co. Ltd. ....	4.909	0,01
272.000	Postal Savings Bank of China Co. Ltd. ....	159.561	0,36
12.800	Qinghai Salt Lake Industry Co. Ltd. ....	30.594	0,07
30.400	Shaanxi Coal Industry Co. Ltd. ....	107.304	0,24
8.000	Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co. Ltd. ....	10.914	0,02
1.600	Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co. Ltd. ....	8.365	0,02
4.800	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co. Ltd. ....	17.515	0,04
6.400	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd. ....	12.229	0,03
13.400	Shanghai Baosight Software Co. Ltd. Anteilsklasse B ....	21.695	0,05
72.000	Shanghai Pudong Development Bank Co. Ltd. ....	81.163	0,19
19.200	Shanghai Rural Commercial Bank Co. Ltd. ....	17.672	0,04
6.400	Shanxi Coal International Energy Group Co. Ltd. ....	12.816	0,03
14.400	Shanxi Coking Coal Energy Group Co. Ltd. ....	20.335	0,05
9.600	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co. Ltd. ....	23.839	0,05
2.850	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd. ....	82.320	0,19
2.850	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd. ....	113.561	0,26
1.600	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co. Ltd. ....	14.780	0,03
3.200	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co. Ltd. ....	6.719	0,02
12.800	Sichuan Hebang Biotechnology Co. Ltd. ....	2.893	0,01
17.600	Sichuan Road & Bridge Group Co. Ltd. ....	19.020	0,04
1.200	Sichuan Swellfun Co. Ltd. ....	6.185	0,01
1.600	Sinomine Resource Group Co. Ltd. ....	5.873	0,01
44.800	Sinopharm Group Co. Ltd. ....	119.067	0,27
9.600	TBEA Co. Ltd. ....	18.238	0,04

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,50 % (30. Juni 2023: 98.92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,50 % (30. Juni 2023: 98.92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 22,27 % (30. Juni 2023: 21.61 %) (Fortsetzung)</b>		
6.400	Tian Di Science & Technology Co. Ltd. ....	6.040	0,01
3.200	Tianqi Lithium Corp. ....	13.110	0,03
14.400	Tongwei Co. Ltd. ....	37.692	0,09
4.800	Western Mining Co. Ltd. ....	11.801	0,03
7.250	Wuliangye Yibin Co. Ltd. ....	127.148	0,29
4.800	Xiamen C & D, Inc. ....	5.871	0,01
3.712	Xinjiang Daqo New Energy Co. Ltd. ....	10.367	0,02
9.600	Yankuang Energy Group Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	29.888	0,07
143.650	Yankuang Energy Group Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	205.335	0,47
2.740	Yealink Network Technology Corp. Ltd. ....	13.800	0,03
4.800	Yintai Gold Co. Ltd. ....	10.710	0,02
1.600	YongXing Special Materials Technology Co. Ltd. ....	7.841	0,02
8.000	Youngor Fashion Co. Ltd. ....	7.802	0,02
6.400	YTO Express Group Co. Ltd. ....	13.719	0,03
4.800	Yunnan Yuntianhua Co. Ltd. ....	12.768	0,03
4.800	Yutong Bus Co. Ltd. ....	16.962	0,04
4.800	Zangge Mining Co. Ltd. ....	15.825	0,04
6.400	Zhejiang NHU Co. Ltd. ....	16.831	0,04
1.600	Zhejiang Supor Co. Ltd. ....	10.980	0,03
4.800	Zhejiang Weixing New Building Materials Co. Ltd. ....	10.138	0,02
		<b>9.769.651</b>	<b>22,27</b>
	<b>Zypern: Null (30. Juni 2023: Null)</b>		
	<b>Tschechische Republik: 0,60 % (30. Juni 2023: 0,53 %)</b>		
6.080	CEZ AS ....	228.955	0,52
7.664	Moneta Money Bank AS ....	33.517	0,08
		<b>262.472</b>	<b>0,60</b>
	<b>Ägypten: 0,24 % (30. Juni 2023: 0,10 %)</b>		
44.896	Commercial International Bank Egypt (CIB) ....	72.350	0,17
85.710	Eastern Co. SAE ....	32.442	0,07
		<b>104.792</b>	<b>0,24</b>
	<b>Griechenland: 1,46 % (30. Juni 2023: 1,20 %)</b>		
8.640	Hellenic Telecommunications Organization SA ....	124.453	0,28
5.776	Jumbo SA ....	166.399	0,38
2.976	Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA ....	74.763	0,17
3.392	Mytilineos SA ....	126.729	0,29
9.488	OPAP SA ....	148.871	0,34
		<b>641.215</b>	<b>1,46</b>
	<b>Hongkong: 1,39 % (30. Juni 2023: 2,77 %)</b>		
18.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd. ....	62.082	0,14
45.700	China Merchants Port Holdings Co. Ltd. ....	68.017	0,15
54.400	China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd. ....	55.603	0,13
192.000	CITIC Ltd. ....	174.603	0,40
288.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd. ....	229.444	0,52
32.000	Far East Horizon Ltd. ....	20.821	0,05
		<b>610.570</b>	<b>1,39</b>
	<b>Ungarn: 1,37 % (30. Juni 2023: 0,63 %)</b>		
17.856	MOL Hungarian Oil & Gas PLC ....	139.461	0,32
6.208	OTP Bank Nyrt ....	308.727	0,70
5.856	Richter Gedeon Nyrt ....	152.246	0,35
		<b>600.434</b>	<b>1,37</b>
	<b>Indien: 15,60 % (30. Juni 2023: 10,47 %)</b>		
24.944	Adani Power Ltd. ....	214.957	0,49
2.880	Bajaj Auto Ltd. ....	328.164	0,75

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 15,60 % (30. Juni 2023: 10,47 %) (Fortsetzung)</b>		
25.760	Bharat Petroleum Corp. Ltd. ....	93.896	0,21
25.760	Bharat Petroleum Corp. Ltd. (Stammaktien) ....	93.896	0,21
4.592	Britannia Industries Ltd. ....	301.529	0,69
17.632	CG Power & Industrial Solutions Ltd. ....	149.006	0,34
76.272	Coal India Ltd. ....	432.776	0,99
7.232	Colgate-Palmolive India Ltd. ....	246.580	0,56
2.736	Cummins India Ltd. ....	130.155	0,30
3.264	Dr Reddy's Laboratories Ltd. ....	250.604	0,57
83.120	GAIL India Ltd. ....	218.846	0,50
27.888	HCL Technologies Ltd. ....	488.147	1,11
3.408	HDFC Asset Management Co. Ltd. ....	163.204	0,37
4.240	Hero MotoCorp Ltd. ....	283.706	0,65
12.736	Hindustan Petroleum Corp. Ltd. ....	50.723	0,12
6.368	Hindustan Petroleum Corp. Ltd. (Stammaktien) ....	25.361	0,06
117.056	Indian Oil Corp. Ltd. ....	232.505	0,53
15.440	Indus Towers Ltd. ....	69.490	0,16
26.096	Infosys Ltd. ....	490.312	1,12
86.080	ITC Ltd. ....	438.620	1,00
19.856	Marico Ltd. ....	145.966	0,33
15.088	Nestle India Ltd. ....	461.691	1,05
22.976	NMDC Ltd. ....	67.795	0,15
133.616	Oil & Natural Gas Corp. Ltd. ....	439.364	1,00
31.664	Petronet LNG Ltd. ....	125.403	0,29
1.792	Supreme Industries Ltd. ....	127.992	0,29
9.792	Tata Consultancy Services Ltd. ....	458.455	1,05
1.168	Tata Elxsi Ltd. ....	98.068	0,22
39.824	Vedanta Ltd. ....	216.820	0,49
		<b>6.844.031</b>	<b>15,60</b>
	<b>Indonesien 2,54 % (30. Juni 2023: 3,09 %)</b>		
868.800	Adaro Energy Indonesia Tbk. PT ....	148.028	0,34
849.600	Astra International Tbk. PT ....	231.402	0,53
169.600	Indofood Sukses Makmur Tbk. PT ....	62.920	0,14
612.800	Sumber Alfaria Trijaya Tbk. PT ....	102.913	0,23
1.992.000	Telkom Indonesia Persero Tbk. PT ....	380.761	0,87
385.600	Unilever Indonesia Tbk. PT ....	71.115	0,16
88.000	United Tractors Tbk. PT ....	118.095	0,27
		<b>1.115.234</b>	<b>2,54</b>
	<b>Jersey: Null (30. Juni 2023: Null)</b>		
	<b>Kuwait: 0,23 % (30. Juni 2023: 0,27 %)</b>		
69.040	Mobile Telecommunications Co. KSCP ....	100.156	0,23
		<b>100.156</b>	<b>0,23</b>
	<b>Malaysia: 0,57 % (30. Juni 2023: 0,72 %)</b>		
65.600	MR DIY Group M Bhd. ....	26.977	0,06
2.930	Nestle Malaysia Bhd. ....	75.463	0,17
30.400	Petronas Gas Bhd. ....	114.834	0,26
24.000	Telekom Malaysia Bhd. ....	34.391	0,08
		<b>251.665</b>	<b>0,57</b>
	<b>Mexiko: 2,85 % (30. Juni 2023: 2,51 %)</b>		
17.584	Arca Continental SAB de CV ....	172.527	0,40
26.448	Banco del Bajío SA ....	80.289	0,18
17.552	Coca-Cola Femsa SAB de CV ....	150.577	0,34
106.416	Fibra Uno Administracion SA de CV ....	130.827	0,30
9.440	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ....	80.102	0,18
3.536	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ....	106.512	0,24

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Mexiko: 2,85 % (30. Juni 2023: 2,51 %) (Fortsetzung)</b>		
56.576	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 'A'	97.926	0,22
5.616	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV .....	51.985	0,12
111.552	Wal-Mart de Mexico SAB de CV .....	379.822	0,87
		<u>1.250.567</u>	<u>2,85</u>
	<b>Philippinen: 0,71 % (30. Juni 2023: 0,43 %)</b>		
40.800	International Container Terminal Services, Inc. ....	243.510	0,56
10.880	Manila Electric Co. ....	67.943	0,15
		<u>311.453</u>	<u>0,71</u>
	<b>Polen: 1,11 % (30. Juni 2023: 0,93 %)</b>		
464	Budimex SA .....	80.449	0,18
24.112	ORLEN SA .....	406.000	0,93
		<u>486.449</u>	<u>1,11</u>
	<b>Katar: 1,07 % (30. Juni 2023: 1,17 %)</b>		
65.280	Industries Qatar QSC .....	229.493	0,53
184.256	Mesaieed Petrochemical Holding Co. ....	83.297	0,19
15.456	Qatar Electricity & Water Co. QSC .....	66.434	0,15
21.664	Qatar Fuel QSC .....	88.596	0,20
		<u>467.820</u>	<u>1,07</u>
	<b>Russland: Null (30. Juni 2023: Null)</b>		
102.144	Alrosa PJSC .....	-	0,00
83.636	Gazprom PJSC .....	-	0,00
130.200	GMK Norilskiy Nickel PAO .....	-	0,00
1.511.510	Inter RAO UES PJSC .....	-	0,00
4.242	LUKOIL PJSC .....	-	0,00
39.606	Moscow Exchange MICEX-Rates PJSC .....	-	0,00
65.240	Novolipetsk Steel PJSC .....	-	0,00
39	PhosAgro PJSC Hinterlegungszertifikate .....	-	0,00
1.998	PhosAgro PJSC GDR .....	-	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 (Vorzugsaktien) .....	-	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: 4,79 % (30. Juni 2023: 4,55 %)</b>		
656	Arabian Internet & Communications Services Co. ....	51.129	0,12
2.528	Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co. ....	173.178	0,39
1.920	Co. for Cooperative Insurance .....	74.004	0,17
3.056	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co. ....	235.089	0,54
832	Elm Co. ....	190.103	0,43
26.000	Jarir Marketing Co. ....	87.877	0,20
1.456	Nahdi Medical Co. ....	51.152	0,12
10.832	SABIC Agri-Nutrients Co. ....	325.688	0,74
56.256	Saudi Arabian Oil Co. ....	415.367	0,95
1.520	Saudi Aramco Base Oil Co. ....	53.238	0,12
44.336	Saudi Telecom Co. ....	443.171	1,01
		<u>2.099.996</u>	<u>4,79</u>
	<b>Südafrika: 3,06 % (30. Juni 2023: 4,54 %)</b>		
8.992	Clicks Group Ltd. ....	169.577	0,39
14.112	Exxaro Resources Ltd. ....	137.565	0,31
26.832	Gold Fields Ltd. ....	401.775	0,92

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südafrika: 3,06 % (30. Juni 2023: 4,54 %) (Fortsetzung)</b>		
19.568	Harmony Gold Mining Co. Ltd. ....	180.088	0,41
3.584	Kumba Iron Ore Ltd. ....	86.289	0,20
25.632	OUTsurance Group Ltd. ....	65.161	0,15
11.888	Sasol Ltd. ....	89.909	0,20
22.880	Vodacom Group Ltd. ....	122.181	0,28
26.240	Woolworths Holdings Ltd. ....	88.779	0,20
		<u>1.341.324</u>	<u>3,06</u>
	<b>Südkorea: 9,10 % (30. Juni 2023: 9,13 %)</b>		
1.040	Coway Co. Ltd. ....	48.506	0,11
2.080	DB Insurance Co. Ltd. ....	173.019	0,39
1.616	Doosan Bobcat, Inc. ....	60.226	0,14
9.664	Hana Financial Group, Inc. ....	426.157	0,97
1.664	Hankook Tire & Technology Co. Ltd. ....	54.641	0,12
1.184	Hanmi Semiconductor Co. Ltd. ....	148.204	0,34
576	Hyundai Glovis Co. Ltd. ....	91.641	0,21
1.232	Hyundai Mobis Co. Ltd. ....	225.098	0,51
864	Hyundai Motor Co. (Vorzugsaktien) ....	114.112	0,26
1.344	Hyundai Motor Co. (zweite Vorzugsaktie) ....	178.875	0,41
12.672	Industrial Bank of Korea ....	129.067	0,29
7.504	KB Financial Group, Inc. ....	427.943	0,98
5.360	Kia Corp. ....	503.486	1,15
4.096	KT&G Corp. ....	262.453	0,60
6.208	LG Uplus Corp. ....	44.288	0,10
2.960	Meritz Financial Group, Inc. ....	170.095	0,39
5.456	NH Investment & Securities Co. Ltd. ....	50.299	0,11
784	Orion Corp. ....	52.513	0,12
2.048	Samsung Life Insurance Co. Ltd. ....	131.673	0,30
12.528	Shinhan Financial Group Co. Ltd. ....	438.230	1,00
24.512	Woori Financial Group, Inc. ....	261.592	0,60
		<u>3.992.118</u>	<u>9,10</u>
	<b>Taiwan: 11,35 % (30. Juni 2023: 13,14 %)</b>		
17.650	Accton Technology Corp. ....	301.951	0,69
94.900	ASE Technology Holding Co. Ltd. ....	492.907	1,12
113.380	Chunghwa Telecom Co. Ltd. ....	438.611	1,00
2.416	eMemory Technology, Inc. ....	191.394	0,44
2.896	Fortune Electric Co. Ltd. ....	84.359	0,19
71.400	Lite-On Technology Corp. ....	233.294	0,53
12.320	MediaTek, Inc. ....	531.665	1,21
6.400	Nien Made Enterprise Co. Ltd. ....	76.938	0,18
23.840	Novatek Microelectronics Corp. ....	445.326	1,02
51.200	Quanta Computer, Inc. ....	492.406	1,12
17.066	Realtek Semiconductor Corp. ....	287.226	0,66
17.280	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	514.541	1,17
272.000	United Microelectronics Corp. ....	467.007	1,06
2.290	Voltronic Power Technology Corp. ....	135.883	0,31
3.520	Wiwynn Corp. ....	286.990	0,65
		<u>4.980.498</u>	<u>11,35</u>
	<b>Thailand: 1,85 % (30. Juni 2023: 2,17 %)</b>		
43.200	Advanced Info Service PCL NVDR ....	246.033	0,56
25.600	Bumrungrad Hospital PCL NVDR ....	172.306	0,39
48.000	Intouch Holdings PCL NVDR ....	93.521	0,21
118.400	Krung Thai Bank PCL NVDR ....	55.171	0,13
59.200	PTT Exploration & Production PCL NVDR ....	245.205	0,56
		<u>812.236</u>	<u>1,85</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens	
<b>übertragbare Wertpapiere: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Aktien: 99,50 % (30. Juni 2023: 98,92 %) (Fortsetzung)</b>				
<b>Türkei: 4,43 % (30. Juni 2023: 3,07 %)</b>				
62.288	Akbank TAS .....	121.694	0,28	
18.832	BIM Birlesik Magazalar AS .....	313.067	0,71	
1.920	Coca-Cola Icecek AS .....	48.376	0,11	
3.568	Ford Otomotiv Sanayi AS .....	122.331	0,28	
30.304	KOC Holding AS .....	209.646	0,48	
6.944	Pegasus Hava Tasimaciligi AS .....	48.272	0,11	
5.440	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS .....	56.419	0,13	
21.072	Turk Hava Yollari AO .....	198.453	0,45	
54.704	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS .....	167.866	0,38	
387.328	Turkiye Is Bankasi AS .....	187.263	0,43	
49.120	Turkiye Petrol Rafinerileri AS .....	247.971	0,56	
49.056	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS .....	75.117	0,17	
143.616	Yapi ve Kredi Bankasi AS .....	148.069	0,34	
		<b>1.944.544</b>	<b>4,43</b>	
<b>Vereinigte Arabische Emirate: 2,07 % (30. Juni 2023: 1,75 %)</b>				
138.432	Abu Dhabi National Oil Co. for Distribution PJSC .....	127.766	0,29	
107.936	Americana Restaurants International PLC .....	93.743	0,21	
203.216	Emaar Properties PJSC .....	453.681	1,04	
52.096	Emirates NBD Bank PJSC .....	234.028	0,53	
		<b>909.218</b>	<b>2,07</b>	
<b>USA: Null (30. Juni 2023: 0,41 %)</b>				
	<b>Summe Aktien .....</b>	<b>43.646.949</b>	<b>99,50</b>	
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere .....</b>	<b>43.646.949</b>	<b>99,50</b>	
<b>Finanzderivate 0,00 % (30. Juni 2023: (0,01) %)</b>				
<b>Terminkontrakte: 0,00 % (30. Juni 2023: (0,01) %)*</b>				
Nominalbetrag USD	Durchschnittli- cher Kurs USD	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens	
216.995	1.085	4 MSCI Emerging Markets Long-Terminkontrakte Fälligkeit im September 2024 .....	645	0,00
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten ..</b>	<b>645</b>	<b>0,00</b>
<b>Devisenterminkontrakte: Null (30. Juni 2023: (0,00) %)</b>				
	<b>Summe Finanzderivate .....</b>	<b>645</b>	<b>0,00</b>	
		<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>	
	<b>Anlagenportfolio</b>	<b>43.647.594</b>	<b>99,50</b>	
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>220.435</b>	<b>0,50</b>	
	<b>Nettovermögen</b>	<b>43.868.029</b>	<b>100,00</b>	

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	92,84
Börsengehandelte Derivate .....	0,00
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	7,16
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers beläuft sich zum 30. Juni 2024 auf 6.230 USD.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 97,06 %</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 97,06 %</b>		
	<b>Österreich: 0,81 %</b>		
100.000	Erste Group Bank AG 4,00 % 07.06.2033 .....	98.580	0,81
		<u>98.580</u>	<u>0,81</u>
	<b>Belgien: 4,17 %</b>		
100.000	Anheuser-Busch InBev SA 3,45 % 22.09.2031 .....	99.833	0,82
200.000	Barry Callebaut Services NV 4,00 % 14.06.2029 .....	200.674	1,65
100.000	Belfius Bank SA 5,25 % 19.04.2033 .....	102.484	0,84
100.000	KBC Group NV 4,38 % 06.12.2031 .....	104.115	0,86
		<u>507.106</u>	<u>4,17</u>
	<b>Tschechische Republik: 1,70 %</b>		
200.000	Ceska sporitelna AS 5,74 % 08.03.2028 .....	206.680	1,70
		<u>206.680</u>	<u>1,70</u>
	<b>Dänemark: 3,16 %</b>		
100.000	Danske Bank AS 1,00 % 15.05.2031 .....	94.716	0,78
100.000	Jyske Bank AS 4,13 % 06.09.2030 .....	100.600	0,83
100.000	Nykredit Realkredit AS 0,75 % 20.01.2027 .....	93.163	0,77
100.000	Orsted AS 2,25 % 14.06.2028 .....	95.436	0,78
		<u>383.915</u>	<u>3,16</u>
	<b>Frankreich: 20,82 %</b>		
200.000	Arkema SA 3,50 % 23.01.2031 .....	197.277	1,62
100.000	AXA SA 3,25 % 28.05.2049 .....	95.398	0,78
100.000	Ayvens SA 3,88 % 24.01.2028 .....	100.001	0,82
200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3,50 % 15.05.2031 .....	197.741	1,63
100.000	BNP Paribas SA 4,13 % 26.09.2032 .....	102.442	0,84
100.000	BPCE SA 4,13 % 10.07.2028 .....	102.039	0,84
100.000	Carrefour Banque SA 4,08 % 05.05.2027 .....	100.712	0,83
100.000	CNP Assurances SACA 1,25 % 27.01.2029 .....	88.585	0,73
100.000	Coentreprise de Transport d'Electricite SA 3,75 % 17.01.2036 .....	97.939	0,81
100.000	Credit Mutuel Arkea SA 3,88 % 22.05.2028 .....	100.994	0,83
100.000	Edenred SE 3,63 % 13.06.2031 .....	99.001	0,81
100.000	Electricite de France SA 4,13 % 17.06.2031 .....	100.879	0,83
200.000	Engie SA 3,88 % 06.03.2036 .....	198.112	1,63
100.000	Holding d'Infrastructures de Transport SASU 4,25 % 18.03.2030 .....	101.053	0,83
100.000	In'li SA 1,13 % 02.07.2029 .....	87.471	0,72
100.000	Orange SA 1,38 % 20.03.2028 .....	93.161	0,77
100.000	Pernod Ricard SA 3,75 % 15.09.2027 .....	100.977	0,83
180.000	RCI Banque SA 4,63 % 02.10.2026 .....	182.808	1,50
100.000	Schneider Electric SE 1,38 % 21.06.2027 .....	95.105	0,78
100.000	Societe Generale SA 4,25 % 06.12.2030 .....	100.068	0,82
100.000	Suez SACA 2,38 % 24.05.2030 .....	92.205	0,76
100.000	Vinci SA 3,38 % 17.10.2032 .....	98.441	0,81
		<u>2.532.409</u>	<u>20,82</u>
	<b>Deutschland: 4,78 %</b>		
100.000	Allianz SE 2,12 % 08.07.2050 .....	89.016	0,73
100.000	Amprion GmbH 3,63 % 21.05.2031 .....	99.876	0,82
200.000	Commerzbank AG 5,13 % 18.01.2030 .....	208.221	1,71
100.000	Deutsche Telekom AG 3,25 % 20.03.2036 .....	96.297	0,79
100.000	HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft GmbH 0,63 % 01.11.2028 .....	88.369	0,73
		<u>581.779</u>	<u>4,78</u>
	<b>Irland: 1,67 %</b>		
100.000	AIB Group PLC 4,63 % 23.07.2029 .....	103.036	0,85
100.000	Dell Bank International DAC 3,63 % 24.06.2029 .....	99.512	0,82
		<u>202.548</u>	<u>1,67</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 97,06 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 97,06 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Italien: 2,42 %</b>		
100.000	Autostrade per l'Italia SpA 2,00 % 04.12.2028 .....	92.237	0,76
200.000	Leasys SpA 4,50 % 26.07.2026 .....	202.390	1,66
		<u>294.627</u>	<u>2,42</u>
	<b>Jersey: 1,39 %</b>		
200.000	Heathrow Funding Ltd. 1,13 % 08.10.2030 .....	169.598	1,39
		<u>169.598</u>	<u>1,39</u>
	<b>Luxembourg: 5,52 %</b>		
100.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 3,63 % 29.10.2029 .....	95.612	0,79
100.000	John Deere Bank SA 2,50 % 14.09.2026 .....	98.124	0,81
200.000	Logicor Financing SARL 1,50 % 13.07.2026 .....	188.755	1,55
200.000	Medtronic Global Holdings SCA 3,00 % 15.10.2028 .....	197.111	1,62
95.000	Nestle Finance International Ltd. 1,13 % 01.04.2026 .....	91.680	0,75
		<u>671.282</u>	<u>5,52</u>
	<b>Niederlande: 16,08 %</b>		
100.000	ABN AMRO Bank NV 4,00 % 16.01.2028 .....	101.221	0,83
100.000	American Medical Systems Europe BV 1,63 % 08.03.2031 .....	88.491	0,73
100.000	Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co. Ltd. 3,50 % 01.10.2046 ....	98.777	0,81
100.000	ASR Nederland NV 3,63 % 12.12.2028 .....	100.157	0,82
100.000	Compass Group Finance Netherlands BV 3,00 % 08.03.2030 .....	97.859	0,80
100.000	Cooperatieve Rabobank UA 4,23 % 25.04.2029 .....	102.161	0,84
200.000	De Volksbank NV 1,75 % 22.10.2030 .....	192.824	1,59
100.000	Enel Finance International NV 0,63 % 28.05.2029 .....	86.921	0,71
100.000	Iberdrola International BV 1,45 % 31.12.2099 .....	93.215	0,77
100.000	ING Groep NV 1,75 % 16.02.2031 .....	89.499	0,74
100.000	LKQ Dutch Bond BV 4,13 % 13.03.2031 .....	99.940	0,82
200.000	Mercedes-Benz International Finance BV 3,25 % 15.11.2030 .....	197.066	1,62
100.000	NN Group NV 6,00 % 03.11.2043 .....	108.117	0,89
200.000	Novo Nordisk Finance Netherlands BV 3,25 % 21.01.2031 .....	199.847	1,64
100.000	Swisscom Finance BV 3,63 % 29.11.2036 .....	99.278	0,82
100.000	TenneT Holding BV 4,88 % 31.12.2099 .....	99.820	0,82
100.000	Vesteda Finance BV 4,00 % 07.05.2032 .....	100.434	0,83
		<u>1.955.627</u>	<u>16,08</u>
	<b>Norwegen: 1,63 %</b>		
100.000	DNB Bank ASA 4,50 % 19.07.2028 .....	102.460	0,84
100.000	Sparebank 1 Oestlandet 1,75 % 27.04.2027 .....	95.273	0,79
		<u>197.733</u>	<u>1,63</u>
	<b>Portugal: 0,78 %</b>		
100.000	EDP - Energias de Portugal SA 1,63 % 15.04.2027 .....	95.312	0,78
		<u>95.312</u>	<u>0,78</u>
	<b>Rumänien: 0,86 %</b>		
100.000	Banca Comerciala Romana SA 7,63 % 19.05.2027 .....	105.010	0,86
		<u>105.010</u>	<u>0,86</u>
	<b>Spanien: 6,46 %</b>		
100.000	Acciona Energia Financiacion Filiales SA 0,38 % 07.10.2027 .....	89.719	0,74
100.000	Banco de Sabadell SA 5,13 % 10.11.2028 .....	104.323	0,86
100.000	Banco Santander SA 5,00 % 22.04.2034 .....	101.779	0,83
100.000	CaixaBank SA 0,75 % 26.05.2028 .....	92.269	0,76
200.000	Ibercaja Banco SA 4,38 % 30.07.2028 .....	202.158	1,66
100.000	Telefonica Emisiones SA 3,70 % 24.01.2032 .....	99.609	0,82
100.000	Unicaja Banco SA 1,00 % 01.12.2026 .....	95.912	0,79
		<u>785.769</u>	<u>6,46</u>
	<b>Schweden: 3,30 %</b>		
100.000	Assa Abloy AB 3,88 % 13.09.2030 .....	102.022	0,84

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 97,06 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 97,06 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweden: 3,30 % (Fortsetzung)</b>		
100.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,13 % 29.06.2027 .....	102.181	0,84
100.000	Swedbank AB 4,38 % 05.09.2030 .....	103.324	0,85
100.000	Telia Co. AB 2,75 % 30.06.2083 .....	93.720	0,77
		<u>401.247</u>	<u>3,30</u>
	<b>Schweiz: 2,16 %</b>		
200.000	UBS AG 0,50 % 31.03.2031 .....	163.009	1,34
100.000	UBS Group AG 3,25 % 02.04.2026 .....	99.443	0,82
		<u>262.452</u>	<u>2,16</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 7,79 %</b>		
200.000	Barclays PLC 0,58 % 09.08.2029 .....	175.348	1,44
200.000	Coca-Cola Europacific Partners PLC 0,20 % 02.12.2028 .....	173.358	1,43
100.000	Lloyds Banking Group PLC 3,13 % 24.08.2030 .....	96.617	0,79
100.000	Mondi Finance PLC 3,75 % 31.05.2032 .....	100.171	0,82
100.000	NatWest Group PLC 4,07 % 06.09.2028 .....	101.055	0,83
100.000	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 3,63 % 20.06.2029 .....	100.361	0,83
100.000	SSE PLC 4,00 % 05.09.2031 .....	102.042	0,84
100.000	Standard Chartered PLC 2,50 % 09.09.2030 .....	98.087	0,81
		<u>947.039</u>	<u>7,79</u>
	<b>USA: 11,56 %</b>		
100.000	AT&T, Inc. 2,05 % 19.05.2032 .....	88.958	0,73
100.000	Citigroup, Inc. 4,11 % 22.09.2033 .....	101.676	0,84
100.000	Fiserv, Inc. 4,50 % 24.05.2031 .....	103.964	0,86
90.000	Goldman Sachs Group, Inc. 1,25 % 07.02.2029 .....	81.095	0,67
100.000	JPMorgan Chase & Co. 1,96 % 23.03.2030 .....	92.623	0,76
100.000	Morgan Stanley 0,41 % 29.10.2027 .....	92.901	0,76
200.000	Nefflix, Inc. 3,63 % 15.06.2030 .....	199.786	1,64
200.000	Prologis Euro Finance LLC 0,63 % 10.09.2031 .....	160.668	1,32
100.000	PVH Corp. 4,13 % 16.07.2029 .....	99.681	0,82
100.000	Thermo Fisher Scientific, Inc. 1,45 % 16.03.2027 .....	95.142	0,78
100.000	Unilever Capital Corp. 3,40 % 06.06.2033 .....	99.976	0,82
200.000	Visa, Inc. 2,00 % 15.06.2029 .....	189.332	1,56
		<u>1.405.802</u>	<u>11,56</u>
	<b>Summe Unternehmensanleihen</b> .....	<u>11.804.515</u>	<u>97,06</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>11.804.515</u>	<u>97,06</u>
		<b>Beizulegender Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	11.804.515	97,06
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	357.529	2,94
	<b>Nettovermögen</b>	<u>12.162.044</u>	<u>100,00</u>
			<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
	An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....		97,05
	Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		2,95
	<b>Gesamtvermögen</b> .....		<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,56 % (30. Juni 2023: 94,18 %)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 42,78 % (30. Juni 2023: 51,19 %)</b>		
	<b>Österreich: Null (30. Juni 2023: 0,24 %)</b>		
	<b>Belgien: 7,85 % (30. Juni 2023: 1,40 %)</b>		
31.000.000	Europäische Union 0,00 % 04.11.2025 .....	29.732.650	7,85
		<u>29.732.650</u>	<u>7,85</u>
	<b>Kanada: 1,77 % (30. Juni 2023: 2,29 %)</b>		
1.000.000	Bank of Nova Scotia 0,45 % 16.03.2026 .....	952.019	0,25
2.800.000	Toronto-Dominion Bank 1,71 % 28.07.2025 .....	2.750.605	0,73
3.000.000	Toronto-Dominion Bank 4,30 % 16.04.2026 .....	3.002.197	0,79
		<u>6.704.821</u>	<u>1,77</u>
	<b>Dänemark: 2,63 % (30. Juni 2023: 1,24 %)</b>		
4.000.000	Danske Bank AS 1,00 % 15.05.2031 .....	3.788.658	1,00
1.800.000	Danske Bank AS 4,55 % 10.04.2027 .....	1.802.268	0,48
2.000.000	Nykredit Realkredit AS 0,63 % 17.01.2025 .....	1.966.004	0,52
1.000.000	Nykredit Realkredit AS 4,45 % 27.02.2026 .....	1.005.565	0,26
1.400.000	Sydbank AS 4,13 % 30.09.2027 .....	1.406.588	0,37
		<u>9.969.083</u>	<u>2,63</u>
	<b>Finnland: 0,61 % (30. Juni 2023: 1,01 %)</b>		
2.300.000	OP Mortgage Bank 3,38 % 15.02.2027 .....	2.307.245	0,61
		<u>2.307.245</u>	<u>0,61</u>
	<b>Frankreich: 3,87 % (30. Juni 2023: 11,22 %)</b>		
1.500.000	Ayvens SA 3,88 % 24.01.2028 .....	1.500.012	0,40
1.250.000	BNP Paribas SA 2,38 % 17.02.2025 .....	1.236.824	0,33
2.000.000	Credit Agricole SA 1,00 % 22.04.2026 .....	1.954.255	0,51
4.000.000	Credit Agricole SA 1,00 % 18.09.2025 .....	3.877.917	1,02
1.000.000	RCI Banque SA 2,63 % 18.02.2030 .....	985.104	0,26
2.000.000	Schneider Electric SE 3,38 % 06.04.2025 .....	1.994.120	0,53
3.100.000	Societe Generale SA 4,40 % 19.01.2026 .....	3.108.860	0,82
		<u>14.657.092</u>	<u>3,87</u>
	<b>Deutschland: 1,44 % (30. Juni 2023: 1,23 %)</b>		
2.000.000	Allianz SE 2,24 % 07.07.2045 .....	1.964.184	0,52
3.600.000	Natixis Pfandbriefbank AG 0,50 % 23.05.2025 .....	3.499.093	0,92
		<u>5.463.277</u>	<u>1,44</u>
	<b>Ungarn: 0,27 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
1.000.000	OTP Bank Nyrt 7,35 % 04.03.2026 .....	1.016.271	0,27
		<u>1.016.271</u>	<u>0,27</u>
	<b>Island: 0,25 % (30. Juni 2023: 0,50 %)</b>		
1.000.000	Arion Banki Hf. 0,38 % 14.07.2025 .....	963.638	0,25
		<u>963.638</u>	<u>0,25</u>
	<b>Irland: Null (30. Juni 2023: 1,76 %)</b>		
	<b>Italien: 1,58 % (30. Juni 2023: 1,45 %)</b>		
1.000.000	Iccrea Banca SpA 4,13 % 28.11.2029 .....	993.379	0,26
1.700.000	Intesa Sanpaolo SpA 4,62 % 16.11.2025 .....	1.710.687	0,45
2.000.000	Iren SpA 0,88 % 04.11.2024 .....	1.979.422	0,52
1.300.000	Leasys SpA 4,50 % 26.07.2026 .....	1.315.536	0,35
		<u>5.999.024</u>	<u>1,58</u>
	<b>Japan: 0,89 % (30. Juni 2023: 0,71 %)</b>		
2.650.000	Asahi Group Holdings Ltd. 0,16 % 23.10.2024 .....	2.620.055	0,69
800.000	NTT Finance Corp. 0,08 % 13.12.2025 .....	761.491	0,20
		<u>3.381.546</u>	<u>0,89</u>
	<b>Luxembourg: 1,84 % (30. Juni 2023: 6,27 %)</b>		
500.000	John Deere Bank SA 2,50 % 14.09.2026 .....	490.620	0,13
2.500.000	Logicor Financing SARL 0,75 % 15.07.2024 .....	2.496.720	0,66

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,56 % (30. Juni 2023: 94.18 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 42,78 % (30. Juni 2023: 51.19 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Luxembourg: 1,84 % (30. Juni 2023: 6.27 %) (Fortsetzung)</b>		
2.000.000	Logicor Financing SARL 4,63 % 25.07.2028 .....	2.013.965	0,53
1.000.000	Medtronic Global Holdings SCA 2,63 % 15.10.2025 .....	985.709	0,26
700.000	Segro Capital SARL 1,25 % 23.03.2026 .....	672.135	0,18
322.240	Vivion Investments SARL 7,90 % 31.08.2028 .....	289.427	0,08
		<u>6.948.576</u>	<u>1,84</u>
	<b>Niederlande: 6,47 % (30. Juni 2023: 5,87 %)</b>		
2.300.000	ABN AMRO Bank NV 4,51 % 15.01.2027 .....	2.313.356	0,61
1.500.000	American Medical Systems Europe BV 0,75 % 08.03.2025 .....	1.469.396	0,39
1.000.000	Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co. Ltd. 3,50 % 01.10.2046 .....	987.768	0,26
3.500.000	ASR Nederland NV 3,63 % 12.12.2028 .....	3.505.486	0,93
2.000.000	De Volksbank NV 1,75 % 22.10.2030 .....	1.928.244	0,51
500.000	Enel Finance International NV 1,00 % 16.09.2024 .....	497.011	0,13
2.000.000	ING Groep NV 0,13 % 29.11.2025 .....	1.969.413	0,52
5.000.000	Mercedes-Benz International Finance BV 4,11 % 01.12.2025 .....	5.013.117	1,33
1.000.000	NIBC Bank NV 6,38 % 01.12.2025 .....	1.031.611	0,27
1.000.000	Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0,75 % 31.03.2025 .....	978.791	0,26
3.000.000	Novo Nordisk Finance Netherlands BV 3,38 % 21.05.2026 .....	3.001.935	0,79
1.800.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 2,25 % 10.03.2025 .....	1.783.648	0,47
		<u>24.479.776</u>	<u>6,47</u>
	<b>Norwegen: 1,04 % (30. Juni 2023: 0,75 %)</b>		
2.500.000	DNB Bank ASA 1,63 % 31.05.2026 .....	2.453.509	0,65
1.500.000	SpareBank 1 SMN 3,13 % 22.12.2025 .....	1.489.380	0,39
		<u>3.942.889</u>	<u>1,04</u>
	<b>Portugal: 0,39 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
1.500.000	Caixa Geral de Depositos SA 1,25 % 25.11.2024 .....	1.484.601	0,39
		<u>1.484.601</u>	<u>0,39</u>
	<b>Rumänien: 0,22 % (30. Juni 2023: 0,30 %)</b>		
800.000	Banca Comerciala Romana SA 7,63 % 19.05.2027 .....	840.078	0,22
		<u>840.078</u>	<u>0,22</u>
	<b>Spanien: 1,70 % (30. Juni 2023: 2,56 %)</b>		
2.000.000	Banco Santander SA 4,63 % 18.10.2027 .....	2.036.576	0,54
1.000.000	Ibercaja Banco SA 2,75 % 23.07.2030 .....	976.075	0,26
400.000	Ibercaja Banco SA 4,38 % 30.07.2028 .....	404.316	0,11
3.000.000	Unicaja Banco SA 4,50 % 30.06.2025 .....	3.000.000	0,79
		<u>6.416.967</u>	<u>1,70</u>
	<b>Schweden: 1,82 % (30. Juni 2023: 2,17 %)</b>		
2.400.000	SBAB Bank AB 1,88 % 10.12.2025 .....	2.343.920	0,62
2.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,13 % 29.06.2027 .....	2.043.618	0,54
1.500.000	Swedbank AB 3,75 % 14.11.2025 .....	1.501.742	0,40
1.000.000	Volvo Treasury AB 2,13 % 01.09.2024 .....	997.000	0,26
		<u>6.886.280</u>	<u>1,82</u>
	<b>Schweiz: 1,83 % (30. Juni 2023: 0,76 %)</b>		
3.000.000	UBS AG 4,26 % 12.04.2026 .....	2.999.655	0,79
4.000.000	UBS Group AG 2,13 % 13.10.2026 .....	3.909.345	1,04
		<u>6.909.000</u>	<u>1,83</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 4,32 % (30. Juni 2023: 2,78 %)</b>		
2.400.000	Aviva PLC 3,88 % 03.07.2044 .....	2.400.350	0,63
500.000	Lloyds Bank PLC 0,00 % 11.07.2024 .....	499.360	0,13
1.000.000	Lloyds Banking Group PLC 3,50 % 01.04.2026 .....	997.666	0,26
2.500.000	Lloyds Banking Group PLC 4,50 % 18.03.2030 .....	2.496.825	0,66
1.300.000	Nationwide Building Society 4,50 % 01.11.2026 .....	1.327.322	0,35
1.500.000	NatWest Group PLC 0,75 % 15.11.2025 .....	1.483.009	0,39

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,56 % (30. Juni 2023: 94,18 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 42,78 % (30. Juni 2023: 51,19 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 4,32 % (30. Juni 2023: 2,78 %) (Fortsetzung)</b>		
4.200.000	NatWest Markets PLC 4,49 % 09.01.2026 .....	4.218.837	1,12
3.000.000	Standard Chartered PLC 2,50 % 09.09.2030 .....	2.942.603	0,78
		<u>16.365.972</u>	<u>4,32</u>
	<b>USA: 1,99 % (30. Juni 2023: 6,68 %)</b>		
2.000.000	AT&T, Inc. 4,17 % 06.03.2025 .....	2.004.503	0,53
2.500.000	Carrier Global Corp. 4,38 % 29.05.2025 .....	2.510.629	0,67
1.700.000	Morgan Stanley 2,10 % 08.05.2026 .....	1.676.120	0,44
1.400.000	National Grid North America, Inc. 0,41 % 20.01.2026 .....	1.331.717	0,35
		<u>7.522.969</u>	<u>1,99</u>
	<b>Summe Unternehmensanleihen .....</b>	<u>161.991.755</u>	<u>42,78</u>
	<b>Staatsanleihen: 50,62 % (30. Juni 2023: 41,90 %)</b>		
	<b>Österreich: 14,44 % (30. Juni 2023: 7,78 %)</b>		
55.000.000	Schatzanweisungen Österreich 0,00 % 29.08.2024 .....	54.677.585	14,44
		<u>54.677.585</u>	<u>14,44</u>
	<b>Belgien: 7,78 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
30.000.000	Schatzanweisungen Königreich Belgien 0,00 % 09.01.2025 .....	29.453.434	7,78
		<u>29.453.434</u>	<u>7,78</u>
	<b>Zypern: Null (30. Juni 2023: 0,08 %)</b>		
	<b>Dänemark: 9,60 % (30. Juni 2023: 4,82 %)</b>		
36.500.000	Staatsanleihen Dänemark 2,50 % 18.11.2024 .....	36.345.194	9,60
		<u>36.345.194</u>	<u>9,60</u>
	<b>Frankreich: 1,43 % (30. Juni 2023: 1,17 %)</b>		
4.000.000	Schatzanweisungen Frankreich BTF 0,00 % 30.10.2024 .....	3.951.788	1,04
1.500.000	SNCF Reseau 2,63 % 29.12.2025 .....	1.480.871	0,39
		<u>5.432.659</u>	<u>1,43</u>
	<b>Deutschland: 11,74 % (30. Juni 2023: 15,10 %)</b>		
35.800.000	Bundesobligation 0,00 % 10.10.2025 .....	34.492.047	9,11
3.000.000	Bundesschatzanweisungen 2,50 % 19.03.2026 .....	2.980.566	0,79
2.525.600	Deutsche Bundesrepublik inflationsgebundene Anleihen 0,10 % 15.04.2026 ...	2.464.386	0,65
4.654.000	Kreditanstalt für Wiederaufbau 0,25 % 30.06.2025 .....	4.517.113	1,19
		<u>44.454.112</u>	<u>11,74</u>
	<b>Island: 0,79 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
3.000.000	Staatsanleihen Island 3,40 % 28.06.2027 .....	2.998.365	0,79
		<u>2.998.365</u>	<u>0,79</u>
	<b>Italien: Null (30. Juni 2023: 6,75 %)</b>		
	<b>Litauen: Null (30. Juni 2023: 0,98 %)</b>		
	<b>Niederlande: Null (30. Juni 2023: 1,17 %)</b>		
	<b>Polen: Null (30. Juni 2023: 0,19 %)</b>		
	<b>Rumänien: 1,81 % (30. Juni 2023: 1,06 %)</b>		
3.000.000	Staatsanleihen Rumänien 2,75 % 29.10.2025 .....	2.967.469	0,78
3.900.000	Staatsanleihen Rumänien 2,88 % 28.10.2024 .....	3.888.342	1,03
		<u>6.855.811</u>	<u>1,81</u>
	<b>Südkorea: 0,90 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
3.500.000	Korea Housing Finance Corp. 0,01 % 05.02.2025 .....	3.424.444	0,90
		<u>3.424.444</u>	<u>0,90</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,56 % (30. Juni 2023: 94.18 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 50,62 % (30. Juni 2023: 41.90 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Spanien: 2,13 % (30. Juni 2023: 2,80 %)</b>		
8.400.000	Instituto de Credito Oficial 1,30 % 31.10.2026 .....	8.046.595	2,13
		8.046.595	2,13
	<b>Summe Staatsanleihen .....</b>	<b>191.688.199</b>	<b>50,62</b>
	<b>Kurzfristige Anlagen: 5,16 % (30. Juni 2023: 0,97 %)</b>		
	<b>Frankreich: 1,36 % (30. Juni 2023: 0,97 %)</b>		
2.200.000	AXA SA 0,00 % 15.10.2024 .....	2.176.339	0,58
3.000.000	Bpifrance SACA 0,00 % 11.11.2024 .....	2.959.841	0,78
		5.136.180	1,36
	<b>Deutschland: 1,06 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
4.000.000	Deutsche Bank AG 0,00 % 15.07.2024 .....	3.993.080	1,06
		3.993.080	1,06
	<b>Luxembourg: 1,05 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
4.000.000	Nestle Finance International Ltd. 0,00 % 14.08.2024 .....	3.980.928	1,05
		3.980.928	1,05
	<b>Norwegen: 0,52 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
2.000.000	DNB Bank ASA 0,00 % 11.10.2024 .....	1.979.227	0,52
		1.979.227	0,52
	<b>Spanien: 0,13 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
500.000	CaixaBank SA 0,00 % 17.12.2024 .....	491.386	0,13
		491.386	0,13
	<b>Schweden: 1,04 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
4.000.000	Svenska Handelsbanken AB 0,00 % 23.10.2024 .....	3.952.366	1,04
		3.952.366	1,04
	<b>Summe kurzfristige Anlagen .....</b>	<b>19.533.167</b>	<b>5,16</b>
	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere 0,00 % (30. Juni 2023: 0,12 %)</b>		
	<b>Irland: Null (30. Juni 2023: 0,12 %)</b>		
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere .....</b>	<b>373.213.121</b>	<b>98,56</b>
	<b>Finanzderivate Null (30. Juni 2023: 0,10 %)</b>		
	<b>Terminkontrakte: Null (30. Juni 2023: 0,10 %)</b>		
		<b>Beizulegender Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	373.213.121	98,56
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	5.438.044	1,44
	<b>Nettovermögen</b>	<b>378.651.165</b>	<b>100,00</b>
			<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
	An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....		98,55
	Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		1,45
	Gesamtvermögen .....		<b>100,00</b>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin European Quality Dividend UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,77 % (30. Juni 2023: 98,93 %)</b>		
	<b>Aktien: 98,77 % (30. Juni 2023: 98,93 %)</b>		
	<b>Belgien: Null (30. Juni 2023: 0,42 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,26 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
3.713	Stolt-Nielsen Ltd. ....	164.314	0,26
		<u>164.314</u>	<u>0,26</u>
	<b>Dänemark: 6,33 % (30. Juni 2023: 5,98 %)</b>		
526	AP Moller - Maersk AS Anteilsklasse A .....	833.706	1,30
737	AP Moller - Maersk AS Anteilsklasse B .....	1.196.304	1,87
99.170	Tryg AS .....	2.023.971	3,16
		<u>4.053.981</u>	<u>6,33</u>
	<b>Finnland: 7,89 % (30. Juni 2023: 8,03 %)</b>		
45.919	Elisa OYJ .....	1.967.170	3,07
81.122	Kesko OYJ .....	1.329.590	2,08
53.768	UPM-Kymmene OYJ .....	1.753.912	2,74
		<u>5.050.672</u>	<u>7,89</u>
	<b>Frankreich: 10,10 % (30. Juni 2023: 9,98 %)</b>		
14.476	Gaztransport Et Technigaz SA .....	1.764.624	2,76
18.847	Rubis SCA .....	494.922	0,77
21.385	Sanofi SA .....	1.923.367	3,01
8.601	Societe BIC SA .....	473.055	0,74
28.999	TotalEnergies SE .....	1.807.508	2,82
		<u>6.463.476</u>	<u>10,10</u>
	<b>Deutschland: 7,38 % (30. Juni 2023: 7,21 %)</b>		
7.191	Allianz SE .....	1.866.064	2,92
34.357	Freenet AG .....	852.054	1,33
8.460	Hannover Rueck SE .....	2.002.482	3,13
		<u>4.720.600</u>	<u>7,38</u>
	<b>Italien: 8,78 % (30. Juni 2023: 7,62 %)</b>		
81.968	Assicurazioni Generali SpA .....	1.909.035	2,98
58.562	Azimut Holding SpA .....	1.289.535	2,02
68.056	Poste Italiane SpA .....	809.526	1,26
390.758	Snam SpA .....	1.614.221	2,52
		<u>5.622.317</u>	<u>8,78</u>
	<b>Jersey: 0,43 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
117.970	TP ICAP Group PLC .....	278.006	0,43
		<u>278.006</u>	<u>0,43</u>
	<b>Luxembourg: 0,45 % (30. Juni 2023: 0,64 %)</b>		
11.891	Aperam SA .....	287.049	0,45
		<u>287.049</u>	<u>0,45</u>
	<b>Niederlande: 3,14 % (30. Juni 2023: 6,37 %)</b>		
560.475	Koninklijke KPN NV .....	2.006.501	3,14
		<u>2.006.501</u>	<u>3,14</u>
	<b>Norwegen: 7,72 % (30. Juni 2023: 5,19 %)</b>		
22.607	Atea ASA .....	303.105	0,47
72.850	Equinor ASA .....	1.940.396	3,03
143.961	Telenor ASA .....	1.535.303	2,40
43.099	Yara International ASA .....	1.161.749	1,82
		<u>4.940.553</u>	<u>7,72</u>
	<b>Spanien: 12,55 % (30. Juni 2023: 12,09 %)</b>		
244.729	Bankinter SA .....	1.866.303	2,91
23.547	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA .....	622.112	0,97
85.634	Endesa SA .....	1.501.592	2,35
140.342	Faes Farma SA .....	505.933	0,79

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin European Quality Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens	
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,77 % (30. Juni 2023: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>			
	<b>Aktien: 98,77 % (30. Juni 2023: 98,93 %) (Fortsetzung)</b>			
	<b>Spanien: 12,55 % (30. Juni 2023: 12,09 %) (Fortsetzung)</b>			
156.322	Iberdrola SA .....	1.893.841	2,96	
100.674	Redeia Corp. SA .....	1.643.000	2,57	
		<u>8.032.781</u>	<u>12,55</u>	
	<b>Schweden: 2,04 % (30. Juni 2023: 2,80 %)</b>			
138.556	Tele2 AB .....	1.302.543	2,04	
		<u>1.302.543</u>	<u>2,04</u>	
	<b>Schweiz: 14,36 % (30. Juni 2023: 9,36 %)</b>			
9.494	Cembra Money Bank AG .....	756.109	1,18	
14.382	EFG International AG .....	197.420	0,31	
5.499	Helvetia Holding AG .....	693.745	1,08	
20.210	Novartis AG .....	2.018.115	3,15	
17.249	Swiss Prime Site AG .....	1.525.961	2,38	
3.811	Swisscom AG .....	2.000.322	3,13	
4.021	Zurich Insurance Group AG .....	2.000.323	3,13	
		<u>9.191.995</u>	<u>14,36</u>	
	<b>Vereinigtes Königreich: 17,34 % (30. Juni 2023: 23,24 %)</b>			
204.638	Ashmore Group PLC .....	410.561	0,64	
118.393	BAE Systems PLC .....	1.843.264	2,88	
168.401	IG Group Holdings PLC .....	1.626.732	2,54	
84.412	Imperial Brands PLC .....	2.015.126	3,15	
42.300	Intermediate Capital Group PLC .....	1.088.636	1,70	
251.920	MONY Group PLC .....	660.229	1,03	
50.431	Paragon Banking Group PLC .....	437.192	0,69	
28.200	Rio Tinto PLC .....	1.729.910	2,70	
97.948	Tate & Lyle PLC .....	690.851	1,08	
28.623	Telecom Plus PLC .....	595.527	0,93	
		<u>11.098.028</u>	<u>17,34</u>	
	<b>Summe Aktien .....</b>	<u>63.212.816</u>	<u>98,77</u>	
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere .....</b>	<u>63.212.816</u>	<u>98,77</u>	
<b>Finanzderivate: (0,01) % (30. Juni 2023 0,00 %)</b>				
<b>Terminkontrakte: (0,01) % (30. Juni 2023 0,00 %)*</b>				
Nominalbetrag EUR	Durchschnittli- cher Kurs EUR	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens	
677.444	521	26 STOXX Europe 600 Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	(8.984)	(0,01)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten ...</b>	<u>(8.984)</u>	<u>(0,01)</u>
		<b>Summe Finanzderivate .....</b>	<u>(8.984)</u>	<u>(0,01)</u>
		<b>Beizulegender Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>	
	<b>Anlagenportfolio</b>	63.203.832	98,76	
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>794.852</u>	<u>1,24</u>	
	<b>Nettovermögen</b>	<u>63.998.684</u>	<u>100,00</u>	

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin European Quality Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	98,74
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	1,26
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 51.707 EUR.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,51 % (30. Juni 2023: 0,51 %)</b>		
6.300	CK Infrastructure Holdings Ltd. ....	35.585	0,06
3.500	DFI Retail Group Holdings Ltd. ....	6.650	0,01
36.000	First Pacific Co. Ltd. ....	16.738	0,03
13.500	Hongkong Land Holdings Ltd. ....	43.605	0,08
2.250	Jardine Matheson Holdings Ltd. ....	79.605	0,14
9.000	Kerry Properties Ltd. ....	15.654	0,03
18.000	Man Wah Holdings Ltd. ....	12.357	0,02
9.000	NWS Holdings Ltd. ....	7.989	0,02
1.350	Orient Overseas International Ltd. ....	21.908	0,04
18.000	Shangri-La Asia Ltd. ....	12.381	0,02
90.000	United Energy Group Ltd. ....	3.516	0,01
1.800	VTech Holdings Ltd. ....	13.464	0,02
9.000	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd. ....	17.407	0,03
		<b>286.859</b>	<b>0,51</b>
	<b>Cayman-Inseln: 1,70 % (30. Juni 2023: 6,22 %)</b>		
4.500	AAC Technologies Holdings, Inc. ....	17.695	0,03
1.450	Airtac International Group ....	44.160	0,08
846	Alchip Technologies Ltd. ....	64.021	0,11
3.600	ASMPT Ltd. ....	50.214	0,09
20.700	Budweiser Brewing Co. APAC Ltd. ....	24.392	0,04
14.500	Chailease Holding Co. Ltd. ....	68.608	0,12
19.800	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd. ....	21.430	0,04
22.500	CK Asset Holdings Ltd. ....	84.295	0,15
27.000	CK Hutchison Holdings Ltd. ....	129.339	0,23
28.800	ESR Group Ltd. ....	37.847	0,07
5.000	HUTCHMED China Ltd. ....	17.612	0,03
10.800	MGM China Holdings Ltd. ....	16.821	0,03
18.000	NagaCorp Ltd. ....	8.830	0,02
810	Parade Technologies Ltd. ....	20.923	0,04
28.800	Sands China Ltd. ....	60.054	0,11
3.880	Silergy Corp. ....	55.255	0,10
18.000	SITC International Holdings Co. Ltd. ....	48.877	0,09
90.000	WH Group Ltd. ....	59.251	0,10
18.774	Wharf Real Estate Investment Co. Ltd. ....	49.776	0,09
21.600	Wynn Macau Ltd. ....	17.706	0,03
23.436	Xinyi Glass Holdings Ltd. ....	25.695	0,04
9.000	Zhen Ding Technology Holding Ltd. ....	35.926	0,06
		<b>958.727</b>	<b>1,70</b>
	<b>China: Null (30. Juni 2023: 28,37 %)</b>		
	<b>Hongkong: 4,95 % (30. Juni 2023: 6,25 %)</b>		
122.400	AIA Group Ltd. ....	830.904	1,48
10.800	Bank of East Asia Ltd. ....	13.722	0,02
40.500	BOC Hong Kong Holdings Ltd. ....	124.757	0,22
9.000	Cathay Pacific Airways Ltd. ....	9.211	0,02
18.000	CLP Holdings Ltd. ....	145.477	0,26
24.570	Galaxy Entertainment Group Ltd. ....	114.551	0,20
9.000	Hang Lung Group Ltd. ....	9.798	0,02
18.000	Hang Lung Properties Ltd. ....	15.355	0,03
8.100	Hang Seng Bank Ltd. ....	104.163	0,18
10.000	Henderson Land Development Co. Ltd. ....	26.834	0,05
126.000	Hong Kong & China Gas Co. Ltd. ....	95.863	0,17
13.950	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd. ....	447.049	0,79
81.000	Lenovo Group Ltd. ....	114.330	0,20
28.800	Link REIT ....	111.955	0,20
36.000	MMG Ltd. ....	13.741	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Hongkong: 4,95 % (30. Juni 2023: 6,25 %) (Fortsetzung)</b>		
13.500	MTR Corp. Ltd. ....	42.623	0,08
18.000	New World Development Co. Ltd. ....	16.853	0,03
45.000	PCCW Ltd. ....	22.536	0,04
13.500	Power Assets Holdings Ltd. ....	73.056	0,13
38.700	Sino Land Co. Ltd. ....	39.903	0,07
27.000	SJM Holdings Ltd. ....	9.164	0,02
15.750	Sun Hung Kai Properties Ltd. ....	136.270	0,24
4.500	Swire Pacific Ltd. ....	39.770	0,07
14.400	Swire Properties Ltd. ....	22.944	0,04
14.200	Techtronic Industries Co. Ltd. ....	162.236	0,29
13.500	Vitasoy International Holdings Ltd. ....	10.202	0,02
11.592	Wharf Holdings Ltd. ....	32.590	0,06
		<b>2.785.857</b>	<b>4,95</b>
	<b>Indien: 33,00 % (30. Juni 2023: 14,13 %)</b>		
54	3M India Ltd. ....	23.834	0,04
2.259	Aarti Industries Ltd. ....	18.591	0,03
513	ABB India Ltd. ....	52.236	0,09
918	ACC Ltd. ....	28.833	0,05
4.023	Adani Energy Solutions Ltd. ....	48.117	0,09
3.393	Adani Enterprises Ltd. ....	129.277	0,23
4.779	Adani Green Energy Ltd. ....	102.517	0,18
8.127	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. ....	144.057	0,26
13.104	Adani Power Ltd. ....	112.925	0,20
3.150	Adani Total Gas Ltd. ....	33.847	0,06
5.634	Aditya Birla Capital Ltd. ....	16.128	0,03
441	AIA Engineering Ltd. ....	22.099	0,04
504	Alkem Laboratories Ltd. ....	30.168	0,05
8.316	Ambuja Cements Ltd. ....	66.842	0,12
1.944	APL Apollo Tubes Ltd. ....	36.258	0,06
1.125	Apollo Hospitals Enterprise Ltd. ....	83.453	0,15
16.299	Ashok Leyland Ltd. ....	47.280	0,08
4.932	Asian Paints Ltd. ....	172.531	0,31
1.350	Astral Ltd. ....	38.544	0,07
3.717	AU Small Finance Bank Ltd. ....	29.957	0,05
3.015	Aurobindo Pharma Ltd. ....	43.663	0,08
1.692	Avenue Supermarts Ltd. ....	95.707	0,17
25.110	Axis Bank Ltd. ....	380.997	0,68
720	Bajaj Auto Ltd. ....	82.041	0,15
2.718	Bajaj Finance Ltd. ....	231.930	0,41
4.320	Bajaj Finserv Ltd. ....	82.276	0,15
288	Bajaj Holdings & Investment Ltd. ....	29.482	0,05
918	Balkrishna Industries Ltd. ....	35.548	0,06
8.982	Bandhan Bank Ltd. ....	21.950	0,04
11.763	Bank of Baroda ....	38.849	0,07
8.658	Bank of India ....	12.512	0,02
738	Bata India Ltd. ....	13.397	0,02
144	Bayer CropScience Ltd. ....	11.591	0,02
3.321	Berger Paints India Ltd. ....	20.080	0,04
37.350	Bharat Electronics Ltd. ....	137.015	0,24
2.862	Bharat Forge Ltd. ....	57.329	0,10
14.589	Bharat Heavy Electricals Ltd. ....	52.635	0,09
11.070	Bharat Petroleum Corp. Ltd. ....	40.350	0,07
11.070	Bharat Petroleum Corp. Ltd. (Stammaktien) ....	40.350	0,07
28.386	Bharti Airtel Ltd. ....	491.570	0,87
1.683	Bharti Airtel Ltd. (partly paid) ....	21.049	0,04
5.166	Biocon Ltd. ....	21.751	0,04

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 33,00 % (30. Juni 2023: 14,13 %) (Fortsetzung)</b>		
99	Bosch Ltd. ....	40.466	0,07
1.350	Britannia Industries Ltd. ....	88.646	0,16
20.655	Canara Bank ....	29.593	0,05
5.382	Castrol India Ltd. ....	12.948	0,02
7.272	CG Power & Industrial Solutions Ltd. ....	61.455	0,11
4.572	Cholamandalam Investment & Finance Co. Ltd. ....	78.048	0,14
5.589	Cipla Ltd. ....	99.250	0,18
24.642	Coal India Ltd. ....	139.821	0,25
630	Coforge Ltd. ....	41.242	0,07
1.512	Colgate-Palmolive India Ltd. ....	51.553	0,09
3.123	Container Corp. of India Ltd. ....	39.040	0,07
1.242	Coromandel International Ltd. ....	23.844	0,04
1.494	Cummins India Ltd. ....	71.071	0,13
6.579	Dabur India Ltd. ....	47.393	0,08
936	Dalmia Bharat Ltd. ....	20.355	0,04
792	Deepak Nitrite Ltd. ....	23.763	0,04
1.260	Divi's Laboratories Ltd. ....	69.453	0,12
405	Dixon Technologies India Ltd. ....	58.143	0,10
6.579	DLF Ltd. ....	65.070	0,12
396	Dr Lal PathLabs Ltd. ....	13.205	0,02
1.260	Dr Reddy's Laboratories Ltd. ....	96.741	0,17
1.566	Eicher Motors Ltd. ....	87.757	0,16
2.691	Emami Ltd. ....	22.244	0,04
7.335	Embassy Office Parks REIT ....	31.255	0,06
5.220	Exide Industries Ltd. ....	35.337	0,06
19.755	Federal Bank Ltd. ....	41.992	0,07
15.435	FSN E-Commerce Ventures Ltd. ....	32.659	0,06
26.244	GAIL India Ltd. ....	69.098	0,12
486	GlaxoSmithKline Pharmaceuticals Ltd. ....	15.451	0,03
1.719	Glenmark Pharmaceuticals Ltd. ....	25.366	0,05
27.558	GMR Airports Infrastructure Ltd. ....	31.915	0,06
4.149	Godrej Consumer Products Ltd. ....	68.456	0,12
1.197	Godrej Properties Ltd. ....	46.048	0,08
4.149	Grasim Industries Ltd. ....	132.870	0,24
450	Gujarat Fluorochemicals Ltd. ....	17.227	0,03
2.286	Gujarat Gas Ltd. ....	17.228	0,03
2.736	Havells India Ltd. ....	59.794	0,11
11.637	HCL Technologies Ltd. ....	203.692	0,36
1.143	HDFC Asset Management Co. Ltd. ....	54.737	0,10
61.047	HDFC Bank Ltd. ....	1.232.690	2,19
11.151	HDFC Life Insurance Co. Ltd. ....	79.573	0,14
1.341	Hero MotoCorp Ltd. ....	89.729	0,16
15.246	Hindalco Industries Ltd. ....	126.804	0,23
2.043	Hindustan Aeronautics Ltd. ....	128.974	0,23
6.426	Hindustan Petroleum Corp. Ltd. ....	25.592	0,05
3.915	Hindustan Petroleum Corp. Ltd. (Stammaktien) ....	15.592	0,03
9.801	Hindustan Unilever Ltd. ....	290.671	0,52
2.646	Hindustan Zinc Ltd. ....	21.249	0,04
27	Honeywell Automation India Ltd. ....	18.362	0,03
34.461	ICICI Bank Ltd. ....	495.751	0,88
2.736	ICICI Lombard General Insurance Co. Ltd. ....	58.716	0,10
4.356	ICICI Prudential Life Insurance Co. Ltd. ....	31.641	0,06
5.796	IDBI Bank Ltd. ....	5.836	0,01
36.900	IDFC First Bank Ltd. ....	36.357	0,06
2.250	Indian Bank ....	14.719	0,03
8.226	Indian Hotels Co. Ltd. ....	61.660	0,11
41.652	Indian Oil Corp. Ltd. ....	82.732	0,15

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 33,00 % (30. Juni 2023: 14,13 %) (Fortsetzung)</b>		
3.420	Indian Railway Catering & Tourism Corp. Ltd. ....	40.572	0,07
20.232	Indian Railway Finance Corp. Ltd. ....	42.171	0,07
7.326	Indian Renewable Energy Development Agency Ltd. ....	16.731	0,03
3.978	Indraprastha Gas Ltd. ....	24.029	0,04
9.495	Indus Towers Ltd. ....	42.734	0,08
855	Info Edge India Ltd. ....	69.578	0,12
38.295	Infosys Ltd. ....	719.517	1,28
1.692	InterGlobe Aviation Ltd. ....	85.795	0,15
1.557	Ipca Laboratories Ltd. ....	21.094	0,04
32.643	ITC Ltd. ....	166.332	0,30
3.699	Jindal Stainless Ltd. ....	36.485	0,06
4.437	Jindal Steel & Power Ltd. ....	55.572	0,10
35.280	Jio Financial Services Ltd. ....	151.528	0,27
4.347	JSW Energy Ltd. ....	38.290	0,07
10.593	JSW Steel Ltd. ....	118.332	0,21
4.122	Jubilant Foodworks Ltd. ....	27.842	0,05
3.060	Kalyan Jewellers India Ltd. ....	18.390	0,03
2.295	Kansai Nerolac Paints Ltd. ....	7.434	0,01
4.914	Kotak Mahindra Bank Ltd. ....	106.221	0,19
1.800	KPIT Technologies Ltd. ....	35.288	0,06
9.540	L&T Finance Ltd. ....	20.727	0,04
297	L&T Technology Services Ltd. ....	17.484	0,03
7.416	Larsen & Toubro Ltd. ....	315.579	0,56
4.410	Laurus Labs Ltd. ....	22.453	0,04
3.429	LIC Housing Finance Ltd. ....	32.765	0,06
243	Linde India Ltd. ....	24.185	0,04
1.026	LTIMindtree Ltd. ....	66.258	0,12
2.736	Lupin Ltd. ....	53.198	0,09
2.547	Macrotech Developers Ltd. ....	45.925	0,08
6.732	Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd. ....	24.268	0,04
10.476	Mahindra & Mahindra Ltd. ....	360.138	0,64
1.044	Mankind Pharma Ltd. ....	26.657	0,05
4.977	Marico Ltd. ....	36.587	0,07
1.494	Maruti Suzuki India Ltd. ....	215.603	0,38
2.601	Max Financial Services Ltd. ....	30.309	0,05
6.624	Max Healthcare Institute Ltd. ....	74.722	0,13
324	Mazagon Dock Shipbuilders Ltd. ....	16.635	0,03
900	Mphasis Ltd. ....	26.513	0,05
27	MRF Ltd. ....	41.918	0,07
1.215	Muthoot Finance Ltd. ....	26.166	0,05
4.050	Nestle India Ltd. ....	123.930	0,22
2.412	New India Assurance Co. Ltd. ....	6.854	0,01
25.911	NHPC Ltd. ....	31.290	0,06
1.044	Nippon Life India Asset Management Ltd. ....	8.068	0,01
13.068	NMDC Ltd. ....	38.559	0,07
52.416	NTPC Ltd. ....	237.825	0,42
1.260	Oberoi Realty Ltd. ....	26.681	0,05
41.157	Oil & Natural Gas Corp. Ltd. ....	135.335	0,24
4.113	Oil India Ltd. ....	35.664	0,06
3.708	One 97 Communications Ltd. ....	17.865	0,03
405	Oracle Financial Services Software Ltd. ....	47.997	0,09
63	Page Industries Ltd. ....	29.540	0,05
1.224	Patanjali Foods Ltd. ....	23.359	0,04
3.528	PB Fintech Ltd. ....	59.116	0,11
1.116	Persistent Systems Ltd. ....	56.765	0,10
8.154	Petronet LNG Ltd. ....	32.293	0,06
1.044	Phoenix Mills Ltd. ....	44.925	0,08

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 33,00 % (30. Juni 2023: 14,13 %) (Fortsetzung)</b>		
918	PI Industries Ltd. ....	41.820	0,07
1.485	Pidilite Industries Ltd. ....	56.256	0,10
1.440	Piramal Enterprises Ltd. ....	16.008	0,03
540	Polycab India Ltd. ....	43.644	0,08
3.015	Poonawalla Fincorp Ltd. ....	14.792	0,03
16.524	Power Finance Corp. Ltd. ....	96.127	0,17
45.945	Power Grid Corp. of India Ltd. ....	182.347	0,32
1.377	Prestige Estates Projects Ltd. ....	31.253	0,06
25.056	Punjab National Bank ....	37.037	0,07
6.174	Rail Vikas Nigam Ltd. ....	30.845	0,05
5.049	RBL Bank Ltd. ....	15.923	0,03
14.193	REC Ltd. ....	89.426	0,16
846	Relaxo Footwears Ltd. ....	8.393	0,01
36.099	Reliance Industries Ltd. ....	1.355.344	2,41
27.144	Samvardhana Motherson International Ltd. ....	61.949	0,11
3.294	SBI Cards & Payment Services Ltd. ....	28.623	0,05
4.275	SBI Life Insurance Co. Ltd. ....	76.487	0,14
459	Schaeffler India Ltd. ....	26.094	0,05
144	Shree Cement Ltd. ....	48.129	0,09
3.177	Shriram Finance Ltd. ....	110.926	0,20
999	Siemens Ltd. ....	92.302	0,16
7.776	SJVN Ltd. ....	12.275	0,02
261	Solar Industries India Ltd. ....	31.365	0,06
4.023	Sona Blw Precision Forgings Ltd. ....	30.925	0,06
1.611	SRF Ltd. ....	47.063	0,08
2.583	Star Health & Allied Insurance Co. Ltd. ....	17.305	0,03
19.404	State Bank of India ....	197.548	0,35
16.443	Steel Authority of India Ltd. ....	29.312	0,05
11.682	Sun Pharmaceutical Industries Ltd. ....	213.060	0,38
747	Sundaram Finance Ltd. ....	42.031	0,07
675	Supreme Industries Ltd. ....	48.211	0,09
126.252	Suzlon Energy Ltd. ....	80.032	0,14
1.863	Syngene International Ltd. ....	15.862	0,03
1.296	Tata Communications Ltd. ....	28.822	0,05
11.223	Tata Consultancy Services Ltd. ....	525.454	0,93
6.930	Tata Consumer Products Ltd. ....	91.205	0,16
387	Tata Elxsi Ltd. ....	32.493	0,06
20.439	Tata Motors Ltd. ....	242.596	0,43
3.717	Tata Motors Ltd. Anteilsklasse A ....	29.669	0,05
17.514	Tata Power Co. Ltd. ....	92.540	0,16
91.548	Tata Steel Ltd. ....	191.039	0,34
846	Tata Technologies Ltd. ....	10.368	0,02
6.795	Tech Mahindra Ltd. ....	116.555	0,21
540	Thermax Ltd. ....	34.652	0,06
4.437	Titan Co. Ltd. ....	181.135	0,32
1.107	Torrent Pharmaceuticals Ltd. ....	37.056	0,07
2.457	Torrent Power Ltd. ....	44.150	0,08
1.890	Trent Ltd. ....	124.202	0,22
1.026	Tube Investments of India Ltd. ....	52.406	0,09
2.385	TVS Motor Co. Ltd. ....	67.638	0,12
1.224	UltraTech Cement Ltd. ....	171.267	0,30
12.825	Union Bank of India Ltd. ....	21.023	0,04
891	United Breweries Ltd. ....	21.221	0,04
3.285	United Spirits Ltd. ....	50.287	0,09
1.935	UNO Minda Ltd. ....	25.341	0,05
5.994	UPL Ltd. ....	41.033	0,07
5.301	Varun Beverages Ltd. ....	103.588	0,18

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 33,00 % (30. Juni 2023: 14,13 %) (Fortsetzung)</b>		
702	Vedant Fashions Ltd. ....	8.853	0,02
13.410	Vedanta Ltd. ....	73.010	0,13
168.975	Vodafone Idea Ltd. ....	36.252	0,06
2.610	Voltas Ltd. ....	46.079	0,08
603	Whirlpool of India Ltd. ....	14.451	0,03
15.687	Wipro Ltd. ....	96.854	0,17
227.034	Yes Bank Ltd. ....	64.499	0,11
9.432	Zee Entertainment Enterprises Ltd. ....	17.169	0,03
75.339	Zomato Ltd. ....	181.202	0,32
2.889	Zydus Lifesciences Ltd. ....	37.207	0,07
		<b>18.578.561</b>	<b>33,00</b>
	<b>Indonesien 2,57 % (30. Juni 2023: 7,98 %)</b>		
150.300	Adaro Energy Indonesia Tbk. PT ....	25.608	0,05
123.300	Amman Mineral Internasional PT ....	82.828	0,15
229.500	Astra International Tbk. PT ....	62.508	0,11
604.800	Bank Central Asia Tbk. PT ....	366.573	0,65
484.200	Bank Mandiri Persero Tbk. PT ....	181.852	0,32
170.100	Bank Negara Indonesia Persero Tbk. PT ....	48.407	0,09
765.900	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT ....	215.154	0,38
301.080	Barito Pacific Tbk. PT ....	18.203	0,03
198.000	Bumi Serpong Damai Tbk. PT ....	11.547	0,02
72.000	Charoen Pokphand Indonesia Tbk. PT ....	22.315	0,04
212.400	Dayamitra Telekomunikasi PT ....	8.366	0,01
408.600	Elang Mahkota Teknologi Tbk. PT ....	9.682	0,02
10.487.700	GoTo Gojek Tokopedia Tbk. PT ....	32.024	0,06
33.300	Indah Kiat Pulp & Paper Tbk. PT ....	18.099	0,03
22.500	Indocement Tunggul Prakarsa Tbk. PT ....	9.962	0,02
28.800	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. PT ....	18.115	0,03
47.700	Indofood Sukses Makmur Tbk. PT ....	17.696	0,03
23.400	Indosat Tbk. PT ....	15.290	0,03
45.000	Jasa Marga Persero Tbk. PT ....	13.686	0,02
269.100	Kalbe Farma Tbk. PT ....	25.061	0,04
156.600	Merdeka Copper Gold Tbk. PT ....	22.761	0,04
89.100	Perusahaan Gas Negara Tbk. PT ....	8.379	0,01
12.600	Petrindo Jaya Kreasi Tbk. PT ....	6.733	0,01
219.600	Sarana Menara Nusantara Tbk. PT ....	9.857	0,02
48.600	Semen Indonesia Persero Tbk. PT ....	11.070	0,02
187.200	Sumber Alfaria Trijaya Tbk. PT ....	31.438	0,06
527.400	Telkom Indonesia Persero Tbk. PT ....	100.810	0,18
51.300	Tower Bersama Infrastructure Tbk. PT ....	5.937	0,01
76.500	Unilever Indonesia Tbk. PT ....	14.109	0,03
19.000	United Tractors Tbk. PT ....	25.498	0,05
47.700	XL Axiata Tbk. PT ....	6.292	0,01
		<b>1.445.860</b>	<b>2,57</b>
	<b>Italien: 0,07 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
5.400	PRADA SpA ....	40.392	0,07
		<b>40.392</b>	<b>0,07</b>
	<b>Luxembourg: 0,10 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
4.500	L'Occitane International SA ....	19.135	0,03
13.500	Samsonite International SA ....	40.289	0,07
		<b>59.424</b>	<b>0,10</b>
	<b>Malaysia: 2,58 % (30. Juni 2023: 1,49 %)</b>		
12.600	Alliance Bank Malaysia Bhd. ....	10.123	0,02
25.200	AMMB Holdings Bhd. ....	22.916	0,04
51.300	Axiata Group Bhd. ....	28.382	0,05

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Malaysia: 2,58 % (30. Juni 2023: 1,49 %) (Fortsetzung)</b>		
44.100	CELCOMDIGI Bhd. ....	34.401	0,06
89.100	CIMB Group Holdings Bhd. ....	128.432	0,23
53.100	Dialog Group Bhd. ....	26.902	0,05
27.000	Gamuda Bhd. ....	37.660	0,07
24.300	Genting Bhd. ....	24.261	0,04
25.200	Genting Malaysia Bhd. ....	13.622	0,02
21.600	Hartalega Holdings Bhd. ....	15.018	0,03
6.300	Hong Leong Bank Bhd. ....	25.641	0,05
2.700	Hong Leong Financial Group Bhd. ....	9.890	0,02
33.300	IHH Healthcare Bhd. ....	44.471	0,08
38.700	IJM Corp. Bhd. ....	25.021	0,04
36.900	IOI Corp. Bhd. ....	28.941	0,05
5.400	Kuala Lumpur Kepong Bhd. ....	23.626	0,04
83.700	Malayan Banking Bhd. ....	176.715	0,31
12.150	Malaysia Airports Holdings Bhd. ....	25.498	0,05
33.300	Maxis Bhd. ....	24.918	0,04
22.500	MISC Bhd. ....	40.636	0,07
31.500	MR DIY Group M Bhd. ....	12.954	0,02
900	Nestle Malaysia Bhd. ....	23.180	0,04
31.500	Petronas Chemicals Group Bhd. ....	42.133	0,08
5.400	Petronas Dagangan Bhd. ....	19.963	0,04
10.800	Petronas Gas Bhd. ....	40.796	0,07
9.000	PPB Group Bhd. ....	27.281	0,05
39.600	Press Metal Aluminium Holdings Bhd. ....	48.351	0,09
162.000	Public Bank Bhd. ....	138.048	0,25
13.500	QL Resources Bhd. ....	18.658	0,03
21.600	RHB Bank Bhd. ....	25.229	0,05
44.100	Sime Darby Bhd. ....	24.492	0,04
40.500	Sime Darby Plantation Bhd. ....	36.229	0,06
12.600	Telekom Malaysia Bhd. ....	18.055	0,03
45.000	Tenaga Nasional Bhd. ....	131.447	0,23
66.600	Top Glove Corp. Bhd. ....	15.529	0,03
48.600	YTL Corp. Bhd. ....	35.542	0,06
27.900	YTL Power International Bhd. ....	28.506	0,05
		<b>1.453.467</b>	<b>2,58</b>
	<b>Philippinen: 0,91 % (30. Juni 2023: 0,46 %)</b>		
115.200	ACEN Corp. ....	9.828	0,02
3.600	Ayala Corp. ....	35.749	0,06
78.300	Ayala Land, Inc. ....	38.075	0,07
22.230	Bank of the Philippine Islands ....	45.174	0,08
23.670	BDO Unibank, Inc. ....	51.775	0,09
81.000	Bloomberry Resorts Corp. ....	13.143	0,02
720	Globe Telecom, Inc. ....	25.798	0,05
1.800	GT Capital Holdings, Inc. ....	19.041	0,03
12.420	International Container Terminal Services, Inc. ....	74.127	0,13
39.600	JG Summit Holdings, Inc. ....	17.601	0,03
5.400	Jollibee Foods Corp. ....	20.823	0,04
3.060	Manila Electric Co. ....	19.109	0,03
24.120	Metropolitan Bank & Trust Co. ....	27.800	0,05
92.700	Monde Nissin Corp. ....	14.868	0,03
1.035	PLDT, Inc. ....	25.376	0,04
111.600	SM Prime Holdings, Inc. ....	53.887	0,10
11.250	Universal Robina Corp. ....	21.345	0,04
		<b>513.519</b>	<b>0,91</b>
	<b>Singapur: 4,36 % (30. Juni 2023: 1,10 %)</b>		
2.700	BOC Aviation Ltd. ....	19.366	0,03

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Singapur: 4,36 % (30. Juni 2023: 1,10 %) (Fortsetzung)</b>		
40.500	CapitaLand Ascendas REIT .....	76.502	0,14
28.800	CapitaLand Ascott Trust .....	18.594	0,03
56.700	CapitaLand Integrated Commercial Trust .....	82.838	0,15
25.200	CapitaLand Investment Ltd. ....	49.461	0,09
4.500	City Developments Ltd. ....	17.133	0,03
23.400	ComfortDelGro Corp. Ltd. ....	23.137	0,04
21.640	DBS Group Holdings Ltd. ....	571.478	1,01
32.400	Frasers Logistics & Commercial Trust .....	22.712	0,04
66.600	Genting Singapore Ltd. ....	42.508	0,08
57.600	Hutchison Port Holdings Trust .....	7.373	0,01
900	Jardine Cycle & Carriage Ltd. ....	17.665	0,03
16.200	Keppel DC REIT .....	21.516	0,04
15.300	Keppel Ltd. ....	73.043	0,13
31.500	Keppel REIT .....	19.408	0,03
18.900	Mapletree Industrial Trust .....	29.426	0,05
37.800	Mapletree Logistics Trust .....	35.980	0,06
27.900	Mapletree Pan Asia Commercial Trust .....	25.116	0,04
33.300	Netlink NBN Trust .....	20.394	0,04
38.700	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. ....	412.057	0,73
10.800	SATS Ltd. ....	22.712	0,04
22.620	Seatrium Ltd. ....	23.033	0,04
10.800	Sembcorp Industries Ltd. ....	38.331	0,07
15.300	Singapore Airlines Ltd. ....	77.897	0,14
9.000	Singapore Exchange Ltd. ....	62.955	0,11
17.100	Singapore Technologies Engineering Ltd. ....	54.634	0,10
85.500	Singapore Telecommunications Ltd. ....	173.492	0,31
27.000	Suntec Real Estate Investment Trust .....	20.919	0,04
12.600	UnitedOverseasBankLtd .....	291.281	0,52
5.400	UOL Group Ltd. ....	20.719	0,04
3.016	Venture Corp. Ltd. ....	31.645	0,06
23.400	Wilmar International Ltd. ....	53.525	0,09
		<b>2.456.850</b>	<b>4,36</b>
	<b>Südkorea: 18,23 % (30 June 2023: 12,68 %)</b>		
423	Alteogen, Inc. ....	86.198	0,15
333	Amorepacific Corp. ....	40.473	0,07
90	BGF retail Co. Ltd. ....	6.754	0,01
3.132	BNK Financial Group, Inc. ....	19.272	0,03
234	Celltrion Pharm, Inc. ....	15.096	0,03
1.593	Celltrion, Inc. ....	201.714	0,36
792	Cheil Worldwide, Inc. ....	10.587	0,02
99	CJ CheilJedang Corp. ....	27.726	0,05
144	CJ Corp. ....	12.711	0,02
252	CosmoAM&T Co. Ltd. ....	26.399	0,05
639	Coway Co. Ltd. ....	29.803	0,05
504	DB Insurance Co. Ltd. ....	41.924	0,07
1.737	DGB Financial Group, Inc. ....	10.120	0,02
333	DL E&C Co. Ltd. ....	7.838	0,01
558	Doosan Bobcat, Inc. ....	20.796	0,04
4.806	Doosan Enerbility Co. Ltd. ....	70.178	0,12
513	Ecopro BM Co. Ltd. ....	68.201	0,12
1.035	Ecopro Co. Ltd. ....	67.747	0,12
90	Ecopro Materials Co. Ltd. ....	5.943	0,01
216	E-MART, Inc. ....	8.866	0,02
180	F&F Co. Ltd. ....	8.160	0,01
855	Fila Holdings Corp. ....	24.908	0,04
711	GS Engineering & Construction Corp. ....	7.763	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 18,23 % (30. Juni 2023: 12,68 %) (Fortsetzung)</b>		
504	GS Holdings Corp. ....	17.172	0,03
2.862	Hana Financial Group, Inc. ....	126.207	0,22
360	Hanjin Kal Corp. ....	16.895	0,03
711	Hankook Tire & Technology Co. Ltd. ....	23.347	0,04
90	Hanmi Pharm Co. Ltd. ....	17.686	0,03
486	Hanmi Semiconductor Co. Ltd. ....	60.834	0,11
1.863	Hanon Systems ....	6.402	0,01
387	Hanwha Aerospace Co. Ltd. ....	70.146	0,12
513	Hanwha Corp. ....	10.007	0,02
4.059	Hanwha Life Insurance Co. Ltd. ....	8.846	0,02
1.215	Hanwha Ocean Co. Ltd. ....	26.966	0,05
1.332	Hanwha Solutions Corp. ....	26.708	0,05
477	HD Hyundai Co. Ltd. ....	25.817	0,05
216	HD Hyundai Heavy Industries Co. Ltd. ....	24.432	0,04
1.566	HD Hyundai Infracore Co. Ltd. ....	8.692	0,02
234	HD HYUNDAI MIPO ....	15.810	0,03
486	HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd. ....	56.067	0,10
378	HL Mando Co. Ltd. ....	12.055	0,02
1.215	HLB, Inc. ....	51.636	0,09
3.303	HMM Co. Ltd. ....	47.103	0,08
441	Hotel Shilla Co. Ltd. ....	17.172	0,03
234	HYBE Co. Ltd. ....	34.424	0,06
819	Hyundai Engineering & Construction Co. Ltd. ....	19.069	0,03
207	Hyundai Glovis Co. Ltd. ....	32.934	0,06
657	Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd. ....	16.467	0,03
702	Hyundai Mobis Co. Ltd. ....	128.262	0,23
1.449	Hyundai Motor Co. ....	310.538	0,55
243	Hyundai Motor Co. (preferred stock) ....	32.094	0,06
396	Hyundai Motor Co. (zweite Vorzugsaktie) ....	52.704	0,09
954	Hyundai Steel Co. ....	20.133	0,04
315	Hyundai Wia Corp. ....	13.250	0,02
3.078	Industrial Bank of Korea ....	31.350	0,06
3.456	Kakao Corp. ....	102.061	0,18
468	Kakao Games Corp. ....	6.970	0,01
2.421	KakaoBank Corp. ....	35.704	0,06
342	Kakaopay Corp. ....	6.683	0,01
1.989	Kangwon Land, Inc. ....	20.056	0,04
3.645	KB Financial Group, Inc. ....	207.870	0,37
36	KCC Corp. ....	8.068	0,01
2.628	Kia Corp. ....	246.858	0,44
792	Korea Aerospace Industries Ltd. ....	30.495	0,05
2.889	Korea Electric Power Corp. ....	41.074	0,07
162	Korea Gas Corp. ....	6.143	0,01
513	Korea Investment Holdings Co. Ltd. ....	26.088	0,05
117	Korea Zinc Co. Ltd. ....	43.774	0,08
2.097	Korean Air Lines Co. Ltd. ....	35.420	0,06
324	Krafton, Inc. ....	66.259	0,12
1.080	KT&G Corp. ....	69.202	0,12
324	Kum Yang Co. Ltd. ....	20.243	0,04
234	Kumho Petrochemical Co. Ltd. ....	24.904	0,04
279	L&F Co. Ltd. ....	27.424	0,05
504	LG Chem Ltd. ....	126.503	0,22
90	LG Chem Ltd. (preferred stock) ....	15.757	0,03
1.017	LG Corp. ....	59.550	0,11
3.205	LG Display Co. Ltd. ....	26.706	0,05
1.224	LG Electronics, Inc. ....	98.614	0,18
441	LG Energy Solution Ltd. ....	104.603	0,19

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 18,23 % (30. Juni 2023: 12,68 %) (Fortsetzung)</b>		
117	LG H&H Co. Ltd. ....	29.367	0,05
162	LG Innotek Co. Ltd. ....	32.012	0,06
2.394	LG Uplus Corp. ....	17.079	0,03
207	Lotte Chemical Corp. ....	17.249	0,03
234	Lotte Energy Materials Corp. ....	8.976	0,02
360	Lotte Fine Chemical Co. Ltd. ....	11.638	0,02
225	Lotte Shopping Co. Ltd. ....	10.380	0,02
198	LS Corp. ....	20.699	0,04
972	Meritz Financial Group, Inc. ....	55.856	0,10
3.573	Mirae Asset Securities Co. Ltd. ....	19.001	0,03
1.476	NAVER Corp. ....	178.964	0,32
180	NCSOFT Corp. ....	23.525	0,04
243	Netmarble Corp. ....	9.480	0,02
1.539	NH Investment & Securities Co. Ltd. ....	14.188	0,03
45	NongShim Co. Ltd. ....	15.986	0,03
153	OCI Holdings Co. Ltd. ....	9.837	0,02
270	Orion Corp. ....	18.085	0,03
2.745	Pan Ocean Co. Ltd. ....	8.545	0,02
378	Pearl Abyss Corp. ....	12.124	0,02
675	Posco DX Co. Ltd. ....	18.806	0,03
315	POSCO Future M Co. Ltd. ....	59.155	0,10
819	POSCO Holdings, Inc. ....	215.980	0,38
513	Posco International Corp. ....	24.374	0,04
216	S-1 Corp. ....	9.101	0,02
198	Samsung Biologics Co. Ltd. ....	104.574	0,19
945	Samsung C&T Corp. ....	97.486	0,17
1.782	Samsung E&A Co. Ltd. ....	31.264	0,06
630	Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd. ....	72.314	0,13
51.903	Samsung Electronics Co. Ltd. ....	3.073.080	5,46
8.991	Samsung Electronics Co. Ltd. (Vorzugsaktien) ....	415.421	0,74
369	Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. ....	104.280	0,19
7.371	Samsung Heavy Industries Co. Ltd. ....	50.068	0,09
837	Samsung Life Insurance Co. Ltd. ....	53.814	0,10
558	Samsung SDI Co. Ltd. ....	143.503	0,25
432	Samsung SDS Co. Ltd. ....	46.605	0,08
882	Samsung Securities Co. Ltd. ....	25.502	0,05
5.409	Shinhan Financial Group Co. Ltd. ....	189.207	0,34
81	Shinsegae, Inc. ....	9.233	0,02
324	SK Biopharmaceuticals Co. Ltd. ....	18.242	0,03
315	SK Bioscience Co. Ltd. ....	12.037	0,02
5.832	SK Hynix, Inc. ....	1.002.011	1,78
288	SK IE Technology Co. Ltd. ....	9.227	0,02
612	SK Innovation Co. Ltd. ....	51.619	0,09
1.017	SK Square Co. Ltd. ....	73.883	0,13
360	SK, Inc. ....	41.401	0,07
207	SKC Co. Ltd. ....	25.354	0,04
603	S-Oil Corp. ....	29.131	0,05
198	Wemade Co. Ltd. ....	6.135	0,01
6.309	Woori Financial Group, Inc. ....	67.330	0,12
621	Yuhan Corp. ....	36.498	0,06
		<b>10.267.057</b>	<b>18,23</b>
	<b>Taiwan: 28,51 % (30. Juni 2023: 16,26 %)</b>		
5.280	Accton Technology Corp. ....	90.329	0,16
27.000	Acer, Inc. ....	38.992	0,07
4.780	Advantech Co. Ltd. ....	54.517	0,10
36.000	ASE Technology Holding Co. Ltd. ....	186.983	0,33

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Taiwan: 28,51 % (30. Juni 2023: 16,26 %) (Fortsetzung)</b>		
27.810	Asia Cement Corp. ....	37.590	0,07
3.159	Asia Vital Components Co. Ltd. ....	74.492	0,13
360	ASMedia Technology, Inc. ....	24.857	0,04
360	ASPEED Technology, Inc. ....	53.709	0,10
7.650	Asustek Computer, Inc. ....	117.433	0,21
81.000	AUO Corp. ....	44.443	0,08
27.000	Capital Securities Corp. ....	20.890	0,04
7.200	Catcher Technology Co. Ltd. ....	51.490	0,09
95.400	Cathay Financial Holding Co. Ltd. ....	173.500	0,31
81.000	Chang Hwa Commercial Bank Ltd. ....	46.066	0,08
20.700	Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd. ....	31.553	0,06
6.750	Chicony Electronics Co. Ltd. ....	35.579	0,06
45.000	China Airlines Ltd. ....	32.875	0,06
162.000	China Development Financial Holding Corp. ....	75.403	0,13
2.520	China Motor Corp. ....	9.632	0,02
126.000	China Steel Corp. ....	89.718	0,16
41.050	Chunghwa Telecom Co. Ltd. ....	158.802	0,28
45.000	Compal Electronics, Inc. ....	48.133	0,09
198.000	CTBC Financial Holding Co. Ltd. ....	231.010	0,41
23.590	Delta Electronics, Inc. ....	281.773	0,50
7.300	E Ink Holdings, Inc. ....	56.705	0,10
162.000	E.Sun Financial Holding Co. Ltd. ....	142.567	0,25
1.800	Eclat Textile Co. Ltd. ....	29.351	0,05
3.357	Elite Material Co. Ltd. ....	49.152	0,09
738	eMemory Technology, Inc. ....	58.464	0,10
12.600	Eternal Materials Co. Ltd. ....	12.001	0,02
27.000	Eva Airways Corp. ....	31.751	0,06
11.430	Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd. ....	67.999	0,12
27.000	Far Eastern International Bank ....	13.816	0,03
27.000	Far Eastern New Century Corp. ....	29.337	0,05
18.000	Far EasTone Telecommunications Co. Ltd. ....	46.663	0,08
5.584	Feng TAY Enterprise Co. Ltd. ....	26.679	0,05
117.000	First Financial Holding Co. Ltd. ....	101.342	0,18
38.700	Formosa Chemicals & Fibre Corp. ....	60.123	0,11
18.000	Formosa Petrochemical Corp. ....	35.954	0,06
42.390	Formosa Plastics Corp. ....	75.133	0,13
9.000	Formosa Taffeta Co. Ltd. ....	6.242	0,01
12.600	Foxconn Technology Co. Ltd. ....	27.692	0,05
83.800	Fubon Financial Holding Co. Ltd. ....	204.841	0,36
1.000	Genius Electronic Optical Co. Ltd. ....	20.406	0,04
4.240	Giant Manufacturing Co. Ltd. ....	27.708	0,05
5.670	Gigabyte Technology Co. Ltd. ....	53.394	0,10
910	Global Unichip Corp. ....	45.021	0,08
2.250	Globalwafers Co. Ltd. ....	37.383	0,07
3.600	Hiwin Technologies Corp. ....	23.636	0,04
130.500	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. ....	860.842	1,53
3.690	Hotai Motor Co. Ltd. ....	70.748	0,13
8.100	HTC Corp. ....	11.523	0,02
108.000	Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd. ....	87.888	0,16
99.000	Innolux Corp. ....	43.791	0,08
27.000	Inventec Corp. ....	46.441	0,08
1.054	Largan Precision Co. Ltd. ....	89.183	0,16
22.500	Lite-On Technology Corp. ....	73.517	0,13
16.210	MediaTek, Inc. ....	699.536	1,24
126.583	Mega Financial Holding Co. Ltd. ....	157.636	0,28
7.200	Micro-Star International Co. Ltd. ....	39.505	0,07
1.260	momo.com, Inc. ....	16.681	0,03

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Taiwan: 28,51 % (30. Juni 2023: 16,26 %) (Fortsetzung)</b>		
56.790	Nan Ya Plastics Corp. ....	86.301	0,15
3.160	Nan Ya Printed Circuit Board Corp. ....	18.118	0,03
11.520	Nanya Technology Corp. ....	24.751	0,04
1.440	Nien Made Enterprise Co. Ltd. ....	17.311	0,03
6.030	Novatek Microelectronics Corp. ....	112.639	0,20
3.600	Oneness Biotech Co. Ltd. ....	18.199	0,03
18.000	Pegatron Corp. ....	57.981	0,10
2.700	PharmaEssentia Corp. ....	46.607	0,08
27.000	Pou Chen Corp. ....	29.129	0,05
36.000	Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp. ....	29.740	0,05
7.200	Powertech Technology, Inc. ....	41.724	0,07
5.850	President Chain Store Corp. ....	49.319	0,09
28.810	Quanta Computer, Inc. ....	277.075	0,49
5.049	Realtek Semiconductor Corp. ....	84.976	0,15
18.000	Ruentex Development Co. Ltd. ....	24.191	0,04
36.000	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. ....	51.101	0,09
153.000	Shin Kong Financial Holding Co. Ltd. ....	46.407	0,08
5.590	Sino-American Silicon Products, Inc. ....	37.478	0,07
126.000	SinoPac Financial Holdings Co. Ltd. ....	98.651	0,18
15.300	Synnex Technology International Corp. ....	34.475	0,06
135.000	Taishin Financial Holding Co. Ltd. ....	78.441	0,14
63.000	Taiwan Business Bank ....	35.344	0,06
71.100	Taiwan Cement Corp. ....	74.954	0,13
117.000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd. ....	93.769	0,17
9.504	Taiwan Fertilizer Co. Ltd. ....	18.837	0,03
27.000	Taiwan High Speed Rail Corp. ....	25.301	0,05
16.560	Taiwan Mobile Co. Ltd. ....	54.619	0,10
3.150	Taiwan Secom Co. Ltd. ....	12.768	0,02
260.910	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	7.769.032	13,80
18.000	Tatung Co. Ltd. ....	31.626	0,06
18.000	Teco Electric & Machinery Co. Ltd. ....	29.684	0,05
14.220	Unimicron Technology Corp. ....	78.899	0,14
51.300	Uni-President Enterprises Corp. ....	128.560	0,23
126.000	United Microelectronics Corp. ....	216.334	0,39
10.260	Vanguard International Semiconductor Corp. ....	40.956	0,07
730	Voltronic Power Technology Corp. ....	43.316	0,08
28.458	Walsin Lihwa Corp. ....	31.141	0,06
2.250	Walsin Technology Corp. ....	8.184	0,02
10.800	Wan Hai Lines Ltd. ....	29.496	0,05
4.500	Win Semiconductors Corp. ....	24.205	0,04
36.000	Winbond Electronics Corp. ....	28.519	0,05
31.500	Wistron Corp. ....	102.924	0,18
990	Wiwynn Corp. ....	80.716	0,14
18.000	WPG Holdings Ltd. ....	49.825	0,09
4.230	Yageo Corp. ....	95.184	0,17
19.845	Yang Ming Marine Transport Corp. ....	45.634	0,08
135.000	Yuanta Financial Holding Co. Ltd. ....	133.371	0,24
5.805	Yulon Motor Co. Ltd. ....	11.953	0,02
		<b>16.050.185</b>	<b>28,51</b>
	<b>Thailand: 2,54 % (30. Juni 2023: 2,92 %)</b>		
12.600	Advanced Info Service PCL NVDR ....	71.760	0,13
45.900	Airports of Thailand PCL NVDR ....	72.232	0,13
8.100	B Grimm Power PCL NVDR ....	4.768	0,01
7.200	Bangkok Bank PCL NVDR ....	25.604	0,05
121.500	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR ....	88.565	0,16
90.000	Bangkok Expressway & Metro PCL NVDR ....	18.761	0,03

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,03 % (30. Juni 2023: 98,37 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Thailand: 2,54 % (30. Juni 2023: 2,92 %) (Fortsetzung)</b>		
142.200	Banpu PCL NVDR .....	19.065	0,03
11.700	Berli Jucker PCL NVDR .....	6.791	0,01
96.300	BTS Group Holdings PCL NVDR .....	11.756	0,02
6.300	Bumrungrad Hospital PCL NVDR .....	42.403	0,07
29.700	Central Pattana PCL NVDR .....	44.715	0,08
31.500	Central Retail Corp. PCL NVDR .....	26.395	0,05
45.000	Charoen Pokphand Foods PCL NVDR .....	28.081	0,05
64.800	CP ALL PCL NVDR .....	97.118	0,17
21.600	CP Axtra PCL NVDR .....	16.039	0,03
31.500	Delta Electronics Thailand PCL NVDR .....	71.459	0,13
49.500	Digital Telecommunications Infrastructure Fund .....	10.589	0,02
2.700	Electricity Generating PCL NVDR .....	7.615	0,01
18.900	Energy Absolute PCL NVDR .....	5.768	0,01
8.100	Global Power Synergy PCL NVDR .....	8.774	0,02
34.200	Gulf Energy Development PCL NVDR .....	37.744	0,07
63.900	Home Product Center PCL NVDR .....	16.107	0,03
20.700	Indorama Ventures PCL NVDR .....	10.999	0,02
9.900	Intouch Holdings PCL NVDR .....	19.289	0,03
17.100	Kasikornbank PCL NVDR .....	58.479	0,10
70.200	Krung Thai Bank PCL NVDR .....	32.711	0,06
14.400	Krungthai Card PCL NVDR .....	15.990	0,03
93.600	Land & Houses PCL NVDR .....	15.048	0,03
45.000	Minor International PCL NVDR .....	36.787	0,07
7.200	Muangthai Capital PCL NVDR .....	8.535	0,01
28.800	Osotspa PCL NVDR .....	18.050	0,03
13.500	PTT Exploration & Production PCL NVDR .....	55.917	0,10
23.400	PTT Global Chemical PCL NVDR .....	19.448	0,03
36.000	PTT Oil & Retail Business PCL NVDR .....	15.696	0,03
153.900	PTT PCL NVDR .....	136.297	0,24
13.500	Ratch Group PCL NVDR .....	9.749	0,02
18.900	SCB X PCL NVDR .....	53.047	0,09
13.500	SCG Packaging PCL NVDR .....	12.416	0,02
8.100	Siam Cement PCL NVDR .....	49.663	0,09
5.520	Srisawad Corp. PCL NVDR .....	5.189	0,01
90.000	Thai Beverage PCL .....	29.884	0,05
28.800	Thai Life Insurance PCL NVDR .....	6.043	0,01
14.400	Thai Oil PCL NVDR .....	20.797	0,04
35.100	Thai Union Group PCL NVDR .....	14.251	0,03
489.600	TMBThanachart Bank PCL NVDR .....	22.814	0,04
119.700	True Corp. PCL NVDR .....	28.541	0,05
		<u>1.427.749</u>	<u>2,54</u>
	<b>Summe Aktien .....</b>	<u>56.324.507</u>	<u>100,03</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere .....</b>	<u>56.324.507</u>	<u>100,03</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Finanzderivate: Null (30. Juni 2023: (0,01) %)

Terminkontrakte: Null (30. Juni 2023: (0,01) %)

	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>Anlagenportfolio</b>	56.324.507	100,03
<b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>	(19.261)	(0,03)
<b>Nettovermögen</b>	<u>56.305.246</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	99,40
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	0,60
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 97,59 % (30. Juni 2023: 97,82 %)</b>		
	<b>Aktien: 97,59 % (30. Juni 2023: 97,82 %)</b>		
	<b>Brasilien: 97,59 % (30. Juni 2023: 97,82 %)</b>		
37.700	Allos SA .....	143.349	0,47
18.200	Alpargatas SA .....	29.883	0,10
10.400	Alupar Investimento SA .....	55.741	0,18
15.600	Ambev SA .....	32.046	0,11
342.030	Ambev SA ADR .....	701.162	2,31
42.900	Atacadao SA .....	69.666	0,23
28.600	Auren Energia SA .....	63.539	0,21
457.600	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	843.616	2,78
123.500	Banco Bradesco SA .....	248.803	0,82
23.400	Banco Bradesco SA (Vorzugsaktien) .....	52.155	0,17
402.194	Banco Bradesco SA ADR .....	900.915	2,97
104.000	Banco BTG Pactual SA .....	578.750	1,91
140.400	Banco do Brasil SA .....	675.149	2,22
29.900	Banco Santander Brasil SA .....	147.819	0,49
55.900	BB Seguridade Participacoes SA .....	331.408	1,09
2.600	Bradespar SA .....	8.402	0,03
20.800	Bradespar SA (Vorzugsaktien) .....	69.315	0,23
15.600	Braskem SA .....	50.161	0,17
54.600	BRF SA .....	222.845	0,73
36.400	Caixa Seguridade Participacoes SA .....	93.778	0,31
91.000	CCR SA .....	190.701	0,63
107.900	Centrais Eletricas Brasileiras SA .....	696.417	2,29
23.400	Centrais Eletricas Brasileiras SA (Vorzugsaktien) .....	168.935	0,56
27.300	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP .....	368.476	1,21
5.200	Cia Energetica de Minas Gerais .....	11.440	0,04
135.200	Cia Energetica de Minas Gerais (Vorzugsaktien) .....	240.731	0,79
65.000	Cia Paranaense de Energia - Copel .....	97.012	0,32
109.200	Cia Paranaense de Energia - Copel Anteilsklasse B .....	182.837	0,60
50.700	Cia Siderurgica Nacional SA .....	117.840	0,39
93.600	Cielo SA .....	94.873	0,31
97.500	Cosan SA .....	237.674	0,78
15.600	CPFL Energia SA .....	91.924	0,30
42.900	CSN Mineracao SA .....	40.085	0,13
15.600	CTEEP-Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista .....	73.753	0,24
28.600	Dexco SA .....	33.778	0,11
22.100	Diagnosticos da America SA .....	11.021	0,04
59.800	Embraer SA .....	389.196	1,28
23.400	Energisa SA .....	192.190	0,63
46.800	Eneva SA .....	107.006	0,35
14.300	Engie Brasil Energia SA .....	114.025	0,38
1.006	Equatorial Energia SA Common Receipts .....	5.631	0,02
73.100	Equatorial Energia SA Ordinary Receipts .....	403.899	1,33
106.600	Gerdau SA .....	352.746	1,16
35.100	GPS Participacoes e Empreendimentos SA .....	108.944	0,36
32.500	Grupo Mateus SA .....	40.549	0,13
388.700	Hapvida Participacoes e Investimentos SA .....	268.023	0,88
32.500	Hypera SA .....	167.928	0,55
6.500	Intelbras SA Industria de Telecomunicacao Eletronica Brasileira .....	27.021	0,09
36.400	Itau Unibanco Holding SA .....	184.082	0,61
24.700	Itau Unibanco Holding SA (Vorzugsaktien) .....	144.124	0,47
372.593	Itau Unibanco Holding SA ADR .....	2.175.943	7,17
444.600	Itausa SA .....	786.031	2,59
27.300	JBS SA .....	158.606	0,52
41.717	JBS SA ADR .....	482.132	1,59
72.920	Klabin SA .....	281.469	0,93
696	Localiza Rent a Car SA (voting rights) .....	1.128	0,00
68.900	Localiza Rent a Car SA Anteilsklasse A .....	520.988	1,72

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 97,59 % (30. Juni 2023: 97,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 97,59 % (30. Juni 2023: 97,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Brasilien: 97,59 % (30. Juni 2023: 97,82 %) (Fortsetzung)</b>		
78.000	Lojas Renner SA .....	175.254	0,58
10.400	M Dias Branco SA .....	54.917	0,18
27.300	Magazine Luiza SA .....	59.225	0,20
54.600	Metalurgica Gerdau SA .....	104.689	0,34
22.100	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA .....	89.682	0,30
79.300	Natura & Co. Holding SA .....	221.862	0,73
18.200	Neoenergia SA .....	60.847	0,20
27.300	Petroleo Brasileiro SA .....	198.467	0,65
28.600	Petroleo Brasileiro SA (Vorzugsaktien) .....	195.920	0,65
138.450	Petroleo Brasileiro SA ADR .....	2.006.141	6,61
215.423	Petroleo Brasileiro SA ADR (Vorzugsaktien) .....	2.938.370	9,68
15.600	Porto Seguro SA .....	86.925	0,29
55.900	PRIIO SA .....	440.401	1,45
91.000	Raia Drogasil SA .....	420.722	1,39
63.700	Rede D'Or Sao Luiz SA .....	311.937	1,03
101.400	Rumo SA .....	378.257	1,25
13.000	Sao Martinho SA .....	76.603	0,25
110.500	Sendas Distribuidora SA .....	205.704	0,68
16.900	SLC Agricola SA .....	53.093	0,17
9.100	Smartfit Escola de Ginastica e Danca SA .....	35.388	0,12
56.600	Suzano SA .....	580.933	1,91
2.600	Telefonica Brasil SA .....	21.223	0,07
33.111	Telefonica Brasil SA ADR .....	271.841	0,90
66.300	TIM SA .....	189.550	0,62
36.400	TOTVS SA .....	199.417	0,66
18.200	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA .....	112.160	0,37
67.600	Ultrapar Participacoes SA .....	262.881	0,87
4.260	Unipar Carbocloro SA .....	37.420	0,12
13.000	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas .....	17.858	0,06
40.300	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas (Vorzugsaktien) .....	57.391	0,19
26.000	Vale SA .....	291.248	0,96
291.876	Vale SA ADR .....	3.260.255	10,74
32.500	Vamos Locacao de Caminhos Maquinas e Equipamentos SA .....	44.293	0,15
91.000	Vibra Energia SA .....	342.410	1,13
122.200	WEG SA .....	928.196	3,06
		<u>29.619.140</u>	<u>97,59</u>
	<b>Summe Aktien .....</b>	<u>29.619.140</u>	<u>97,59</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere .....</b>	<u>29.619.140</u>	<u>97,59</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

Finanzderivate: 0,04 % (30. Juni 2023: (0,00) %)

Terminkontrakte: 0,04 % (30. Juni 2023: (0,00) %)\*

Nominalbetrag USD	Durchschnittli- cher Kurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
314.802	22.174	71 Mini Bovespa Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im August 2024 .....	5.719	0,02
443.872	22.193	20 Bovespa Index Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im August 2024 .....	7.662	0,02
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten ..</b>	<b>13.381</b>	<b>0,04</b>
		<b>Summe Finanzderivate .....</b>	<b>13.381</b>	<b>0,04</b>
			<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlagenportfolio</b>	29.632.521	97,63
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	718.668	2,37
		<b>Nettovermögen</b>	<b>30.351.189</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
		An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....		97,57
		Börsengehandelte Derivate .....		0,04
		Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		2,39
		<b>Gesamtvermögen .....</b>		<b>100,00</b>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 132.987 USD.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,92 % (30. Juni 2023: 0,96 %)</b>		
1.488.000	Alibaba Health Information Technology Ltd. ....	596.542	0,11
3.720.000	Alibaba Pictures Group Ltd. ....	197.736	0,04
992.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd. ....	304.942	0,06
768.800	China Ltd. ....	689.295	0,13
235.600	China Resources Gas Group Ltd. ....	825.327	0,15
1.488.000	China Ruyi Holdings Ltd. ....	400.236	0,07
248.000	COSCO SHIPPING Ports Ltd. ....	171.212	0,03
290.030	Hopson Development Holdings Ltd. ....	132.990	0,02
992.000	Kunlun Energy Co. Ltd. ....	1.029.177	0,19
434.000	Luye Pharma Group Ltd. ....	150.088	0,03
372.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd. ....	154.853	0,03
372.000	Shenzhen International Holdings Ltd. ....	296.841	0,06
		<b>4.949.239</b>	<b>0,92</b>
	<b>Cayman-Inseln: 50,91 % (30. Juni 2023: 51,59 %)</b>		
434.000	3SBio, Inc. ....	357.989	0,07
173.600	Akeso, Inc. ....	839.383	0,16
4.389.600	Alibaba Group Holding Ltd. ....	39.637.626	7,41
5.000	Angelalign Technology, Inc. ....	36.344	0,01
328.650	ANTA Sports Products Ltd. ....	3.157.101	0,59
15.872	Autohome, Inc. ADR ....	435.686	0,08
576.600	Baidu, Inc. ....	6.295.969	1,18
161.200	BeiGene Ltd. ....	1.779.778	0,33
71.920	Bilibili, Inc. ....	1.168.974	0,22
248.000	Blue Moon Group Holdings Ltd. ....	65.753	0,01
992.000	Bosideng International Holdings Ltd. ....	618.777	0,12
248.000	C&D International Investment Group Ltd. ....	461.224	0,09
372.000	China Conch Venture Holdings Ltd. ....	346.871	0,06
992.000	China Feihe Ltd. ....	458.683	0,09
558.000	China Hongqiao Group Ltd. ....	844.783	0,16
248.000	China Lesso Group Holdings Ltd. ....	99.106	0,02
99.200	China Literature Ltd. ....	319.553	0,06
248.000	China Medical System Holdings Ltd. ....	210.283	0,04
44.000	China Meidong Auto Holdings Ltd. ....	11.835	0,00
744.000	China Mengniu Dairy Co. Ltd. ....	1.334.119	0,25
496.000	China Resources Building Materials Technology Holdings Ltd. ....	87.671	0,02
682.000	China Resources Land Ltd. ....	2.319.223	0,43
17.057	China Resources Microelectronics Ltd. ....	87.471	0,02
148.800	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd. ....	492.671	0,09
496.000	China State Construction International Holdings Ltd. ....	677.224	0,13
2.835.000	Country Garden Holdings Co. Ltd. ....	176.112	0,03
545.600	Country Garden Services Holdings Co. Ltd. ....	336.833	0,06
19.220	Dada Nexus Ltd. ADR ....	24.217	0,00
12.772	Daqo New Energy Corp. ADR ....	186.471	0,03
124.000	East Buy Holding Ltd. ....	200.435	0,04
198.400	ENN Energy Holdings Ltd. ....	1.635.249	0,31
172.608	Full Truck Alliance Co. Ltd. ADR ....	1.387.768	0,26
48.236	GalaxyCore, Inc. ....	80.010	0,01
5.332.000	GCL Technology Holdings Ltd. ....	792.213	0,15
173.600	GDS Holdings Ltd. ....	207.455	0,04
1.364.000	Geely Automobile Holdings Ltd. ....	1.535.666	0,29
248.000	Genscript Biotech Corp. ....	264.283	0,05
99.200	Giant Biogene Holding Co. Ltd. ....	582.565	0,11
310.000	Greentown China Holdings Ltd. ....	243.794	0,04
496.000	H World Group Ltd. ....	1.651.766	0,31
372.000	Haidilao International Holding Ltd. ....	668.965	0,12
137.000	Haitian International Holdings Ltd. ....	389.554	0,07

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Cayman-Inseln: 50,91 % (30. Juni 2023: 51,59 %) (Fortsetzung)</b>		
248.000	Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	518.400	0,10
186.000	Hengan International Group Co. Ltd. ....	567.001	0,11
93.333	Horizon Construction Development Ltd. ....	17.932	0,00
74.400	Hygeia Healthcare Holdings Co. Ltd. ....	268.253	0,05
372.000	Innovent Biologics, Inc. ....	1.753.413	0,33
119.784	iQIYI, Inc. ADR ....	439.607	0,08
1.760.800	J&T Global Express Ltd. ....	1.608.026	0,30
272.800	JD Health International, Inc. ....	742.501	0,14
434.000	JD Logistics, Inc. ....	465.830	0,09
613.800	JD.com, Inc. ....	8.121.211	1,52
620.000	Jinxin Fertility Group Ltd. ....	220.765	0,04
248.000	Jiumaojiu International Holdings Ltd. ....	128.647	0,02
6.448	JOYY, Inc. ADR ....	194.020	0,04
83.576	Kanzhun Ltd. ADR ....	1.572.065	0,29
162.440	KE Holdings, Inc. ADR ....	2.298.526	0,43
186.000	Kingboard Holdings Ltd. ....	437.877	0,08
248.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd. ....	266.824	0,05
744.000	Kingdee International Software Group Co. Ltd. ....	697.554	0,13
566.505	Kingsoft Cloud Holdings Ltd. ....	99.407	0,02
223.200	Kingsoft Corp. Ltd. ....	644.665	0,12
731.600	Kuaishou Technology ....	4.324.531	0,81
372.000	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd. ....	110.065	0,02
285.200	Li Auto, Inc. ....	2.568.020	0,48
558.000	Li Ning Co. Ltd. ....	1.207.854	0,23
558.000	Longfor Group Holdings Ltd. ....	766.165	0,14
45.508	Lufax Holding Ltd. ADR ....	107.854	0,02
1.376.400	Meituan ....	19.586.295	3,66
260.400	Microport Scientific Corp. ....	175.770	0,03
74.400	MINISO Group Holding Ltd. ....	356.877	0,07
186.000	Minth Group Ltd. ....	289.218	0,05
458.800	NetEase, Inc. ....	8.761.826	1,64
396.800	New Oriental Education & Technology Group, Inc. ....	3.034.168	0,57
345.960	NIO, Inc. ....	1.508.817	0,28
182.528	PDD Holdings, Inc. ADR ....	24.267.098	4,53
148.800	Ping An Healthcare & Technology Co. Ltd. ....	218.033	0,04
173.600	Pop Mart International Group Ltd. ....	850.501	0,16
30.380	Qifu Technology, Inc. ADR ....	599.397	0,11
205.344	RLX Technology, Inc. ADR ....	377.833	0,07
248.000	Sany Heavy Equipment International Holdings Co. Ltd. ....	154.377	0,03
770.285	Seazen Group Ltd. ....	134.179	0,02
5.456.000	SenseTime Group, Inc. ....	922.448	0,17
198.400	Shenzhen International Group Holdings Ltd. ....	1.942.731	0,36
2.604.000	Sino Biopharmaceutical Ltd. ....	890.524	0,17
496.000	Smoores International Holdings Ltd. ....	601.624	0,11
161.200	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. ....	996.222	0,19
102.796	TAL Education Group ADR ....	1.096.833	0,20
1.624.400	Tencent Holdings Ltd. ....	77.481.179	14,48
160.580	Tencent Music Entertainment Group ADR ....	2.256.149	0,42
496.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. ....	597.812	0,11
297.600	Tongcheng Travel Holdings Ltd. ....	592.349	0,11
744.000	Topsports International Holdings Ltd. ....	395.471	0,07
372.000	Towngas Smart Energy Co. Ltd. ....	132.935	0,02
136.400	Trip.com Group Ltd. ....	6.544.489	1,22
60.016	Tuya, Inc. ADR ....	102.627	0,02
248.000	Uni-President China Holdings Ltd. ....	226.483	0,04
89.032	Vipshop Holdings Ltd. ADR ....	1.159.197	0,22
1.116.000	Want Want China Holdings Ltd. ....	674.683	0,13

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Cayman-Inseln: 50,91 % (30. Juni 2023: 51,59 %) (Fortsetzung)</b>		
19.096	Weibo Corp. ADR .....	146.657	0,03
930.000	Wuxi Biologics Cayman, Inc. ....	1.374.619	0,26
3.794.400	Xiaomi Corp. ....	8.009.288	1,50
1.113.644	Xinyi Solar Holdings Ltd. ....	560.573	0,10
334.800	XPeng, Inc. ....	1.267.175	0,24
310.000	Xtep International Holdings Ltd. ....	190.985	0,04
310.000	Yadea Group Holdings Ltd. ....	391.897	0,07
124.000	Yihai International Holding Ltd. ....	208.059	0,04
248.000	Zai Lab Ltd. ....	425.647	0,08
124.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd. ....	181.377	0,03
124.000	ZJLD Group, Inc. ....	128.330	0,02
		<b>272.467.218</b>	<b>50,91</b>
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %)</b>		
136.400	360 Security Technology, Inc. ....	143.484	0,03
37.200	37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co. Ltd. ....	66.494	0,01
37.200	Addsino Co. Ltd. ....	29.858	0,01
9.548	Advanced Micro-Fabrication Equipment, Inc. China .....	184.739	0,03
24.800	AECC Aero-Engine Control Co. Ltd. ....	68.175	0,01
49.600	AECC Aviation Power Co. Ltd. ....	248.311	0,05
1.550.000	Agricultural Bank of China Ltd. Anteilsklasse A .....	925.646	0,17
7.936.000	Agricultural Bank of China Ltd. Anteilsklasse H .....	3.395.015	0,63
173.600	Aier Eye Hospital Group Co. Ltd. ....	245.390	0,05
173.600	Air China Ltd. Anteilsklasse A .....	175.482	0,03
496.000	Air China Ltd. Anteilsklasse H .....	230.612	0,04
12.400	All Winner Technology Co. Ltd. ....	39.930	0,01
62.000	Alpha Group .....	50.783	0,01
248.000	Aluminum Corp. of China Ltd. Anteilsklasse A .....	259.181	0,05
992.000	Aluminum Corp. of China Ltd. Anteilsklasse H .....	677.224	0,13
9.633	Amlogic Shanghai Co. Ltd. ....	78.269	0,01
124.000	Angang Steel Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	36.007	0,01
496.000	Angang Steel Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	77.506	0,01
24.800	Angel Yeast Co. Ltd. ....	94.874	0,02
37.200	Anhui Anke Biotechnology Group Co. Ltd. ....	43.514	0,01
74.400	Anhui Conch Cement Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	240.396	0,04
310.000	Anhui Conch Cement Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	738.530	0,14
12.400	Anhui Gujing Distillery Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	358.488	0,07
24.800	Anhui Gujing Distillery Co. Ltd. Anteilsklasse B .....	369.043	0,07
37.200	Anhui Jianghuai Automobile Group Corp. Ltd. ....	80.710	0,02
12.400	Anhui Yingjia Distillery Co. Ltd. ....	97.660	0,02
24.800	Apeloa Pharmaceutical Co. Ltd. ....	46.095	0,01
4.840	Asymchem Laboratories Tianjin Co. Ltd. ....	43.621	0,01
24.800	Avary Holding Shenzhen Co. Ltd. ....	135.059	0,03
186.000	AVIC Industry-Finance Holdings Co. Ltd. ....	56.558	0,01
620.000	AviChina Industry & Technology Co. Ltd. ....	278.736	0,05
12.400	Avicopter PLC .....	69.823	0,01
99.200	BAIC BluePark New Energy Technology Co. Ltd. ....	109.787	0,02
682.000	BAIC Motor Corp. Ltd. ....	174.706	0,03
396.800	Bank of Beijing Co. Ltd. ....	317.403	0,06
86.800	Bank of Changsha Co. Ltd. ....	97.252	0,02
830.800	Bank of China Ltd. Anteilsklasse A .....	525.733	0,10
21.576.000	Bank of China Ltd. Anteilsklasse H .....	10.639.598	1,99
719.200	Bank of Communications Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	735.863	0,14
1.860.000	Bank of Communications Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	1.460.384	0,27
111.600	Bank of Hangzhou Co. Ltd. ....	199.481	0,04
334.800	Bank of Jiangsu Co. Ltd. ....	340.723	0,06
198.400	Bank of Nanjing Co. Ltd. ....	282.347	0,05

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
124.000	Bank of Ningbo Co. Ltd. ....	374.674	0,07
260.400	Bank of Shanghai Co. Ltd. ....	258.943	0,05
24.800	Bank of Suzhou Co. Ltd. ....	25.476	0,00
161.200	Bank of Zhengzhou Co. Ltd. ....	38.198	0,01
359.600	Baoshan Iron & Steel Co. Ltd. ....	327.543	0,06
260.400	BBMG Corp. Anteilsklasse A ....	48.864	0,01
620.000	BBMG Corp. Anteilsklasse H ....	44.471	0,01
186.000	Beijing Capital Eco-Environment Protection Group Co. Ltd. ....	68.277	0,01
496.000	Beijing Capital International Airport Co. Ltd. ....	163.906	0,03
99.200	Beijing Dabeinong Technology Group Co. Ltd. ....	52.312	0,01
12.400	Beijing Easpring Material Technology Co. Ltd. ....	58.273	0,01
12.400	Beijing E-Hualu Information Technology Co. Ltd. ....	28.585	0,01
74.400	Beijing Enlight Media Co. Ltd. ....	85.703	0,02
62.000	Beijing Jetsen Technology Co. Ltd. ....	31.506	0,01
496.000	Beijing Jingneng Clean Energy Co. Ltd. ....	118.165	0,02
8.206	Beijing Kingsoft Office Software, Inc. ....	255.705	0,05
37.200	Beijing New Building Materials PLC ....	151.127	0,03
37.200	Beijing Orient National Communication Science & Technology Co. Ltd. ....	31.183	0,01
136.400	Beijing Originwater Technology Co. Ltd. ....	78.281	0,01
1.970	Beijing Roborock Technology Co. Ltd. ....	105.936	0,02
49.600	Beijing Shiji Information Technology Co. Ltd. ....	38.928	0,01
136.400	Beijing Shougang Co. Ltd. ....	50.817	0,01
37.200	Beijing Sinnet Technology Co. Ltd. ....	43.055	0,01
29.840	Beijing Tiantan Biological Products Corp. Ltd. ....	99.728	0,02
24.800	Beijing Tongrentang Co. Ltd. ....	129.794	0,02
12.400	Beijing United Information Technology Co. Ltd. ....	33.306	0,01
12.400	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co. Ltd. ....	111.893	0,02
62.000	Beijing Yanjing Brewery Co. Ltd. ....	74.986	0,01
37.200	Beijing Zhong Ke San Huan High-Tech Co. Ltd. ....	38.979	0,01
533.200	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd. ....	392.185	0,07
17.240	Bethel Automotive Safety Systems Co. Ltd. ....	91.857	0,02
5.918	Bloomage Biotechnology Corp. Ltd. ....	45.855	0,01
49.600	Bluefocus Intelligent Communications Group Co. Ltd. ....	36.958	0,01
37.200	Bluestar Adisseo Co. ....	49.424	0,01
24.800	BOC International China Co. Ltd. ....	30.844	0,01
669.600	BOE Technology Group Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	375.116	0,07
235.600	BOE Technology Group Co. Ltd. Anteilsklasse B ....	76.950	0,01
24.800	BTG Hotels Group Co. Ltd. ....	41.951	0,01
37.200	BYD Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	1.275.098	0,24
248.000	BYD Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	7.369.419	1,38
37.200	By-health Co. Ltd. ....	69.041	0,01
37.200	C&S Paper Co. Ltd. ....	35.259	0,01
111.600	Caitong Securities Co. Ltd. ....	101.040	0,02
7.002	Cambricon Technologies Corp. Ltd. ....	190.538	0,04
12.400	Canmax Technologies Co. Ltd. ....	29.179	0,01
24.800	CanSino Biologics, Inc. ....	62.068	0,01
10.101	Cathay Biotech, Inc. ....	62.799	0,01
86.800	CECEP Solar Energy Co. Ltd. ....	55.997	0,01
161.200	CECEP Wind-Power Corp. ....	66.018	0,01
111.600	Central China Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	52.125	0,01
372.000	Central China Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	48.124	0,01
24.800	CETC Cyberspace Security Technology Co. Ltd. ....	48.337	0,01
248.000	CGN Power Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	157.275	0,03
2.852.000	CGN Power Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	1.256.613	0,23
12.400	Changchun High-Tech Industry Group Co. Ltd. ....	155.865	0,03
136.400	Changjiang Securities Co. Ltd. ....	90.238	0,02
37.200	Chaozhou Three-Circle Group Co. Ltd. ....	148.732	0,03

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
24.800	Chengxin Lithium Group Co. Ltd. ....	45.586	0,01
62.000	China Baoan Group Co. Ltd. ....	73.033	0,01
806.000	China Bohai Bank Co. Ltd. ....	98.074	0,02
2.232.000	China Cinda Asset Management Co. Ltd. ....	185.824	0,03
446.400	China CITIC Bank Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	409.662	0,08
2.356.000	China CITIC Bank Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	1.511.843	0,28
3.596.000	China CITIC Financial Asset Management Co. Ltd. ....	161.206	0,03
111.600	China Coal Energy Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	190.768	0,04
496.000	China Coal Energy Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	579.389	0,11
496.000	China Communications Services Corp. Ltd. ....	267.459	0,05
135.207	China Construction Bank Corp. Anteilsklasse A .....	137.043	0,03
24.056.000	China Construction Bank Corp. Anteilsklasse H .....	17.778.405	3,32
74.400	China CSSC Holdings Ltd. ....	414.859	0,08
322.400	China Eastern Airlines Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	177.079	0,03
496.000	China Eastern Airlines Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	124.518	0,02
620.000	China Energy Engineering Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	180.034	0,03
1.240.000	China Energy Engineering Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	136.588	0,03
868.000	China Everbright Bank Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	376.882	0,07
868.000	China Everbright Bank Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	270.159	0,05
136.400	China Galaxy Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	202.895	0,04
992.000	China Galaxy Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	519.671	0,10
62.000	China Great Wall Securities Co. Ltd. ....	56.897	0,01
62.000	China Greatwall Technology Group Co. Ltd. ....	74.306	0,01
37.200	China Green Electricity Investment of Tianjin Co. Ltd. ....	48.558	0,01
24.800	China International Capital Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	100.581	0,02
396.800	China International Capital Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	441.657	0,08
49.600	China International Marine Containers Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	62.910	0,01
186.000	China International Marine Containers Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	167.718	0,03
74.400	China Jushi Co. Ltd. ....	112.606	0,02
1.860.000	China Life Insurance Co. Ltd. ....	2.630.120	0,49
868.000	China Longyuan Power Group Corp. Ltd. ....	780.460	0,15
24.800	China Meheco Co. Ltd. ....	34.376	0,01
372.000	China Merchants Bank Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	1.742.082	0,33
992.000	China Merchants Bank Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	4.504.240	0,84
161.200	China Merchants Energy Shipping Co. Ltd. ....	186.573	0,03
97.062	China Merchants Expressway Network & Technology Holdings Co. Ltd. ....	157.674	0,03
24.800	China Merchants Property Operation & Service Co. Ltd. ....	34.037	0,01
136.400	China Merchants Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	259.877	0,05
124.000	China Merchants Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	97.994	0,02
173.600	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co. Ltd. ....	209.009	0,04
632.400	China Minsheng Banking Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	328.290	0,06
1.674.000	China Minsheng Banking Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	578.912	0,11
12.400	China National Accord Medicines Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	54.740	0,01
24.800	China National Accord Medicines Corp. Ltd. Anteilsklasse B .....	46.408	0,01
1.240.000	China National Building Material Co. Ltd. ....	444.706	0,08
124.000	China National Chemical Engineering Co. Ltd. ....	139.951	0,03
310.000	China National Nuclear Power Co. Ltd. ....	452.632	0,08
12.400	China National Software & Service Co. Ltd. ....	50.817	0,01
74.400	China Nonferrous Metal Industry's Foreign Engineering & Construction Co. Ltd. ....	51.768	0,01
62.000	China Northern Rare Earth Group High-Tech Co. Ltd. ....	146.065	0,03
49.600	China Oilfield Services Ltd. Anteilsklasse A .....	116.852	0,02
496.000	China Oilfield Services Ltd. Anteilsklasse H .....	476.471	0,09
124.000	China Pacific Insurance Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	473.183	0,09
669.600	China Pacific Insurance Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	1.634.677	0,31
756.400	China Petroleum & Chemical Corp. Anteilsklasse A .....	654.780	0,12
6.292.000	China Petroleum & Chemical Corp. Anteilsklasse H .....	4.077.865	0,76

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
372.000	China Railway Group Ltd. Anteilsklasse A .....	332.213	0,06
992.000	China Railway Group Ltd. Anteilsklasse H .....	547.624	0,10
130.572	China Railway Signal & Communication Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	107.307	0,02
496.000	China Railway Signal & Communication Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	213.459	0,04
24.800	China Rare Earth Resources & Technology Co. Ltd. ....	86.111	0,02
2.232.000	China Reinsurance Group Corp. ....	162.953	0,03
12.400	China Resources Boya Bio-pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	56.048	0,01
24.800	China Resources Double Crane Pharmaceutical Co. Ltd. ....	66.511	0,01
32.360	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co. Ltd. ....	188.730	0,04
124.000	China Shenhua Energy Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	753.594	0,14
868.000	China Shenhua Energy Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	3.996.798	0,75
37.200	China South Publishing & Media Group Co. Ltd. ....	63.284	0,01
235.600	China Southern Airlines Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	190.072	0,04
496.000	China Southern Airlines Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	185.506	0,03
74.400	China Southern Power Grid Energy Efficiency&Clean Energy Co. Ltd. ....	44.839	0,01
768.800	China State Construction Engineering Corp. Ltd. ....	559.158	0,10
496.000	China Suntien Green Energy Corp. Ltd. ....	224.894	0,04
496.000	China Three Gorges Renewables Group Co. Ltd. ....	296.207	0,06
37.200	China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	318.405	0,06
24.800	China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	151.994	0,03
12.152.000	China Tower Corp. Ltd. ....	1.572.037	0,29
24.800	China TransInfo Technology Co. Ltd. ....	30.810	0,01
508.400	China United Network Communications Ltd. ....	327.288	0,06
173.600	China Vanke Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	164.782	0,03
582.800	China Vanke Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	347.109	0,06
99.200	China XD Electric Co. Ltd. ....	109.243	0,02
446.400	China Yangtze Power Co. Ltd. ....	1.768.272	0,33
12.400	China Zhenhua Group Science & Technology Co. Ltd. ....	70.536	0,01
186.000	China Zheshang Bank Co. Ltd. ....	70.315	0,01
24.800	Chinalin Securities Co. Ltd. ....	33.901	0,01
37.200	Chinese Universe Publishing & Media Group Co. Ltd. ....	75.614	0,01
12.400	Chongqing Brewery Co. Ltd. ....	103.095	0,02
161.200	Chongqing Changan Automobile Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	296.529	0,06
384.400	Chongqing Changan Automobile Co. Ltd. Anteilsklasse B .....	180.694	0,03
12.400	Chongqing Department Store Co. Ltd. ....	37.977	0,01
24.800	Chongqing Fuling Zhacai Group Co. Ltd. ....	41.612	0,01
99.200	Chongqing Rural Commercial Bank Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	68.209	0,01
620.000	Chongqing Rural Commercial Bank Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	304.147	0,06
49.600	Chongqing Zhifei Biological Products Co. Ltd. ....	190.428	0,04
86.800	Citic Pacific Special Steel Group Co. Ltd. ....	161.334	0,03
210.800	CITIC Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	526.361	0,10
434.000	CITIC Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	639.265	0,12
124.000	CMOC Group Ltd. Anteilsklasse A .....	144.367	0,03
1.116.000	CMOC Group Ltd. Anteilsklasse H .....	1.020.601	0,19
17.600	CNGR Advanced Material Co. Ltd. ....	74.707	0,01
136.400	CNOOC Energy Technology & Services Ltd. ....	76.973	0,01
74.400	CNPC Capital Co. Ltd. ....	56.252	0,01
79.540	Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. ....	1.961.359	0,37
186.000	COSCO SHIPPING Development Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	65.729	0,01
1.116.000	COSCO SHIPPING Development Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	161.524	0,03
86.800	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	185.588	0,03
248.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	322.094	0,06
235.600	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	499.866	0,09
744.000	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	1.301.719	0,24
409.200	CRRC Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	420.923	0,08
992.000	CRRC Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	640.377	0,12
86.800	CSC Financial Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	228.745	0,04

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
186.000	CSC Financial Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	137.938	0,03
334.800	CSG Holding Co. Ltd. ....	110.637	0,02
29.080	CSPC Innovation Pharmaceutical Co. Ltd. ....	100.494	0,02
37.200	CSSC Science & Technology Co. Ltd. ....	68.888	0,01
24.800	Daan Gene Co. Ltd. ....	16.984	0,00
285.200	Daqin Railway Co. Ltd. ....	279.698	0,05
744.000	Datang International Power Generation Co. Ltd. ....	159.141	0,03
74.400	DHC Software Co. Ltd. ....	46.061	0,01
12.400	Dian Diagnostics Group Co. Ltd. ....	20.381	0,00
24.800	Do-Fluoride New Materials Co. Ltd. ....	41.544	0,01
12.400	Dong-E-E-Jiao Co. Ltd. ....	106.322	0,02
49.600	Dongfang Electric Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	125.344	0,02
99.200	Dongfang Electric Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	158.061	0,03
545.600	Dongfeng Motor Group Co. Ltd. ....	155.838	0,03
12.400	Dongguan Yiheda Automation Co. Ltd. ....	33.391	0,01
74.400	Dongxing Securities Co. Ltd. ....	81.117	0,02
37.200	East Group Co. Ltd. ....	20.432	0,00
297.600	East Money Information Co. Ltd. ....	430.451	0,08
37.200	Eastern Air Logistics Co. Ltd. ....	103.689	0,02
12.400	Ecovacs Robotics Co. Ltd. ....	80.132	0,01
62.000	ENN Natural Gas Co. Ltd. ....	176.637	0,03
12.400	Eoptolink Technology, Inc. Ltd. ....	179.270	0,03
37.200	Eve Energy Co. Ltd. ....	203.404	0,04
74.400	Everbright Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	148.987	0,03
74.400	Everbright Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	47.075	0,01
206.956	Everdisplay Optronics Shanghai Co. Ltd. ....	56.127	0,01
86.800	Fangda Carbon New Material Co. Ltd. ....	51.242	0,01
62.000	FAW Jiefang Group Co. Ltd. ....	66.494	0,01
24.800	Fiberhome Telecommunication Technologies Co. Ltd. ....	54.010	0,01
74.400	Financial Street Holdings Co. Ltd. ....	23.948	0,00
99.200	First Capital Securities Co. Ltd. ....	69.160	0,01
24.800	Flat Glass Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	68.277	0,01
124.000	Flat Glass Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	182.647	0,03
272.800	Focus Media Information Technology Co. Ltd. ....	226.435	0,04
86.800	Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd. ....	409.815	0,08
173.600	Founder Securities Co. Ltd. ....	183.804	0,03
235.600	Foxconn Industrial Internet Co. Ltd. ....	884.204	0,17
24.800	Fujian Sunner Development Co. Ltd. ....	46.333	0,01
37.200	Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	244.065	0,05
148.800	Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	864.318	0,16
12.400	Gan & Lee Pharmaceuticals Co. Ltd. ....	78.671	0,01
28.400	Ganfeng Lithium Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	111.447	0,02
99.200	Ganfeng Lithium Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	193.384	0,04
136.400	GCL System Integration Technology Co. Ltd. ....	36.245	0,01
334.800	GD Power Development Co. Ltd. ....	274.687	0,05
111.600	GEM Co. Ltd. ....	97.371	0,02
173.600	Gemdale Corp. ....	80.845	0,02
111.600	GF Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	186.029	0,03
297.600	GF Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	246.621	0,05
49.600	Giant Network Group Co. Ltd. ....	64.133	0,01
12.400	GigaDevice Semiconductor, Inc. ....	162.404	0,03
12.400	Ginlong Technologies Co. Ltd. ....	70.723	0,01
37.200	Glarun Technology Co. Ltd. ....	69.602	0,01
74.400	GoerTek, Inc. ....	198.819	0,04
74.400	Goldwind Science & Technology Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	68.481	0,01
173.600	Goldwind Science & Technology Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	70.708	0,01
12.400	Goneo Group Co. Ltd. ....	130.983	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99.03 % (30 June 2023: 99.26 %) (continued)</b>		
	<b>Aktien: 99.03 % (30 June 2023: 99.26 %) (continued)</b>		
	<b>China: 43.56 % (30 June 2023: 42.38 %) (continued)</b>		
6.802	GoodWe Technologies Co. Ltd. ....	52.285	0,01
37.200	Gotion High-tech Co. Ltd. ....	97.575	0,02
86.800	Grandjoy Holdings Group Co. Ltd. ....	27.820	0,01
49.600	Great Wall Motor Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	171.881	0,03
558.000	Great Wall Motor Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	860.507	0,16
74.400	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai .....	399.675	0,07
359.600	Greenland Holdings Corp. Ltd. ....	66.494	0,01
62.000	GRG Banking Equipment Co. Ltd. ....	88.828	0,02
248.000	Guangdong Electric Power Development Co. Ltd. ....	66.706	0,01
24.800	Guangdong Golden Dragon Development, Inc. ....	25.476	0,00
24.800	Guangdong Haid Group Co. Ltd. ....	159.823	0,03
86.800	Guangdong HEC Technology Holding Co. Ltd. ....	83.699	0,02
24.800	Guangdong Xinbao Electrical Appliances Holdings Co. Ltd. ....	47.794	0,01
124.000	Guanghui Energy Co. Ltd. ....	113.795	0,02
496.000	Guangshen Railway Co. Ltd. ....	134.682	0,03
62.000	Guangxi Liugong Machinery Co. Ltd. ....	95.027	0,02
74.400	Guangzhou Automobile Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	78.875	0,01
744.000	Guangzhou Automobile Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	263.012	0,05
49.600	Guangzhou Baiyun International Airport Co. Ltd. ....	64.405	0,01
37.200	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	149.445	0,03
62.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	163.985	0,03
12.400	Guangzhou Great Power Energy & Technology Co. Ltd. ....	31.149	0,01
49.600	Guangzhou Haige Communications Group, Inc. Co. ....	70.383	0,01
12.400	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co. Ltd. ....	46.180	0,01
37.200	Guangzhou Tinci Materials Technology Co. Ltd. ....	89.473	0,02
12.400	Guangzhou Wondfo Biotech Co. Ltd. ....	41.442	0,01
62.000	Guangzhou Yuexiu Capital Holdings Group Co. Ltd. ....	42.121	0,01
49.600	Guangzhou Zhujiang Brewery Co. Ltd. ....	50.409	0,01
6.774	Guobo Electronics Co. Ltd. ....	65.542	0,01
24.800	Guolian Securities Co. Ltd. ....	32.746	0,01
99.200	Guosen Securities Co. Ltd. ....	118.075	0,02
49.600	Guosheng Financial Holding, Inc. ....	57.543	0,01
136.400	Guotai Junan Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	253.151	0,05
198.400	Guotai Junan Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	196.941	0,04
86.800	Guoyuan Securities Co. Ltd. ....	72.048	0,01
124.000	Haier Smart Home Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	482.015	0,09
595.200	Haier Smart Home Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	1.989.743	0,37
744.000	Hainan Airlines Holding Co. Ltd. ....	103.944	0,02
210.800	Hainan Airport Infrastructure Co. Ltd. ....	90.662	0,02
12.400	Haisco Pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	52.142	0,01
173.600	Haitong Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	203.540	0,04
892.800	Haitong Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	415.102	0,08
24.800	Hang Zhou Great Star Industrial Co. Ltd. ....	83.903	0,02
74.400	Hangzhou Binjiang Real Estate Group Co. Ltd. ....	73.984	0,01
12.400	Hangzhou Chang Chuan Technology Co. Ltd. ....	46.146	0,01
24.057	Hangzhou First Applied Material Co. Ltd. ....	48.438	0,01
12.400	Hangzhou Lion Microelectronics Co. Ltd. ....	39.302	0,01
12.400	Hangzhou Oxygen Plant Group Co. Ltd. ....	37.790	0,01
24.800	Hangzhou Robam Appliances Co. Ltd. ....	75.071	0,01
37.200	Hangzhou Silan Microelectronics Co. Ltd. ....	89.219	0,02
12.400	Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	82.544	0,02
37.200	Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	131.506	0,02
12.400	Han's Laser Technology Industry Group Co. Ltd. ....	35.327	0,01
24.800	Haohua Chemical Science & Technology Co. Ltd. ....	98.169	0,02
24.800	Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co. Ltd. ....	72.251	0,01
12.400	Hefei Meiya Optoelectronic Technology, Inc. ....	28.024	0,01
37.200	Heilongjiang Agriculture Co. Ltd. ....	63.640	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
49.600	Henan Shenhua Coal Industry & Electricity Power Co. Ltd. ....	137.437	0,03
49.600	Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd. ....	161.487	0,03
37.200	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co. Ltd. ....	63.538	0,01
62.000	Hengli Petrochemical Co. Ltd. ....	118.466	0,02
49.600	Hengtong Optic-electric Co. Ltd. ....	107.137	0,02
62.000	Hengyi Petrochemical Co. Ltd. ....	60.209	0,01
198.400	Hesteel Co. Ltd. ....	52.719	0,01
24.800	Hisense Home Appliances Group Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	109.515	0,02
124.000	Hisense Home Appliances Group Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	408.177	0,08
24.800	Hisense Visual Technology Co. Ltd. ....	84.038	0,02
12.400	Hithink RoyalFlush Information Network Co. Ltd. ....	176.127	0,03
86.800	HLA Group Corp. Ltd. ....	109.855	0,02
12.400	Hoshine Silicon Industry Co. Ltd. ....	79.334	0,01
12.400	Hoyuan Green Energy Co. Ltd. ....	29.026	0,01
136.400	Huadian Power International Corp. Ltd. Anteilsklasse A ....	129.658	0,02
496.000	Huadian Power International Corp. Ltd. Anteilsklasse H ....	300.494	0,06
37.200	Huadong Medicine Co. Ltd. ....	141.700	0,03
74.400	Huafon Chemical Co. Ltd. ....	73.067	0,01
24.800	Huagong Tech Co. Ltd. ....	101.668	0,02
49.600	Huaibei Mining Holdings Co. Ltd. ....	113.727	0,02
37.200	Hualan Biological Engineering, Inc. ....	80.455	0,02
136.400	Huaneng Lancang River Hydropower, Inc. ....	201.400	0,04
161.200	Huaneng Power International, Inc. Anteilsklasse A ....	212.406	0,04
992.000	Huaneng Power International, Inc. Anteilsklasse H ....	735.671	0,14
136.400	Huatai Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	231.479	0,04
347.200	Huatai Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	383.782	0,07
49.600	Huaxi Securities Co. Ltd. ....	44.771	0,01
285.200	Huaxia Bank Co. Ltd. ....	250.009	0,05
24.800	Huaxin Cement Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	46.707	0,01
74.400	Huaxin Cement Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	71.852	0,01
62.000	Huayu Automotive Systems Co. Ltd. ....	139.102	0,03
124.000	Hubei Biocause Pharmaceutical Co. Ltd. ....	29.723	0,01
173.600	Hubei Energy Group Co. Ltd. ....	142.906	0,03
12.400	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co. Ltd. ....	53.857	0,01
24.800	Hubei Xingfa Chemicals Group Co. Ltd. ....	64.812	0,01
12.400	Huizhou Desay Sv Automotive Co. Ltd. ....	147.916	0,03
37.200	Humanwell Healthcare Group Co. Ltd. ....	87.486	0,02
24.800	Hunan Gold Corp. Ltd. ....	61.483	0,01
124.000	Hunan Valin Steel Co. Ltd. ....	75.241	0,01
37.200	Hundsun Technologies, Inc. ....	89.983	0,02
36.456	Hygon Information Technology Co. Ltd. ....	351.135	0,07
24.800	IEIT Systems Co. Ltd. ....	123.544	0,02
37.200	Iflytek Co. Ltd. ....	218.843	0,04
3.080	Imeik Technology Development Co. Ltd. ....	72.604	0,01
1.413.600	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Anteilsklasse A ....	1.103.641	0,21
20.336.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Anteilsklasse H ....	12.085.847	2,26
384.400	Industrial Bank Co. Ltd. ....	927.718	0,17
173.600	Industrial Securities Co. Ltd. ....	120.317	0,02
12.400	Ingenic Semiconductor Co. Ltd. ....	94.161	0,02
756.400	Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co. Ltd. ....	145.046	0,03
62.000	Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp. Ltd. ....	179.185	0,03
148.800	Inner Mongolia ERDOS Resources Co. Ltd. ....	124.099	0,02
148.800	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co. Ltd. ....	75.207	0,01
111.600	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd. ....	394.987	0,07
272.800	Inner Mongolia Yitai Coal Co. Ltd. ....	489.949	0,09
62.000	Inner Mongolia Yuan Xing Energy Co. Ltd. ....	58.681	0,01
12.400	Intco Medical Technology Co. Ltd. ....	45.535	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
74.400	IRICO Display Devices Co. Ltd. ....	69.398	0,01
12.400	Isoftstone Information Technology Group Co. Ltd. ....	59.802	0,01
62.000	JA Solar Technology Co. Ltd. ....	95.112	0,02
12.400	Jafron Biomedical Co. Ltd. ....	46.214	0,01
24.800	Jason Furniture Hangzhou Co. Ltd. ....	109.685	0,02
37.200	JCET Group Co. Ltd. ....	161.572	0,03
86.800	Jiangsu Eastern Shenghong Co. Ltd. ....	94.756	0,02
49.600	Jiangsu Expressway Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	85.601	0,02
280.000	Jiangsu Expressway Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	298.742	0,06
62.000	Jiangsu Financial Leasing Co. Ltd. ....	42.885	0,01
24.800	Jiangsu Hengli Hydraulic Co. Ltd. ....	158.226	0,03
111.600	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co. Ltd. ....	587.895	0,11
24.800	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd. ....	156.935	0,03
24.800	Jiangsu Nhwa Pharmaceutical Co. Ltd. ....	80.642	0,02
18.450	Jiangsu Pacific Quartz Co. Ltd. ....	74.828	0,01
49.600	Jiangsu Phoenix Publishing & Media Corp. Ltd. ....	74.459	0,01
24.800	Jiangsu Yanghe Distillery Co. Ltd. ....	274.263	0,05
12.400	Jiangsu Yangnong Chemical Co. Ltd. ....	95.877	0,02
12.400	Jiangsu Yoke Technology Co. Ltd. ....	106.848	0,02
24.800	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co. Ltd. ....	127.722	0,02
74.400	Jiangsu Zhongtian Technology Co. Ltd. ....	161.521	0,03
49.600	Jiangxi Copper Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	160.876	0,03
248.000	Jiangxi Copper Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	494.895	0,09
37.200	Jiangxi Special Electric Motor Co. Ltd. ....	41.527	0,01
24.800	Jilin Aodong Pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	45.518	0,01
49.600	Jinduicheng Molybdenum Co. Ltd. ....	70.723	0,01
74.400	Jinke Smart Services Group Co. Ltd. ....	70.422	0,01
96.844	Jinko Solar Co. Ltd. ....	94.180	0,02
12.400	JiuGui Liquor Co. Ltd. ....	74.510	0,01
62.000	Jizhong Energy Resources Co. Ltd. ....	56.897	0,01
37.200	Joincare Pharmaceutical Group Industry Co. Ltd. ....	56.914	0,01
12.400	Joinn Laboratories China Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	22.538	0,00
79.352	Joinn Laboratories China Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	76.228	0,01
96.124	Jointown Pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	64.251	0,01
12.400	Jonjee Hi-Tech Industrial & Commercial Holding Co. Ltd. ....	38.537	0,01
49.600	Juneyao Airlines Co. Ltd. ....	74.663	0,01
186.000	J-Yuan Trust Co. Ltd. ....	69.041	0,01
24.800	Kaishan Group Co. Ltd. ....	34.308	0,01
37.200	Keda Industrial Group Co. Ltd. ....	42.953	0,01
37.200	Kingnet Network Co. Ltd. ....	48.660	0,01
49.600	Kuang-Chi Technologies Co. Ltd. ....	117.871	0,02
24.800	Kunlun Tech Co. Ltd. ....	109.515	0,02
22.650	Kweichow Moutai Co. Ltd. ....	4.552.399	0,85
12.400	Lao Feng Xiang Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	98.832	0,02
62.000	Lao Feng Xiang Co. Ltd. Anteilsklasse B ....	227.726	0,04
49.600	LB Group Co. Ltd. ....	126.160	0,02
161.200	Legend Holdings Corp. ....	121.405	0,02
99.200	Lens Technology Co. Ltd. ....	247.971	0,05
161.200	Leo Group Co. Ltd. ....	31.574	0,01
37.200	Lepu Medical Technology Beijing Co. Ltd. ....	75.614	0,01
12.400	Levima Advanced Materials Corp. ....	23.286	0,00
74.400	Leyard Optoelectronic Co. Ltd. ....	45.858	0,01
421.600	Liaoning Port Co. Ltd. ....	71.028	0,01
148.800	Lingyi iTech Guangdong Co. ....	145.114	0,03
12.400	Livzon Pharmaceutical Group, Inc. Anteilsklasse A ....	63.199	0,01
49.600	Livzon Pharmaceutical Group, Inc. Anteilsklasse H ....	163.271	0,03
124.000	LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. ....	238.120	0,04

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
24.800	Longshine Technology Group Co. Ltd. ....	28.907	0,01
6.774	Loongson Technology Corp. Ltd. ....	81.585	0,02
37.200	Luxi Chemical Group Co. Ltd. ....	59.055	0,01
136.400	Luxshare Precision Industry Co. Ltd. ....	734.419	0,14
24.800	Luzhou Laojiao Co. Ltd. ....	487.416	0,09
248.000	Maanshan Iron & Steel Co. Ltd. ....	35.894	0,01
37.200	Mango Excellent Media Co. Ltd. ....	106.492	0,02
12.400	Maxscend Microelectronics Co. Ltd. ....	132.036	0,02
62.000	Meihua Holdings Group Co. Ltd. ....	85.091	0,02
99.200	Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co. Ltd. ....	51.361	0,01
310.000	Metallurgical Corp. of China Ltd. Anteilsklasse A ....	131.629	0,02
868.000	Metallurgical Corp. of China Ltd. Anteilsklasse H ....	177.883	0,03
49.600	Ming Yang Smart Energy Group Ltd. ....	64.133	0,01
20.031	Montage Technology Co. Ltd. ....	156.827	0,03
99.200	Muyuan Foods Co. Ltd. ....	592.413	0,11
111.600	Nanjing Iron & Steel Co. Ltd. ....	76.124	0,01
24.880	Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co. Ltd. ....	40.485	0,01
62.000	Nanjing Securities Co. Ltd. ....	65.220	0,01
148.800	NARI Technology Co. Ltd. ....	508.714	0,10
32.860	National Silicon Industry Group Co. Ltd. ....	62.157	0,01
12.400	NAURA Technology Group Co. Ltd. ....	543.312	0,10
49.600	NavInfo Co. Ltd. ....	42.257	0,01
37.200	New China Life Insurance Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	153.012	0,03
198.400	New China Life Insurance Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	378.636	0,07
99.200	New Hope Liuhe Co. Ltd. ....	124.189	0,02
24.800	Newland Digital Technology Co. Ltd. ....	47.250	0,01
37.200	Ninestar Corp. ....	134.618	0,03
12.400	Ningbo Deye Technology Co. Ltd. ....	126.261	0,02
37.200	Ningbo Joyson Electronic Corp. ....	75.512	0,01
12.400	Ningbo Orient Wires & Cables Co. Ltd. ....	82.900	0,02
7.075	Ningbo Ronbay New Energy Technology Co. Ltd. ....	22.560	0,00
24.800	Ningbo Sanxing Medical Electric Co. Ltd. ....	118.890	0,02
49.600	Ningbo Shanshan Co. Ltd. ....	55.165	0,01
24.800	Ningbo Tuopu Group Co. Ltd. ....	182.106	0,03
173.600	Ningbo Zhoushan Port Co. Ltd. ....	80.845	0,02
62.000	Ningxia Baofeng Energy Group Co. Ltd. ....	147.169	0,03
446.400	Nongfu Spring Co. Ltd. ....	2.118.390	0,40
24.800	North Industries Group Red Arrow Co. Ltd. ....	49.832	0,01
62.000	Northeast Securities Co. Ltd. ....	47.386	0,01
124.000	Offshore Oil Engineering Co. Ltd. ....	100.377	0,02
74.400	OFILM Group Co. Ltd. ....	79.589	0,01
12.400	Oppein Home Group, Inc. ....	90.968	0,02
37.200	ORG Technology Co. Ltd. ....	21.196	0,00
121.864	Orient Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	126.857	0,02
248.000	Orient Securities Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	97.200	0,02
49.600	Oriental Energy Co. Ltd. ....	55.777	0,01
74.400	Oriental Pearl Group Co. Ltd. ....	61.959	0,01
74.400	Ourpalm Co. Ltd. ....	42.495	0,01
37.200	Ovctek China, Inc. ....	79.894	0,01
173.600	Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co. Ltd. ....	59.445	0,01
24.800	People.cn Co. Ltd. ....	67.903	0,01
210.800	People's Insurance Co. Group of China Ltd. Anteilsklasse A ....	148.698	0,03
2.108.000	People's Insurance Co. Group of China Ltd. Anteilsklasse H ....	723.601	0,14
24.800	Perfect World Co. Ltd. ....	25.816	0,00
446.400	PetroChina Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	631.002	0,12
5.456.000	PetroChina Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	5.520.711	1,03
24.800	Pharmaron Beijing Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	63.114	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
74.400	Pharmaron Beijing Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	80.524	0,02
1.736.000	PICC Property & Casualty Co. Ltd. ....	2.156.826	0,40
347.200	Ping An Bank Co. Ltd. ....	482.694	0,09
186.000	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Anteilsklasse A .....	1.053.707	0,20
1.612.000	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Anteilsklasse H .....	7.309.066	1,37
49.600	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co. Ltd. ....	76.090	0,01
3.203	Piotech, Inc. ....	52.694	0,01
223.200	Poly Developments & Holdings Group Co. Ltd. ....	267.809	0,05
49.600	Poly Property Services Co. Ltd. ....	183.600	0,03
409.200	Postal Savings Bank of China Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	284.165	0,05
2.728.000	Postal Savings Bank of China Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	1.600.307	0,30
334.800	Power Construction Corp. of China Ltd. ....	256.344	0,05
7.584	Pylon Technologies Co. Ltd. ....	41.250	0,01
13.493	Qi An Xin Technology Group, Inc. ....	43.653	0,01
24.800	Qingdao TGOOD Electric Co. Ltd. ....	68.345	0,01
99.200	Qinghai Salt Lake Industry Co. Ltd. ....	237.101	0,04
7.378	Raytron Technology Co. Ltd. ....	28.266	0,01
173.600	Red Star Macalline Group Corp. Ltd. ....	30.462	0,01
62.000	Remegen Co. Ltd. ....	194.559	0,04
186.000	Rongsheng Petrochemical Co. Ltd. ....	246.103	0,05
148.800	SAIC Motor Corp. Ltd. ....	282.483	0,05
62.000	Sailun Group Co. Ltd. ....	118.890	0,02
86.800	Sanan Optoelectronics Co. Ltd. ....	139.339	0,03
62.000	Sansteel Minguang Co. Ltd. Fujian .....	25.052	0,00
148.800	Sany Heavy Industry Co. Ltd. ....	336.290	0,06
66.216	Satellite Chemical Co. Ltd. ....	163.072	0,03
86.800	SDIC Capital Co. Ltd. ....	67.173	0,01
124.000	SDIC Power Holdings Co. Ltd. ....	309.794	0,06
161.200	Sealand Securities Co. Ltd. ....	64.252	0,01
49.600	Seazen Holdings Co. Ltd. ....	60.260	0,01
24.800	Seres Group Co. Ltd. ....	309.522	0,06
86.800	SF Holding Co. Ltd. ....	424.319	0,08
7.607	SG Micro Corp. ....	86.251	0,02
173.600	Shaanxi Coal Industry Co. Ltd. ....	612.760	0,11
74.400	Shaanxi Energy Investment Co. Ltd. ....	117.498	0,02
111.600	Shaanxi International Trust Co. Ltd. ....	42.036	0,01
74.400	Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co. Ltd. ....	101.498	0,02
285.200	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd. Anteilsklasse B .....	53.698	0,01
186.000	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd. Anteilsklasse H .....	40.977	0,01
24.800	Shandong Denghai Seeds Co. Ltd. ....	27.447	0,01
74.400	Shandong Gold Mining Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	279.018	0,05
155.000	Shandong Gold Mining Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	308.515	0,06
24.800	Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co. Ltd. ....	129.658	0,02
49.600	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co. Ltd. ....	180.985	0,03
24.800	Shandong Linglong Tyre Co. Ltd. ....	62.400	0,01
272.800	Shandong Nanshan Aluminum Co. Ltd. ....	142.363	0,03
12.400	Shandong Pharmaceutical Glass Co. Ltd. ....	43.038	0,01
49.600	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd. ....	94.773	0,02
545.600	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. ....	259.963	0,05
24.800	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co. Ltd. ....	57.169	0,01
29.840	Shanghai Baosight Software Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	130.504	0,02
193.560	Shanghai Baosight Software Co. Ltd. Anteilsklasse B .....	313.374	0,06
2.205	Shanghai BOCHU Electronic Technology Corp. Ltd. ....	55.738	0,01
161.200	Shanghai Construction Group Co. Ltd. ....	47.471	0,01
235.600	Shanghai Electric Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	119.400	0,02
744.000	Shanghai Electric Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	145.800	0,03
74.400	Shanghai Electric Power Co. Ltd. ....	100.785	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
49.600	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	150.413	0,03
124.000	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	209.965	0,04
86.800	Shanghai Huayi Group Co. Ltd. ....	35.241	0,01
49.600	Shanghai International Airport Co. Ltd. ....	219.098	0,04
198.400	Shanghai International Port Group Co. Ltd. ....	157.071	0,03
24.800	Shanghai Jinjiang International Hotels Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	78.060	0,01
62.000	Shanghai Jinjiang International Hotels Co. Ltd. Anteilsklasse B .....	83.638	0,02
74.400	Shanghai Jinqiao Export Processing Zone Development Co. Ltd. ....	66.067	0,01
13.051	Shanghai Junshi Biosciences Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	51.930	0,01
49.600	Shanghai Junshi Biosciences Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	74.329	0,01
37.200	Shanghai Lingang Holdings Corp. Ltd. ....	46.418	0,01
49.600	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co. Ltd. Anteilsklasse A ...	59.921	0,01
334.800	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co. Ltd. Anteilsklasse B ...	131.576	0,02
12.400	Shanghai M&G Stationery, Inc. ....	53.127	0,01
74.400	Shanghai Mechanical & Electrical Industry Co. Ltd. ....	63.389	0,01
12.400	Shanghai Moons' Electric Co. Ltd. ....	68.328	0,01
62.000	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	162.285	0,03
223.200	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	335.626	0,06
545.600	Shanghai Pudong Development Bank Co. Ltd. ....	615.036	0,11
49.600	Shanghai Putailai New Energy Technology Co. Ltd. ....	95.995	0,02
148.800	Shanghai RAAS Blood Products Co. Ltd. ....	159.381	0,03
49.600	Shanghai Rural Commercial Bank Co. Ltd. ....	45.654	0,01
74.400	Shanghai Tunnel Engineering Co. Ltd. ....	66.545	0,01
24.800	Shanghai Waigaoqiao Free Trade Zone Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	30.096	0,01
74.400	Shanghai Waigaoqiao Free Trade Zone Group Co. Ltd. Anteilsklasse B .....	54.684	0,01
74.400	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co. Ltd. ....	52.482	0,01
37.200	Shanghai Zhangjiang High-Tech Park Development Co. Ltd. ....	94.161	0,02
310.000	Shanghai Zhenhua Heavy Industries Co. Ltd. ....	60.760	0,01
37.200	Shanxi Coal International Energy Group Co. Ltd. ....	74.493	0,01
111.600	Shanxi Coking Coal Energy Group Co. Ltd. ....	157.598	0,03
62.000	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co. Ltd. ....	153.963	0,03
86.800	Shanxi Meijin Energy Co. Ltd. ....	56.592	0,01
111.600	Shanxi Securities Co. Ltd. ....	71.844	0,01
111.600	Shanxi Taigang Stainless Steel Co. Ltd. ....	51.666	0,01
24.800	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd. ....	716.331	0,13
12.400	Shede Spirits Co. Ltd. ....	96.250	0,02
86.800	Shenergy Co. Ltd. ....	104.980	0,02
49.600	Shenghe Resources Holding Co. Ltd. ....	58.562	0,01
49.600	Shengyi Technology Co. Ltd. ....	143.076	0,03
421.600	Shenwan Hongyuan Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	248.888	0,05
595.200	Shenwan Hongyuan Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	112.828	0,02
74.400	Shenzhen Airport Co. Ltd. ....	65.118	0,01
15.920	Shenzhen Capchem Technology Co. Ltd. ....	62.277	0,01
3.528	Shenzhen Dynanonic Co. Ltd. ....	13.627	0,00
148.800	Shenzhen Energy Group Co. Ltd. ....	148.783	0,03
24.800	Shenzhen Everwin Precision Technology Co. Ltd. ....	40.728	0,01
248.000	Shenzhen Expressway Corp. Ltd. ....	231.247	0,04
49.600	Shenzhen Gas Corp. Ltd. ....	45.382	0,01
12.400	Shenzhen Goodix Technology Co. Ltd. ....	116.767	0,02
49.600	Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd. ....	348.518	0,07
37.200	Shenzhen Kaifa Technology Co. Ltd. ....	77.041	0,01
15.040	Shenzhen Kangtai Biological Products Co. Ltd. ....	32.157	0,01
12.400	Shenzhen Kedali Industry Co. Ltd. ....	129.726	0,02
24.800	Shenzhen Kingdom Sci-Tech Co. Ltd. ....	33.731	0,01
24.800	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd. ....	988.182	0,18
124.000	Shenzhen MTC Co. Ltd. ....	81.695	0,02
173.600	Shenzhen Overseas Chinese Town Co. Ltd. ....	48.507	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
24.800	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co. Ltd. ....	90.459	0,02
12.400	Shenzhen SC New Energy Technology Corp. ....	91.732	0,02
24.800	Shenzhen SED Industry Co. Ltd. ....	50.885	0,01
24.800	Shenzhen Sunway Communication Co. Ltd. ....	66.511	0,01
21.431	Shenzhen Transsion Holdings Co. Ltd. ....	224.676	0,04
12.400	Shenzhen YUTO Packaging Technology Co. Ltd. ....	43.463	0,01
62.000	Shenzhen Zhongjin Lingnan Nonfemet Co. Ltd. ....	36.007	0,01
49.600	Shijiazhuang Changshan BeiMing Technology Co. Ltd. ....	43.548	0,01
37.200	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co. Ltd. ....	78.111	0,01
24.800	Siasun Robot & Automation Co. Ltd. ....	33.085	0,01
8.243	SICC Co. Ltd. ....	52.975	0,01
86.800	Sichuan Chuantou Energy Co. Ltd. ....	222.919	0,04
173.600	Sichuan Hebang Biotechnology Co. Ltd. ....	39.234	0,01
37.200	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co. Ltd. ....	154.540	0,03
24.800	Sichuan New Energy Power Co. Ltd. ....	36.584	0,01
131.660	Sichuan Road & Bridge Group Co. Ltd. ....	142.284	0,03
12.400	Sichuan Swellfun Co. Ltd. ....	63.912	0,01
24.800	Sichuan Yahua Industrial Group Co. Ltd. ....	30.300	0,01
12.400	Sieyuan Electric Co. Ltd. ....	113.625	0,02
74.400	Sinolink Securities Co. Ltd. ....	76.939	0,01
37.200	Sinoma International Engineering Co. ....	61.449	0,01
37.200	Sinoma Science & Technology Co. Ltd. ....	65.729	0,01
12.400	Sinomine Resource Group Co. Ltd. ....	45.518	0,01
372.000	Sinopec Engineering Group Co. Ltd. ....	257.294	0,05
744.000	Sinopec Oilfield Service Corp. ....	48.600	0,01
992.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co. Ltd. ....	139.765	0,03
297.600	Sinopharm Group Co. Ltd. ....	790.942	0,15
124.000	Sinotrans Ltd. Anteilsklasse A ....	95.622	0,02
496.000	Sinotrans Ltd. Anteilsklasse H ....	241.412	0,05
12.400	Skshu Paint Co. Ltd. ....	61.602	0,01
62.000	Songcheng Performance Development Co. Ltd. ....	68.192	0,01
111.600	SooChow Securities Co. Ltd. ....	90.187	0,02
148.800	Southwest Securities Co. Ltd. ....	72.965	0,01
12.400	Spring Airlines Co. Ltd. ....	95.673	0,02
3.500	StarPower Semiconductor Ltd. ....	41.281	0,01
37.200	STO Express Co. Ltd. ....	42.801	0,01
34.880	Sungrow Power Supply Co. Ltd. ....	296.350	0,06
12.400	Sunresin New Materials Co. Ltd. ....	70.927	0,01
37.200	Sunwoda Electronic Co. Ltd. ....	77.296	0,01
13.071	SUPCON Technology Co. Ltd. ....	67.496	0,01
24.800	Suzhou Anjie Technology Co. Ltd. ....	52.448	0,01
37.200	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co. Ltd. ....	105.473	0,02
86.800	Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co. Ltd. ....	36.024	0,01
5.200	Suzhou TFC Optical Communication Co. Ltd. ....	62.977	0,01
12.400	Taiji Computer Corp. Ltd. ....	38.300	0,01
62.000	Tangshan Jidong Cement Co. Ltd. ....	34.478	0,01
124.000	TangShan Port Group Co. Ltd. ....	79.826	0,01
37.200	Tasly Pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	64.099	0,01
91.520	TBEA Co. Ltd. ....	173.868	0,03
359.600	TCL Technology Group Corp. ....	212.780	0,04
74.050	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co. Ltd. ....	87.734	0,02
12.400	Thunder Software Technology Co. Ltd. ....	77.432	0,01
62.000	Tian Di Science & Technology Co. Ltd. ....	58.511	0,01
161.200	Tianfeng Securities Co. Ltd. ....	48.134	0,01
12.400	Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co. Ltd. ....	30.894	0,01
74.400	Tianjin Chase Sun Pharmaceutical Co. Ltd. ....	31.081	0,01
62.000	Tianma Microelectronics Co. Ltd. ....	61.823	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
24.800	Tianqi Lithium Corp. ....	101.600	0,02
24.800	Tianqi Lithium Corp. Anteilsklasse H ....	71.153	0,01
37.200	Tianshan Aluminum Group Co. Ltd. ....	41.323	0,01
37.200	TianShan Material Co. Ltd. ....	27.515	0,01
62.000	Tianshui Huatian Technology Co. Ltd. ....	69.211	0,01
49.600	Titan Wind Energy Suzhou Co. Ltd. ....	60.736	0,01
37.200	TongFu Microelectronics Co. Ltd. ....	114.084	0,02
49.600	Tongkun Group Co. Ltd. ....	108.428	0,02
272.800	Tongling Nonferrous Metals Group Co. Ltd. ....	134.890	0,03
86.800	Tongwei Co. Ltd. ....	227.199	0,04
12.400	Topchoice Medical Corp. ....	91.800	0,02
248.000	TravelSky Technology Ltd. ....	290.965	0,05
42.904	Trina Solar Co. Ltd. ....	99.432	0,02
12.400	Tsingtao Brewery Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	123.595	0,02
166.800	Tsingtao Brewery Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	1.113.082	0,21
14.399	Unigroup Guoxin Microelectronics Co. Ltd. ....	103.740	0,02
37.200	Unisplendour Corp. Ltd. ....	113.880	0,02
24.800	Universal Scientific Industrial Shanghai Co. Ltd. ....	54.520	0,01
24.800	Valiant Co. Ltd. ....	33.969	0,01
37.200	Walvax Biotechnology Co. Ltd. ....	57.984	0,01
37.200	Wanda Film Holding Co. Ltd. ....	61.602	0,01
74.400	Wangsu Science & Technology Co. Ltd. ....	80.506	0,02
62.000	Wanhua Chemical Group Co. Ltd. ....	686.676	0,13
59.800	Wanxiang Qianchao Co. Ltd. ....	36.531	0,01
124.000	Weichai Power Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	275.825	0,05
496.000	Weichai Power Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	949.130	0,18
24.800	Weifu High-Technology Group Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	55.301	0,01
49.600	Weifu High-Technology Group Co. Ltd. Anteilsklasse B ....	74.012	0,01
15.940	Weihai Guangwei Composites Co. Ltd. ....	54.212	0,01
124.000	Wens Foodstuffs Group Co. Ltd. ....	336.629	0,06
49.600	Western Mining Co. Ltd. ....	121.947	0,02
86.800	Western Securities Co. Ltd. ....	73.593	0,01
10.522	Western Superconducting Technologies Co. Ltd. ....	55.227	0,01
24.800	Will Semiconductor Co. Ltd. Shanghai ....	337.546	0,06
24.800	Wingtech Technology Co. Ltd. ....	95.961	0,02
37.200	Winning Health Technology Group Co. Ltd. ....	30.062	0,01
409.200	Wintime Energy Group Co. Ltd. ....	66.137	0,01
37.200	Wolong Electric Group Co. Ltd. ....	61.908	0,01
24.800	Wonders Information Co. Ltd. ....	16.135	0,00
124.000	Wuchan Zhongda Group Co. Ltd. ....	73.712	0,01
99.200	Wuhan Guide Infrared Co. Ltd. ....	80.030	0,01
74.400	Wuliangye Yibin Co. Ltd. ....	1.304.804	0,24
49.600	WUS Printed Circuit Kunshan Co. Ltd. ....	247.971	0,05
49.600	WuXi AppTec Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	266.246	0,05
86.800	WuXi AppTec Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	324.636	0,06
6.324	Wuxi Autowell Technology Co. Ltd. ....	36.216	0,01
223.200	XCMG Construction Machinery Co. Ltd. ....	218.588	0,04
62.000	Xiamen C & D, Inc. ....	75.835	0,01
74.400	Xiamen ITG Group Corp. Ltd. ....	73.067	0,01
24.800	Xiamen Tungsten Co. Ltd. ....	58.596	0,01
49.600	Xiangcai Co. Ltd. ....	40.491	0,01
12.400	Xinfengming Group Co. Ltd. ....	26.479	0,00
124.000	Xinhua Winshare Publishing & Media Co. Ltd. ....	154.377	0,03
13.624	Xinjiang Daqo New Energy Co. Ltd. ....	38.049	0,01
24.800	Xuji Electric Co. Ltd. ....	116.886	0,02
52.200	Yango Group Co. Ltd. ....	-	0,00
62.000	Yangtze Optical Fibre & Cable Joint Stock Co. Ltd. ....	61.544	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
12.400	Yangzhou Yangjie Electronic Technology Co. Ltd. ....	66.069	0,01
74.400	Yankuang Energy Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	231.632	0,04
725.400	Yankuang Energy Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	1.036.896	0,19
62.000	Yantai Changyu Pioneer Wine Co. Ltd. ....	74.727	0,01
24.800	Yantai Eddie Precision Machinery Co. Ltd. ....	47.658	0,01
24.800	Yantai Jereh Oilfield Services Group Co. Ltd. ....	119.162	0,02
24.800	Yealink Network Technology Corp. Ltd. ....	124.903	0,02
62.000	Yifan Pharmaceutical Co. Ltd. ....	104.963	0,02
17.704	Yifeng Pharmacy Chain Co. Ltd. ....	59.532	0,01
37.200	Yihai Kerry Arawana Holdings Co. Ltd. ....	139.356	0,03
49.600	Yintai Gold Co. Ltd. ....	110.670	0,02
12.400	Yixintang Pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	25.629	0,00
99.200	Yonghui Superstores Co. Ltd. ....	33.697	0,01
12.400	YongXing Special Materials Technology Co. Ltd. ....	60.770	0,01
74.400	Yonyou Network Technology Co. Ltd. ....	101.906	0,02
99.200	Youngor Fashion Co. Ltd. ....	96.743	0,02
62.000	YTO Express Group Co. Ltd. ....	132.902	0,02
24.800	Yuan Longping High-tech Agriculture Co. Ltd. ....	33.391	0,01
24.800	Yunda Holding Co. Ltd. ....	26.292	0,00
62.000	Yunnan Aluminium Co. Ltd. ....	114.729	0,02
24.800	Yunnan Baiyao Group Co. Ltd. ....	173.750	0,03
99.200	Yunnan Chihong Zinc&Germanium Co. Ltd. ....	72.557	0,01
49.600	Yunnan Copper Co. Ltd. ....	84.650	0,02
22.670	Yunnan Energy New Material Co. Ltd. ....	98.277	0,02
37.200	Yunnan Tin Co. Ltd. ....	78.926	0,01
37.200	Yunnan Yuntianhua Co. Ltd. ....	98.951	0,02
37.200	Yutong Bus Co. Ltd. ....	131.459	0,02
24.800	Zangge Mining Co. Ltd. ....	81.763	0,02
12.400	Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co. Ltd. ....	351.864	0,07
372.000	Zhaojin Mining Industry Co. Ltd. ....	624.177	0,12
148.800	Zhefu Holding Group Co. Ltd. ....	56.864	0,01
173.600	Zhejiang Century Huatong Group Co. Ltd. ....	81.559	0,02
111.600	Zhejiang China Commodities City Group Co. Ltd. ....	113.421	0,02
24.800	Zhejiang Chint Electrics Co. Ltd. ....	64.744	0,01
37.200	Zhejiang Crystal-Optech Co. Ltd. ....	86.518	0,02
49.600	Zhejiang Dahua Technology Co. Ltd. ....	105.031	0,02
12.400	Zhejiang Dingli Machinery Co. Ltd. ....	102.619	0,02
496.000	Zhejiang Expressway Co. Ltd. ....	334.800	0,06
37.200	Zhejiang Hailiang Co. Ltd. ....	40.660	0,01
7.812	Zhejiang HangKe Technology, Inc. Co. ....	18.672	0,00
62.000	Zhejiang Hisoar Pharmaceutical Co. Ltd. ....	43.395	0,01
49.600	Zhejiang Huace Film & Television Co. Ltd. ....	41.714	0,01
24.800	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co. Ltd. ....	57.917	0,01
42.540	Zhejiang Huayou Cobalt Co. Ltd. ....	128.945	0,02
24.800	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co. Ltd. ....	97.592	0,02
37.200	Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co. Ltd. ....	69.907	0,01
49.600	Zhejiang Juhua Co. Ltd. ....	163.933	0,03
173.600	Zhejiang Leapmotor Technology Co. Ltd. ....	595.906	0,11
62.000	Zhejiang Longsheng Group Co. Ltd. ....	72.948	0,01
12.400	Zhejiang Medicine Co. Ltd. ....	18.649	0,00
53.120	Zhejiang NHU Co. Ltd. ....	139.697	0,03
37.200	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co. Ltd. ....	97.218	0,02
12.400	Zhejiang Supor Co. Ltd. ....	85.091	0,02
37.200	Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Co. Ltd. ....	67.462	0,01
37.200	Zhejiang Weixing New Building Materials Co. Ltd. ....	78.569	0,01
12.400	Zhejiang Wolvo Bio-Pharmaceutical Co. Ltd. ....	34.342	0,01
24.800	Zhejiang Yongtai Technology Co. Ltd. ....	26.563	0,00

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 43,56 % (30. Juni 2023: 42,38 %) (Fortsetzung)</b>		
173.600	Zhejiang Zheneng Electric Power Co. Ltd. ....	169.062	0,03
24.800	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co. Ltd. ....	50.274	0,01
24.800	Zheshang Securities Co. Ltd. ....	36.414	0,01
198.400	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. ....	345.092	0,06
17.440	Zhongji Innolight Co. Ltd. ....	329.363	0,06
99.200	Zhongjin Gold Corp. Ltd. ....	201.094	0,04
49.600	Zhongtai Securities Co. Ltd. ....	38.520	0,01
62.000	Zhuhai Huafa Properties Co. Ltd. ....	55.199	0,01
12.152	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	82.191	0,02
136.400	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	538.095	0,10
12.400	Zhuzhou Hongda Electronics Corp. Ltd. ....	38.724	0,01
37.200	Zhuzhou Kibing Group Co. Ltd. ....	32.865	0,01
372.000	Zijin Mining Group Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	895.244	0,17
1.488.000	Zijin Mining Group Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	3.140.897	0,59
161.200	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	169.572	0,03
421.600	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	272.700	0,05
198.400	ZTE Corp. ....	439.116	0,08
74.400	ZTE Corp. Anteilsklasse A ....	285.031	0,05
		<b>233.102.986</b>	<b>43,56</b>
	<b>Hongkong: 2,80% (30 June 2023: 3,06%)</b>		
124.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd. ....	416.118	0,08
186.000	BYD Electronic International Co. Ltd. ....	929.118	0,17
868.000	China Everbright Environment Group Ltd. ....	435.812	0,08
248.000	China Everbright Ltd. ....	125.471	0,02
1.736.000	China Jinmao Holdings Group Ltd. ....	137.859	0,03
426.640	China Merchants Port Holdings Co. Ltd. ....	634.982	0,12
992.000	China Overseas Land & Investment Ltd. ....	1.720.378	0,32
1.116.000	China Power International Development Ltd. ....	578.912	0,11
434.000	China Resources Beer Holdings Co. Ltd. ....	1.459.192	0,27
434.000	China Resources Pharmaceutical Group Ltd. ....	321.856	0,06
496.000	China Resources Power Holdings Co. Ltd. ....	1.521.531	0,28
372.000	China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd. ....	380.224	0,07
620.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co. Ltd. ....	288.265	0,05
1.612.000	CITIC Ltd. ....	1.465.943	0,27
2.232.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd. ....	1.778.190	0,33
496.000	Far East Horizon Ltd. ....	322.730	0,06
558.000	Fosun International Ltd. ....	300.177	0,06
806.000	Guangdong Investment Ltd. ....	471.786	0,09
124.000	Hua Hong Semiconductor Ltd. ....	350.206	0,07
124.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd. ....	185.188	0,04
744.000	Shenzhen Investment Ltd. ....	88.624	0,02
496.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd. ....	203.294	0,04
186.000	Sinotruk Hong Kong Ltd. ....	483.618	0,09
620.000	Sun Art Retail Group Ltd. ....	118.324	0,02
372.000	Yuexiu Property Co. Ltd. ....	243.000	0,05
		<b>14.960.798</b>	<b>2,80</b>
	<b>Singapur: 0,27 % (30. Juni 2023: 0,19%)</b>		
657.200	Yangzijiang Financial Holding Ltd. ....	169.725	0,03
657.200	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd. ....	1.192.925	0,22
223.200	Yanlord Land Group Ltd. ....	72.465	0,02
		<b>1.435.115</b>	<b>0,27</b>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,03 % (30. Juni 2023: 99,26 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 0,57 % (30. Juni 2023: 1,08 %)</b>		
99.200	Yum China Holdings, Inc. ....	3.067.203	0,57
		<u>3.067.203</u>	<u>0,57</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>529.982.559</u>	<u>99,03</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>529.982.559</u>	<u>99,03</u>

Finanzderivate: (0,02) % (30. Juni 2023: (0,00) %)

Terminkontrakte: (0,02) % (30. Juni 2023: (0,00) %)\*

Nominalbetrag USD	Durchschnittli- cher Kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
5.363.973	460	233 MSCI China Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	(119.143)	(0,02)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten</b> ...	<u>(119.143)</u>	<u>(0,02)</u>
		<b>Summe Finanzderivate</b> .....	<u>(119.143)</u>	<u>(0,02)</u>
			<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlagenportfolio</b>	529.863.416	99,01
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	5.288.443	0,99
		<b>Nettovermögen</b>	<u>535.151.859</u>	<u>100,00</u>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
		An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....		99,00
		Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		1,00
		<b>Gesamtvermögen</b> .....		<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 543.246 USD.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 %</b>		
	<b>Aktien: 99,93 %</b>		
	<b>Australien: 1,97 %</b>		
94	AGL Energy Ltd. ....	680	0,01
68	ALS Ltd. ....	636	0,01
15	Altium Ltd. ....	682	0,01
540	Alumina Ltd. ....	611	0,01
29	Ampol Ltd. ....	626	0,01
337	ANZ Group Holdings Ltd. ....	6.356	0,08
144	APA Group ....	768	0,01
71	Aristocrat Leisure Ltd. ....	2.360	0,03
22	ASX Ltd. ....	882	0,01
183	Atlas Arteria Ltd. ....	625	0,01
262	Aurizon Holdings Ltd. ....	639	0,01
88	Bendigo & Adelaide Bank Ltd. ....	675	0,01
565	BHP Group Ltd. ....	16.105	0,21
50	BlueScope Steel Ltd. ....	682	0,01
156	Brambles Ltd. ....	1.514	0,02
41	CAR Group Ltd. ....	965	0,01
78	Charter Hall Group ....	582	0,01
345	Cleanaway Waste Management Ltd. ....	638	0,01
7	Cochlear Ltd. ....	1.553	0,02
146	Coles Group Ltd. ....	1.661	0,02
188	Commonwealth Bank of Australia ....	15.993	0,21
66	Computershare Ltd. ....	1.161	0,01
54	CSL Ltd. ....	10.646	0,14
142	Dexus ....	615	0,01
193	Endeavour Group Ltd. ....	651	0,01
246	Evolution Mining Ltd. ....	575	0,01
178	Fortescue Ltd. ....	2.545	0,03
209	Goodman Group ....	4.850	0,06
230	GPT Group ....	614	0,01
330	Incitec Pivot Ltd. ....	639	0,01
268	Insurance Australia Group Ltd. ....	1.278	0,02
17	JB Hi-Fi Ltd. ....	695	0,01
249	Lottery Corp. Ltd. ....	843	0,01
148	Lynas Rare Earths Ltd. ....	586	0,01
41	Macquarie Group Ltd. ....	5.605	0,07
309	Medibank Pvt Ltd. ....	770	0,01
19	Mineral Resources Ltd. ....	684	0,01
494	Mirvac Group ....	617	0,01
348	National Australia Bank Ltd. ....	8.420	0,11
74	NEXTDC Ltd. ....	871	0,01
126	Northern Star Resources Ltd. ....	1.094	0,01
55	Orica Ltd. ....	656	0,01
193	Origin Energy Ltd. ....	1.400	0,02
324	Pilbara Minerals Ltd. ....	664	0,01
8	Pro Medicus Ltd. ....	765	0,01
159	Qantas Airways Ltd. ....	621	0,01
168	QBE Insurance Group Ltd. ....	1.951	0,03
267	Qube Holdings Ltd. ....	651	0,01
20	Ramsay Health Care Ltd. ....	634	0,01
6	REA Group Ltd. ....	788	0,01
38	Reece Ltd. ....	639	0,01
42	Rio Tinto Ltd. ....	3.338	0,04
364	Santos Ltd. ....	1.862	0,02
583	Scentre Group ....	1.215	0,02
43	SEEK Ltd. ....	613	0,01
25	Seven Group Holdings Ltd. ....	629	0,01
54	Sonic Healthcare Ltd. ....	949	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Australien: 1,97 % (Fortsetzung)</b>		
508	South32 Ltd. ....	1.242	0,02
178	Steadfast Group Ltd. ....	735	0,01
268	Stockland ....	746	0,01
143	Suncorp Group Ltd. ....	1.663	0,02
454	Telstra Group Ltd. ....	1.098	0,01
347	Transurban Group ....	2.874	0,04
91	Treasury Wine Estates Ltd. ....	756	0,01
508	Vicinity Ltd. ....	628	0,01
31	Washington H Soul Pattinson & Co. Ltd. ....	680	0,01
127	Wesfarmers Ltd. ....	5.528	0,07
389	Westpac Banking Corp. ....	7.074	0,09
123	Whitehaven Coal Ltd. ....	628	0,01
18	WiseTech Global Ltd. ....	1.206	0,02
212	Woodside Energy Group Ltd. ....	3.994	0,05
137	Woolworths Group Ltd. ....	3.092	0,04
68	Worley Ltd. ....	680	0,01
		<u>148.991</u>	<u>1,97</u>
	<b>Österreich: 0,06 %</b>		
11	ANDRITZ AG ....	682	0,01
34	Erste Group Bank AG ....	1.612	0,02
16	OMV AG ....	697	0,01
9	Verbund AG ....	710	0,01
24	Voestalpine AG ....	649	0,01
		<u>4.350</u>	<u>0,06</u>
	<b>Belgien: 0,21 %</b>		
4	Ackermans & van Haaren NV ....	692	0,01
19	Ageas SA ....	869	0,01
98	Anheuser-Busch InBev SA ....	5.684	0,07
3	D'iereen Group ....	637	0,01
7	Elia Group SA ....	656	0,01
9	Groupe Bruxelles Lambert NV ....	643	0,01
27	KBC Group NV ....	1.907	0,02
3	Sofina SA ....	686	0,01
8	Syensqo SA ....	717	0,01
14	UCB SA ....	2.081	0,03
37	Umicore SA ....	556	0,01
24	Warehouses De Pauw CVA ....	651	0,01
		<u>15.779</u>	<u>0,21</u>
	<b>Bermuda: 0,15 %</b>		
160	Aegon Ltd. ....	989	0,01
40	Arch Capital Group Ltd. ....	4.035	0,05
8	Credicorp Ltd. ....	1.291	0,02
5	Everest Group Ltd. ....	1.905	0,02
200	Hongkong Land Holdings Ltd. ....	646	0,01
37	Liberty Global Ltd. Anteilsklasse A ....	645	0,01
36	Liberty Global Ltd. Anteilsklasse C ....	643	0,01
6	RenaissanceRe Holdings Ltd. ....	1.341	0,02
		<u>11.495</u>	<u>0,15</u>
	<b>Kanada: 2,52 %</b>		
56	Agnico Eagle Mines Ltd. ....	3.662	0,05
81	Alimentation Couche-Tard, Inc. ....	4.544	0,06
81	Bank of Montreal ....	6.797	0,09
137	Bank of Nova Scotia ....	6.266	0,08
197	Barrick Gold Corp. ....	3.285	0,04
34	BCE, Inc. ....	1.101	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Kanada: 2,52 % (Fortsetzung)</b>		
46	Brookfield Asset Management Ltd. ....	1.751	0,02
167	Brookfield Corp. ....	6.944	0,09
49	Cameco Corp. ....	2.410	0,03
105	Canadian Imperial Bank of Commerce ....	4.992	0,07
63	Canadian National Railway Co. ....	7.443	0,10
236	Canadian Natural Resources Ltd. ....	8.405	0,11
105	Canadian Pacific Kansas City Ltd. ....	8.267	0,11
146	Cenovus Energy, Inc. ....	2.869	0,04
23	CGI, Inc. ....	2.295	0,03
2	Constellation Software, Inc. ....	5.762	0,08
30	Dollarama, Inc. ....	2.739	0,04
238	Enbridge, Inc. ....	8.465	0,11
2	Fairfax Financial Holdings Ltd. ....	2.275	0,03
55	Fortis, Inc. ....	2.137	0,03
21	Franco-Nevada Corp. ....	2.489	0,03
6	George Weston Ltd. ....	863	0,01
31	Great-West Lifeco, Inc. ....	904	0,01
36	Hydro One Ltd. ....	1.048	0,01
18	Imperial Oil Ltd. ....	1.227	0,02
20	Intact Financial Corp. ....	3.333	0,05
16	Loblaw Cos. Ltd. ....	1.856	0,03
30	Magna International, Inc. ....	1.257	0,02
203	Manulife Financial Corp. ....	5.405	0,07
23	Metro, Inc. ....	1.274	0,02
38	National Bank of Canada ....	3.013	0,04
56	Nutrien Ltd. ....	2.850	0,04
62	Pembina Pipeline Corp. ....	2.300	0,03
61	Power Corp. of Canada ....	1.695	0,02
35	Restaurant Brands International, Inc. ....	2.466	0,03
158	Royal Bank of Canada ....	16.818	0,22
31	Saputo, Inc. ....	696	0,01
135	Shopify, Inc. ....	8.920	0,12
66	Sun Life Financial, Inc. ....	3.236	0,04
145	Suncor Energy, Inc. ....	5.526	0,07
116	TC Energy Corp. ....	4.396	0,06
51	Teck Resources Ltd. ....	2.444	0,03
55	TELUS Corp. ....	832	0,01
15	Thomson Reuters Corp. ....	2.528	0,03
198	Toronto-Dominion Bank ....	10.881	0,14
37	Tourmaline Oil Corp. ....	1.678	0,02
29	Waste Connections, Inc. ....	5.087	0,07
51	Wheaton Precious Metals Corp. ....	2.674	0,04
		<u>190.105</u>	<u>2,52</u>
	<b>Cayman-Inseln: 0,16 %</b>		
300	Budweiser Brewing Co. APAC Ltd. ....	353	0,00
400	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd. ....	433	0,01
500	CK Asset Holdings Ltd. ....	1.873	0,02
500	CK Hutchison Holdings Ltd. ....	2.395	0,03
400	ESR Group Ltd. ....	526	0,01
14	GLOBALFOUNDRIES, Inc. ....	708	0,01
357	NU Holdings Ltd. ....	4.602	0,06
400	Sands China Ltd. ....	834	0,01
1.000	WH Group Ltd. ....	658	0,01
		<u>12.382</u>	<u>0,16</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Curaçao: 0,10 %</b>		
160	Schlumberger NV .....	7.549	0,10
		<u>7.549</u>	<u>0,10</u>
	<b>Dänemark: 0,93 %</b>		
1	AP Moller - Maersk AS Anteilsklasse B .....	1.740	0,02
10	Carlsberg AS .....	1.201	0,02
14	Coloplast AS .....	1.683	0,02
74	Danske Bank AS .....	2.207	0,03
14	Demant AS .....	606	0,01
19	DSV AS .....	2.914	0,04
7	Genmab AS .....	1.756	0,02
343	Novo Nordisk AS .....	49.570	0,66
39	Novonesis (Novozymes) B .....	2.388	0,03
21	Orsted AS .....	1.118	0,02
9	Pandora AS .....	1.359	0,02
37	Tryg AS .....	809	0,01
113	Vestas Wind Systems AS .....	2.619	0,03
		<u>69.970</u>	<u>0,93</u>
	<b>Finnland: 0,26 %</b>		
16	Elisa OYJ .....	734	0,01
49	Fortum OYJ .....	717	0,01
37	Kesko OYJ .....	650	0,01
37	Kone OYJ .....	1.828	0,02
72	Metso OYJ .....	763	0,01
47	Neste OYJ .....	837	0,01
585	Nokia OYJ .....	2.231	0,03
373	Nordea Bank Abp .....	4.443	0,06
16	Orion OYJ .....	683	0,01
50	Sampo OYJ .....	2.149	0,03
66	Stora Enso OYJ .....	902	0,01
60	UPM-Kymmene OYJ .....	2.098	0,03
26	Valmet OYJ .....	744	0,01
54	Wartsila OYJ Abp .....	1.042	0,01
		<u>19.821</u>	<u>0,26</u>
	<b>Frankreich: 2,52 %</b>		
19	Accor SA .....	780	0,01
5	Aeroports de Paris SA .....	609	0,01
63	Air Liquide SA .....	10.890	0,14
39	Alstom SA .....	656	0,01
10	Amundi SA .....	646	0,01
7	Arkema SA .....	609	0,01
201	AXA SA .....	6.585	0,09
7	BioMerieux .....	666	0,01
112	BNP Paribas SA .....	7.146	0,09
106	Bolloré SE .....	623	0,01
20	Bouygues SA .....	642	0,01
34	Bureau Veritas SA .....	942	0,01
18	Capgemini SE .....	3.582	0,05
58	Carrefour SA .....	821	0,01
51	Cie de Saint-Gobain SA .....	3.969	0,05
79	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA .....	3.057	0,04
113	Credit Agricole SA .....	1.543	0,02
70	Danone SA .....	4.282	0,06
4	Dassault Aviation SA .....	727	0,01
75	Dassault Systemes SE .....	2.837	0,04
28	Edenred SE .....	1.183	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Frankreich: 2,52 % (Fortsetzung)</b>		
9	Eiffage SA .....	827	0,01
150	Engie SA .....	2.144	0,03
34	EssilorLuxottica SA .....	7.332	0,10
8	Eurazeo SE .....	637	0,01
7	Gecina SA .....	645	0,01
40	Getlink SE .....	662	0,01
4	Hermes International SCA .....	9.174	0,12
5	Ipsen SA .....	614	0,01
8	Kering SA .....	2.902	0,04
23	Klepierre SA .....	616	0,01
19	La Francaise des Jeux SAEM .....	648	0,01
28	Legrand SA .....	2.780	0,04
26	L'Oreal SA .....	11.426	0,15
28	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE .....	21.414	0,28
215	Orange SA .....	2.155	0,03
23	Pernod Ricard SA .....	3.123	0,04
26	Publicis Groupe SA .....	2.769	0,03
21	Renault SA .....	1.077	0,01
26	Rexel SA .....	673	0,01
38	Safran SA .....	8.039	0,10
123	Sanofi SA .....	11.856	0,16
4	Sartorius Stedim Biotech .....	657	0,01
60	Schneider Electric SE .....	14.424	0,19
24	SCOR SE .....	609	0,01
82	Societe Generale SA .....	1.926	0,02
10	Sodexo SA .....	900	0,01
7	Teleperformance SE .....	738	0,01
11	Thales SA .....	1.763	0,02
225	TotalEnergies SE .....	15.031	0,20
12	Unibail-Rodamco-Westfield .....	946	0,01
70	Veolia Environnement SA .....	2.095	0,03
56	Vinci SA .....	5.905	0,08
75	Vivendi SE .....	784	0,01
52	Worldline SA .....	564	0,01
		<b>190.650</b>	<b>2,52</b>
	<b>Deutschland: 2,12 %</b>		
19	adidas AG .....	4.541	0,06
44	Allianz SE .....	12.237	0,16
100	BASF SE .....	4.843	0,06
110	Bayer AG .....	3.110	0,04
33	Bayerische Motoren Werke AG .....	3.126	0,04
8	Bayerische Motoren Werke AG (Vorzugsaktien) .....	707	0,01
13	Bechtle AG .....	612	0,01
11	Beiersdorf AG .....	1.610	0,02
15	Brenntag SE .....	1.012	0,01
116	Commerzbank AG .....	1.764	0,02
12	Continental AG .....	680	0,01
21	Covestro AG .....	1.233	0,02
8	CTS Eventim AG & Co. KGaA .....	668	0,01
59	Daimler Truck Holding AG .....	2.350	0,03
22	Delivery Hero SE .....	522	0,01
219	Deutsche Bank AG .....	3.499	0,05
21	Deutsche Boerse AG .....	4.301	0,06
98	Deutsche Lufthansa AG .....	600	0,01
375	Deutsche Telekom AG .....	9.437	0,13
110	DHL Group .....	4.455	0,06

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Deutschland: 2,12 % (Fortsetzung)</b>		
249	E.ON SE .....	3.270	0,04
33	Evonik Industries AG .....	674	0,01
23	Fresenius Medical Care AG .....	882	0,01
46	Fresenius SE & Co. KGaA .....	1.375	0,02
14	FUCHS SE .....	640	0,01
19	GEA Group AG .....	792	0,01
7	Hannover Rueck SE .....	1.776	0,02
15	Heidelberg Materials AG .....	1.557	0,02
18	Henkel AG & Co. KGaA (Vorzugsaktien) .....	1.605	0,02
11	Henkel AG & Co. KGaA Anteilsklasse A .....	866	0,01
146	Infineon Technologies AG .....	5.368	0,07
15	KION Group AG .....	628	0,01
9	Knorr-Bremse AG .....	688	0,01
8	LEG Immobilien SE .....	654	0,01
94	Mercedes-Benz Group AG .....	6.505	0,09
15	Merck KGaA .....	2.488	0,03
6	MTU Aero Engines AG .....	1.536	0,02
15	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München .....	7.508	0,10
7	Nemetschek SE .....	689	0,01
13	Puma SE .....	597	0,01
1	Rational AG .....	833	0,01
5	Rheinmetall AG .....	2.549	0,03
80	RWE AG .....	2.739	0,04
123	SAP SE .....	24.984	0,33
3	Sartorius AG .....	704	0,01
9	Scout24 SE .....	687	0,01
83	Siemens AG .....	15.453	0,20
60	Siemens Energy AG .....	1.563	0,02
31	Siemens Healthineers AG .....	1.787	0,02
15	Symrise AG .....	1.838	0,02
5	Volkswagen AG .....	601	0,01
21	Volkswagen AG (Vorzugsaktien) .....	2.372	0,03
78	Vonovia SE .....	2.220	0,03
27	Zalando SE .....	633	0,01
		<u>160.368</u>	<u>2,12</u>
	<b>Guernsey: 0,01 %</b>		
13	Amdocs Ltd. ....	1.026	0,01
		<u>1.026</u>	<u>0,01</u>
	<b>Hongkong: 0,41 %</b>		
1.400	AIA Group Ltd. ....	9.504	0,13
400	Bank of East Asia Ltd. ....	508	0,01
500	BOC Hong Kong Holdings Ltd. ....	1.540	0,02
200	CLP Holdings Ltd. ....	1.617	0,02
1.000	Hang Lung Properties Ltd. ....	853	0,01
100	Hang Seng Bank Ltd. ....	1.286	0,02
1.000	Hong Kong & China Gas Co. Ltd. ....	761	0,01
200	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd. ....	6.409	0,08
2.000	Lenovo Group Ltd. ....	2.823	0,04
300	Link REIT .....	1.166	0,01
159	Sun Hung Kai Properties Ltd. ....	1.376	0,02
250	Techtronic Industries Co. Ltd. ....	2.856	0,04
		<u>30.699</u>	<u>0,41</u>
	<b>Irland: 1,62 %</b>		
70	Accenture PLC .....	21.239	0,28
161	AIB Group PLC .....	852	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Irland: 1,62 % (Fortsetzung)</b>		
10	Allergion PLC .....	1.181	0,01
22	Aon PLC .....	6.459	0,08
116	Bank of Ireland Group PLC .....	1.214	0,02
77	CRH PLC .....	5.739	0,08
11	DCC PLC .....	770	0,01
45	Eaton Corp. PLC .....	14.110	0,19
20	Flutter Entertainment PLC .....	3.657	0,05
32	Glanbia PLC .....	624	0,01
9	ICON PLC .....	2.821	0,04
49	James Hardie Industries PLC .....	1.548	0,02
76	Johnson Controls International PLC .....	5.052	0,07
17	Kerry Group PLC .....	1.378	0,02
17	Kingspan Group PLC .....	1.448	0,02
54	Linde PLC .....	23.696	0,31
149	Medtronic PLC .....	11.728	0,15
18	Pentair PLC .....	1.380	0,02
22	Seagate Technology Holdings PLC .....	2.272	0,03
29	Smurfit Kappa Group PLC .....	1.294	0,02
11	STERIS PLC .....	2.415	0,03
25	Trane Technologies PLC .....	8.223	0,11
11	Willis Towers Watson PLC .....	2.884	0,04
		<u>121.984</u>	<u>1,62</u>
	<b>Isle of Man: 0,01 %</b>		
73	Entain PLC .....	581	0,01
		<u>581</u>	<u>0,01</u>
	<b>Israel: 0,17 %</b>		
10	Azrieli Group Ltd. ....	587	0,01
150	Bank Hapoalim BM .....	1.326	0,02
170	Bank Leumi Le-Israel BM .....	1.385	0,02
6	Camtek Ltd. ....	745	0,01
9	Check Point Software Technologies Ltd. ....	1.485	0,02
4	Elbit Systems Ltd. ....	699	0,01
143	ICL Group Ltd. ....	619	0,01
139	Israel Discount Bank Ltd. ....	693	0,01
19	Mizrahi Tefahot Bank Ltd. ....	644	0,01
7	Nice Ltd. ....	1.145	0,01
3	Nova Ltd. ....	704	0,01
126	Teva Pharmaceutical Industries Ltd. ....	2.073	0,02
18	Tower Semiconductor Ltd. ....	694	0,01
		<u>12.799</u>	<u>0,17</u>
	<b>Italien: 0,58 %</b>		
315	A2A SpA .....	628	0,01
19	Amplifon SpA .....	677	0,01
140	Assicurazioni Generali SpA .....	3.495	0,05
154	Banco BPM SpA .....	993	0,01
7	Brunello Cucinelli SpA .....	701	0,01
16	Buzzi SpA .....	644	0,01
871	Enel SpA .....	6.062	0,08
253	Eni SpA .....	3.892	0,05
69	FinecoBank Banca Fineco SpA .....	1.029	0,01
62	Infrastrutture Wireless Italiane SpA .....	648	0,01
14	Interpump Group SpA .....	622	0,01
1.808	Intesa Sanpaolo SpA .....	6.726	0,09
45	Leonardo SpA .....	1.046	0,01
61	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA .....	895	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Italien: 0,58 % (Fortsetzung)</b>		
23	Moncler SpA .....	1.407	0,02
101	Nexi SpA .....	616	0,01
51	Poste Italiane SpA .....	650	0,01
100	PRADA SpA .....	748	0,01
31	Prysmian SpA .....	1.921	0,02
13	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA .....	679	0,01
5	Reply SpA .....	738	0,01
255	Snam SpA .....	1.129	0,01
158	Terna - Rete Elettrica Nazionale .....	1.222	0,02
183	UniCredit SpA .....	6.787	0,09
		<b>43.955</b>	<b>0,58</b>
	<b>Japan: 6,50 %</b>		
100	Advantest Corp. ....	3.994	0,05
100	Aeon Co. Ltd. ....	2.138	0,03
100	Ajinomoto Co., Inc. ....	3.507	0,05
100	Amada Co. Ltd. ....	1.105	0,01
100	Asahi Group Holdings Ltd. ....	3.528	0,05
100	Asahi Kasei Corp. ....	641	0,01
200	Astellas Pharma, Inc. ....	1.977	0,03
100	Bandai Namco Holdings, Inc. ....	1.952	0,03
100	Bridgestone Corp. ....	3.930	0,05
100	Canon, Inc. ....	2.707	0,04
100	Capcom Co. Ltd. ....	1.886	0,02
100	Central Japan Railway Co. ....	2.159	0,03
100	Chiba Bank Ltd. ....	890	0,01
100	Chubu Electric Power Co., Inc. ....	1.182	0,02
100	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd. ....	3.553	0,05
200	Concordia Financial Group Ltd. ....	1.176	0,02
100	CyberAgent, Inc. ....	626	0,01
100	Dai-ichi Life Holdings, Inc. ....	2.672	0,04
200	Daiichi Sankyo Co. Ltd. ....	6.868	0,09
30	Daikin Industries Ltd. ....	4.172	0,06
12	Daito Trust Construction Co. Ltd. ....	1.237	0,02
100	Daiwa House Industry Co. Ltd. ....	2.535	0,03
200	Daiwa Securities Group, Inc. ....	1.526	0,02
200	Denso Corp. ....	3.106	0,04
10	Disco Corp. ....	3.795	0,05
100	East Japan Railway Co. ....	1.656	0,02
300	ENEOS Holdings, Inc. ....	1.542	0,02
100	FANUC Corp. ....	2.741	0,04
17	Fast Retailing Co. Ltd. ....	4.286	0,06
100	FUJIFILM Holdings Corp. ....	2.339	0,03
200	Fujitsu Ltd. ....	3.129	0,04
1	GLP J-Reit .....	816	0,01
200	Hachijuni Bank Ltd. ....	1.305	0,02
100	Haseko Corp. ....	1.105	0,01
500	Hitachi Ltd. ....	11.193	0,15
600	Honda Motor Co. Ltd. ....	6.416	0,08
40	Hoya Corp. ....	4.651	0,06
100	Hulic Co. Ltd. ....	886	0,01
100	Idemitsu Kosan Co. Ltd. ....	647	0,01
100	Inpex Corp. ....	1.471	0,02
2	Invincible Investment Corp. ....	811	0,01
100	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd. ....	1.877	0,02
100	Isuzu Motors Ltd. ....	1.325	0,02
200	ITOCHU Corp. ....	9.765	0,13

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Japan: 6,50 % (Fortsetzung)</b>		
100	J Front Retailing Co. Ltd. ....	1.043	0,01
100	Japan Exchange Group, Inc. ....	2.332	0,03
2	Japan Metropolitan Fund Invest .....	1.125	0,01
200	Japan Post Bank Co. Ltd. ....	1.889	0,03
200	Japan Post Holdings Co. Ltd. ....	1.983	0,03
200	Japan Tobacco, Inc. ....	5.406	0,07
100	JFE Holdings, Inc. ....	1.439	0,02
100	Kajima Corp. ....	1.729	0,02
100	Kansai Electric Power Co., Inc. ....	1.680	0,02
100	Kansai Paint Co. Ltd. ....	1.610	0,02
100	Kao Corp. ....	4.056	0,05
100	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd. ....	1.455	0,02
200	KDDI Corp. ....	5.289	0,07
22	Keyence Corp. ....	9.649	0,13
100	Kikkoman Corp. ....	1.158	0,02
100	Kirin Holdings Co. Ltd. ....	1.289	0,02
100	Kobe Steel Ltd. ....	1.241	0,02
100	Koito Manufacturing Co. Ltd. ....	1.379	0,02
100	Komatsu Ltd. ....	2.904	0,04
200	Konica Minolta, Inc. ....	554	0,01
100	Kubota Corp. ....	1.399	0,02
100	Kuraray Co. Ltd. ....	1.150	0,02
200	Kyocera Corp. ....	2.302	0,03
100	Kyowa Kirin Co. Ltd. ....	1.708	0,02
100	Kyushu Electric Power Co., Inc. ....	1.030	0,01
100	Lixil Corp. ....	1.053	0,01
300	LY Corp. ....	725	0,01
100	M3, Inc. ....	953	0,01
200	Marubeni Corp. ....	3.700	0,05
100	Mazda Motor Corp. ....	967	0,01
200	Mebuki Financial Group, Inc. ....	779	0,01
100	MEIJI Holdings Co. Ltd. ....	2.157	0,03
100	Minebea Mitsumi, Inc. ....	2.048	0,03
100	MISUMI Group, Inc. ....	1.710	0,02
200	Mitsubishi Chemical Group Corp. ....	1.110	0,01
400	Mitsubishi Corp. ....	7.828	0,10
200	Mitsubishi Electric Corp. ....	3.192	0,04
100	Mitsubishi Estate Co. Ltd. ....	1.567	0,02
100	Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc. ....	1.907	0,03
100	Mitsubishi HC Capital, Inc. ....	660	0,01
300	Mitsubishi Heavy Industries Ltd. ....	3.213	0,04
1.200	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. ....	12.898	0,17
200	Mitsui & Co. Ltd. ....	4.539	0,06
300	Mitsui Fudosan Co. Ltd. ....	2.739	0,04
100	Mitsui OSK Lines Ltd. ....	2.995	0,04
300	Mizuho Financial Group, Inc. ....	6.263	0,08
200	MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. ....	4.445	0,06
200	Murata Manufacturing Co. Ltd. ....	4.130	0,05
100	Nexon Co. Ltd. ....	1.849	0,02
100	NGK Insulators Ltd. ....	1.281	0,02
100	NIDEC Corp. ....	4.467	0,06
300	Nikon Corp. ....	3.032	0,04
100	Nintendo Co. Ltd. ....	5.319	0,07
100	Nippon Paint Holdings Co. Ltd. ....	652	0,01
100	Nippon Steel Corp. ....	2.114	0,03
3.100	Nippon Telegraph & Telephone Corp. ....	2.925	0,04
100	Nippon Yusen KK ....	2.911	0,04

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Japan: 6,50 % (Fortsetzung)</b>		
200	Nissan Motor Co. Ltd. ....	679	0,01
100	Nisshin Seifun Group, Inc. ....	1.150	0,02
300	Nomura Holdings, Inc. ....	1.720	0,02
1	Nomura Real Estate Master Fund, Inc. ....	887	0,01
100	Nomura Research Institute Ltd. ....	2.811	0,04
100	NTT Data Group Corp. ....	1.468	0,02
100	Obayashi Corp. ....	1.189	0,02
100	Odakyu Electric Railway Co. Ltd. ....	967	0,01
200	Oji Holdings Corp. ....	789	0,01
100	Olympus Corp. ....	1.612	0,02
100	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. ....	1.365	0,02
100	Oriental Land Co. Ltd. ....	2.786	0,04
200	ORIX Corp. ....	4.416	0,06
100	Osaka Gas Co. Ltd. ....	2.203	0,03
100	Otsuka Corp. ....	1.922	0,03
100	Otsuka Holdings Co. Ltd. ....	4.209	0,06
100	Pan Pacific International Holdings Corp. ....	2.340	0,03
200	Panasonic Holdings Corp. ....	1.637	0,02
200	Rakuten Group, Inc. ....	1.032	0,01
200	Recruit Holdings Co. Ltd. ....	10.701	0,14
200	Renesas Electronics Corp. ....	3.741	0,05
300	Resona Holdings, Inc. ....	1.985	0,03
100	Ricoh Co. Ltd. ....	855	0,01
100	Rohm Co. Ltd. ....	1.337	0,02
100	Ryohin Keikaku Co. Ltd. ....	1.662	0,02
100	Sanrio Co. Ltd. ....	1.839	0,02
100	Santen Pharmaceutical Co. Ltd. ....	1.022	0,01
100	SBI Holdings, Inc. ....	2.528	0,03
100	Seibu Holdings, Inc. ....	1.378	0,02
100	Seiko Epson Corp. ....	1.554	0,02
100	Sekisui Chemical Co. Ltd. ....	1.384	0,02
100	Sekisui House Ltd. ....	2.215	0,03
300	Seven & i Holdings Co. Ltd. ....	3.655	0,05
100	SG Holdings Co. Ltd. ....	922	0,01
100	Shimadzu Corp. ....	2.502	0,03
8	Shimano, Inc. ....	1.236	0,02
200	Shimizu Corp. ....	1.123	0,01
200	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. ....	7.756	0,10
100	Shizuoka Financial Group, Inc. ....	960	0,01
100	Skylark Holdings Co. Ltd. ....	1.330	0,02
6	SMC Corp. ....	2.847	0,04
300	SoftBank Corp. ....	3.664	0,05
100	SoftBank Group Corp. ....	6.459	0,09
100	Sompo Holdings, Inc. ....	2.135	0,03
100	Sony Group Corp. ....	8.479	0,11
100	Subaru Corp. ....	2.120	0,03
300	Sumitomo Chemical Co. Ltd. ....	643	0,01
100	Sumitomo Corp. ....	2.497	0,03
100	Sumitomo Electric Industries Ltd. ....	1.556	0,02
100	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. ....	6.667	0,09
100	Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc. ....	2.282	0,03
100	Sumitomo Realty & Development Co. Ltd. ....	2.935	0,04
200	Suzuki Motor Corp. ....	2.301	0,03
100	Systemex Corp. ....	1.611	0,02
100	T&D Holdings, Inc. ....	1.746	0,02
200	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. ....	5.187	0,07
50	TDK Corp. ....	3.066	0,04

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Japan: 6,50 % (Fortsetzung)</b>		
200	Terumo Corp. ....	3.299	0,04
100	TIS, Inc. ....	1.938	0,03
100	Tobu Railway Co. Ltd. ....	1.684	0,02
100	Tohoku Electric Power Co., Inc. ....	902	0,01
200	Tokio Marine Holdings, Inc. ....	7.466	0,10
200	Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc. ....	1.077	0,01
49	Tokyo Electron Ltd. ....	10.631	0,14
100	Tokyo Gas Co. Ltd. ....	2.148	0,03
100	Tokyo Tatemono Co. Ltd. ....	1.578	0,02
100	Tokyu Corp. ....	1.102	0,01
100	Tokyu Fudosan Holdings Corp. ....	667	0,01
100	TOPPAN Holdings, Inc. ....	2.756	0,04
200	Toray Industries, Inc. ....	947	0,01
100	Tosoh Corp. ....	1.304	0,02
18	Toyota Industries Corp. ....	1.518	0,02
1.300	Toyota Motor Corp. ....	26.588	0,35
100	Unicharm Corp. ....	3.212	0,04
200	USS Co. Ltd. ....	1.683	0,02
100	West Japan Railway Co. ....	1.862	0,02
100	Yamaha Motor Co. Ltd. ....	926	0,01
100	Yamato Holdings Co. Ltd. ....	1.099	0,01
		<u>491.199</u>	<u>6,50</u>
	<b>Jersey: 0,29 %</b>		
161	Amcor PLC ....	1.601	0,02
31	Aptiv PLC ....	2.183	0,03
103	Experian PLC ....	4.799	0,06
23	Ferguson PLC ....	4.430	0,06
1.364	Glencore PLC ....	7.778	0,10
120	WPP PLC ....	1.099	0,02
		<u>21.890</u>	<u>0,29</u>
	<b>Liberia: 0,06 %</b>		
27	Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	4.305	0,06
		<u>4.305</u>	<u>0,06</u>
	<b>Luxembourg: 0,14 %</b>		
70	Allegro.eu SA ....	656	0,01
54	ArcelorMittal SA ....	1.237	0,01
105	B&M European Value Retail SA ....	580	0,01
14	Eurofins Scientific SE ....	699	0,01
37	InPost SA ....	653	0,01
300	Samsonite International SA ....	895	0,01
16	Spotify Technology SA ....	5.021	0,07
50	Tenaris SA ....	769	0,01
		<u>10.510</u>	<u>0,14</u>
	<b>Niederlande: 1,77 %</b>		
15	Aalberts NV ....	610	0,01
52	ABN AMRO Bank NV ....	855	0,01
3	Adyen NV ....	3.579	0,05
66	Airbus SE ....	9.073	0,12
19	Akzo Nobel NV ....	1.156	0,02
7	Argenx SE ....	3.065	0,04
5	ASM International NV ....	3.814	0,05
44	ASML Holding NV ....	45.469	0,60
17	ASR Nederland NV ....	811	0,01
9	BE Semiconductor Industries NV ....	1.506	0,02
98	CNH Industrial NV ....	993	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Niederlande: 1,77 % (Fortsetzung)</b>		
63	Davide Campari-Milano NV .....	596	0,01
9	Euronext NV .....	834	0,01
11	EXOR NV .....	1.152	0,01
13	Ferrari NV .....	5.304	0,07
59	Ferrovial SE .....	2.293	0,03
15	Heineken Holding NV .....	1.184	0,02
31	Heineken NV .....	3.000	0,04
6	IMCD NV .....	831	0,01
349	ING Groep NV .....	5.970	0,08
105	Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	3.105	0,04
424	Koninklijke KPN NV .....	1.627	0,02
89	Koninklijke Philips NV .....	2.250	0,03
29	LyondellBasell Industries NV .....	2.774	0,04
31	NN Group NV .....	1.444	0,02
29	NXP Semiconductors NV .....	7.804	0,10
163	Prosus NV .....	5.810	0,08
25	Qiagen NV .....	1.033	0,01
13	Randstad NV .....	590	0,01
25	Signify NV .....	624	0,01
232	Stellantis NV .....	4.593	0,06
73	STMicroelectronics NV .....	2.884	0,04
84	Universal Music Group NV .....	2.501	0,03
27	Wolters Kluwer NV .....	4.480	0,06
		<u>133.614</u>	<u>1,77</u>
	<b>Neuseeland: 0,11 %</b>		
140	a2 Milk Co. Ltd. ....	606	0,01
148	Auckland International Airport Ltd. ....	688	0,01
116	Contact Energy Ltd. ....	636	0,01
33	EBOS Group Ltd. ....	648	0,01
65	Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd. ....	1.191	0,01
97	Infratil Ltd. ....	662	0,01
16	Mainfreight Ltd. ....	659	0,01
166	Meridian Energy Ltd. ....	636	0,01
260	Spark New Zealand Ltd. ....	659	0,01
17	Xero Ltd. ....	1.549	0,02
		<u>7.934</u>	<u>0,11</u>
	<b>Norwegen: 0,16 %</b>		
34	Aker BP ASA .....	869	0,01
112	DNB Bank ASA .....	2.206	0,03
97	Equinor ASA .....	2.769	0,03
38	Gjensidige Forsikring ASA .....	681	0,01
8	Kongsberg Gruppen ASA .....	654	0,01
50	Mowi ASA .....	834	0,01
147	Norsk Hydro ASA .....	918	0,01
85	Orkla ASA .....	693	0,01
12	Salmar ASA .....	633	0,01
71	Telenor ASA .....	812	0,01
51	TOMRA Systems ASA .....	610	0,01
23	Yara International ASA .....	664	0,01
		<u>12.343</u>	<u>0,16</u>
	<b>Panama: 0,03 %</b>		
112	Carnival Corp. ....	2.097	0,03
		<u>2.097</u>	<u>0,03</u>
	<b>Polen: 0,08 %</b>		
18	Bank Polska Kasa Opieki SA .....	752	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Polen: 0,08 % (Fortsetzung)</b>		
7	Dino Polska SA .....	707	0,01
19	KGHM Polska Miedz SA .....	711	0,01
65	ORLEN SA .....	1.094	0,01
96	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA .....	1.503	0,02
63	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA .....	808	0,01
6	Santander Bank Polska SA .....	808	0,01
		<u>6.383</u>	<u>0,08</u>
	<b>Portugal: 0,04 %</b>		
337	EDP - Energias de Portugal SA .....	1.264	0,02
49	Galp Energia SGPS SA .....	1.036	0,01
31	Jeronimo Martins SGPS SA .....	606	0,01
		<u>2.906</u>	<u>0,04</u>
	<b>Singapur: 0,33 %</b>		
400	CapitaLand Ascendas REIT .....	756	0,01
600	CapitaLand Integrated Commercial Trust .....	877	0,01
400	CapitaLand Investment Ltd. ....	785	0,01
200	DBS Group Holdings Ltd. ....	5.282	0,07
47	Flex Ltd. ....	1.386	0,02
1.100	Genting Singapore Ltd. ....	702	0,01
200	Keppel Ltd. ....	955	0,01
300	Mapletree Industrial Trust .....	467	0,01
700	Mapletree Logistics Trust .....	666	0,01
400	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. ....	4.259	0,06
200	Sembcorp Industries Ltd. ....	710	0,01
200	Singapore Airlines Ltd. ....	1.018	0,01
100	Singapore Exchange Ltd. ....	700	0,01
300	Singapore Technologies Engineering Ltd. ....	958	0,01
800	Singapore Telecommunications Ltd. ....	1.623	0,02
100	United Overseas Bank Ltd. ....	2.312	0,03
100	Venture Corp. Ltd. ....	1.049	0,01
300	Wilmar International Ltd. ....	686	0,01
		<u>25.191</u>	<u>0,33</u>
	<b>Südkorea: 1,39 %</b>		
5	Alteogen, Inc. ....	1.019	0,01
6	Amorepacific Corp. ....	729	0,01
16	Celltrion, Inc. ....	2.026	0,03
4	CosmoAM&T Co. Ltd. ....	419	0,00
20	Coway Co. Ltd. ....	933	0,01
9	DB Insurance Co. Ltd. ....	749	0,01
47	Doosan Enerbility Co. Ltd. ....	686	0,01
5	Ecopro BM Co. Ltd. ....	665	0,01
11	Ecopro Co. Ltd. ....	720	0,01
29	Hana Financial Group, Inc. ....	1.279	0,02
20	Hankook Tire & Technology Co. Ltd. ....	657	0,01
6	Hanmi Semiconductor Co. Ltd. ....	751	0,01
5	Hanwha Aerospace Co. Ltd. ....	906	0,01
7	HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd. ....	808	0,01
16	HLB, Inc. ....	680	0,01
49	HMM Co. Ltd. ....	699	0,01
3	HYBE Co. Ltd. ....	441	0,00
6	Hyundai Glovis Co. Ltd. ....	955	0,01
8	Hyundai Mobis Co. Ltd. ....	1.462	0,02
15	Hyundai Motor Co. ....	3.215	0,04
5	Hyundai Motor Co. (Vorzugsaktien) .....	660	0,01
6	Hyundai Motor Co. (Zweite Vorzugsaktien) .....	799	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 1,39 % (Fortsetzung)</b>		
60	Industrial Bank of Korea .....	611	0,01
37	Kakao Corp. ....	1.093	0,01
40	KakaoBank Corp. ....	590	0,01
38	KB Financial Group, Inc. ....	2.167	0,03
28	Kia Corp. ....	2.630	0,03
15	Korea Aerospace Industries Ltd. ....	578	0,01
46	Korea Electric Power Corp. ....	654	0,01
2	Korea Zinc Co. Ltd. ....	748	0,01
41	Korean Air Lines Co. Ltd. ....	692	0,01
4	Krafton, Inc. ....	818	0,01
11	KT&G Corp. ....	705	0,01
5	L&F Co. Ltd. ....	491	0,01
5	LG Chem Ltd. ....	1.255	0,02
12	LG Corp. ....	703	0,01
100	LG Display Co. Ltd. ....	833	0,01
12	LG Electronics, Inc. ....	967	0,01
4	LG Energy Solution Ltd. ....	949	0,01
2	LG H&H Co. Ltd. ....	502	0,01
5	LG Innotek Co. Ltd. ....	988	0,01
12	Meritz Financial Group, Inc. ....	690	0,01
15	NAVER Corp. ....	1.819	0,02
4	POSCO Future M Co. Ltd. ....	751	0,01
8	POSCO Holdings, Inc. ....	2.110	0,03
2	Samsung Biologics Co. Ltd. ....	1.056	0,01
9	Samsung C&T Corp. ....	928	0,01
40	Samsung E&A Co. Ltd. ....	702	0,01
6	Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd. ....	689	0,01
538	Samsung Electronics Co. Ltd. ....	31.854	0,42
95	Samsung Electronics Co. Ltd. (Vorzugsaktien) .....	4.389	0,06
4	Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. ....	1.130	0,01
96	Samsung Heavy Industries Co. Ltd. ....	652	0,01
11	Samsung Life Insurance Co. Ltd. ....	707	0,01
6	Samsung SDI Co. Ltd. ....	1.543	0,02
6	Samsung SDS Co. Ltd. ....	647	0,01
56	Shinhan Financial Group Co. Ltd. ....	1.959	0,03
60	SK Hynix, Inc. ....	10.309	0,14
9	SK Innovation Co. Ltd. ....	759	0,01
10	SK Square Co. Ltd. ....	726	0,01
5	SK, Inc. ....	575	0,01
5	SKC Co. Ltd. ....	612	0,01
67	Woori Financial Group, Inc. ....	715	0,01
8	Yuhan Corp. ....	470	0,01
		<b>105.024</b>	<b>1,39</b>
	<b>Spanien: 0,66 %</b>		
25	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA .....	1.079	0,01
8	Aena SME SA .....	1.612	0,02
49	Amadeus IT Group SA .....	3.263	0,04
645	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA .....	6.465	0,08
589	Banco de Sabadell SA .....	1.137	0,01
1.743	Banco Santander SA .....	8.090	0,11
77	Bankinter SA .....	629	0,01
415	CaixaBank SA .....	2.198	0,03
63	Cellnex Telecom SA .....	2.051	0,03
43	EDP Renovaveis SA .....	601	0,01
42	Enagas SA .....	625	0,01
35	Endesa SA .....	658	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Spanien: 0,66 % (Fortsetzung)</b>		
656	Iberdrola SA .....	8.518	0,11
118	Industria de Diseno Textil SA .....	5.863	0,08
304	International Consolidated Airlines Group SA .....	623	0,01
56	Merlin Properties Socimi SA .....	624	0,01
25	Naturgy Energy Group SA .....	540	0,01
48	Redeia Corp. SA .....	840	0,01
136	Repsol SA .....	2.148	0,03
577	Telefonica SA .....	2.449	0,03
		<hr/>	<hr/>
		50.013	0,66
	<b>Schweden: 0,85 %</b>		
35	Alfa Laval AB .....	1.534	0,02
109	Assa Abloy AB .....	3.084	0,04
284	Atlas Copco AB Anteilsklasse A .....	5.342	0,07
169	Atlas Copco AB Anteilsklasse B .....	2.731	0,04
44	Beijer Ref AB .....	679	0,01
31	Boliden AB .....	993	0,01
53	Castellum AB .....	648	0,01
70	Epiroc AB Anteilsklasse A .....	1.398	0,02
42	Epiroc AB Anteilsklasse B .....	769	0,01
71	EQT AB .....	2.100	0,03
68	Essity AB .....	1.743	0,02
20	Evolution AB .....	2.085	0,03
100	Fastighets AB Balder .....	686	0,01
38	Gefinge AB .....	646	0,01
67	H & M Hennes & Mauritz AB .....	1.061	0,01
236	Hexagon AB .....	2.666	0,03
16	Holmen AB .....	630	0,01
19	Industrivarden AB Anteilsklasse A .....	647	0,01
19	Industrivarden AB Anteilsklasse C .....	641	0,01
30	Indutrade AB .....	769	0,01
24	Investment AB Latour .....	649	0,01
54	Investor AB Anteilsklasse A .....	1.467	0,02
189	Investor AB Anteilsklasse B .....	5.179	0,07
13	L E Lundbergforetagen AB .....	643	0,01
25	Lifco AB .....	687	0,01
163	Nibe Industrier AB .....	692	0,01
36	Saab AB .....	867	0,01
26	Sagax AB .....	666	0,01
121	Sandvik AB .....	2.427	0,03
64	Securitas AB .....	636	0,01
171	Skandinaviska Enskilda Banken AB .....	2.527	0,03
41	Skanska AB .....	739	0,01
38	SKF AB .....	763	0,01
118	SSAB AB .....	641	0,01
67	Svenska Cellulosa AB SCA .....	990	0,01
156	Svenska Handelsbanken AB .....	1.487	0,02
97	Swedbank AB .....	1.998	0,03
26	Swedish Orphan Biovitrum AB .....	696	0,01
67	Tele2 AB .....	675	0,01
311	Telefonaktiebolaget LM Ericsson .....	1.932	0,02
277	Telia Co. AB .....	744	0,01
24	Trelleborg AB .....	935	0,01
25	Volvo AB Anteilsklasse A .....	652	0,01
176	Volvo AB Anteilsklasse B .....	4.505	0,06
		<hr/>	<hr/>
		64.049	0,85

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweiz: 2,71 %</b>		
178	ABB Ltd. ....	9.888	0,13
18	Adecco Group AG ....	597	0,01
55	Alcon, Inc. ....	4.910	0,07
17	Avolta AG ....	660	0,01
5	Baloise Holding AG ....	880	0,01
8	Banque Cantonale Vaudoise ....	849	0,01
2	Belimo Holding AG ....	1.003	0,01
16	Bunge Global SA ....	1.708	0,02
45	Chubb Ltd. ....	11.479	0,15
60	Cie Financiere Richemont SA ....	9.365	0,12
42	Clariant AG ....	661	0,01
23	Coca-Cola HBC AG ....	784	0,01
19	DSM-Firmenich AG ....	2.150	0,03
1	EMS-Chemie Holding AG ....	820	0,01
4	Flughafen Zurich AG ....	885	0,01
17	Garmin Ltd. ....	2.770	0,04
4	Geberit AG ....	2.363	0,03
10	Georg Fischer AG ....	671	0,01
1	Givaudan SA ....	4.741	0,06
5	Helvetia Holding AG ....	676	0,01
63	Holcim AG ....	5.582	0,07
23	Julius Baer Group Ltd. ....	1.285	0,02
6	Kuehne & Nagel International AG ....	1.725	0,02
17	Logitech International SA ....	1.644	0,02
8	Lonza Group AG ....	4.366	0,06
294	Nestle SA ....	30.009	0,40
229	Novartis AG ....	24.508	0,33
2	Partners Group Holding AG ....	2.568	0,03
6	PSP Swiss Property AG ....	770	0,01
78	Roche Holding AG ....	21.657	0,29
4	Roche Holding AG (voting rights) ....	1.219	0,02
48	Sandoz Group AG ....	1.738	0,02
3	Schindler Holding AG ....	748	0,01
5	Schindler Holding AG (teilweise eingezahlt) ....	1.256	0,02
17	SGS SA ....	1.513	0,02
37	SIG Group AG ....	677	0,01
17	Sika AG ....	4.866	0,07
5	Sonova Holding AG ....	1.545	0,02
12	Straumann Holding AG ....	1.486	0,02
7	Swatch Group AG ....	1.434	0,02
3	Swiss Life Holding AG ....	2.205	0,03
9	Swiss Prime Site AG ....	853	0,01
33	Swiss Re AG ....	4.095	0,05
3	Swisscom AG ....	1.688	0,02
34	TE Connectivity Ltd. ....	5.115	0,07
2	Tecan Group AG ....	669	0,01
10	Temenos AG ....	690	0,01
360	UBS Group AG ....	10.596	0,14
3	VAT Group AG ....	1.701	0,02
16	Zurich Insurance Group AG ....	8.531	0,11
		<u>204.599</u>	<u>2,71</u>
	<b>Thailand: 0,01 %</b>		
1.800	Thai Beverage PCL ....	598	0,01
		<u>598</u>	<u>0,01</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 3,56 %</b>		
104	3i Group PLC ....	4.031	0,05

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 3,56 % (Fortsetzung)</b>		
33	Admiral Group PLC .....	1.091	0,01
140	Anglo American PLC .....	4.428	0,06
39	Antofagasta PLC .....	1.040	0,01
49	Ashtead Group PLC .....	3.272	0,04
36	Associated British Foods PLC .....	1.126	0,01
168	AstraZeneca PLC .....	26.240	0,35
100	Auto Trader Group PLC .....	1.013	0,01
303	Aviva PLC .....	1.826	0,02
341	BAE Systems PLC .....	5.690	0,08
1.683	Barclays PLC .....	4.444	0,06
109	Barratt Developments PLC .....	651	0,01
76	Beazley PLC .....	680	0,01
12	Berkeley Group Holdings PLC .....	696	0,01
1.895	BP PLC .....	11.383	0,15
224	British American Tobacco PLC .....	6.881	0,09
119	British Land Co. PLC .....	619	0,01
709	BT Group PLC .....	1.258	0,02
38	Bunzl PLC .....	1.446	0,02
51	Burberry Group PLC .....	566	0,01
598	Centrica PLC .....	1.020	0,01
23	Coca-Cola Europacific Partners PLC .....	1.676	0,02
191	Compass Group PLC .....	5.215	0,07
209	ConvaTec Group PLC .....	620	0,01
16	Croda International PLC .....	799	0,01
249	Diageo PLC .....	7.836	0,10
154	DS Smith PLC .....	820	0,01
31	Endeavour Mining PLC .....	661	0,01
449	GSK PLC .....	8.681	0,11
775	Haleon PLC .....	3.160	0,04
43	Halma PLC .....	1.471	0,02
48	Hargreaves Lansdown PLC .....	687	0,01
27	Hikma Pharmaceuticals PLC .....	645	0,01
62	Howden Joinery Group PLC .....	689	0,01
2.113	HSBC Holdings PLC .....	18.267	0,24
29	IMI PLC .....	647	0,01
97	Imperial Brands PLC .....	2.482	0,03
153	Informa PLC .....	1.655	0,02
18	InterContinental Hotels Group PLC .....	1.894	0,03
30	Intermediate Capital Group PLC .....	827	0,01
18	Intertek Group PLC .....	1.091	0,01
203	J Sainsbury PLC .....	654	0,01
411	JD Sports Fashion PLC .....	621	0,01
32	Johnson Matthey PLC .....	634	0,01
210	Kingfisher PLC .....	660	0,01
80	Land Securities Group PLC .....	626	0,01
671	Legal & General Group PLC .....	1.925	0,03
7.094	Lloyds Banking Group PLC .....	4.909	0,07
56	London Stock Exchange Group PLC .....	6.654	0,09
252	M&G PLC .....	650	0,01
229	Marks & Spencer Group PLC .....	829	0,01
146	Melrose Industries PLC .....	1.021	0,01
50	Mondi PLC .....	960	0,01
539	National Grid PLC .....	6.014	0,08
705	NatWest Group PLC .....	2.779	0,04
13	Next PLC .....	1.485	0,02
76	Pearson PLC .....	952	0,01
36	Persimmon PLC .....	615	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 3,56 % (Fortsetzung)</b>		
105	Phoenix Group Holdings PLC .....	692	0,01
309	Prudential PLC .....	2.806	0,04
79	Reckitt Benckiser Group PLC .....	4.276	0,06
210	RELX PLC .....	9.660	0,13
283	Rentokil Initial PLC .....	1.650	0,02
93	Rightmove PLC .....	631	0,01
120	Rio Tinto PLC .....	7.890	0,10
945	Rolls-Royce Holdings PLC .....	5.457	0,07
44	Royalty Pharma PLC .....	1.160	0,02
73	RS Group PLC .....	647	0,01
112	Sage Group PLC .....	1.541	0,02
150	Segro PLC .....	1.703	0,02
30	Severn Trent PLC .....	903	0,01
717	Shell PLC .....	25.686	0,34
98	Smith & Nephew PLC .....	1.215	0,02
39	Smiths Group PLC .....	841	0,01
8	Spirax-Sarco Engineering PLC .....	858	0,01
123	SSE PLC .....	2.782	0,04
239	Standard Chartered PLC .....	2.163	0,03
397	Taylor Wimpey PLC .....	713	0,01
790	Tesco PLC .....	3.056	0,04
277	Unilever PLC .....	15.214	0,20
57	UNITE Group PLC .....	643	0,01
77	United Utilities Group PLC .....	956	0,01
2.454	Vodafone Group PLC .....	2.164	0,03
29	Weir Group PLC .....	727	0,01
21	Whitbread PLC .....	790	0,01
84	Wise PLC .....	724	0,01
		<b>268.760</b>	<b>3,56</b>
	<b>USA: 67,44 %</b>		
62	3M Co. ....	6.336	0,08
194	Abbott Laboratories .....	20.159	0,27
199	AbbVie, Inc. ....	34.132	0,45
50	Adobe, Inc. ....	27.777	0,37
180	Advanced Micro Devices, Inc. ....	29.198	0,39
79	AES Corp. ....	1.388	0,02
64	Aflac, Inc. ....	5.716	0,08
33	Agilent Technologies, Inc. ....	4.278	0,06
25	Air Products & Chemicals, Inc. ....	6.451	0,09
49	Airbnb, Inc. ....	7.430	0,10
17	Akamai Technologies, Inc. ....	1.531	0,02
13	Albemarle Corp. ....	1.242	0,02
19	Alexandria Real Estate Equities, Inc. ....	2.222	0,03
8	Align Technology, Inc. ....	1.931	0,03
29	Alliant Energy Corp. ....	1.476	0,02
29	Allstate Corp. ....	4.630	0,06
31	Ally Financial, Inc. ....	1.230	0,02
14	Alnylam Pharmaceuticals, Inc. ....	3.402	0,04
552	Alphabet, Inc. ....	101.248	1,34
659	Alphabet, Inc. Anteilsklasse A .....	120.037	1,59
193	Altria Group, Inc. ....	8.791	0,12
1.041	Amazon.com, Inc. ....	201.173	2,66
30	Ameren Corp. ....	2.133	0,03
59	American Electric Power Co., Inc. ....	5.177	0,07
64	American Express Co. ....	14.819	0,20
76	American International Group, Inc. ....	5.642	0,07

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
52	American Tower Corp. ....	10.108	0,13
22	American Water Works Co., Inc. ....	2.842	0,04
11	Ameriprise Financial, Inc. ....	4.699	0,06
26	AMETEK, Inc. ....	4.334	0,06
60	Amgen, Inc. ....	18.747	0,25
132	Amphenol Corp. ....	8.893	0,12
56	Analog Devices, Inc. ....	12.783	0,17
56	Annaly Capital Management, Inc. ....	1.067	0,01
10	ANSYS, Inc. ....	3.215	0,04
41	APA Corp. ....	1.207	0,02
58	Apollo Global Management, Inc. ....	6.848	0,09
1.626	Apple, Inc. ....	342.468	4,53
93	Applied Materials, Inc. ....	21.947	0,29
55	Archer-Daniels-Midland Co. ....	3.325	0,04
20	ARES Management Corp. ....	2.666	0,04
29	Arista Networks, Inc. ....	10.164	0,13
24	Arthur J Gallagher & Co. ....	6.223	0,08
805	AT&T, Inc. ....	15.384	0,20
18	Atlassian Corp. ....	3.184	0,04
17	Atmos Energy Corp. ....	1.983	0,03
24	Autodesk, Inc. ....	5.939	0,08
8	Autoliv, Inc. ....	856	0,01
46	Automatic Data Processing, Inc. ....	10.980	0,15
2	AutoZone, Inc. ....	5.928	0,08
16	AvalonBay Communities, Inc. ....	3.310	0,04
76	Avantor, Inc. ....	1.611	0,02
9	Avery Dennison Corp. ....	1.968	0,03
8	Axon Enterprise, Inc. ....	2.354	0,03
112	Baker Hughes Co. ....	3.939	0,05
35	Ball Corp. ....	2.101	0,03
761	Bank of America Corp. ....	30.265	0,40
84	Bank of New York Mellon Corp. ....	5.031	0,07
25	Bath & Body Works, Inc. ....	976	0,01
57	Baxter International, Inc. ....	1.907	0,03
32	Becton Dickinson & Co. ....	7.479	0,10
204	Berkshire Hathaway, Inc. ....	82.987	1,10
24	Best Buy Co., Inc. ....	2.023	0,03
13	Bill Holdings, Inc. ....	684	0,01
16	Biogen, Inc. ....	3.709	0,05
21	BioMarin Pharmaceutical, Inc. ....	1.729	0,02
17	Bio-Techne Corp. ....	1.218	0,02
16	BlackRock, Inc. ....	12.597	0,17
80	Blackstone, Inc. ....	9.904	0,13
62	Block, Inc. ....	3.998	0,05
65	Boeing Co. ....	11.831	0,16
4	Booking Holdings, Inc. ....	15.846	0,21
26	BorgWarner, Inc. ....	838	0,01
18	Boston Properties, Inc. ....	1.108	0,01
165	Boston Scientific Corp. ....	12.707	0,17
227	Bristol-Myers Squibb Co. ....	9.427	0,12
51	Broadcom, Inc. ....	81.882	1,08
13	Broadridge Financial Solutions, Inc. ....	2.561	0,03
27	Brown & Brown, Inc. ....	2.414	0,03
19	Brown-Forman Corp. ....	821	0,01
13	Builders FirstSource, Inc. ....	1.799	0,02
7	Burlington Stores, Inc. ....	1.680	0,02
31	Cadence Design Systems, Inc. ....	9.540	0,13

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
24	Caesars Entertainment, Inc. ....	954	0,01
22	Campbell Soup Co. ....	994	0,01
42	Capital One Financial Corp. ....	5.815	0,08
27	Cardinal Health, Inc. ....	2.655	0,03
25	Carlyle Group, Inc. ....	1.004	0,01
18	CarMax, Inc. ....	1.320	0,02
94	Carrier Global Corp. ....	5.930	0,08
20	Catalent, Inc. ....	1.125	0,01
55	Caterpillar, Inc. ....	18.320	0,24
12	Cboe Global Markets, Inc. ....	2.041	0,03
34	CBRE Group, Inc. ....	3.030	0,04
15	CDW Corp. ....	3.358	0,04
12	Celanese Corp. ....	1.619	0,02
19	Cencora, Inc. ....	4.281	0,06
60	Centene Corp. ....	3.978	0,05
71	CenterPoint Energy, Inc. ....	2.200	0,03
21	CF Industries Holdings, Inc. ....	1.557	0,02
13	CH Robinson Worldwide, Inc. ....	1.146	0,02
6	Charles River Laboratories International, Inc. ....	1.239	0,02
167	Charles Schwab Corp. ....	12.306	0,16
11	Charter Communications, Inc. ....	3.289	0,04
26	Cheniere Energy, Inc. ....	4.546	0,06
193	Chevron Corp. ....	30.189	0,40
150	Chipotle Mexican Grill, Inc. ....	9.397	0,12
27	Church & Dwight Co., Inc. ....	2.799	0,04
31	Cigna Group ....	10.248	0,14
17	Cincinnati Financial Corp. ....	2.008	0,03
10	Cintas Corp. ....	7.003	0,09
454	Cisco Systems, Inc. ....	21.570	0,29
215	Citigroup, Inc. ....	13.644	0,18
51	Citizens Financial Group, Inc. ....	1.838	0,02
14	Clorox Co. ....	1.911	0,03
34	Cloudflare, Inc. ....	2.816	0,04
40	CME Group, Inc. ....	7.864	0,10
33	CMS Energy Corp. ....	1.964	0,03
435	Coca-Cola Co. ....	27.688	0,37
56	Cognizant Technology Solutions Corp. ....	3.808	0,05
22	Coinbase Global, Inc. ....	4.889	0,06
91	Colgate-Palmolive Co. ....	8.831	0,12
436	Comcast Corp. ....	17.074	0,23
53	Conagra Brands, Inc. ....	1.506	0,02
131	ConocoPhillips ....	14.984	0,20
39	Consolidated Edison, Inc. ....	3.487	0,05
18	Constellation Brands, Inc. ....	4.631	0,06
35	Constellation Energy Corp. ....	7.009	0,09
22	Cooper Cos., Inc. ....	1.921	0,03
98	Copart, Inc. ....	5.308	0,07
86	Corning, Inc. ....	3.341	0,04
8	Corpay, Inc. ....	2.131	0,03
78	Corteva, Inc. ....	4.207	0,06
45	CoStar Group, Inc. ....	3.336	0,04
50	Costco Wholesale Corp. ....	42.499	0,56
83	Coterra Energy, Inc. ....	2.214	0,03
130	Coupang, Inc. ....	2.723	0,04
24	CrowdStrike Holdings, Inc. ....	9.197	0,12
49	Crown Castle, Inc. ....	4.787	0,06
219	CSX Corp. ....	7.326	0,10

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
15	Cummins, Inc. ....	4.154	0,05
141	CVS Health Corp. ....	8.327	0,11
74	Danaher Corp. ....	18.489	0,24
13	Darden Restaurants, Inc. ....	1.967	0,03
33	Datadog, Inc. ....	4.280	0,06
6	DaVita, Inc. ....	831	0,01
17	Dayforce, Inc. ....	843	0,01
29	Deere & Co. ....	10.835	0,14
18	Delta Air Lines, Inc. ....	854	0,01
71	Devon Energy Corp. ....	3.365	0,04
44	Dexcom, Inc. ....	4.989	0,07
20	Diamondback Energy, Inc. ....	4.004	0,05
36	Digital Realty Trust, Inc. ....	5.474	0,07
28	Discover Financial Services ....	3.663	0,05
23	DocuSign, Inc. ....	1.231	0,02
25	Dollar General Corp. ....	3.306	0,04
23	Dollar Tree, Inc. ....	2.456	0,03
94	Dominion Energy, Inc. ....	4.606	0,06
4	Domino's Pizza, Inc. ....	2.065	0,03
39	DoorDash, Inc. ....	4.242	0,06
15	Dover Corp. ....	2.707	0,04
79	Dow, Inc. ....	4.191	0,06
33	DR Horton, Inc. ....	4.651	0,06
23	DTE Energy Co. ....	2.553	0,03
86	Duke Energy Corp. ....	8.620	0,11
47	DuPont de Nemours, Inc. ....	3.783	0,05
13	Eastman Chemical Co. ....	1.274	0,02
57	eBay, Inc. ....	3.062	0,04
28	Ecolab, Inc. ....	6.664	0,09
43	Edison International ....	3.088	0,04
67	Edwards Lifesciences Corp. ....	6.189	0,08
30	Electronic Arts, Inc. ....	4.180	0,06
26	Elevance Health, Inc. ....	14.088	0,19
95	Eli Lilly & Co. ....	86.011	1,14
64	Emerson Electric Co. ....	7.050	0,09
15	Enphase Energy, Inc. ....	1.496	0,02
24	Entergy Corp. ....	2.568	0,03
64	EOG Resources, Inc. ....	8.056	0,11
6	EPAM Systems, Inc. ....	1.129	0,01
14	Equifax, Inc. ....	3.394	0,04
11	Equinix, Inc. ....	8.323	0,11
37	Equitable Holdings, Inc. ....	1.512	0,02
21	Equity LifeStyle Properties, Inc. ....	1.368	0,02
42	Equity Residential ....	2.912	0,04
7	Essex Property Trust, Inc. ....	1.905	0,03
26	Estee Lauder Cos., Inc. ....	2.766	0,04
13	Etsy, Inc. ....	767	0,01
25	Evergy, Inc. ....	1.324	0,02
39	Eversource Energy ....	2.212	0,03
112	Exelon Corp. ....	3.876	0,05
14	Expedia Group, Inc. ....	1.764	0,02
16	Expeditors International of Washington, Inc. ....	1.997	0,03
23	Extra Space Storage, Inc. ....	3.574	0,05
503	Exxon Mobil Corp. ....	57.905	0,77
7	F5, Inc. ....	1.206	0,02
4	FactSet Research Systems, Inc. ....	1.633	0,02
3	Fair Isaac Corp. ....	4.466	0,06

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
64	Fastenal Co. ....	4.022	0,05
9	Federal Realty Investment Trust .....	909	0,01
25	FedEx Corp. ....	7.496	0,10
29	Fidelity National Financial, Inc. ....	1.433	0,02
63	Fidelity National Information Services, Inc. ....	4.748	0,06
77	Fifth Third Bancorp .....	2.810	0,04
1	First Citizens BancShares, Inc. ....	1.684	0,02
12	First Solar, Inc. ....	2.706	0,04
64	FirstEnergy Corp. ....	2.449	0,03
65	Fiserv, Inc. ....	9.688	0,13
14	FMC Corp. ....	806	0,01
440	Ford Motor Co. ....	5.518	0,07
71	Fortinet, Inc. ....	4.279	0,06
39	Fortive Corp. ....	2.890	0,04
14	Fortune Brands Innovations, Inc. ....	909	0,01
27	Fox Corp. Anteilsklasse A .....	928	0,01
21	Fox Corp. Anteilsklasse B .....	672	0,01
32	Franklin Resources, Inc. ....	715	0,01
160	Freeport-McMoRan, Inc. ....	7.776	0,10
8	Gartner, Inc. ....	3.592	0,05
48	GE HealthCare Technologies, Inc. ....	3.740	0,05
31	GE Vernova, Inc. ....	5.317	0,07
63	Gen Digital, Inc. ....	1.574	0,02
7	Generac Holdings, Inc. ....	926	0,01
31	General Dynamics Corp. ....	8.994	0,12
122	General Electric Co. ....	19.394	0,26
63	General Mills, Inc. ....	3.985	0,05
127	General Motors Co. ....	5.900	0,08
16	Genuine Parts Co. ....	2.213	0,03
140	Gilead Sciences, Inc. ....	9.605	0,13
29	Global Payments, Inc. ....	2.804	0,04
10	Globe Life, Inc. ....	823	0,01
16	GoDaddy, Inc. ....	2.235	0,03
35	Goldman Sachs Group, Inc. ....	15.831	0,21
3	GRAIL, Inc. ....	46	0,00
99	Halliburton Co. ....	3.344	0,04
33	Hartford Financial Services Group, Inc. ....	3.318	0,04
22	HCA Healthcare, Inc. ....	7.068	0,09
79	Healthpeak Properties, Inc. ....	1.548	0,02
5	HEICO Corp. ....	1.118	0,01
9	HEICO Corp. Anteilsklasse A .....	1.598	0,02
14	Henry Schein, Inc. ....	897	0,01
17	Hershey Co. ....	3.125	0,04
31	Hess Corp. ....	4.573	0,06
145	Hewlett Packard Enterprise Co. ....	3.070	0,04
28	Hilton Worldwide Holdings, Inc. ....	6.110	0,08
26	Hologic, Inc. ....	1.930	0,03
111	Home Depot, Inc. ....	38.211	0,51
73	Honeywell International, Inc. ....	15.588	0,21
32	Hormel Foods Corp. ....	976	0,01
78	Host Hotels & Resorts, Inc. ....	1.402	0,02
45	Howmet Aerospace, Inc. ....	3.493	0,05
110	HP, Inc. ....	3.852	0,05
6	Hubbell, Inc. ....	2.193	0,03
5	HubSpot, Inc. ....	2.949	0,04
14	Humana, Inc. ....	5.231	0,07
162	Huntington Bancshares, Inc. ....	2.135	0,03

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
4	Huntington Ingalls Industries, Inc. ....	985	0,01
8	IDEX Corp. ....	1.610	0,02
9	IDEXX Laboratories, Inc. ....	4.385	0,06
33	Illinois Tool Works, Inc. ....	7.820	0,10
18	Illumina, Inc. ....	1.879	0,02
21	Incyte Corp. ....	1.273	0,02
45	Ingersoll Rand, Inc. ....	4.088	0,05
8	Insulet Corp. ....	1.614	0,02
478	Intel Corp. ....	14.804	0,20
64	Intercontinental Exchange, Inc. ....	8.761	0,12
103	International Business Machines Corp. ....	17.814	0,24
29	International Flavors & Fragrances, Inc. ....	2.761	0,04
39	International Paper Co. ....	1.683	0,02
42	Interpublic Group of Co., Inc. ....	1.222	0,02
31	Intuit, Inc. ....	20.374	0,27
40	Intuitive Surgical, Inc. ....	17.794	0,24
69	Invitation Homes, Inc. ....	2.476	0,03
20	IQVIA Holdings, Inc. ....	4.229	0,06
33	Iron Mountain, Inc. ....	2.957	0,04
12	J M Smucker Co. ....	1.308	0,02
8	Jack Henry & Associates, Inc. ....	1.328	0,02
14	Jacobs Solutions, Inc. ....	1.956	0,03
9	JB Hunt Transport Services, Inc. ....	1.440	0,02
270	Johnson & Johnson ....	39.463	0,52
321	JPMorgan Chase & Co. ....	64.925	0,86
36	Juniper Networks, Inc. ....	1.313	0,02
31	Kellanova ....	1.788	0,02
119	Keurig Dr Pepper, Inc. ....	3.975	0,05
104	KeyCorp ....	1.478	0,02
20	Keysight Technologies, Inc. ....	2.735	0,04
38	Kimberly-Clark Corp. ....	5.252	0,07
74	Kimco Realty Corp. ....	1.440	0,02
217	Kinder Morgan, Inc. ....	4.312	0,06
75	KKR & Co., Inc. ....	7.893	0,10
15	KLA Corp. ....	12.368	0,16
100	Kraft Heinz Co. ....	3.222	0,04
74	Kroger Co. ....	3.695	0,05
21	L3Harris Technologies, Inc. ....	4.716	0,06
9	Labcorp Holdings, Inc. ....	1.832	0,02
15	Lam Research Corp. ....	15.973	0,21
16	Lamb Weston Holdings, Inc. ....	1.345	0,02
40	Las Vegas Sands Corp. ....	1.770	0,02
6	Lear Corp. ....	685	0,01
15	Leidos Holdings, Inc. ....	2.188	0,03
27	Lennar Corp. Anteilsklasse A ....	4.046	0,05
13	Liberty Broadband Corp. ....	713	0,01
22	Liberty Media Corp.-Liberty Formula One ....	1.580	0,02
32	Liberty Media Corp.-Liberty SiriusXM ....	709	0,01
18	Live Nation Entertainment, Inc. ....	1.687	0,02
30	LKQ Corp. ....	1.248	0,02
24	Lockheed Martin Corp. ....	11.210	0,15
20	Loews Corp. ....	1.495	0,02
64	Lowe's Co., Inc. ....	14.109	0,19
8	LPL Financial Holdings, Inc. ....	2.234	0,03
14	Lululemon Athletica, Inc. ....	4.182	0,06
19	M&T Bank Corp. ....	2.876	0,04
64	Marathon Oil Corp. ....	1.835	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
39	Marathon Petroleum Corp. ....	6.766	0,09
1	Markel Group, Inc. ....	1.576	0,02
26	Marriott International, Inc. ....	6.286	0,08
55	Marsh & McLennan Co., Inc. ....	11.590	0,15
7	Martin Marietta Materials, Inc. ....	3.793	0,05
96	Marvell Technology, Inc. ....	6.710	0,09
25	Masco Corp. ....	1.667	0,02
93	Mastercard, Inc. ....	41.028	0,54
30	Match Group, Inc. ....	911	0,01
28	McCormick & Co., Inc. ....	1.986	0,03
81	McDonald's Corp. ....	20.642	0,27
15	McKesson Corp. ....	8.761	0,12
5	MercadoLibre, Inc. ....	8.217	0,11
284	Merck & Co., Inc. ....	35.159	0,47
245	Meta Platforms, Inc. ....	123.534	1,64
67	MetLife, Inc. ....	4.703	0,06
2	Mettler-Toledo International, Inc. ....	2.795	0,04
27	MGM Resorts International ....	1.200	0,02
59	Microchip Technology, Inc. ....	5.398	0,07
124	Micron Technology, Inc. ....	16.310	0,22
832	Microsoft Corp. ....	371.862	4,92
13	Mid-America Apartment Communities, Inc. ....	1.854	0,02
36	Moderna, Inc. ....	4.275	0,06
7	Molina Healthcare, Inc. ....	2.081	0,03
20	Molson Coors Beverage Co. ....	1.017	0,01
150	Mondelez International, Inc. ....	9.816	0,13
8	MongoDB, Inc. ....	2.000	0,03
5	Monolithic Power Systems, Inc. ....	4.108	0,05
85	Monster Beverage Corp. ....	4.246	0,06
17	Moody's Corp. ....	7.156	0,09
130	Morgan Stanley ....	12.635	0,17
36	Mosaic Co. ....	1.040	0,01
18	Motorola Solutions, Inc. ....	6.949	0,09
8	MSCI, Inc. ....	3.854	0,05
42	Nasdaq, Inc. ....	2.531	0,03
23	NetApp, Inc. ....	2.962	0,04
48	Netflix, Inc. ....	32.394	0,43
129	Newmont Corp. ....	5.401	0,07
43	News Corp. Anteilsklasse A ....	1.186	0,02
24	News Corp. Anteilsklasse B ....	681	0,01
230	NextEra Energy, Inc. ....	16.286	0,22
135	NIKE, Inc. ....	10.175	0,13
50	NiSource, Inc. ....	1.440	0,02
25	Norfolk Southern Corp. ....	5.367	0,07
23	Northern Trust Corp. ....	1.932	0,03
16	Northrop Grumman Corp. ....	6.975	0,09
24	NRG Energy, Inc. ....	1.869	0,02
27	Nucor Corp. ....	4.268	0,06
2.661	NVIDIA Corp. ....	328.740	4,35
71	Occidental Petroleum Corp. ....	4.475	0,06
17	Okta, Inc. ....	1.591	0,02
22	Old Dominion Freight Line, Inc. ....	3.885	0,05
22	Omnicom Group, Inc. ....	1.973	0,03
48	ON Semiconductor Corp. ....	3.290	0,04
65	ONEOK, Inc. ....	5.301	0,07
176	Oracle Corp. ....	24.851	0,33
7	O'Reilly Automotive, Inc. ....	7.392	0,10

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
45	Otis Worldwide Corp. ....	4.332	0,06
58	PACCAR, Inc. ....	5.971	0,08
10	Packaging Corp. of America ....	1.826	0,02
225	Palantir Technologies, Inc. ....	5.699	0,08
35	Palo Alto Networks, Inc. ....	11.865	0,16
66	Paramount Global ....	686	0,01
14	Parker-Hannifin Corp. ....	7.081	0,09
36	Paychex, Inc. ....	4.268	0,06
6	Paycom Software, Inc. ....	858	0,01
117	PayPal Holdings, Inc. ....	6.790	0,09
154	PepsiCo, Inc. ....	25.399	0,34
635	Pfizer, Inc. ....	17.767	0,24
240	PG&E Corp. ....	4.190	0,06
174	Philip Morris International, Inc. ....	17.631	0,23
47	Phillips 66 ....	6.635	0,09
66	Pinterest, Inc. ....	2.909	0,04
44	PNC Financial Services Group, Inc. ....	6.841	0,09
4	Pool Corp. ....	1.229	0,02
26	PPG Industries, Inc. ....	3.273	0,04
83	PPL Corp. ....	2.295	0,03
26	Principal Financial Group, Inc. ....	2.040	0,03
264	Procter & Gamble Co. ....	43.539	0,58
66	Progressive Corp. ....	13.709	0,18
104	Prologis, Inc. ....	11.680	0,15
40	Prudential Financial, Inc. ....	4.688	0,06
13	PTC, Inc. ....	2.362	0,03
56	Public Service Enterprise Group, Inc. ....	4.127	0,05
18	Public Storage ....	5.178	0,07
23	PulteGroup, Inc. ....	2.532	0,03
11	Qorvo, Inc. ....	1.276	0,02
125	QUALCOMM, Inc. ....	24.897	0,33
16	Quanta Services, Inc. ....	4.065	0,05
12	Quest Diagnostics, Inc. ....	1.643	0,02
21	Raymond James Financial, Inc. ....	2.596	0,03
97	Realty Income Corp. ....	5.124	0,07
21	Regency Centers Corp. ....	1.306	0,02
11	Regeneron Pharmaceuticals, Inc. ....	11.561	0,15
103	Regions Financial Corp. ....	2.064	0,03
23	Republic Services, Inc. ....	4.470	0,06
16	ResMed, Inc. ....	3.063	0,04
14	Revvity, Inc. ....	1.468	0,02
92	Rivian Automotive, Inc. ....	1.235	0,02
11	Robert Half, Inc. ....	704	0,01
57	ROBLOX Corp. ....	2.121	0,03
13	Rockwell Automation, Inc. ....	3.579	0,05
31	Rollins, Inc. ....	1.512	0,02
12	Roper Technologies, Inc. ....	6.764	0,09
37	Ross Stores, Inc. ....	5.377	0,07
149	RTX Corp. ....	14.958	0,20
35	S&P Global, Inc. ....	15.610	0,21
105	Salesforce, Inc. ....	26.995	0,36
12	SBA Communications Corp. ....	2.356	0,03
11	SEI Investments Co. ....	712	0,01
71	Sempra ....	5.400	0,07
23	ServiceNow, Inc. ....	18.093	0,24
26	Sherwin-Williams Co. ....	7.759	0,10
36	Simon Property Group, Inc. ....	5.465	0,07

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
18	Skyworks Solutions, Inc. ....	1.918	0,03
6	Snap-on, Inc. ....	1.568	0,02
35	Snowflake, Inc. ....	4.728	0,06
16	Solventum Corp. ....	846	0,01
123	Southern Co. ....	9.541	0,13
10	Southern Copper Corp. ....	1.077	0,01
22	Southwest Airlines Co. ....	629	0,01
24	SS&C Technologies Holdings, Inc. ....	1.504	0,02
17	Stanley Black & Decker, Inc. ....	1.358	0,02
127	Starbucks Corp. ....	9.887	0,13
34	State Street Corp. ....	2.516	0,03
17	Steel Dynamics, Inc. ....	2.201	0,03
41	Stryker Corp. ....	13.950	0,18
14	Sun Communities, Inc. ....	1.685	0,02
45	Synchrony Financial ....	2.124	0,03
17	Synopsys, Inc. ....	10.116	0,13
56	Sysco Corp. ....	3.998	0,05
25	T Rowe Price Group, Inc. ....	2.883	0,04
19	Take-Two Interactive Software, Inc. ....	2.954	0,04
25	Targa Resources Corp. ....	3.219	0,04
52	Target Corp. ....	7.698	0,10
5	Teledyne Technologies, Inc. ....	1.940	0,03
5	Teleflex, Inc. ....	1.052	0,01
17	Teradyne, Inc. ....	2.521	0,03
312	Tesla, Inc. ....	61.739	0,82
102	Texas Instruments, Inc. ....	19.842	0,26
2	Texas Pacific Land Corp. ....	1.469	0,02
21	Textron, Inc. ....	1.803	0,02
43	Thermo Fisher Scientific, Inc. ....	23.779	0,31
127	TJX Co., Inc. ....	13.983	0,18
54	T-Mobile U.S., Inc. ....	9.514	0,13
12	Tractor Supply Co. ....	3.240	0,04
50	Trade Desk, Inc. ....	4.883	0,06
6	TransDigm Group, Inc. ....	7.666	0,10
22	TransUnion ....	1.632	0,02
26	Travelers Co., Inc. ....	5.287	0,07
27	Trimble, Inc. ....	1.510	0,02
150	Truist Financial Corp. ....	5.827	0,08
20	Twilio, Inc. ....	1.136	0,01
5	Tyler Technologies, Inc. ....	2.514	0,03
32	Tyson Foods, Inc. ....	1.828	0,02
175	U.S. Bancorp ....	6.947	0,09
225	Uber Technologies, Inc. ....	16.353	0,22
37	UDR, Inc. ....	1.523	0,02
55	UiPath, Inc. ....	697	0,01
5	Ulta Beauty, Inc. ....	1.929	0,03
68	Union Pacific Corp. ....	15.386	0,20
13	United Airlines Holdings, Inc. ....	633	0,01
82	United Parcel Service, Inc. ....	11.222	0,15
7	United Rentals, Inc. ....	4.527	0,06
103	UnitedHealth Group, Inc. ....	52.454	0,69
37	Unity Software, Inc. ....	602	0,01
6	Universal Health Services, Inc. ....	1.110	0,01
4	Vail Resorts, Inc. ....	721	0,01
37	Valero Energy Corp. ....	5.800	0,08
17	Veeva Systems, Inc. ....	3.111	0,04
45	Ventas, Inc. ....	2.307	0,03

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,93 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 67,44 % (Fortsetzung)</b>		
28	Veralto Corp. ....	2.673	0,04
10	VeriSign, Inc. ....	1.778	0,02
16	Verisk Analytics, Inc. ....	4.313	0,06
472	Verizon Communications, Inc. ....	19.465	0,26
29	Vertex Pharmaceuticals, Inc. ....	13.593	0,18
133	Viatris, Inc. ....	1.414	0,02
117	VICI Properties, Inc. ....	3.351	0,04
177	Visa, Inc. ....	46.457	0,61
39	Vistra Corp. ....	3.353	0,04
11	Voya Financial, Inc. ....	783	0,01
15	Vulcan Materials Co. ....	3.730	0,05
23	W R Berkley Corp. ....	1.807	0,02
80	Walgreens Boots Alliance, Inc. ....	968	0,01
486	Walmart, Inc. ....	32.907	0,44
206	Walt Disney Co. ....	20.454	0,27
272	Warner Bros Discovery, Inc. ....	2.024	0,03
45	Waste Management, Inc. ....	9.600	0,13
7	Waters Corp. ....	2.031	0,03
35	WEC Energy Group, Inc. ....	2.746	0,04
393	Wells Fargo & Co. ....	23.340	0,31
66	Welltower, Inc. ....	6.880	0,09
8	West Pharmaceutical Services, Inc. ....	2.635	0,03
37	Western Digital Corp. ....	2.803	0,04
20	Westinghouse Air Brake Technologies Corp. ....	3.161	0,04
5	Westlake Corp. ....	724	0,01
29	Westrock Co. ....	1.458	0,02
82	Weyerhaeuser Co. ....	2.328	0,03
136	Williams Cos., Inc. ....	5.780	0,08
24	Workday, Inc. ....	5.365	0,07
24	WP Carey, Inc. ....	1.321	0,02
5	WW Grainger, Inc. ....	4.511	0,06
11	Wynn Resorts Ltd. ....	985	0,01
62	Xcel Energy, Inc. ....	3.311	0,04
27	Xylem, Inc. ....	3.662	0,05
32	Yum! Brands, Inc. ....	4.239	0,06
6	Zebra Technologies Corp. ....	1.854	0,02
18	Zillow Group, Inc. ....	835	0,01
23	Zimmer Biomet Holdings, Inc. ....	2.496	0,03
51	Zoetis, Inc. ....	8.841	0,12
28	Zoom Video Communications, Inc. ....	1.657	0,02
10	Zscaler, Inc. ....	1.922	0,03
		<u>5.093.587</u>	<u>67,44</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>7.547.506</u>	<u>99,93</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>7.547.506</u>	<u>99,93</u>
		<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	7.547.506	99,93
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	5.534	0,07
	<b>Nettovermögen</b>	<u>7.553.040</u>	<u>100,00</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	99,93
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	0,07
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %)</b>		
	<b>Aktien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %)</b>		
	<b>Indien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %)</b>		
1.591	3M India Ltd. ....	702.211	0,08
108.292	Aarti Industries Ltd. ....	891.205	0,10
28.323	ABB India Ltd. ....	2.883.979	0,31
44.280	ACC Ltd. ....	1.390.754	0,15
192.024	Adani Energy Solutions Ltd. ....	2.296.689	0,25
172.111	Adani Enterprises Ltd. ....	6.557.607	0,71
230.087	Adani Green Energy Ltd. ....	4.935.747	0,53
405.697	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. ....	7.191.254	0,78
630.136	Adani Power Ltd. ....	5.430.259	0,59
152.726	Adani Total Gas Ltd. ....	1.641.043	0,18
90.445	Adani Wilmar Ltd. ....	360.207	0,04
275.634	Aditya Birla Capital Ltd. ....	789.046	0,08
21.157	AIA Engineering Ltd. ....	1.060.178	0,11
28.452	Alkem Laboratories Ltd. ....	1.703.060	0,18
394.941	Ambuja Cements Ltd. ....	3.174.447	0,34
106.528	APL Apollo Tubes Ltd. ....	1.986.904	0,21
53.836	Apollo Hospitals Enterprise Ltd. ....	3.993.564	0,43
770.413	Ashok Leyland Ltd. ....	2.234.810	0,24
247.724	Asian Paints Ltd. ....	8.665.847	0,93
63.572	Astral Ltd. ....	1.815.047	0,20
198.285	AU Small Finance Bank Ltd. ....	1.598.050	0,17
144.873	Aurobindo Pharma Ltd. ....	2.098.020	0,23
81.762	Avenue Supermarts Ltd. ....	4.624.805	0,50
1.246.305	Axis Bank Ltd. ....	18.910.357	2,04
36.791	Bajaj Auto Ltd. ....	4.192.178	0,45
136.294	Bajaj Finance Ltd. ....	11.630.122	1,25
206.798	Bajaj Finserv Ltd. ....	3.938.555	0,42
14.211	Bajaj Holdings & Investment Ltd. ....	1.454.758	0,16
44.280	Balkrishna Industries Ltd. ....	1.714.647	0,18
430.782	Bandhan Bank Ltd. ....	1.052.733	0,11
559.016	Bank of Baroda ....	1.846.236	0,20
493.843	Bank of India ....	713.692	0,08
34.241	Bata India Ltd. ....	621.584	0,07
6.355	Bayer CropScience Ltd. ....	511.555	0,05
159.792	Berger Paints India Ltd. ....	966.177	0,10
1.954.647	Bharat Electronics Ltd. ....	7.170.457	0,77
136.288	Bharat Forge Ltd. ....	2.730.009	0,29
693.258	Bharat Heavy Electricals Ltd. ....	2.501.174	0,27
553.776	Bharat Petroleum Corp. Ltd. ....	2.018.531	0,22
527.068	Bharat Petroleum Corp. Ltd. (Stammaktien) ....	1.921.179	0,21
1.448.567	Bharti Airtel Ltd. ....	25.085.333	2,70
91.694	Bharti Airtel Ltd. (partly paid) ....	1.146.787	0,12
243.980	Biocon Ltd. ....	1.027.269	0,11
4.799	Bosch Ltd. ....	1.961.577	0,21
65.334	Britannia Industries Ltd. ....	4.290.086	0,46
982.000	Canara Bank ....	1.406.920	0,15
256.171	Castrol India Ltd. ....	616.285	0,07
346.746	CG Power & Industrial Solutions Ltd. ....	2.930.318	0,32
223.419	Cholamandalam Investment & Finance Co. Ltd. ....	3.813.964	0,41
292.144	Cipla Ltd. ....	5.187.910	0,56
1.235.738	Coal India Ltd. ....	7.011.716	0,76
34.865	Coforge Ltd. ....	2.282.369	0,25
71.424	Colgate-Palmolive India Ltd. ....	2.435.247	0,26
151.620	Container Corp. of India Ltd. ....	1.895.352	0,20
68.158	Coromandel International Ltd. ....	1.308.478	0,14
73.752	Cummins India Ltd. ....	3.508.477	0,38
313.316	Dabur India Ltd. ....	2.257.040	0,24

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
44.918	Dalmia Bharat Ltd. ....	976.844	0,11
37.693	Deepak Nitrite Ltd. ....	1.130.937	0,12
69.018	Divi's Laboratories Ltd. ....	3.804.381	0,41
19.606	Dixon Technologies India Ltd. ....	2.814.682	0,30
336.006	DLF Ltd. ....	3.323.291	0,36
18.236	Dr Lal PathLabs Ltd. ....	608.111	0,07
66.537	Dr Reddy's Laboratories Ltd. ....	5.108.597	0,55
76.161	Eicher Motors Ltd. ....	4.267.984	0,46
113.695	Emami Ltd. ....	939.829	0,10
474.423	Embassy Office Parks REIT ....	2.021.550	0,22
247.159	Exide Industries Ltd. ....	1.673.168	0,18
989.575	Federal Bank Ltd. ....	2.103.459	0,23
732.469	FSN E-Commerce Ventures Ltd. ....	1.549.835	0,17
1.427.779	GAIL India Ltd. ....	3.759.183	0,41
60.025	General Insurance Corp. of India ....	272.636	0,03
23.167	GlaxoSmithKline Pharmaceuticals Ltd. ....	736.510	0,08
81.493	Glenmark Pharmaceuticals Ltd. ....	1.202.544	0,13
1.342.763	GMR Airports Infrastructure Ltd. ....	1.555.037	0,17
200.808	Godrej Consumer Products Ltd. ....	3.313.227	0,36
35.461	Godrej Industries Ltd. ....	363.976	0,04
57.194	Godrej Properties Ltd. ....	2.200.241	0,24
212.183	Grasim Industries Ltd. ....	6.795.072	0,73
20.785	Gujarat Fluorochemicals Ltd. ....	795.719	0,09
106.711	Gujarat Gas Ltd. ....	804.228	0,09
130.152	Havells India Ltd. ....	2.844.419	0,31
576.859	HCL Technologies Ltd. ....	10.097.238	1,09
54.905	HDFC Asset Management Co. Ltd. ....	2.629.317	0,28
3.068.149	HDFC Bank Ltd. ....	61.953.522	6,68
541.940	HDFC Life Insurance Co. Ltd. ....	3.867.263	0,42
71.747	Hero MotoCorp Ltd. ....	4.800.714	0,52
764.182	Hindalco Industries Ltd. ....	6.355.850	0,68
103.817	Hindustan Aeronautics Ltd. ....	6.553.964	0,71
340.519	Hindustan Petroleum Corp. Ltd. ....	1.356.155	0,15
164.029	Hindustan Petroleum Corp. Ltd. (Stammaktien) ....	653.264	0,07
483.452	Hindustan Unilever Ltd. ....	14.337.892	1,55
125.481	Hindustan Zinc Ltd. ....	1.007.685	0,11
1.164	Honeywell Automation India Ltd. ....	791.627	0,09
1.721.591	ICICI Bank Ltd. ....	24.766.548	2,67
130.152	ICICI Lombard General Insurance Co. Ltd. ....	2.793.147	0,30
205.365	ICICI Prudential Life Insurance Co. Ltd. ....	1.491.705	0,16
317.706	IDBI Bank Ltd. ....	319.925	0,03
1.911.769	IDFC First Bank Ltd. ....	1.883.627	0,20
145.934	Indian Bank ....	954.663	0,10
448.931	Indian Hotels Co. Ltd. ....	3.365.065	0,36
2.242.142	Indian Oil Corp. Ltd. ....	4.453.497	0,48
162.943	Indian Railway Catering & Tourism Corp. Ltd. ....	1.933.040	0,21
982.278	Indian Railway Finance Corp. Ltd. ....	2.047.426	0,22
363.602	Indian Renewable Energy Development Agency Ltd. ....	830.393	0,09
192.413	Indraprastha Gas Ltd. ....	1.162.266	0,12
714.290	Indus Towers Ltd. ....	3.214.787	0,35
41.730	Info Edge India Ltd. ....	3.395.875	0,37
1.912.606	Infosys Ltd. ....	35.935.547	3,87
89.030	InterGlobe Aviation Ltd. ....	4.514.359	0,49
72.552	Ipca Laboratories Ltd. ....	982.905	0,11
1.634.334	ITC Ltd. ....	8.327.729	0,90
180.498	Jindal Stainless Ltd. ....	1.780.358	0,19
212.814	Jindal Steel & Power Ltd. ....	2.665.423	0,29

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
1.725.350	Jio Financial Services Ltd. ....	7.410.392	0,80
289.811	JSW Energy Ltd. ....	2.552.735	0,27
132.872	JSW Infrastructure Ltd. ....	523.282	0,06
549.971	JSW Steel Ltd. ....	6.143.583	0,66
196.006	Jubilant Foodworks Ltd. ....	1.323.944	0,14
214.112	Kalyan Jewellers India Ltd. ....	1.286.790	0,14
112.592	Kansai Nerolac Paints Ltd. ....	364.696	0,04
270.167	Kotak Mahindra Bank Ltd. ....	5.839.916	0,63
91.769	KPIT Technologies Ltd. ....	1.799.063	0,19
460.179	L&T Finance Ltd. ....	999.798	0,11
13.840	L&T Technology Services Ltd. ....	814.765	0,09
367.201	Larsen & Toubro Ltd. ....	15.625.776	1,68
213.556	Laurus Labs Ltd. ....	1.087.276	0,12
166.649	LIC Housing Finance Ltd. ....	1.592.396	0,17
11.428	Linde India Ltd. ....	1.137.380	0,12
49.615	LTIMindtree Ltd. ....	3.204.068	0,35
129.774	Lupin Ltd. ....	2.523.269	0,27
141.767	Macrotech Developers Ltd. ....	2.556.184	0,28
321.608	Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd. ....	1.159.351	0,12
529.431	Mahindra & Mahindra Ltd. ....	18.200.490	1,96
101.152	Mangalore Refinery & Petrochemicals Ltd. ....	259.990	0,03
51.069	Mankind Pharma Ltd. ....	1.303.986	0,14
288.972	Marico Ltd. ....	2.124.297	0,23
75.362	Maruti Suzuki India Ltd. ....	10.875.671	1,17
130.106	Max Financial Services Ltd. ....	1.516.103	0,16
357.953	Max Healthcare Institute Ltd. ....	4.037.877	0,44
16.589	Mazagon Dock Shipbuilders Ltd. ....	851.746	0,09
16.589	Metro Brands Ltd. ....	244.396	0,03
60.513	Mphasis Ltd. ....	1.782.680	0,19
1.433	MRF Ltd. ....	2.224.733	0,24
58.199	Muthoot Finance Ltd. ....	1.253.385	0,13
194.242	Nestle India Ltd. ....	5.943.788	0,64
120.009	New India Assurance Co. Ltd. ....	340.998	0,04
1.600.703	NHPC Ltd. ....	1.933.033	0,21
92.885	Nippon Life India Asset Management Ltd. ....	717.850	0,08
93.306	NLC India Ltd. ....	268.715	0,03
629.428	NMDC Ltd. ....	1.857.242	0,20
2.581.268	NTPC Ltd. ....	11.711.860	1,26
63.211	Oberoi Realty Ltd. ....	1.338.508	0,14
2.102.781	Oil & Natural Gas Corp. Ltd. ....	6.914.496	0,75
196.274	Oil India Ltd. ....	1.701.885	0,18
190.116	One 97 Communications Ltd. ....	915.954	0,10
12.372	Oracle Financial Services Software Ltd. ....	1.466.205	0,16
3.269	Page Industries Ltd. ....	1.532.793	0,16
51.069	Patanjali Foods Ltd. ....	974.621	0,10
168.237	PB Fintech Ltd. ....	2.818.997	0,30
55.306	Persistent Systems Ltd. ....	2.813.103	0,30
405.012	Petronet LNG Ltd. ....	1.604.020	0,17
51.069	Phoenix Mills Ltd. ....	2.197.582	0,24
43.939	PI Industries Ltd. ....	2.001.658	0,22
82.866	Pidilite Industries Ltd. ....	3.139.194	0,34
68.264	Piramal Enterprises Ltd. ....	758.875	0,08
26.024	Polycab India Ltd. ....	2.103.298	0,23
147.098	Poonawalla Fincorp Ltd. ....	721.664	0,08
787.939	Power Finance Corp. Ltd. ....	4.583.771	0,49
2.279.348	Power Grid Corp. of India Ltd. ....	9.046.323	0,98
69.269	Prestige Estates Projects Ltd. ....	1.572.160	0,17

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
1.212.789	Punjab National Bank .....	1.792.695	0,19
307.124	Rail Vikas Nigam Ltd. ....	1.534.377	0,17
73.633	Rajesh Exports Ltd. ....	249.101	0,03
239.711	RBL Bank Ltd. ....	755.979	0,08
681.696	REC Ltd. ....	4.295.165	0,46
37.798	Relaxo Footwears Ltd. ....	375.000	0,04
1.813.329	Reliance Industries Ltd. ....	68.081.792	7,34
1.456.013	Samvardhana Motherson International Ltd. ....	3.322.966	0,36
158.431	SBI Cards & Payment Services Ltd. ....	1.376.694	0,15
227.638	SBI Life Insurance Co. Ltd. ....	4.072.847	0,44
21.698	Schaeffler India Ltd. ....	1.233.511	0,13
7.117	Shree Cement Ltd. ....	2.378.697	0,26
153.528	Shriram Finance Ltd. ....	5.360.477	0,58
48.609	Siemens Ltd. ....	4.491.177	0,48
386.939	SJVN Ltd. ....	610.796	0,07
13.114	Solar Industries India Ltd. ....	1.575.929	0,17
190.927	Sona Blw Precision Forgings Ltd. ....	1.467.657	0,16
76.511	SRF Ltd. ....	2.235.163	0,24
121.883	Star Health & Allied Insurance Co. Ltd. ....	816.548	0,09
974.931	State Bank of India .....	9.925.560	1,07
798.768	Steel Authority of India Ltd. ....	1.423.917	0,15
593.293	Sun Pharmaceutical Industries Ltd. ....	10.820.682	1,17
45.956	Sun TV Network Ltd. ....	414.548	0,04
36.304	Sundaram Finance Ltd. ....	2.042.689	0,22
34.490	Supreme Industries Ltd. ....	2.463.427	0,27
6.379.061	Suzlon Energy Ltd. ....	4.043.738	0,44
88.374	Syngene International Ltd. ....	752.457	0,08
61.483	Tata Communications Ltd. ....	1.367.317	0,15
563.225	Tata Consultancy Services Ltd. ....	26.369.838	2,84
341.645	Tata Consumer Products Ltd. ....	4.496.337	0,48
18.236	Tata Elxsi Ltd. ....	1.531.135	0,16
1.005.400	Tata Motors Ltd. ....	11.933.379	1,29
209.536	Tata Motors Ltd. Anteilsklasse A .....	1.672.519	0,18
804.116	Tata Power Co. Ltd. ....	4.248.760	0,46
4.586.808	Tata Steel Ltd. ....	9.571.584	1,03
40.576	Tata Technologies Ltd. ....	497.276	0,05
262.174	Tata Teleservices Maharashtra Ltd. ....	244.387	0,03
332.710	Tech Mahindra Ltd. ....	5.706.991	0,62
18.843	Thermax Ltd. ....	1.209.161	0,13
224.108	Titan Co. Ltd. ....	9.148.955	0,99
53.699	Torrent Pharmaceuticals Ltd. ....	1.797.512	0,19
118.626	Torrent Power Ltd. ....	2.131.605	0,23
99.063	Trent Ltd. ....	6.509.973	0,70
48.543	Tube Investments of India Ltd. ....	2.479.470	0,27
129.863	TVS Motor Co. Ltd. ....	3.682.884	0,40
62.527	UltraTech Cement Ltd. ....	8.749.019	0,94
832.263	Union Bank of India Ltd. ....	1.364.258	0,15
36.577	United Breweries Ltd. ....	871.159	0,09
155.659	United Spirits Ltd. ....	2.382.836	0,26
91.825	UNO Minda Ltd. ....	1.202.548	0,13
288.710	UPL Ltd. ....	1.976.437	0,21
254.687	Varun Beverages Ltd. ....	4.976.915	0,54
32.761	Vedant Fashions Ltd. ....	413.169	0,04
765.831	Vedanta Ltd. ....	4.169.537	0,45
11.359.854	Vodafone Idea Ltd. ....	2.437.149	0,26
124.749	Voltas Ltd. ....	2.202.434	0,24
33.249	Whirlpool of India Ltd. ....	796.800	0,09

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 100,64 % (30. Juni 2023: 100,68 %) (Fortsetzung)</b>		
761.682	Wipro Ltd. ....	4.702.767	0,51
10.936.644	Yes Bank Ltd. ....	3.107.050	0,33
447.995	Zee Entertainment Enterprises Ltd. ....	815.484	0,09
3.742.278	Zomato Ltd. ....	9.000.765	0,97
136.938	Zydus Lifesciences Ltd. ....	1.763.628	0,19
		<u>933.315.279</u>	<u>100,64</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>933.315.279</u>	<u>100,64</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>933.315.279</u>	<u>100,64</u>

Finanzderivate: 0,03 % (30. Juni 2023: 0,01 %)

Terminkontrakte: 0,03 % (30. Juni 2023: 0,01 %)\*

Nominalwert USD	Durchschnittli- cher Kurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
18.072.941	23.780	380 IFSC Nifty 50 Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im Juli 2024 .....	273.079	0,03
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten</b> ..	<u>273.079</u>	<u>0,03</u>
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente</b> .....	<u>273.079</u>	<u>0,03</u>

	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>Anlagenportfolio</b>	933.588.358	100,67
<b>Sonstige Nettverbindlichkeiten</b>	<u>(6.172.255)</u>	<u>(0,67)</u>
<b>Nettovermögen</b>	<u>927.416.103</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....	97,69
Börsengehandelte Derivate .....	0,03
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	<u>2,28</u>
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. The value of variation margin cash at broker as at 30. Juni 2024 is USD 607,397.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %)</b>		
	<b>Südkorea: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %)</b>		
37.979	Alteogen, Inc. ....	7.739.273	0,95
26.562	Amorepacific Corp. ....	3.228.349	0,40
9.553	Amorepacific Corp. (Vorzugsaktien) ....	325.489	0,04
23.067	AMOREPACIFIC Group ....	542.112	0,07
7.456	BGF retail Co. Ltd. ....	559.539	0,07
244.650	BNK Financial Group, Inc. ....	1.505.402	0,18
17.009	Celltrion Pharm, Inc. ....	1.097.275	0,13
131.878	Celltrion, Inc. ....	16.699.118	2,05
59.648	Cheil Worldwide, Inc. ....	797.329	0,10
7.223	CJ CheilJedang Corp. ....	2.022.860	0,25
1.398	CJ CheilJedang Corp. (Vorzugsaktien) ....	156.609	0,02
12.116	CJ Corp. ....	1.069.447	0,13
9.087	CJ ENM Co. Ltd. ....	555.848	0,07
7.456	CJ Logistics Corp. ....	515.122	0,06
20.271	CosmoAM&T Co. Ltd. ....	2.123.558	0,26
51.260	Coway Co. Ltd. ....	2.390.768	0,29
167.061	Daewoo Engineering & Construction Co. Ltd. ....	451.483	0,06
40.076	DB Insurance Co. Ltd. ....	3.333.601	0,41
133.975	DGB Financial Group, Inc. ....	780.588	0,10
25.164	DL E&C Co. Ltd. ....	592.309	0,07
10.485	DL Holdings Co. Ltd. ....	450.173	0,06
26.096	Dongsuh Cos Inc. ....	363.998	0,05
44.736	Doosan Bobcat, Inc. ....	1.667.241	0,20
384.916	Doosan Enerbility Co. Ltd. ....	5.620.640	0,69
41.474	Ecopro BM Co. Ltd. ....	5.513.797	0,68
89.006	Ecopro Co. Ltd. ....	5.825.965	0,71
10.718	Ecopro Materials Co. Ltd. ....	707.785	0,09
17.941	E-MART, Inc. ....	736.409	0,09
13.980	F&F Co. Ltd. ....	633.746	0,08
46.833	Fila Holdings Corp. ....	1.364.332	0,17
4.660	Green Cross Corp. ....	386.951	0,05
54.289	GS Engineering & Construction Corp. ....	592.781	0,07
40.775	GS Holdings Corp. ....	1.389.283	0,17
38.911	GS Retail Co. Ltd. ....	589.389	0,07
238.359	Hana Financial Group, Inc. ....	10.511.000	1,29
28.892	Hanjin Kal Corp. ....	1.355.920	0,17
66.638	Hankook Tire & Technology Co. Ltd. ....	2.188.186	0,27
6.757	Hanmi Pharm Co. Ltd. ....	1.327.838	0,16
21.902	Hanmi Science Co. Ltd. ....	494.048	0,06
39.843	Hanmi Semiconductor Co. Ltd. ....	4.987.249	0,61
141.198	Hanon Systems ....	485.192	0,06
31.222	Hanwha Aerospace Co. Ltd. ....	5.659.200	0,69
39.610	Hanwha Corp. ....	772.632	0,10
21.436	Hanwha Corp. (Vorzugsaktien) ....	234.683	0,03
311.987	Hanwha Life Insurance Co. Ltd. ....	679.957	0,08
84.812	Hanwha Ocean Co. Ltd. ....	1.882.315	0,23
93.899	Hanwha Solutions Corp. ....	1.882.755	0,23
38.445	HD Hyundai Co. Ltd. ....	2.080.750	0,26
19.572	HD Hyundai Heavy Industries Co. Ltd. ....	2.213.847	0,27
120.694	HD Hyundai Infracore Co. Ltd. ....	669.889	0,08
18.174	HD HYUNDAI MIPO ....	1.227.884	0,15
39.144	HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd. ....	4.515.850	0,55
26.329	Hite Jinro Co. Ltd. ....	406.459	0,05
30.057	HL Mando Co. Ltd. ....	958.592	0,12
106.248	HLB, Inc. ....	4.515.444	0,55
264.222	HMM Co. Ltd. ....	3.768.019	0,46
28.193	Hotel Shilla Co. Ltd. ....	1.097.817	0,13

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
18.873	HYBE Co. Ltd. ....	2.776.449	0,34
6.058	Hyundai Autoever Corp. ....	723.527	0,09
12.116	Hyundai Department Store Co. Ltd. ....	428.659	0,05
66.172	Hyundai Engineering & Construction Co. Ltd. ....	1.540.728	0,19
16.776	Hyundai Glovis Co. Ltd. ....	2.669.048	0,33
52.891	Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd. ....	1.325.637	0,16
61.512	Hyundai Mobis Co. Ltd. ....	11.238.843	1,38
120.694	Hyundai Motor Co. ....	25.866.131	3,17
20.038	Hyundai Motor Co. (Vorzugsaktien) ....	2.646.501	0,32
31.688	Hyundai Motor Co. (Zweite Vorzugsaktie) ....	4.217.393	0,52
76.424	Hyundai Steel Co. ....	1.612.871	0,20
14.679	Hyundai Wia Corp. ....	617.446	0,08
242.786	Industrial Bank of Korea ....	2.472.837	0,30
301.968	Kakao Corp. ....	8.917.544	1,09
34.251	Kakao Games Corp. ....	510.095	0,06
194.555	KakaoBank Corp. ....	2.869.209	0,35
25.164	Kakaopay Corp. ....	491.763	0,06
92.268	Kangwon Land, Inc. ....	930.389	0,11
306.628	KB Financial Group, Inc. ....	17.486.595	2,14
3.728	KCC Corp. ....	835.516	0,10
18.407	KEPCO Plant Service & Engineering Co. Ltd. ....	507.480	0,06
225.777	Kia Corp. ....	21.208.112	2,60
63.609	Korea Aerospace Industries Ltd. ....	2.449.166	0,30
231.369	Korea Electric Power Corp. ....	3.289.423	0,40
23.533	Korea Gas Corp. ....	892.425	0,11
33.785	Korea Investment Holdings Co. Ltd. ....	1.718.089	0,21
9.786	Korea Zinc Co. Ltd. ....	3.661.308	0,45
167.760	Korean Air Lines Co. Ltd. ....	2.833.578	0,35
32.620	Krafton, Inc. ....	6.670.926	0,82
90.637	KT&G Corp. ....	5.807.616	0,71
30.989	Kum Yang Co. Ltd. ....	1.936.109	0,24
14.912	Kumho Petrochemical Co. Ltd. ....	1.587.074	0,19
22.601	L&F Co. Ltd. ....	2.221.515	0,27
42.872	LG Chem Ltd. ....	10.760.825	1,32
6.757	LG Chem Ltd. (Vorzugsaktien) ....	1.183.027	0,15
79.686	LG Corp. ....	4.665.958	0,57
284.027	LG Display Co. Ltd. ....	2.366.720	0,29
97.627	LG Electronics, Inc. ....	7.865.481	0,96
15.844	LG Electronics, Inc. (Vorzugsaktien) ....	560.554	0,07
36.115	LG Energy Solution Ltd. ....	8.566.326	1,05
8.621	LG H&H Co. Ltd. ....	2.163.862	0,27
1.864	LG H&H Co. Ltd. (Vorzugsaktien) ....	206.509	0,03
12.815	LG Innotek Co. Ltd. ....	2.532.278	0,31
187.565	LG Uplus Corp. ....	1.338.095	0,16
16.077	Lotte Chemical Corp. ....	1.339.653	0,16
3.262	Lotte Chilsung Beverage Co. Ltd. ....	314.707	0,04
22.834	Lotte Corp. ....	418.029	0,05
19.106	Lotte Energy Materials Corp. ....	732.871	0,09
13.048	Lotte Fine Chemical Co. Ltd. ....	421.821	0,05
9.786	Lotte Shopping Co. Ltd. ....	451.443	0,06
15.844	LS Corp. ....	1.656.340	0,20
83.880	Meritz Financial Group, Inc. ....	4.820.129	0,59
241.854	Mirae Asset Securities Co. Ltd. ....	1.286.140	0,16
123.956	NAVER Corp. ....	15.029.609	1,84
14.446	NCSOFT Corp. ....	1.888.002	0,23
20.038	Netmarble Corp. ....	781.722	0,10
119.063	NH Investment & Securities Co. Ltd. ....	1.097.646	0,13

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südkorea: 99,68 % (30. Juni 2023: 99,56 %) (Fortsetzung)</b>		
2.796	NongShim Co. Ltd. ....	993.276	0,12
13.980	OCI Holdings Co. Ltd. ....	898.823	0,11
20.271	Orion Corp. ....	1.357.781	0,17
1.398	Ottogi Corp. ....	439.763	0,05
209.700	Pan Ocean Co. Ltd. ....	652.789	0,08
39.144	Paradise Co. Ltd. ....	400.967	0,05
29.125	Pearl Abyss Corp. ....	934.158	0,11
47.998	Posco DX Co. Ltd. ....	1.337.249	0,16
25.863	POSCO Future M Co. Ltd. ....	4.856.946	0,60
67.803	POSCO Holdings, Inc. ....	17.880.486	2,19
41.707	Posco International Corp. ....	1.981.575	0,24
16.776	S-1 Corp. ....	706.871	0,09
16.077	Samsung Biologics Co. Ltd. ....	8.491.085	1,04
75.492	Samsung C&T Corp. ....	7.787.769	0,95
27.727	Samsung Card Co. Ltd. ....	771.481	0,09
143.528	Samsung E&A Co. Ltd. ....	2.518.127	0,31
50.561	Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd. ....	5.803.587	0,71
3.635.965	Samsung Electronics Co. Ltd. ....	215.278.712	26,39
628.867	Samsung Electronics Co. Ltd. (Vorzugsaktien) ....	29.056.260	3,56
29.824	Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. ....	8.428.286	1,03
2.563	Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. (Vorzugsaktien) ....	518.558	0,06
589.956	Samsung Heavy Industries Co. Ltd. ....	4.007.329	0,49
67.570	Samsung Life Insurance Co. Ltd. ....	4.344.312	0,53
47.532	Samsung SDI Co. Ltd. ....	12.223.994	1,50
1.260	Samsung SDI Co. Ltd. (Vorzugsaktien) ....	200.923	0,03
33.086	Samsung SDS Co. Ltd. ....	3.569.394	0,44
56.852	Samsung Securities Co. Ltd. ....	1.643.814	0,20
36.814	SD Biosensor, Inc. ....	263.435	0,03
24.465	Seegene, Inc. ....	355.467	0,04
451.321	Shinhan Financial Group Co. Ltd. ....	15.787.218	1,94
6.058	Shinsegae, Inc. ....	690.520	0,09
24.931	SK Biopharmaceuticals Co. Ltd. ....	1.403.671	0,17
20.737	SK Bioscience Co. Ltd. ....	792.420	0,10
8.854	SK Chemicals Co. Ltd. ....	313.894	0,04
489.999	SK Hynix, Inc. ....	84.187.987	10,32
23.067	SK IE Technology Co. Ltd. ....	739.015	0,09
54.056	SK Innovation Co. Ltd. ....	4.559.318	0,56
83.181	SK Networks Co. Ltd. ....	290.967	0,04
83.181	SK Square Co. Ltd. ....	6.042.935	0,74
32.154	SK, Inc. ....	3.697.768	0,45
17.009	SKC Co. Ltd. ....	2.083.340	0,26
37.280	S-Oil Corp. ....	1.801.032	0,22
22.368	Solus Advanced Materials Co. Ltd. ....	296.398	0,04
18.174	Wemade Co. Ltd. ....	563.110	0,07
546.851	Woori Financial Group, Inc. ....	5.835.991	0,72
47.299	Yuhan Corp. ....	2.779.869	0,34
		<b>813.220.514</b>	<b>99,68</b>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<b>813.220.514</b>	<b>99,68</b>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<b>813.220.514</b>	<b>99,68</b>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Finanzderivate: 0,00 % (30. Juni 2023: (0.00)%)

Terminkontrakte: 0,00 % (30. Juni 2023: (0.00)%)\*

Nominalwert USD	Durchschnittli- cher Kurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
2.405.719	-	35 Kospi 2 Index Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	50.196	0,00
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten ..</b>	<b>50.196</b>	<b>0,00</b>
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente .....</b>	<b>50.196</b>	<b>0,00</b>
			<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlagenportfolio</b>	813.270.710	99,68
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	2.580.691	0,32
		<b>Nettovermögen</b>	<b>815.851.401</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
		An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....		99,67
		Börsengehandelte Derivate .....		0,01
		Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		0,32
		<b>Gesamtvermögen .....</b>		<b>100,00</b>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. The value of variation margin cash at broker as at 30. Juni 2024 is USD 165,296.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,43 % (30. Juni 2023: 98,69 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,43 % (30. Juni 2023: 98,69 %)</b>		
	<b>Cayman-Inseln: 2,28 % (30. Juni 2023: 2,55 %)</b>		
320	Advanced Energy Solution Holding Co. Ltd. ....	6.224	0,05
1.520	Airtac International Group .....	46.296	0,37
836	Alchip Technologies Ltd. ....	63.264	0,50
15.480	Chailease Holding Co. Ltd. ....	73.245	0,58
760	Parade Technologies Ltd. ....	19.632	0,16
3.600	Silergy Corp. ....	51.268	0,41
6.660	Zhen Ding Technology Holding Ltd. ....	26.585	0,21
		<u>286.514</u>	<u>2,28</u>
	<b>Taiwan: 97,15 % (30. Juni 2023: 96,14 %)</b>		
5.740	Accton Technology Corp. ....	98.198	0,78
32.000	Acer, Inc. ....	46.212	0,37
5.040	Advantech Co. Ltd. ....	57.482	0,46
37.200	ASE Technology Holding Co. Ltd. ....	193.228	1,54
28.000	Asia Cement Corp. ....	37.847	0,30
3.156	Asia Vital Components Co. Ltd. ....	74.421	0,59
415	ASMedia Technology, Inc. ....	28.655	0,23
328	ASPEED Technology, Inc. ....	48.935	0,39
7.760	Asustek Computer, Inc. ....	119.121	0,95
76.000	AUO Corp. ....	41.700	0,33
24.000	Capital Securities Corp. ....	18.569	0,15
6.640	Catcher Technology Co. Ltd. ....	47.485	0,38
101.000	Cathay Financial Holding Co. Ltd. ....	183.685	1,46
76.000	Chang Hwa Commercial Bank Ltd. ....	43.222	0,34
20.000	Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd. ....	30.486	0,24
6.640	Chicony Electronics Co. Ltd. ....	35.000	0,28
32.000	China Airlines Ltd. ....	23.377	0,19
172.000	China Development Financial Holding Corp. ....	80.058	0,64
2.920	China Motor Corp. ....	11.161	0,09
132.000	China Steel Corp. ....	93.991	0,75
41.800	Chunghwa Telecom Co. Ltd. ....	161.703	1,29
44.000	Compal Electronics, Inc. ....	47.063	0,37
200.000	CTBC Financial Holding Co. Ltd. ....	233.343	1,85
23.760	Delta Electronics, Inc. ....	283.803	2,26
8.800	E Ink Holdings, Inc. ....	68.357	0,54
164.000	E.Sun Financial Holding Co. Ltd. ....	144.327	1,15
2.200	Eclat Textile Co. Ltd. ....	35.874	0,28
3.336	Elite Material Co. Ltd. ....	48.845	0,39
744	eMemory Technology, Inc. ....	58.939	0,47
8.000	Ennostar, Inc. ....	10.715	0,08
10.500	Eternal Materials Co. Ltd. ....	10.001	0,08
29.000	Eva Airways Corp. ....	34.103	0,27
11.160	Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd. ....	66.393	0,53
24.000	Far Eastern International Bank .....	12.281	0,10
32.000	Far Eastern New Century Corp. ....	34.770	0,28
19.000	Far EasTone Telecommunications Co. Ltd. ....	49.255	0,39
5.560	Feng TAY Enterprise Co. Ltd. ....	26.565	0,21
120.000	First Financial Holding Co. Ltd. ....	103.941	0,83
37.000	Formosa Chemicals & Fibre Corp. ....	57.482	0,46
15.000	Formosa Petrochemical Corp. ....	29.962	0,24
40.000	Formosa Plastics Corp. ....	70.897	0,56
600	Formosa Sumco Technology Corp. ....	3.218	0,02
12.000	Formosa Taffeta Co. Ltd. ....	8.323	0,07
12.000	Foxconn Technology Co. Ltd. ....	26.374	0,21
85.000	Fubon Financial Holding Co. Ltd. ....	207.774	1,65
880	Genius Electronic Optical Co. Ltd. ....	17.957	0,14
3.400	Giant Manufacturing Co. Ltd. ....	22.218	0,18

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,43 % (30. Juni 2023: 98,69 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,43 % (30. Juni 2023: 98,69 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Taiwan: 97,15 % (30. Juni 2023: 96,14 %) (Fortsetzung)</b>		
5.400	Gigabyte Technology Co. Ltd. ....	50.851	0,40
947	Global Unichip Corp. ....	46.852	0,37
2.560	Globalwafers Co. Ltd. ....	42.533	0,34
3.000	Hiwin Technologies Corp. ....	19.697	0,16
131.200	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. ....	865.460	6,88
3.600	Hotai Motor Co. Ltd. ....	69.023	0,55
8.000	HTC Corp. ....	11.380	0,09
112.000	Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd. ....	91.142	0,72
92.000	Innolux Corp. ....	40.695	0,32
28.000	Inventec Corp. ....	48.161	0,38
1.120	Largan Precision Co. Ltd. ....	94.767	0,75
22.800	Lite-On Technology Corp. ....	74.497	0,59
16.240	MediaTek, Inc. ....	700.831	5,57
125.000	Mega Financial Holding Co. Ltd. ....	155.665	1,24
7.600	Micro-Star International Co. Ltd. ....	41.700	0,33
800	momo.com, Inc. ....	10.591	0,08
56.000	Nan Ya Plastics Corp. ....	85.101	0,68
2.400	Nan Ya Printed Circuit Board Corp. ....	13.760	0,11
12.000	Nanya Technology Corp. ....	25.782	0,20
1.560	Nien Made Enterprise Co. Ltd. ....	18.754	0,15
6.240	Novatek Microelectronics Corp. ....	116.562	0,93
3.600	Oneness Biotech Co. Ltd. ....	18.199	0,14
22.620	Pegatron Corp. ....	72.863	0,58
2.520	PharmaEssentia Corp. ....	43.500	0,35
24.000	Pou Chen Corp. ....	25.893	0,21
32.000	Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp. ....	26.435	0,21
7.600	Powertech Technology, Inc. ....	44.062	0,35
6.240	President Chain Store Corp. ....	52.607	0,42
29.200	Quanta Computer, Inc. ....	280.825	2,23
5.228	Realtek Semiconductor Corp. ....	87.989	0,70
16.000	Ruentex Development Co. Ltd. ....	21.503	0,17
40.000	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. ....	56.779	0,45
148.000	Shin Kong Financial Holding Co. Ltd. ....	44.891	0,36
5.840	Sino-American Silicon Products, Inc. ....	39.154	0,31
128.000	SinoPac Financial Holdings Co. Ltd. ....	100.217	0,80
14.800	Synnex Technology International Corp. ....	33.349	0,26
132.000	Taishin Financial Holding Co. Ltd. ....	76.698	0,61
60.000	Taiwan Business Bank ....	33.661	0,27
75.000	Taiwan Cement Corp. ....	75.903	0,60
116.000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd. ....	92.967	0,74
8.000	Taiwan Fertilizer Co. Ltd. ....	15.856	0,13
14.000	Taiwan Glass Industry Corp. ....	8.350	0,07
24.000	Taiwan High Speed Rail Corp. ....	22.490	0,18
16.760	Taiwan Mobile Co. Ltd. ....	55.279	0,44
3.040	Taiwan Secom Co. Ltd. ....	12.322	0,10
128.920	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	3.838.814	30,52
24.000	Tatung Co. Ltd. ....	42.168	0,33
12.000	Teco Electric & Machinery Co. Ltd. ....	19.789	0,16
3.000	Transcend Information, Inc. ....	10.635	0,08
4.000	U-Ming Marine Transport Corp. ....	6.880	0,05
14.360	Unimicron Technology Corp. ....	79.676	0,63
52.000	Uni-President Enterprises Corp. ....	130.315	1,04
129.000	United Microelectronics Corp. ....	221.485	1,76
9.770	Vanguard International Semiconductor Corp. ....	39.000	0,31
720	Voltronic Power Technology Corp. ....	42.723	0,34
29.000	Walsin Lihwa Corp. ....	31.734	0,25
3.280	Walsin Technology Corp. ....	11.930	0,09

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,43 % (30. Juni 2023: 98,69 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,43 % (30. Juni 2023: 98,69 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Taiwan: 97,15 % (30. Juni 2023: 96,14 %) (Fortsetzung)</b>		
10.400	Wan Hai Lines Ltd. ....	28.403	0,23
4.440	Win Semiconductors Corp. ....	23.882	0,19
36.000	Winbond Electronics Corp. ....	28.519	0,23
30.632	Wistron Corp. ....	100.088	0,80
960	Wiwynn Corp. ....	78.270	0,62
16.000	WPG Holdings Ltd. ....	44.289	0,35
4.280	Yageo Corp. ....	96.309	0,77
20.000	Yang Ming Marine Transport Corp. ....	45.990	0,37
132.000	Yuanta Financial Holding Co. Ltd. ....	130.407	1,04
6.261	Yulon Motor Co. Ltd. ....	12.892	0,10
200	Yulon Nissan Motor Co. Ltd. ....	841	0,01
		<u>12.217.951</u>	<u>97,15</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>12.504.465</u>	<u>99,43</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>12.504.465</u>	<u>99,43</u>

Finanzderivate: 0,00 % (30. Juni 2023: 0,00 %)

Terminkontrakte: 0,00 % (30. Juni 2023: 0,00 %)\*

Nominalwert USD	Durchschnittli- cher Kurs USD		Nicht realisierter Gewinn USD	% des Netto- vermögens
76.970	1.924	1 FTSE Taiwan Index Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im Juli 2024 .....	180	0,00
		<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten</b> ..	180	0,00
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente</b> .....	180	0,00

	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>Anlagenportfolio</b>	12.504.645	99,43
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	71.818	0,57
<b>Nettovermögen</b>	<u>12.576.463</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....	99,19
Börsengehandelte Derivate .....	0,00
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	0,81
<b>Gesamtvermögen</b> .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 3.180 USD.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2023

## Franklin Future of Food UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,86 %</b>		
	<b>Aktien: 99,86 %</b>		
	<b>Australien: 1,01 %</b>		
2.304	GrainCorp Ltd. ....	13.649	0,57
3.413	Nufarm Ltd. ....	10.485	0,44
		<u>24.134</u>	<u>1,01</u>
	<b>Kanada: 3,77 %</b>		
1.761	Nutrien Ltd. ....	89.636	3,77
		<u>89.636</u>	<u>3,77</u>
	<b>Cayman-Inseln: 2,34 %</b>		
19.000	China Mengniu Dairy Co. Ltd. ....	34.070	1,43
814	Consolidated Water Co. Ltd. ....	21.604	0,91
		<u>55.674</u>	<u>2,34</u>
	<b>Finnland: 1,01 %</b>		
599	Huhtamaki OYJ ....	24.048	1,01
		<u>24.048</u>	<u>1,01</u>
	<b>Frankreich: 3,59 %</b>		
1.397	Danone SA ....	85.462	3,59
		<u>85.462</u>	<u>3,59</u>
	<b>Deutschland: 3,65 %</b>		
3.067	Bayer AG ....	86.713	3,65
		<u>86.713</u>	<u>3,65</u>
	<b>Irland: 1,99 %</b>		
618	Pentair PLC ....	47.382	1,99
		<u>47.382</u>	<u>1,99</u>
	<b>Japan: 8,87 %</b>		
5.330	Hitachi Ltd. ....	119.317	5,01
4.100	Kubota Corp. ....	57.348	2,41
543	Kurita Water Industries Ltd. ....	23.018	0,97
1.500	Nippon Kayaku Co. Ltd. ....	11.446	0,48
		<u>211.129</u>	<u>8,87</u>
	<b>Niederlande: 0,53 %</b>		
625	Corbion NV ....	12.546	0,53
		<u>12.546</u>	<u>0,53</u>
	<b>Norwegen: 5,44 %</b>		
868	Austevoll Seafood ASA ....	6.750	0,28
3.144	Leroy Seafood Group ASA ....	12.774	0,54
2.567	Mowi ASA ....	42.842	1,80
748	Salmar ASA ....	39.481	1,66
956	Yara International ASA ....	27.618	1,16
		<u>129.465</u>	<u>5,44</u>
	<b>Schweden: 1,12 %</b>		
2.868	Billerud Aktiebolag ....	26.567	1,12
		<u>26.567</u>	<u>1,12</u>
	<b>Schweiz: 3,99 %</b>		
58	Bucher Industries AG ....	23.365	0,98
632	DSM-Firmenich AG ....	71.528	3,01
		<u>94.893</u>	<u>3,99</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 11,84 %</b>		
702	Croda International PLC ....	35.035	1,47
1.551	Pennon Group PLC ....	11.244	0,47
1.237	Reckitt Benckiser Group PLC ....	66.957	2,81
1.129	Severn Trent PLC ....	33.967	1,43

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Future of Food UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,86 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,86 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 11,84 % (Fortsetzung)</b>		
1.931	Unilever PLC .....	106.060	4,46
2.292	United Utilities Group PLC .....	28.469	1,20
		<u>281.732</u>	<u>11,84</u>
	<b>USA: 50,71 %</b>		
457	A O Smith Corp. ....	37.373	1,57
393	AGCO Corp. ....	38.467	1,62
154	American States Water Co. ....	11.176	0,47
711	American Water Works Co., Inc. ....	91.833	3,86
261	Badger Meter, Inc. ....	48.637	2,04
633	California Water Service Group .....	30.694	1,29
432	Clorox Co. ....	58.955	2,48
255	Deere & Co. ....	95.276	4,00
1.742	Dow, Inc. ....	92.413	3,88
1.340	DuPont de Nemours, Inc. ....	107.857	4,53
334	Ecolab, Inc. ....	79.492	3,34
1.859	Energy Recovery, Inc. ....	24.706	1,04
724	Essential Utilities, Inc. ....	27.027	1,14
895	FMC Corp. ....	51.507	2,17
1.484	Green Plains, Inc. ....	23.536	0,99
487	Greif, Inc. ....	27.988	1,18
391	John Bean Technologies Corp. ....	37.133	1,56
1.759	Mosaic Co. ....	50.835	2,14
1.123	Sysco Corp. ....	80.171	3,37
875	Titan Machinery, Inc. ....	13.913	0,58
2.066	United Natural Foods, Inc. ....	27.065	1,14
177	Watts Water Technologies, Inc. ....	32.456	1,36
714	Xylem, Inc. ....	96.840	4,07
722	Zurn Elkay Water Solutions Corp. ....	21.227	0,89
		<u>1.206.577</u>	<u>50,71</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>2.375.958</u>	<u>99,86</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>2.375.958</u>	<u>99,86</u>
		<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	2.375.958	99,86
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>3.244</u>	<u>0,14</u>
	<b>Nettovermögen</b>	<u><u>2.379.202</u></u>	<u><u>100,00</u></u>
			<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
	An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....		99,79
	Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		<u>0,21</u>
	Gesamtvermögen .....		<u><u>100,00</u></u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2023

## Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,91 %</b>		
	<b>Aktien: 99,91 %</b>		
	<b>Australien: 2,87 %</b>		
114	Cochlear Ltd. ....	25.288	0,97
313	Pro Medicus Ltd. ....	29.947	1,14
1.136	Sonic Healthcare Ltd. ....	19.953	0,76
		<u>75.188</u>	<u>2,87</u>
	<b>Belgien: 0,18 %</b>		
424	Barco NV ....	4.708	0,18
		<u>4.708</u>	<u>0,18</u>
	<b>Bermuda: 0,55 %</b>		
36.000	Alibaba Health Information Technology Ltd. ....	14.433	0,55
		<u>14.433</u>	<u>0,55</u>
	<b>Kanada: 0,46 %</b>		
74	Novanta, Inc. ....	12.070	0,46
		<u>12.070</u>	<u>0,46</u>
	<b>Cayman-Inseln: 0,27 %</b>		
2.000	HUTCHMED China Ltd. ....	7.045	0,27
		<u>7.045</u>	<u>0,27</u>
	<b>Dänemark: 5,39 %</b>		
250	Demant AS ....	10.829	0,41
52	Genmab AS ....	13.041	0,50
581	GN Store Nord AS ....	16.207	0,62
700	Novo Nordisk AS ....	101.164	3,86
		<u>141.241</u>	<u>5,39</u>
	<b>Frankreich: 4,34 %</b>		
125	L'Oreal SA ....	54.934	2,10
609	Sanofi SA ....	58.703	2,24
		<u>113.637</u>	<u>4,34</u>
	<b>Deutschland: 4,25 %</b>		
147	adidas AG ....	35.133	1,34
784	Bayer AG ....	22.166	0,85
188	BioNTech SE ADR ....	15.162	0,58
289	Eckert & Ziegler SE ....	14.204	0,54
427	Siemens Healthineers AG ....	24.621	0,94
		<u>111.286</u>	<u>4,25</u>
	<b>Irland: 2,23 %</b>		
742	Medtronic PLC ....	58.403	2,23
		<u>58.403</u>	<u>2,23</u>
	<b>Italien: 0,46 %</b>		
1.180	Technogym SpA ....	12.166	0,46
		<u>12.166</u>	<u>0,46</u>
	<b>Japan: 2,30 %</b>		
862	Canon, Inc. ....	23.332	0,89
686	Nihon Kohden Corp. ....	9.911	0,38
488	Omron Corp. ....	16.773	0,64
800	SMS Co. Ltd. ....	10.155	0,39
		<u>60.171</u>	<u>2,30</u>
	<b>Niederlande: 0,50 %</b>		
316	Qiagen NV ....	12.984	0,50
		<u>12.984</u>	<u>0,50</u>
	<b>Neuseeland: 0,43 %</b>		
581	EBOS Group Ltd. ....	11.407	0,43
		<u>11.407</u>	<u>0,43</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,91 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,91 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Spanien: 1,09 %</b>		
642	Fluidra SA .....	13.410	0,51
163	Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA .....	15.295	0,58
		<u>28.705</u>	<u>1,09</u>
	<b>Schweiz: 6,09 %</b>		
348	Alcon, Inc. ....	31.067	1,19
48	Lonza Group AG .....	26.195	1,00
275	Roche Holding AG .....	76.355	2,91
84	Sonova Holding AG .....	25.950	0,99
		<u>159.567</u>	<u>6,09</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 4,66 %</b>		
669	AstraZeneca PLC .....	104.493	3,99
1.416	Smith & Nephew PLC .....	17.552	0,67
		<u>122.045</u>	<u>4,66</u>
	<b>USA: 63,84 %</b>		
651	2seventy bio, Inc. ....	2.506	0,10
757	Abbott Laboratories .....	78.660	3,00
456	AbbVie, Inc. ....	78.213	2,98
2.181	AdaptHealth Corp. ....	21.810	0,83
3.262	Adaptive Biotechnologies Corp. ....	11.808	0,45
1.764	Alector, Inc. ....	8.009	0,31
213	Amedisys, Inc. ....	19.553	0,75
186	Axonics, Inc. ....	12.505	0,48
513	Beam Therapeutics, Inc. ....	12.020	0,46
108	Biogen, Inc. ....	25.037	0,96
811	Boston Scientific Corp. ....	62.455	2,38
1.067	Bristol-Myers Squibb Co. ....	44.313	1,69
3.011	Brookdale Senior Living, Inc. ....	20.565	0,78
2.726	Caribou Biosciences, Inc. ....	4.471	0,17
3.727	Community Health Systems, Inc. ....	12.523	0,48
155	CONMED Corp. ....	10.745	0,41
327	Dexcom, Inc. ....	37.075	1,41
5.358	DocGo, Inc. ....	16.556	0,63
542	Doximity, Inc. ....	15.160	0,58
2.507	Editas Medicine, Inc. ....	11.708	0,45
444	Edwards Lifesciences Corp. ....	41.012	1,56
110	Elevance Health, Inc. ....	59.605	2,27
117	Eli Lilly & Co. ....	105.929	4,04
929	Fate Therapeutics, Inc. ....	3.047	0,12
380	Globus Medical, Inc. ....	26.026	0,99
30	GRAIL, Inc. ....	461	0,02
138	HCA Healthcare, Inc. ....	44.337	1,69
1.975	Healthcare Services Group, Inc. ....	20.896	0,80
326	Hologic, Inc. ....	24.205	0,92
58	IDEXX Laboratories, Inc. ....	28.258	1,08
183	Illumina, Inc. ....	19.102	0,73
118	Insulet Corp. ....	23.812	0,91
756	Intellia Therapeutics, Inc. ....	16.919	0,65
189	Intuitive Surgical, Inc. ....	84.077	3,21
160	iRhythm Technologies, Inc. ....	17.222	0,66
87	MacroGenics, Inc. ....	370	0,01
510	Maravai LifeSciences Holdings, Inc. ....	3.652	0,14
112	Masimo Corp. ....	14.105	0,54
660	Merck & Co., Inc. ....	81.708	3,12
132	Merit Medical Systems, Inc. ....	11.345	0,43
237	Moderna, Inc. ....	28.144	1,07

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,91 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,91 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 63,84 % (Fortsetzung)</b>		
2.577	Pfizer, Inc. ....	72.104	2,75
158	Planet Fitness, Inc. ....	11.627	0,44
49	Regeneron Pharmaceuticals, Inc. ....	51.500	1,96
145	ResMed, Inc. ....	27.756	1,06
94	Revvity, Inc. ....	9.857	0,38
835	Select Medical Holdings Corp. ....	29.275	1,12
1.820	Sleep Number Corp. ....	17.417	0,66
195	Stryker Corp. ....	66.349	2,53
812	Tandem Diabetes Care, Inc. ....	32.715	1,25
218	Tenet Healthcare Corp. ....	29.001	1,11
137	Thermo Fisher Scientific, Inc. ....	75.761	2,89
1.245	Udemy, Inc. ....	10.744	0,41
125	Vertex Pharmaceuticals, Inc. ....	58.590	2,24
189	Zimmer Biomet Holdings, Inc. ....	20.512	0,78
		<u>1.673.132</u>	<u>63,84</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>2.618.188</u>	<u>99,91</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>2.618.188</u>	<u>99,91</u>
		<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	2.618.188	99,91
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	2.414	0,09
	<b>Nettovermögen</b>	<u>2.620.602</u>	<u>100,00</u>
			<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
	An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....		99,88
	Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		0,12
	Gesamtvermögen .....		<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %)</b>		
	<b>Australien: 1,73 % (30. Juni 2023: 3,54 %)</b>		
795	Ampol Ltd. ....	17.170	0,09
1.650	BlueScope Steel Ltd. ....	22.513	0,11
12.090	Brambles Ltd. ....	117.320	0,61
215	Cochlear Ltd. ....	47.693	0,25
23.830	Pilbara Minerals Ltd. ....	48.859	0,25
6.950	Suncorp Group Ltd. ....	80.809	0,42
		<u>334.364</u>	<u>1,73</u>
	<b>Österreich: 0,21 % (30. Juni 2023: 0,11 %)</b>		
515	Verbund AG ....	40.651	0,21
		<u>40.651</u>	<u>0,21</u>
	<b>Belgien: 0,12 % (30. Juni 2023: Nil)</b>		
525	Ageas SA ....	24.015	0,12
		<u>24.015</u>	<u>0,12</u>
	<b>Bermuda: 0,09 % (30. Juni 2023: 0,27 %)</b>		
5.000	China Resources Gas Group Ltd. ....	17.515	0,09
		<u>17.515</u>	<u>0,09</u>
	<b>Brasilien: 0,59 % (30. Juni 2023: 0,61 %)</b>		
18.500	Cia Energetica de Minas Gerais ....	32.940	0,17
1.000	CPFL Energia SA ....	5.893	0,03
1.000	Engie Brasil Energia SA ....	7.974	0,04
5.500	Lojas Renner SA ....	12.358	0,07
3.000	Telefonica Brasil SA ....	24.488	0,13
7.000	TIM SA ....	20.013	0,10
2.500	Ultrapar Participacoes SA ....	9.722	0,05
		<u>113.388</u>	<u>0,59</u>
	<b>Kanada: 8,08 % (30. Juni 2023: 9,21 %)</b>		
2.790	Agnico Eagle Mines Ltd. ....	182.445	0,94
4.030	Bank of Nova Scotia ....	184.308	0,95
1.550	Canadian National Railway Co. ....	183.121	0,95
320	Canadian Tire Corp. Ltd. ....	31.744	0,17
1.950	Dollarama, Inc. ....	178.006	0,92
1.095	Gildan Activewear, Inc. ....	41.524	0,22
1.440	Metro, Inc. ....	79.759	0,41
3.310	Nutrien Ltd. ....	168.481	0,87
3.725	Pembina Pipeline Corp. ....	138.182	0,72
950	RioCan Real Estate Investment Trust ....	11.671	0,06
1.315	Saputo, Inc. ....	29.522	0,15
2.930	Sun Life Financial, Inc. ....	143.636	0,74
3.435	Toronto-Dominion Bank ....	188.776	0,98
		<u>1.561.175</u>	<u>8,08</u>
	<b>Cayman-Inseln: 1,50 % (30. Juni 2023: 1,11 %)</b>		
20.000	Bosideng International Holdings Ltd. ....	12.475	0,06
2.500	ENN Energy Holdings Ltd. ....	20.606	0,11
4.000	Li Auto, Inc. ....	36.017	0,19
9.500	NetEase, Inc. ....	181.424	0,94
2.550	Vipshop Holdings Ltd. ADR ....	33.201	0,17
5.500	Yadea Group Holdings Ltd. ....	6.953	0,03
		<u>290.676</u>	<u>1,50</u>
	<b>Chile: 0,42 % (30. Juni 2023: 0,64 %)</b>		
1.915	Empresas Copec SA ....	14.708	0,08
137.580	Enel Americas SA ....	12.768	0,07
1.320	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ....	53.178	0,27
		<u>80.654</u>	<u>0,42</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 1,61 % (30. Juni 2023: 0,22 %)</b>		
500	37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co. Ltd. ....	894	0,01
21.500	Agricultural Bank of China Ltd. Anteilsklasse A .....	12.840	0,07
110.000	Agricultural Bank of China Ltd. Anteilsklasse H .....	47.058	0,24
500	Ganfeng Lithium Group Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	1.962	0,01
2.000	Ganfeng Lithium Group Co. Ltd. Anteilsklasse H .....	3.899	0,02
16.500	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Anteilsklasse A .....	12.882	0,07
255.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Anteilsklasse H .....	151.548	0,78
5.500	Industrial Bank Co. Ltd. ....	13.274	0,07
1.500	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd. ....	5.309	0,03
14.000	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. ....	6.670	0,03
4.500	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. ....	6.767	0,04
300	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd. ....	11.954	0,06
10.000	Sinopharm Group Co. Ltd. ....	26.577	0,14
1.000	WuXi AppTec Co. Ltd. ....	3.740	0,02
500	WuXi AppTec Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	2.684	0,01
1.000	Zhejiang Weixing New Building Materials Co. Ltd. ....	2.112	0,01
		<u>310.170</u>	<u>1,61</u>
	<b>Colombia: 0,04 % (30. Juni 2023: Nil)</b>		
1.555	Interconexion Electrica SA ESP .....	6.829	0,04
		<u>6.829</u>	<u>0,04</u>
	<b>Czech Republic: 0,10 % (30. Juni 2023: 0,04 %)</b>		
270	Komerční Banka AS .....	9.041	0,05
2.130	Moneta Money Bank AS .....	9.315	0,05
		<u>18.356</u>	<u>0,10</u>
	<b>Dänemark: 1,66 % (30. Juni 2023: 2,01 %)</b>		
1.450	Novo Nordisk AS .....	209.554	1,08
735	Pandora AS .....	111.018	0,58
		<u>320.572</u>	<u>1,66</u>
	<b>Finnland: 1,14 % (30. Juni 2023: 1,11 %)</b>		
995	Elisa OYJ .....	45.684	0,24
1.610	Kesko OYJ .....	28.281	0,14
1.745	Neste OYJ .....	31.092	0,16
3.300	UPM-Kymmene OYJ .....	115.370	0,60
		<u>220.427</u>	<u>1,14</u>
	<b>Frankreich: 2,44 % (30. Juni 2023: 3,00 %)</b>		
4.770	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA .....	184.603	0,95
7.590	Credit Agricole SA .....	103.635	0,54
80	Hermes International SCA .....	183.484	0,95
		<u>471.722</u>	<u>2,44</u>
	<b>Deutschland: 0,70 % (30. Juni 2023: 1,57 %)</b>		
970	Henkel AG & Co. KGaA (Vorzugsaktien) .....	86.515	0,45
620	Henkel AG & Co. KGaA Anteilsklasse A .....	48.807	0,25
		<u>135.322</u>	<u>0,70</u>
	<b>Griechenland: 0,33 % (30. Juni 2023: 0,22 %)</b>		
1.565	Hellenic Telecommunications Organization SA .....	22.543	0,12
590	Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA .....	14.822	0,08
705	Mytilineos SA .....	26.339	0,13
		<u>63.704</u>	<u>0,33</u>
	<b>Hongkong: 0,79 % (30. Juni 2023: 1,39 %)</b>		
60.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd. ....	47.801	0,25
4.500	Hang Seng Bank Ltd. ....	57.868	0,30

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Hongkong: 0,79 % (30. Juni 2023: 1,39 %) (Fortsetzung)</b>		
24.000	Sino Land Co. Ltd. ....	24.746	0,13
2.500	Swire Pacific Ltd. ....	22.094	0,11
		<u>152.509</u>	<u>0,79</u>
	<b>Hungary: 0,14 % (30. Juni 2023: 0,08 %)</b>		
1.070	Richter Gedeon Nyrt. ....	27.818	0,14
		<u>27.818</u>	<u>0,14</u>
	<b>Indien: 2,11 % (30. Juni 2023: 1,54 %)</b>		
1.240	Asian Paints Ltd. ....	43.378	0,22
785	Britannia Industries Ltd. ....	51.546	0,27
3.400	Dabur India Ltd. ....	24.495	0,13
495	Eicher Motors Ltd. ....	27.739	0,14
860	Hero MotoCorp Ltd. ....	57.544	0,30
5.015	Hindustan Unilever Ltd. ....	148.731	0,77
3.665	Marico Ltd. ....	26.942	0,14
245	PI Industries Ltd. ....	11.161	0,06
230	Supreme Industries Ltd. ....	16.428	0,08
		<u>407.964</u>	<u>2,11</u>
	<b>Indonesien 0,06 % (30. Juni 2023: 0,11 %)</b>		
124.000	Kalbe Farma Tbk. PT. ....	11.548	0,06
		<u>11.548</u>	<u>0,06</u>
	<b>Irland: 1,35 % (30. Juni 2023: 0,44 %)</b>		
2.295	CRH PLC. ....	172.079	0,89
2.835	James Hardie Industries PLC. ....	89.556	0,46
		<u>261.635</u>	<u>1,35</u>
	<b>Italien: 1,30 % (30. Juni 2023: 0,82 %)</b>		
5.615	Assicurazioni Generali SpA. ....	140.156	0,72
2.890	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA. ....	42.405	0,22
1.125	Moncler SpA. ....	68.798	0,36
		<u>251.359</u>	<u>1,30</u>
	<b>Japan: 9,00 % (30. Juni 2023: 9,27 %)</b>		
3.200	Bridgestone Corp. ....	125.764	0,65
1.400	Brother Industries Ltd. ....	24.639	0,13
3.500	Concordia Financial Group Ltd. ....	20.587	0,11
2.000	JFE Holdings, Inc. ....	28.789	0,15
7.000	KDDI Corp. ....	185.117	0,96
2.000	MatsukiyoCocokara & Co. ....	28.721	0,15
4.500	Mitsubishi Chemical Group Corp. ....	24.984	0,13
4.200	Mitsubishi Estate Co. Ltd. ....	65.796	0,34
1.000	Mitsui Chemicals, Inc. ....	27.602	0,14
1.064	Nitto Denko Corp. ....	84.070	0,43
2.100	Nomura Research Institute Ltd. ....	59.021	0,31
7.700	ORIX Corp. ....	170.026	0,88
8.000	Renesas Electronics Corp. ....	149.646	0,77
1.500	Seiko Epson Corp. ....	23.303	0,12
2.200	Sekisui House Ltd. ....	48.729	0,25
2.500	SG Holdings Co. Ltd. ....	23.040	0,12
16.000	SoftBank Corp. ....	195.400	1,01
6.500	Sompo Holdings, Inc. ....	138.801	0,72
3.100	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. ....	206.686	1,07
6.900	Yamaha Motor Co. Ltd. ....	63.870	0,33
800	Yokogawa Electric Corp. ....	19.346	0,10
1.000	ZOZO, Inc. ....	25.040	0,13
		<u>1.738.977</u>	<u>9,00</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Jersey: 0,93 % (30. Juni 2023: 0,61 %)</b>		
925	Ferguson PLC .....	179.126	0,93
		<u>179.126</u>	<u>0,93</u>
	<b>Malaysia: 0,25 % (30. Juni 2023: 0,57 %)</b>		
14.500	MR DIY Group M Bhd. ....	5.963	0,03
500	Nestle Malaysia Bhd. ....	12.877	0,07
2.000	Petronas Dagangan Bhd. ....	7.394	0,04
4.000	PPB Group Bhd. ....	12.128	0,06
17.000	Sime Darby Bhd. ....	9.441	0,05
		<u>47.803</u>	<u>0,25</u>
	<b>Mexiko: 0,74 % (30. Juni 2023: 0,88 %)</b>		
1.170	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV .....	35.243	0,18
13.925	Grupo Financiero Banorte SAB de CV .....	108.564	0,56
		<u>143.807</u>	<u>0,74</u>
	<b>Niederlande: 2,34 % (30. Juni 2023: 2,37 %)</b>		
3.340	Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	98.762	0,51
13.035	Koninklijke KPN NV .....	50.014	0,26
910	LyondellBasell Industries NV .....	87.051	0,45
1.955	NEPI Rockcastle NV .....	14.065	0,07
1.225	Wolters Kluwer NV .....	203.236	1,05
		<u>453.128</u>	<u>2,34</u>
	<b>Norwegen: 0,22 % (30. Juni 2023: 0,55 %)</b>		
5.200	Orkla ASA .....	42.367	0,22
		<u>42.367</u>	<u>0,22</u>
	<b>Polen: 0,18 % (30. Juni 2023: Nil)</b>		
90	Budimex SA .....	15.604	0,08
135	Santander Bank Polska SA .....	18.175	0,10
		<u>33.779</u>	<u>0,18</u>
	<b>Qatar: 0,09 % (30. Juni 2023: 0,12 %)</b>		
4.465	Qatar Fuel QSC .....	18.260	0,09
		<u>18.260</u>	<u>0,09</u>
	<b>Russia: Null (30. Juni 2023: Nil)</b>		
9	PhosAgro PJSC Depositary Receipts .....	-	0,00
447	PhosAgro PJSC GDR .....	-	0,00
1	PhosAgro PJSC GDR Reg S .....	-	0,00
357	Polyus PJSC .....	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	<b>Singapur: 0,38 % (30. Juni 2023: Nil)</b>		
20.000	CapitaLand Ascendas REIT .....	37.779	0,20
24.000	CapitaLand Integrated Commercial Trust .....	35.064	0,18
		<u>72.843</u>	<u>0,38</u>
	<b>Südafrika: 2,02 % (30. Juni 2023: 2,07 %)</b>		
4.475	Absa Group Ltd. ....	38.832	0,20
455	Anglo American Platinum Ltd. ....	14.994	0,08
295	Capitec Bank Holdings Ltd. ....	42.473	0,22
1.720	Clicks Group Ltd. ....	32.437	0,17
6.700	Gold Fields Ltd. ....	100.324	0,52
6.460	Impala Platinum Holdings Ltd. ....	32.112	0,16
700	Kumba Iron Ore Ltd. ....	16.853	0,09
24.970	Old Mutual Ltd. ....	16.943	0,09
4.350	Standard Bank Group Ltd. ....	50.220	0,26

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Südafrika: 2,02 % (30. Juni 2023: 2,07 %) (Fortsetzung)</b>		
4.850	Vodacom Group Ltd. ....	25.899	0,13
5.830	Woolworths Holdings Ltd. ....	19.730	0,10
		<u>390.817</u>	<u>2,02</u>
	<b>Südkorea: 2,63 % (30. Juni 2023: 1,98 %)</b>		
395	Coway Co. Ltd. ....	18.423	0,10
2.275	Hana Financial Group, Inc. ....	100.322	0,52
2.705	KB Financial Group, Inc. ....	154.263	0,80
660	LG Corp. ....	38.646	0,20
705	Samsung E&A Co. Ltd. ....	12.369	0,06
3.290	Shinhan Financial Group Co. Ltd. ....	115.084	0,60
210	SK Telecom Co. Ltd. ....	7.857	0,04
270	S-Oil Corp. ....	13.044	0,07
4.440	Woori Financial Group, Inc. ....	47.384	0,24
		<u>507.392</u>	<u>2,63</u>
	<b>Spanien: 0,25 % (30. Juni 2023: 0,29 %)</b>		
2.775	Redeia Corp. SA ....	48.538	0,25
		<u>48.538</u>	<u>0,25</u>
	<b>Schweden: 0,76 % (30. Juni 2023: 0,47 %)</b>		
2.020	Boliden AB ....	64.681	0,34
5.305	Svenska Handelsbanken AB ....	50.569	0,26
3.120	Tele2 AB ....	31.435	0,16
		<u>146.685</u>	<u>0,76</u>
	<b>Schweiz: 3,56 % (30. Juni 2023: 2,28 %)</b>		
605	Bunge Global SA ....	64.596	0,34
760	Coca-Cola HBC AG ....	25.920	0,13
385	Kuehne & Nagel International AG ....	110.710	0,57
960	SGS SA ....	85.466	0,44
1.620	Swiss Re AG ....	201.013	1,04
375	Zurich Insurance Group AG ....	199.936	1,04
		<u>687.641</u>	<u>3,56</u>
	<b>Taiwan: 2,23 % (30. Juni 2023: 2,74 %)</b>		
26.000	Chunghwa Telecom Co. Ltd. ....	100.581	0,52
10.000	Eva Airways Corp. ....	11.760	0,06
10.000	Far EasTone Telecommunications Co. Ltd. ....	25.923	0,13
55.000	SinoPac Financial Holdings Co. Ltd. ....	43.062	0,22
7.500	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	223.325	1,16
450	Voltronic Power Technology Corp. ....	26.702	0,14
		<u>431.353</u>	<u>2,23</u>
	<b>Thailand: 0,81 % (30. Juni 2023: 0,90 %)</b>		
8.500	Advanced Info Service PCL NVDR ....	48.409	0,25
33.500	Bangkok Dusit Medical Services PCL ....	24.191	0,13
35.500	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR ....	25.877	0,13
13.500	Central Pattana PCL NVDR ....	20.325	0,10
34.000	Home Product Center PCL NVDR ....	8.570	0,04
9.500	Intouch Holdings PCL NVDR ....	18.510	0,10
7.500	Thai Oil PCL NVDR ....	10.832	0,06
		<u>156.714</u>	<u>0,81</u>
	<b>Türkei: 0,14 % (30. Juni 2023: 0,05 %)</b>		
26.890	Yapi ve Kredi Bankasi AS ....	27.724	0,14
		<u>27.724</u>	<u>0,14</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 5,98 % (30. Juni 2023: 5,64 %)</b>		
3.505	3i Group PLC ....	135.844	0,70
1.760	Admiral Group PLC ....	58.179	0,30

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 5,98 % (30. Juni 2023: 5,64 %) (Fortsetzung)</b>		
7.590	Barratt Developments PLC .....	45.305	0,23
665	Berkeley Group Holdings PLC .....	38.568	0,20
2.480	Burberry Group PLC .....	27.519	0,14
880	Intertek Group PLC .....	53.329	0,28
8.595	J Sainsbury PLC .....	27.706	0,14
13.515	Kingfisher PLC .....	42.506	0,22
3.295	Land Securities Group PLC .....	25.811	0,13
3.310	Mondi PLC .....	63.545	0,33
3.625	Pearson PLC .....	45.402	0,24
4.435	RELX PLC .....	204.012	1,06
6.455	SSE PLC .....	146.019	0,76
24.970	Taylor Wimpey PLC .....	44.869	0,23
3.595	Unilever PLC .....	197.456	1,02
		<u>1.156.070</u>	<u>5,98</u>
	<b>USA: 40,74 % (30. Juni 2023: 40,70 %)</b>		
405	Adobe, Inc. ....	224.994	1,16
620	Amgen, Inc. ....	193.719	1,00
890	Applied Materials, Inc. ....	210.031	1,09
3.310	Bank of New York Mellon Corp. ....	198.236	1,03
1.390	Best Buy Co., Inc. ....	117.163	0,61
1.150	Cheniere Energy, Inc. ....	201.054	1,04
585	Cigna Group .....	193.383	1,00
910	Clorox Co. ....	124.188	0,64
3.110	Coca-Cola Co. ....	197.951	1,02
3.245	Conagra Brands, Inc. ....	92.223	0,48
1.875	Consolidated Edison, Inc. ....	167.663	0,87
685	Cummins, Inc. ....	189.697	0,98
160	Deckers Outdoor Corp. ....	154.872	0,80
200	Dick's Sporting Goods, Inc. ....	42.970	0,22
1.180	DR Horton, Inc. ....	166.297	0,86
1.530	Electronic Arts, Inc. ....	213.175	1,10
160	EMCOR Group, Inc. ....	58.413	0,30
1.045	Expeditors International of Washington, Inc. ....	130.406	0,68
255	FactSet Research Systems, Inc. ....	104.109	0,54
1.560	Fox Corp. Anteilsklasse A .....	53.617	0,28
920	Fox Corp. Anteilsklasse B .....	29.458	0,15
2.775	General Mills, Inc. ....	175.547	0,91
985	Graco, Inc. ....	78.091	0,40
1.030	Hartford Financial Services Group, Inc. ....	103.556	0,54
585	Home Depot, Inc. ....	201.380	1,04
785	Illinois Tool Works, Inc. ....	186.014	0,96
1.895	International Paper Co. ....	81.769	0,42
2.250	Interpublic Group of Co., Inc. ....	65.453	0,34
1.925	Iron Mountain, Inc. ....	172.519	0,89
410	JB Hunt Transport Services, Inc. ....	65.600	0,34
1.700	Kellanova .....	98.056	0,51
205	Lam Research Corp. ....	218.294	1,13
170	Lennox International, Inc. ....	90.947	0,47
1.560	LKQ Corp. ....	64.880	0,34
190	MarketAxess Holdings, Inc. ....	38.101	0,20
930	Marsh & McLennan Co., Inc. ....	195.970	1,01
475	Moody's Corp. ....	199.942	1,03
2.055	NVIDIA Corp. ....	253.875	1,31
1.115	Old Dominion Freight Line, Inc. ....	196.909	1,02
640	Owens Corning .....	111.181	0,58
1.080	PepsiCo, Inc. ....	178.124	0,92

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,76 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 40,74 % (30. Juni 2023: 40,70 %) (Fortsetzung)</b>		
1.355	Phillips 66 .....	191.285	0,99
935	Progressive Corp. ....	194.209	1,01
710	Quest Diagnostics, Inc. ....	97.185	0,50
680	Solventum Corp. ....	35.958	0,19
585	Steel Dynamics, Inc. ....	75.758	0,39
1.370	Synchrony Financial .....	64.650	0,33
985	Texas Instruments, Inc. ....	191.612	0,99
625	Tractor Supply Co. ....	168.750	0,87
905	Travelers Co., Inc. ....	184.023	0,95
160	Ulta Beauty, Inc. ....	61.739	0,32
1.205	Valero Energy Corp. ....	188.896	0,98
4.935	Verizon Communications, Inc. ....	203.519	1,05
355	West Pharmaceutical Services, Inc. ....	116.933	0,61
265	Williams-Sonoma, Inc. ....	74.828	0,39
205	WW Grainger, Inc. ....	184.959	0,96
		<u>7.874.131</u>	<u>40,74</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>19.279.528</u>	<u>99,76</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>19.279.528</u>	<u>99,76</u>

Finanzderivate: (0,00) % (30. Juni 2023: 0,00 %)

Terminkontrakte: (0,00) % (30. Juni 2023: 0,00 %)\*

Nominalwert USD	Durchschnittli- cher Kurs USD		Unrealised Loss USD	% des Netto- vermögens
44.241	442	1 MSCI ACWI Long-Termionkontrakt mit Fälligkeit im September 2024 .....	(241)	(0,00)
		<b>Net unrealised loss on futures contracts</b> .....	<u>(241)</u>	<u>(0,00)</u>
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente</b> .....	<u>(241)</u>	<u>(0,00)</u>

	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>Anlagenportfolio</b>	19.279.287	99,76
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	46.262	0,24
<b>Nettovermögen</b>	<u>19.325.549</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	99,48
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	0,52
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers beläuft sich zum 30. Juni 2024 auf 2.551 USD.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,90 % (30. Juni 2023: 99,88 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,90 % (30. Juni 2023: 99,88 %)</b>		
	<b>Australien: 3,21 % (30. Juni 2023: 6,64 %)</b>		
11.634	Commonwealth Bank of Australia .....	989.713	2,10
11.900	Computershare Ltd. ....	209.335	0,44
10.612	Sonic Healthcare Ltd. ....	186.394	0,40
52.584	Telstra Group Ltd. ....	127.128	0,27
		<u>1.512.570</u>	<u>3,21</u>
	<b>Brasilien: 0,08 % (30. Juni 2023: Nil)</b>		
22.400	Cia Energetica de Minas Gerais .....	39.884	0,08
		<u>39.884</u>	<u>0,08</u>
	<b>Kanada: 2,01 % (30. Juni 2023: 5,46 %)</b>		
1.134	iA Financial Corp., Inc. ....	71.196	0,15
1.960	IGM Financial, Inc. ....	54.101	0,12
3.864	Imperial Oil Ltd. ....	263.408	0,56
11.340	Sun Life Financial, Inc. ....	555.916	1,18
		<u>944.621</u>	<u>2,01</u>
	<b>Cayman-Inseln: 0,40 % (30. Juni 2023: 1,00 %)</b>		
56.000	Bosideng International Holdings Ltd. ....	34.931	0,07
57.000	SITC International Holdings Co. Ltd. ....	154.776	0,33
		<u>189.707</u>	<u>0,40</u>
	<b>China: 0,40 % (30. Juni 2023: 0,24 %)</b>		
2.800	Bank of Chengdu Co. Ltd. ....	5.826	0,01
4.200	Bank of Hangzhou Co. Ltd. ....	7.507	0,02
12.600	Bank of Nanjing Co. Ltd. ....	17.931	0,04
22.400	China Merchants Bank Co. Ltd. ....	104.900	0,22
1.400	Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp. Ltd. ....	4.046	0,01
112.000	People's Insurance Co. Group of China Ltd. Anteilsklasse H .....	38.446	0,08
4.200	Tongwei Co. Ltd. ....	10.993	0,02
		<u>189.649</u>	<u>0,40</u>
	<b>Dänemark: Null (30. Juni 2023: 0,43 %)</b>		
	<b>Finnland: 1,27 % (30. Juni 2023: 1,17 %)</b>		
3.948	Elisa OYJ .....	181.268	0,38
8.484	Kone OYJ .....	419.084	0,89
		<u>600.352</u>	<u>1,27</u>
	<b>Deutschland: 2,71 % (30. Juni 2023: 2,70 %)</b>		
3.248	Allianz SE .....	903.331	1,92
1.470	Hannover Rueck SE .....	372.915	0,79
		<u>1.276.246</u>	<u>2,71</u>
	<b>Griechenland: 0,30 % (30. Juni 2023: 0,17 %)</b>		
5.740	Hellenic Telecommunications Organization SA .....	82.681	0,18
1.988	Jumbo SA .....	57.272	0,12
		<u>139.953</u>	<u>0,30</u>
	<b>Hongkong: 0,18 % (30. Juni 2023: Nil)</b>		
15.500	Power Assets Holdings Ltd. ....	83.879	0,18
		<u>83.879</u>	<u>0,18</u>
	<b>Indien: 1,86 % (30. Juni 2023: 0,78 %)</b>		
1.400	Bajaj Auto Ltd. ....	159.524	0,34
14.224	HCL Technologies Ltd. ....	248.974	0,53
91.350	ITC Ltd. ....	465.473	0,99
		<u>873.971</u>	<u>1,86</u>
	<b>Irland: 1,86 % (30. Juni 2023: 2,84 %)</b>		
2.800	Eaton Corp. PLC .....	877.940	1,86
		<u>877.940</u>	<u>1,86</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,90 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,90 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Japan: 12,36 % (30. Juni 2023: 9,02 %)</b>		
32.200	Astellas Pharma, Inc. ....	318.277	0,68
2.261	Daito Trust Construction Co. Ltd. ....	233.114	0,49
14.000	Daiwa House Industry Co. Ltd. ....	354.830	0,75
12.600	Hulic Co. Ltd. ....	111.580	0,24
33.600	KDDI Corp. ....	888.564	1,89
16.800	MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. ....	373.368	0,79
567.000	Nippon Telegraph & Telephone Corp. ....	535.065	1,14
3.123	Nitto Denko Corp. ....	246.757	0,52
32.700	ORIX Corp. ....	722.059	1,53
5.300	SBI Holdings, Inc. ....	133.999	0,28
9.800	Sekisui House Ltd. ....	217.067	0,46
28.600	Sompo Holdings, Inc. ....	610.724	1,30
28.900	Tokio Marine Holdings, Inc. ....	1.078.854	2,29
		<u>5.824.258</u>	<u>12,36</u>
	<b>Jersey: Null (30. Juni 2023: Nil)</b>		
	<b>Malaysia: 0,13 % (30. Juni 2023: 0,12 %)</b>		
16.800	Petronas Gas Bhd. ....	63.461	0,13
		<u>63.461</u>	<u>0,13</u>
	<b>Niederlande: 1,07 % (30. Juni 2023: 1,11 %)</b>		
5.292	LyondellBasell Industries NV ....	506.233	1,07
		<u>506.233</u>	<u>1,07</u>
	<b>Neuseeland: 0,30 % (30. Juni 2023: 0,35 %)</b>		
56.602	Spark New Zealand Ltd. ....	143.480	0,30
		<u>143.480</u>	<u>0,30</u>
	<b>Norwegen: 0,25 % (30. Juni 2023: 0,21 %)</b>		
14.406	Orkla ASA ....	117.372	0,25
		<u>117.372</u>	<u>0,25</u>
	<b>Qatar: 0,64 % (30. Juni 2023: 0,49 %)</b>		
22.694	Qatar International Islamic Bank QSC ....	62.329	0,13
46.732	Qatar Islamic Bank SAQ ....	238.730	0,51
		<u>301.059</u>	<u>0,64</u>
	<b>Russia: Null (30. Juni 2023: Nil)</b>		
61.664	Tatneft PJSC ....	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	<b>Saudi Arabia: 2,96 % (30. Juni 2023: 2,72 %)</b>		
44.758	Al Rajhi Bank ....	972.326	2,07
42.070	Saudi Telecom Co. ....	420.520	0,89
		<u>1.392.846</u>	<u>2,96</u>
	<b>Singapur: Null (30. Juni 2023: 0,15 %)</b>		
	<b>Südafrika: Null (30. Juni 2023: 0,15 %)</b>		
	<b>Spanien: 0,25 % (30. Juni 2023: 0,25 %)</b>		
6.860	Redeia Corp. SA ....	119.988	0,25
		<u>119.988</u>	<u>0,25</u>
	<b>Schweiz: 11,25 % (30. Juni 2023: 9,99 %)</b>		
4.676	Garmin Ltd. ....	761.814	1,62
9.114	Novartis AG ....	975.399	2,07
677	Partners Group Holding AG ....	869.417	1,85
3.500	Roche Holding AG ....	971.789	2,06
154	Roche Holding AG (voting rights) ....	46.923	0,10
4.088	SGS SA ....	363.944	0,77

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,90 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,90 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweiz: 11,25 % (30. Juni 2023: 9,99 %) (Fortsetzung)</b>		
602	Swisscom AG .....	338.650	0,72
1.820	Zurich Insurance Group AG .....	970.356	2,06
		<u>5.298.292</u>	<u>11,25</u>
	<b>Taiwan: 1,31 % (30. Juni 2023: 3,05 %)</b>		
3.230	Eclat Textile Co. Ltd. ....	52.669	0,11
4.700	Nien Made Enterprise Co. Ltd. ....	56.502	0,12
17.230	Novatek Microelectronics Corp. ....	321.852	0,69
10.979	Realtek Semiconductor Corp. ....	184.780	0,39
		<u>615.803</u>	<u>1,31</u>
	<b>Türkei: 0,39 % (30. Juni 2023: 0,14 %)</b>		
6.146	BIM Birlesik Magazalar AS .....	102.172	0,22
2.324	Ford Otomotiv Sanayi AS .....	79.680	0,17
		<u>181.852</u>	<u>0,39</u>
	<b>United Arab Emirates: 0,86 % (30. Juni 2023: 0,97 %)</b>		
95.088	Abu Dhabi National Oil Co. for Distribution PJSC .....	87.762	0,19
72.240	Emirates Telecommunications Group Co. PJSC .....	316.652	0,67
		<u>404.414</u>	<u>0,86</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 2,02 % (30. Juni 2023: 5,13 %)</b>		
17.304	Unilever PLC .....	950.424	2,02
		<u>950.424</u>	<u>2,02</u>
	<b>USA: 51,83 % (30. Juni 2023: 44,60 %)</b>		
9.170	3M Co. ....	937.082	1,99
5.796	AbbVie, Inc. ....	994.130	2,11
2.996	Amgen, Inc. ....	936.100	1,99
672	Broadcom, Inc. ....	1.078.916	2,29
5.628	CF Industries Holdings, Inc. ....	417.147	0,88
5.908	Chevron Corp. ....	924.129	1,96
20.132	Cisco Systems, Inc. ....	956.471	2,03
2.982	Clorox Co. ....	406.954	0,86
15.022	Coca-Cola Co. ....	956.150	2,03
7.812	ConocoPhillips .....	893.537	1,90
2.996	Cummins, Inc. ....	829.682	1,76
8.316	Emerson Electric Co. ....	916.091	1,94
6.804	EOG Resources, Inc. ....	856.419	1,82
8.022	Exxon Mobil Corp. ....	923.493	1,96
7.210	Fidelity National Financial, Inc. ....	356.318	0,75
9.940	Fifth Third Bancorp .....	362.711	0,77
6.244	Johnson & Johnson .....	912.623	1,94
7.070	Kimberly-Clark Corp. ....	977.074	2,07
2.016	Lockheed Martin Corp. ....	941.674	2,00
7.224	Merck & Co., Inc. ....	894.331	1,90
5.222	NetApp, Inc. ....	672.594	1,43
2.212	Packaging Corp. of America .....	403.823	0,86
7.504	Paychex, Inc. ....	889.674	1,89
5.614	Procter & Gamble Co. ....	925.861	1,96
4.704	QUALCOMM, Inc. ....	936.943	1,99
1.050	Snap-on, Inc. ....	274.460	0,58
2.184	Southern Copper Corp. ....	235.304	0,50
10.052	Synchrony Financial .....	474.354	1,01
8.036	T Rowe Price Group, Inc. ....	926.631	1,97
4.746	Texas Instruments, Inc. ....	923.239	1,96

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,90 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,90 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 51,83 % (30. Juni 2023: 44,60 %) (Fortsetzung)</b>		
6.496	United Parcel Service, Inc. ....	888.978	1,89
854	Watsco, Inc. ....	395.607	0,84
		<u>24.418.500</u>	<u>51,83</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>47.066.754</u>	<u>99,90</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>47.066.754</u>	<u>99,90</u>
		<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	47.066.754	99,90
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>44.840</u>	<u>0,10</u>
	<b>Nettovermögen</b>	<u>47.111.594</u>	<u>100,00</u>
			<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
	An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....		99,85
	Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		<u>0,15</u>
	Gesamtvermögen .....		<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2023: 99,53 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,10 % (30. Juni 2023: 99,53 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,77 % (30. Juni 2023: 0,49 %)</b>		
24.000	Alibaba Health Information Technology Ltd. ....	9.622	0,19
36.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd. ....	11.066	0,21
72.000	China Ruyi Holdings Ltd. ....	19.366	0,37
		<u>40.054</u>	<u>0,77</u>
	<b>Cayman-Inseln: 53,10 % (30. Juni 2023: 51,41 %)</b>		
2.000	Akeso, Inc. ....	9.670	0,19
53.590	Alibaba Group Holding Ltd. ....	483.912	9,29
2.072	ANTA Sports Products Ltd. ....	19.904	0,38
492	Autohome, Inc. ADR ....	13.505	0,26
9.900	Baidu, Inc. ....	108.099	2,08
3.100	BeiGene Ltd. ....	34.226	0,66
2.000	China Literature Ltd. ....	6.443	0,12
12.800	China Resources Land Ltd. ....	43.528	0,84
600	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd. ....	1.987	0,04
9.952	Genscript Biotech Corp. ....	10.605	0,20
561	H World Group Ltd. ADR ....	18.693	0,36
12.000	Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	25.084	0,48
4.800	Hygeia Healthcare Holdings Co. Ltd. ....	17.307	0,33
7.000	Innovent Biologics, Inc. ....	32.994	0,63
5.100	JD Health International, Inc. ....	13.881	0,27
2.412	Kanzhun Ltd. ADR ....	45.370	0,87
66.000	Kingdee International Software Group Co. Ltd. ....	61.880	1,19
4.400	Kingsoft Corp. Ltd. ....	12.708	0,24
6.300	Kuaishou Technology ....	37.240	0,71
993	Legend Biotech Corp. ADR ....	43.980	0,84
14.500	Li Auto, Inc. ....	130.562	2,51
7.300	Meituan ....	103.880	1,99
3.600	MINISO Group Holding Ltd. ....	17.268	0,33
6.270	NetEase, Inc. ....	119.740	2,30
519	NIO, Inc. ADR ....	2.159	0,04
1.794	PDD Holdings, Inc. ADR ....	238.512	4,58
150	Qifu Technology, Inc. ADR ....	2.960	0,06
45.000	Sino Biopharmaceutical Ltd. ....	15.389	0,30
20.574	Tencent Holdings Ltd. ....	981.346	18,84
12.000	Topsports International Holdings Ltd. ....	6.379	0,12
1.550	Trip.com Group Ltd. ....	74.369	1,43
13.500	Wuxi Biologics Cayman, Inc. ....	19.954	0,38
3.300	XPeng, Inc. ....	12.490	0,24
		<u>2.766.024</u>	<u>53,10</u>
	<b>China: 42,30 % (30. Juni 2023: 44,16 %)</b>		
3.906	Aier Eye Hospital Group Co. Ltd. ....	5.521	0,11
2.800	Anhui Gujing Distillery Co. Ltd. Anteilsklasse B ....	41.666	0,80
300	Anhui Yingjia Distillery Co. Ltd. ....	2.363	0,05
9.900	Beijing Enlight Media Co. Ltd. ....	11.404	0,22
454	Beijing Kingsoft Office Software, Inc. ....	14.147	0,27
180	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co. Ltd. ....	1.624	0,03
162.300	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd. ....	119.377	2,29
357	Bloomage Biotechnology Corp. Ltd. ....	2.766	0,05
7.800	BOC International China Co. Ltd. ....	9.701	0,19
850	BYD Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	25.258	0,48
600	By-health Co. Ltd. ....	1.114	0,02
15.300	Caitong Securities Co. Ltd. ....	13.852	0,27
1.380	Cambricon Technologies Corp. Ltd. ....	37.552	0,72
4.500	Changjiang Securities Co. Ltd. ....	2.977	0,06
300	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co. Ltd. ....	4.604	0,09
200	Chaozhou Three-Circle Group Co. Ltd. ....	800	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,10 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,30 % (30. Juni 2023: 44,16 %) (Fortsetzung)</b>		
300	Chifeng Jilong Gold Mining Co. Ltd. ....	671	0,01
113.000	China Construction Bank Corp. Anteilsklasse H .....	83.512	1,60
13.500	China Galaxy Securities Co. Ltd. ....	7.072	0,14
9.600	China Great Wall Securities Co. Ltd. ....	8.810	0,17
6.000	China International Capital Corp. Ltd. ....	6.678	0,13
50.000	China Life Insurance Co. Ltd. ....	70.702	1,36
4.290	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co. Ltd. ....	25.020	0,48
94.800	China Three Gorges Renewables Group Co. Ltd. ....	56.614	1,09
1.100	China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd. Anteilsklasse A .....	9.415	0,18
3.900	China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd. Anteilsklasse H .....	23.902	0,46
18.900	China Yangtze Power Co. Ltd. ....	74.866	1,44
500	Chongqing Zhifei Biological Products Co. Ltd. ....	1.920	0,04
13.500	CITIC Securities Co. Ltd. ....	19.885	0,38
2.100	CSC Financial Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	5.534	0,11
4.800	CSPC Innovation Pharmaceutical Co. Ltd. ....	16.588	0,32
600	Dong-E-E-Jiao Co. Ltd. ....	5.145	0,10
52.500	East Money Information Co. Ltd. ....	75.936	1,46
1.200	Empyrean Technology Co. Ltd. ....	12.664	0,24
300	Eve Energy Co. Ltd. ....	1.640	0,03
27.921	Everdisplay Optronics Shanghai Co. Ltd. ....	7.572	0,14
13.500	First Capital Securities Co. Ltd. ....	9.412	0,18
7.800	Focus Media Information Technology Co. Ltd. ....	6.474	0,12
17.700	Founder Securities Co. Ltd. ....	18.740	0,36
11.400	Goldwind Science & Technology Co. Ltd. ....	10.493	0,20
100	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co. Ltd. ....	372	0,01
8.100	Guolian Securities Co. Ltd. ....	10.695	0,20
2.700	Guotai Junan Securities Co. Ltd. Anteilsklasse A .....	5.011	0,10
4.200	Guoyuan Securities Co. Ltd. ....	3.486	0,07
18.300	Hainan Airport Infrastructure Co. Ltd. ....	7.871	0,15
82.800	Haitong Securities Co. Ltd. ....	38.497	0,74
300	Hangzhou Silan Microelectronics Co. Ltd. ....	720	0,01
600	Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd. ....	3.994	0,08
1.500	Hithink RoyalFlush Information Network Co. Ltd. ....	21.306	0,41
400	Huadong Medicine Co. Ltd. ....	1.524	0,03
900	Hualan Biological Engineering, Inc. ....	1.947	0,04
16.800	Huatai Securities Co. Ltd. ....	18.570	0,36
1.800	Hundsun Technologies, Inc. ....	4.354	0,08
7.263	Hygon Information Technology Co. Ltd. ....	69.956	1,34
560	Imeik Technology Development Co. Ltd. ....	13.201	0,25
4.800	Industrial Securities Co. Ltd. ....	3.327	0,06
11.100	JA Solar Technology Co. Ltd. ....	17.028	0,33
6.000	Jiangsu Expressway Co. Ltd. ....	6.402	0,12
7.500	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co. Ltd. ....	39.509	0,76
600	Jiangsu Pacific Quartz Co. Ltd. ....	2.433	0,05
300	Jiangsu Yanghe Distillery Co. Ltd. ....	3.318	0,06
7.200	Kuang-Chi Technologies Co. Ltd. ....	17.110	0,33
660	Kweichow Moutai Co. Ltd. ....	132.653	2,55
25.200	LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. ....	48.392	0,93
500	Luzhou Laojiao Co. Ltd. ....	9.827	0,19
1.479	Montage Technology Co. Ltd. ....	11.579	0,22
12.300	Nanjing Securities Co. Ltd. ....	12.939	0,25
26.700	NARI Technology Co. Ltd. ....	91.281	1,75
3.456	National Silicon Industry Group Co. Ltd. ....	6.537	0,13
1.260	Ningbo Deye Technology Co. Ltd. ....	12.830	0,25
7.500	Nongfu Spring Co. Ltd. ....	35.591	0,68
400	Rockchip Electronics Co. Ltd. ....	3.242	0,06
900	Sangfor Technologies, Inc. ....	6.229	0,12

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Investment	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,10 % (30. Juni 2023: 99,53 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 42,30 % (30. Juni 2023: 44,16 %) (Fortsetzung)</b>		
1.300	SG Micro Corp. ....	14.740	0,28
12.000	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. ....	5.718	0,11
7.200	Shanghai Baosight Software Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	31.489	0,60
30.960	Shanghai Baosight Software Co. Ltd. Anteilsklasse B ....	50.124	0,96
681	Shanghai BOCHU Electronic Technology Corp. Ltd. ....	17.214	0,33
4.200	Shanghai International Airport Co. Ltd. ....	18.553	0,36
6.000	Shanghai Putailai New Energy Technology Co. Ltd. ....	11.612	0,22
7.200	Shanghai RAAS Blood Products Co. Ltd. ....	7.712	0,15
4.500	Shanghai Zhangjiang High-Tech Park Development Co. Ltd. ....	11.391	0,22
1.600	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd. ....	46.215	0,89
75.600	Shenwan Hongyuan Group Co. Ltd. ....	44.630	0,86
3.900	Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd. ....	27.404	0,53
600	Shenzhen Kangtai Biological Products Co. Ltd. ....	1.283	0,02
600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd. ....	23.908	0,46
1.200	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co. Ltd. ....	11.085	0,21
3.600	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co. Ltd. ....	13.131	0,25
16.200	Sichuan Chuantou Energy Co. Ltd. ....	41.605	0,80
9.000	Songcheng Performance Development Co. Ltd. ....	9.899	0,19
22.200	Southwest Securities Co. Ltd. ....	10.886	0,21
6.860	Sungrow Power Supply Co. Ltd. ....	58.284	1,12
2.709	SUPCON Technology Co. Ltd. ....	13.989	0,27
600	Thunder Software Technology Co. Ltd. ....	3.747	0,07
9.000	TravelSky Technology Ltd. ....	10.559	0,20
4.500	Unisplendour Corp. Ltd. ....	13.776	0,26
1.500	Walvax Biotechnology Co. Ltd. ....	2.338	0,04
5.100	Western Securities Co. Ltd. ....	4.324	0,08
700	Wuliangye Yibin Co. Ltd. ....	12.276	0,24
3.300	WuXi AppTec Co. Ltd. ....	12.342	0,24
4.200	Yealink Network Technology Corp. Ltd. ....	21.153	0,41
1.300	Yunnan Baiyao Group Co. Ltd. ....	9.108	0,17
400	Yunnan Botanee Bio-Technology Group Co. Ltd. ....	2.647	0,05
2.000	Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co. Ltd. ....	56.752	1,09
33.790	Zhejiang Expressway Co. Ltd. ....	22.808	0,44
600	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co. Ltd. ....	2.361	0,04
900	Zhejiang Weiming Environment Protection Co. Ltd. ....	2.537	0,05
12.900	Zheshang Securities Co. Ltd. ....	18.941	0,36
5.400	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd. ....	21.303	0,41
		<b>2.203.566</b>	<b>42,30</b>
	<b>Hongkong: 1,26 % (30. Juni 2023: 1,77 %)</b>		
19.500	China Overseas Land & Investment Ltd. ....	33.818	0,65
40.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd. ....	31.867	0,61
		<b>65.685</b>	<b>1,26</b>
	<b>Singapur: Null (30. Juni 2023: 0,44 %)</b>		
	<b>USA: 1,67 % (30. Juni 2023: 1,26 %)</b>		
2.820	Yum China Holdings, Inc. ....	86.969	1,67
		<b>86.969</b>	<b>1,67</b>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<b>5.162.298</b>	<b>99,10</b>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<b>5.162.298</b>	<b>99,10</b>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,02) % (30. Juni 2023: (0,00) %)

Terminkontrakte: (0,02) % (30. Juni 2023: (0,00) %)\*

Nominalwert USD	Durchschnittli- cher Kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
46.060	461	2 MSCI China Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	(1.040)	(0,02)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten ...</b>	<b>(1.040)</b>	<b>(0,02)</b>
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente .....</b>	<b>(1.040)</b>	<b>(0,02)</b>
			<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlagenportfolio</b>	5.161.258	99,08
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	47.910	0,92
		<b>Nettovermögen</b>	<b>5.209.168</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
		An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....		99,05
		Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		0,95
		Gesamtvermögen .....		<b>100,00</b>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 4.710 USD.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,56 % (30. Juni 2023: 0,64 %)</b>		
4.000	Alibaba Health Information Technology Ltd. ....	1.604	0,03
58.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd. ....	17.829	0,33
8.000	China Ruyi Holdings Ltd. ....	2.152	0,04
56	Credicorp Ltd. ....	9.034	0,16
		<u>30.619</u>	<u>0,56</u>
	<b>Brasilien: 5,58 % (30. Juni 2023: 5,37 %)</b>		
6.400	Ambev SA .....	13.147	0,24
10.000	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	18.436	0,34
1.800	Banco BTG Pactual SA .....	10.017	0,18
4.200	BB Seguridade Participacoes SA .....	24.900	0,46
1.200	CCR SA .....	2.515	0,05
2.000	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP .....	26.995	0,49
15.600	Cia Paranaense de Energia - Copel .....	26.120	0,48
3.300	CPFL Energia SA .....	19.445	0,36
3.500	Energisa SA .....	28.746	0,53
6.400	Hapvida Participacoes e Investimentos SA .....	4.413	0,08
800	Hypera SA .....	4.134	0,08
6.500	Itau Unibanco Holding SA (Vorzugsaktien) .....	37.927	0,69
8.099	Itausa SA .....	14.319	0,26
11	Localiza Rent a Car SA (Stimmrecht) .....	18	0,00
1.115	Localiza Rent a Car SA Anteilsklasse A .....	8.431	0,15
4.600	Lojas Renner SA .....	10.335	0,19
1.200	Natura & Co. Holding SA .....	3.357	0,06
1.800	Raia Drogasil SA .....	8.322	0,15
400	Rede D'Or Sao Luiz SA .....	1.959	0,04
800	Telefonica Brasil SA .....	6.530	0,12
3.000	TIM SA .....	8.577	0,16
3.400	WEG SA .....	25.825	0,47
		<u>304.468</u>	<u>5,58</u>
	<b>Cayman-Inseln: 12,22 % (30. Juni 2023: 16,00 %)</b>		
160	Airtac International Group .....	4.873	0,09
1.600	Akeso, Inc. ....	7.736	0,14
34	Alchip Technologies Ltd. ....	2.573	0,05
9.600	Alibaba Group Holding Ltd. ....	86.687	1,59
54	Autohome, Inc. ADR .....	1.482	0,03
2.200	Baidu, Inc. ....	24.022	0,44
500	BeiGene Ltd. ....	5.520	0,10
4.000	Bosideng International Holdings Ltd. ....	2.495	0,05
1.387	Chailease Holding Co. Ltd. ....	6.563	0,12
400	China Literature Ltd. ....	1.289	0,02
1.286	Genscript Biotech Corp. ....	1.370	0,02
114	H World Group Ltd. ADR .....	3.799	0,07
1.000	Haidilao International Holding Ltd. ....	1.798	0,03
1.000	Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. ....	2.090	0,04
800	Hygeia Healthcare Holdings Co. Ltd. ....	2.884	0,05
1.000	Innovent Biologics, Inc. ....	4.714	0,09
254	iQIYI, Inc. ADR .....	932	0,02
1.100	JD Health International, Inc. ....	2.994	0,05
358	Kanzhun Ltd. ADR .....	6.734	0,12
2.000	Kingdee International Software Group Co. Ltd. ....	1.875	0,03
400	Kingsoft Corp. Ltd. ....	1.155	0,02
1.800	Kuaishou Technology .....	10.640	0,19
194	Legend Biotech Corp. ADR .....	8.592	0,16
900	Li Auto, Inc. ....	8.104	0,15
1.500	Li Ning Co. Ltd. ....	3.247	0,06
3.900	Meituan .....	55.497	1,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>übertragbare Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Cayman-Inseln: 12,22 % (30. Juni 2023: 16,00 %) (Fortsetzung)</b>			
400	MINISO Group Holding Ltd. ....	1.919	0,03
1.302	NetEase, Inc. ....	24.865	0,46
1.400	New Oriental Education & Technology Group, Inc. ....	10.705	0,20
386	PDD Holdings, Inc. ADR ....	51.319	0,94
400	Pop Mart International Group Ltd. ....	1.960	0,04
1.180	Silergy Corp. ....	16.804	0,31
12.000	Sino Biopharmaceutical Ltd. ....	4.104	0,08
468	TAL Education Group ADR ....	4.994	0,09
5.330	Tencent Holdings Ltd. ....	254.232	4,66
130	Tencent Music Entertainment Group ADR ....	1.827	0,03
4.000	Topsports International Holdings Ltd. ....	2.126	0,04
550	Trip.com Group Ltd. ....	26.389	0,48
2.824	Wuxi Biologics Cayman, Inc. ....	4.174	0,08
400	XPeng, Inc. ....	1.514	0,03
		<b>666.597</b>	<b>12,22</b>
<b>Chile: 1,29 % (30. Juni 2023: 0,91 %)</b>			
80.206	Banco de Chile ....	8.923	0,16
148	Banco de Credito e Inversiones SA ....	4.152	0,08
204.734	Banco Santander Chile ....	9.587	0,18
19.566	Cia Sud Americana de Vapores SA ....	1.238	0,02
2.756	Falabella SA ....	8.470	0,16
940	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ....	37.869	0,69
		<b>70.239</b>	<b>1,29</b>
<b>China: 8,46 % (30. Juni 2023: 12,10 %)</b>			
300	Anhui Gujing Distillery Co. Ltd. Anteilsklasse B ....	4.464	0,08
200	Anhui Kouzi Distillery Co. Ltd. ....	1.074	0,02
2.600	Beijing Enlight Media Co. Ltd. ....	2.995	0,06
9.800	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd. ....	7.208	0,13
700	BYD Co. Ltd. Anteilsklasse A ....	23.994	0,44
2.000	BYD Co. Ltd. Anteilsklasse H ....	59.431	1,09
100	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co. Ltd. ....	1.535	0,03
1.400	Chifeng Jilong Gold Mining Co. Ltd. ....	3.133	0,06
1.000	China Galaxy Securities Co. Ltd. ....	524	0,01
800	China International Capital Corp. Ltd. ....	890	0,02
10.000	China Life Insurance Co. Ltd. ....	14.140	0,26
24.800	China Three Gorges Renewables Group Co. Ltd. ....	14.810	0,27
5.600	China Yangtze Power Co. Ltd. ....	22.183	0,41
3.000	CITIC Securities Co. Ltd. ....	4.419	0,08
200	CSPC Innovation Pharmaceutical Co. Ltd. ....	691	0,01
400	Dong-E-E-Jiao Co. Ltd. ....	3.430	0,06
300	Empyrean Technology Co. Ltd. ....	3.166	0,06
200	Eve Energy Co. Ltd. ....	1.094	0,02
800	Focus Media Information Technology Co. Ltd. ....	664	0,01
340	Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd. ....	1.605	0,03
400	Ginlong Technologies Co. Ltd. ....	2.281	0,04
3.200	Goldwind Science & Technology Co. Ltd. ....	2.945	0,05
600	Gotion High-tech Co. Ltd. ....	1.574	0,03
400	Guangzhou Haige Communications Group, Inc. Co. ....	568	0,01
200	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co. Ltd. ....	809	0,02
13.600	Haitong Securities Co. Ltd. ....	6.323	0,12
1.400	Hangzhou Silan Microelectronics Co. Ltd. ....	3.358	0,06
100	Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd. ....	666	0,01
1.400	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co. Ltd. ....	2.391	0,04
2.200	Hengtong Optic-electric Co. Ltd. ....	4.752	0,09
400	Huadong Medicine Co. Ltd. ....	1.524	0,03
2.800	Huatai Securities Co. Ltd. ....	3.095	0,06

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>China: 8,46 % (30. Juni 2023: 12,10 %) (Fortsetzung)</b>		
3.080	JA Solar Technology Co. Ltd. ....	4.725	0,09
4.000	Jiangsu Expressway Co. Ltd. ....	4.268	0,08
700	Jiangsu Hengli Hydraulic Co. Ltd. ....	4.466	0,08
200	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co. Ltd. ....	1.054	0,02
200	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd. ....	1.266	0,02
200	Jiangsu Yanghe Distillery Co. Ltd. ....	2.212	0,04
7.466	Jinko Solar Co. Ltd. ....	7.261	0,13
800	Kuang-Chi Technologies Co. Ltd. ....	1.901	0,04
80	Kweichow Moutai Co. Ltd. ....	16.079	0,29
200	Lepu Medical Technology Beijing Co. Ltd. ....	407	0,01
6.600	LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. ....	12.674	0,23
100	Luzhou Laojiao Co. Ltd. ....	1.965	0,04
3.200	Nanjing Securities Co. Ltd. ....	3.366	0,06
7.000	NARI Technology Co. Ltd. ....	23.931	0,44
400	Ningbo Deye Technology Co. Ltd. ....	4.073	0,07
1.600	Nongfu Spring Co. Ltd. ....	7.593	0,14
600	Sany Heavy Industry Co. Ltd. ....	1.356	0,03
2.400	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. ....	1.144	0,02
1.600	Shanghai Aiko Solar Energy Co. Ltd. ....	1.983	0,04
288	Shanghai Baosight Software Co. Ltd. ....	1.260	0,02
4.800	Shanghai Baosight Software Co. Ltd. Anteilsklasse B ....	7.771	0,14
200	Shanghai BOCHU Electronic Technology Corp. Ltd. ....	5.056	0,09
580	Shanghai Putailai New Energy Technology Co. Ltd. ....	1.123	0,02
5.000	Shanghai RAAS Blood Products Co. Ltd. ....	5.356	0,10
100	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd. ....	2.888	0,05
2.400	Shenwan Hongyuan Group Co. Ltd. ....	1.417	0,03
600	Shenzhen Capchem Technology Co. Ltd. ....	2.347	0,04
1.200	Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd. ....	8.432	0,15
100	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd. ....	3.985	0,07
600	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co. Ltd. ....	2.188	0,04
4.200	Sichuan Chuantou Energy Co. Ltd. ....	10.786	0,20
100	Sichuan Swellfun Co. Ltd. ....	515	0,01
2.400	Songcheng Performance Development Co. Ltd. ....	2.640	0,05
1.820	Sungrow Power Supply Co. Ltd. ....	15.463	0,28
690	SUPCON Technology Co. Ltd. ....	3.563	0,07
5.400	Tianfeng Securities Co. Ltd. ....	1.612	0,03
3.800	Tongwei Co. Ltd. ....	9.946	0,18
4.000	TravelSky Technology Ltd. ....	4.693	0,09
500	Tsingtao Brewery Co. Ltd. ....	3.337	0,06
600	Unisplendour Corp. Ltd. ....	1.837	0,03
4.000	Western Securities Co. Ltd. ....	3.391	0,06
300	Wuliangye Yibin Co. Ltd. ....	5.261	0,10
600	WuXi AppTec Co. Ltd. ....	2.244	0,04
280	Yealink Network Technology Corp. Ltd. ....	1.410	0,03
240	Yifeng Pharmacy Chain Co. Ltd. ....	807	0,01
2.400	Yintai Gold Co. Ltd. ....	5.355	0,10
400	Yunnan Baiyao Group Co. Ltd. ....	2.802	0,05
100	Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co. Ltd. ....	2.838	0,05
1.500	Zhaojin Mining Industry Co. Ltd. ....	2.517	0,05
8.040	Zhejiang Expressway Co. Ltd. ....	5.427	0,10
200	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co. Ltd. ....	467	0,01
1.400	Zhejiang Weiming Environment Protection Co. Ltd. ....	3.946	0,07
4.600	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd. ....	18.147	0,33
3.200	ZTE Corp. ....	7.082	0,13
		<b>461.369</b>	<b>8,46</b>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>übertragbare Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Kolumbien: 0,05 % (30. Juni 2023: 0,05 %)</b>			
678	Interconexion Electrica SA ESP .....	2.978	0,05
		<u>2.978</u>	<u>0,05</u>
<b>Tschechische Republik: 0,41 % (30. Juni 2023: 0,21 %)</b>			
506	Komerční Banka AS .....	16.943	0,31
1.228	Moneta Money Bank AS .....	5.371	0,10
		<u>22.314</u>	<u>0,41</u>
<b>Griechenland: 0,53 % (30. Juni 2023: 0,98 %)</b>			
1.256	Hellenic Telecommunications Organization SA .....	18.092	0,33
244	Jumbo SA .....	7.029	0,13
246	OPAP SA .....	3.860	0,07
		<u>28.981</u>	<u>0,53</u>
<b>Hongkong: 0,26 % (30. Juni 2023: 0,72 %)</b>			
1.436	China Resources Beer Holdings Co. Ltd. ....	4.828	0,09
10.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd. ....	7.967	0,15
400	Hua Hong Semiconductor Ltd. ....	1.130	0,02
		<u>13.925</u>	<u>0,26</u>
<b>Ungarn: 0,41 % (30. Juni 2023: 0,33 %)</b>			
334	OTP Bank Nyrt .....	16.610	0,31
218	Richter Gedeon Nyrt .....	5.668	0,10
		<u>22.278</u>	<u>0,41</u>
<b>Indien: 21,61 % (30. Juni 2023: 16,79 %)</b>			
14	ABB India Ltd. ....	1.426	0,03
928	Adani Green Energy Ltd. ....	19.907	0,36
1.070	Asian Paints Ltd. ....	37.431	0,69
218	Avenue Supermarts Ltd. ....	12.331	0,23
1.134	Axis Bank Ltd. ....	17.206	0,31
328	Bajaj Finance Ltd. ....	27.989	0,51
1.216	Bajaj Finserv Ltd. ....	23.159	0,42
74	Bajaj Holdings & Investment Ltd. ....	7.575	0,14
35.952	Bharat Electronics Ltd. ....	131.887	2,42
2.278	Bharti Airtel Ltd. ....	39.449	0,72
88	Britannia Industries Ltd. ....	5.778	0,11
906	Cholamandalam Investment & Finance Co. Ltd. ....	15.466	0,28
428	Cipla Ltd. ....	7.600	0,14
1.386	Colgate-Palmolive India Ltd. ....	47.257	0,87
390	Container Corp. of India Ltd. ....	4.875	0,09
232	Cummins India Ltd. ....	11.037	0,20
1.046	Dabur India Ltd. ....	7.535	0,14
134	Divi's Laboratories Ltd. ....	7.386	0,13
1.038	DLF Ltd. ....	10.266	0,19
116	Dr Reddy's Laboratories Ltd. ....	8.906	0,16
544	Godrej Consumer Products Ltd. ....	8.976	0,16
758	Godrej Properties Ltd. ....	29.160	0,53
1.618	Havells India Ltd. ....	35.361	0,65
1.392	HCL Technologies Ltd. ....	24.365	0,45
22	HDFC Asset Management Co. Ltd. ....	1.054	0,02
1.696	HDFC Bank Ltd. ....	34.246	0,63
1.426	Hindustan Unilever Ltd. ....	42.291	0,77
608	ICICI Lombard General Insurance Co. Ltd. ....	13.048	0,24
228	Indian Railway Catering & Tourism Corp. Ltd. ....	2.705	0,05
92	Info Edge India Ltd. ....	7.487	0,14
5.102	Infosys Ltd. ....	95.860	1,76
542	Jio Financial Services Ltd. ....	2.328	0,04
178	Jubilant Foodworks Ltd. ....	1.202	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Indien: 21,61 % (30. Juni 2023: 16,79 %) (Fortsetzung)</b>		
752	Kotak Mahindra Bank Ltd. ....	16.255	0,30
258	Lupin Ltd. ....	5.016	0,09
1.594	Macrotech Developers Ltd. ....	28.741	0,53
578	Max Healthcare Institute Ltd. ....	6.520	0,12
356	Nestle India Ltd. ....	10.894	0,20
10	Page Industries Ltd. ....	4.689	0,09
120	PB Fintech Ltd. ....	2.011	0,04
226	PI Industries Ltd. ....	10.296	0,19
130	Pidilite Industries Ltd. ....	4.925	0,09
178	SBI Cards & Payment Services Ltd. ....	1.547	0,03
556	SBI Life Insurance Co. Ltd. ....	9.948	0,18
816	Shriram Finance Ltd. ....	28.491	0,52
216	Siemens Ltd. ....	19.957	0,37
1.172	Sun Pharmaceutical Industries Ltd. ....	21.375	0,39
114.022	Suzlon Energy Ltd. ....	72.280	1,32
978	Tata Consultancy Services Ltd. ....	45.789	0,84
4.052	Tata Consumer Products Ltd. ....	53.328	0,98
904	Tech Mahindra Ltd. ....	15.506	0,28
514	Titan Co. Ltd. ....	20.984	0,38
182	Torrent Pharmaceuticals Ltd. ....	6.092	0,11
254	Trent Ltd. ....	16.692	0,31
4.836	Wipro Ltd. ....	29.858	0,55
2.250	Zomato Ltd. ....	5.412	0,10
		<b>1.179.155</b>	<b>21,61</b>
	<b>Indonesien 0,59 % (30. Juni 2023: 0,73 %)</b>		
51.400	Bank Central Asia Tbk. PT ....	31.154	0,57
377.600	GoTo Gojek Tokopedia Tbk. PT ....	1.153	0,02
		<b>32.307</b>	<b>0,59</b>
	<b>Kuwait: 0,35 % (30. Juni 2023: 0,14 %)</b>		
1.608	Boubyan Bank KSCP ....	2.967	0,06
4.399	Mabaneer Co. KPSC ....	11.917	0,22
1.413	National Bank of Kuwait SAKP ....	3.971	0,07
		<b>18.855</b>	<b>0,35</b>
	<b>Luxembourg: 0,46 % (30. Juni 2023: 0,41 %)</b>		
1.558	Allegro.eu SA ....	14.611	0,27
424	Reinet Investments SCA ....	10.669	0,19
		<b>25.280</b>	<b>0,46</b>
	<b>Malaysia: 0,82 % (30. Juni 2023: 0,81 %)</b>		
4.800	Gamuda Bhd. ....	6.695	0,12
1.600	Hong Leong Bank Bhd. ....	6.512	0,12
3.400	IHH Healthcare Bhd. ....	4.540	0,09
3.400	Malayan Banking Bhd. ....	7.178	0,13
800	Malaysia Airports Holdings Bhd. ....	1.679	0,03
3.000	Maxis Bhd. ....	2.245	0,04
18.600	Public Bank Bhd. ....	15.850	0,29
		<b>44.699</b>	<b>0,82</b>
	<b>Mexiko: 3,04 % (30. Juni 2023: 3,02 %)</b>		
4.602	America Movil SAB de CV ....	3.919	0,07
126	Arca Continental SAB de CV ....	1.236	0,02
80	Banco del Bajío SA ....	243	0,00
714	Coca-Cola Femsa SAB de CV ....	6.125	0,11
5.698	Fibra Uno Administracion SA de CV ....	7.005	0,13
610	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ....	5.176	0,10
4.192	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV ....	65.608	1,20

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Mexiko: 3,04 % (30. Juni 2023: 3,02 %) (Fortsetzung)</b>		
440	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV .....	13.254	0,24
2.792	Grupo Financiero Banorte SAB de CV .....	21.767	0,40
3.644	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV .....	8.663	0,16
2.786	Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV .....	2.512	0,05
7.278	Prologis Property Mexico SA de CV .....	23.794	0,44
724	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV .....	6.702	0,12
		<u>166.004</u>	<u>3,04</u>
	<b>Niederlande: 0,62 % (30. Juni 2023: 0,52 %)</b>		
4.702	NEPI Rockcastle NV .....	33.828	0,62
		<u>33.828</u>	<u>0,62</u>
	<b>Peru: 0,10 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
324	Cia de Minas Buenaventura SAA ADR .....	5.492	0,10
		<u>5.492</u>	<u>0,10</u>
	<b>Philippinen: 0,03 % (30. Juni 2023: 0,10 %)</b>		
3.600	Ayala Land, Inc. ....	1.750	0,03
		<u>1.750</u>	<u>0,03</u>
	<b>Polen: 2,46 % (30. Juni 2023: 1,40 %)</b>		
340	Bank Polska Kasa Opieki SA .....	14.209	0,26
184	Budimex SA .....	31.902	0,59
76	CD Projekt SA .....	2.627	0,05
68	Dino Polska SA .....	6.871	0,13
3	LPP SA .....	12.754	0,23
1.546	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA .....	24.197	0,44
1.326	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA .....	17.000	0,31
182	Santander Bank Polska SA .....	24.502	0,45
		<u>134.062</u>	<u>2,46</u>
	<b>Katar: 0,58 % (30. Juni 2023: 0,67 %)</b>		
12.880	Masraf Al Rayan QSC .....	8.253	0,15
36.402	Mesaieed Petrochemical Holding Co. ....	16.456	0,30
2.000	Qatar International Islamic Bank QSC .....	5.493	0,10
258	Qatar Islamic Bank SAQ .....	1.318	0,03
		<u>31.520</u>	<u>0,58</u>
	<b>Saudi-Arabien: 5,10 % (30. Juni 2023: 5,71 %)</b>		
2.938	Al Rajhi Bank .....	63.825	1,17
2.637	Alinma Bank .....	21.860	0,40
1.816	Arab National Bank .....	9.807	0,18
1.795	Bank AlBilad .....	15.598	0,29
3.142	Bank Al-Jazira .....	13.819	0,25
1.080	Banque Saudi Fransi .....	10.220	0,19
104	Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co. ....	7.124	0,13
18	Dallah Healthcare Co. ....	763	0,02
2.562	Dar Al Arkan Real Estate Development Co. ....	8.058	0,15
72	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co. ....	5.539	0,10
18	Elm Co. ....	4.113	0,08
664	Etihad Etisalat Co. ....	9.451	0,17
1.940	Jarir Marketing Co. ....	6.557	0,12
48	Mouwasat Medical Services Co. ....	1.551	0,03
2.208	Riyad Bank .....	15.332	0,28
1.598	Saudi Awwal Bank .....	16.463	0,30
4.744	Saudi National Bank .....	46.408	0,85
68	Saudi Tadawul Group Holding Co. ....	4.517	0,08
1.696	Saudi Telecom Co. ....	16.953	0,31
		<u>277.958</u>	<u>5,10</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>übertragbare Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Südafrika: 2,42 % (30. Juni 2023: 2,84 %)</b>			
122	Capitec Bank Holdings Ltd. ....	17.565	0,32
338	Clicks Group Ltd. ....	6.374	0,12
1.016	Discovery Ltd. ....	7.494	0,14
6.114	FirstRand Ltd. ....	25.749	0,47
656	Gold Fields Ltd. ....	9.823	0,18
794	Harmony Gold Mining Co. Ltd. ....	7.307	0,13
230	Naspers Ltd. ....	44.932	0,82
2.930	Sanlam Ltd. ....	12.985	0,24
		<b>132.229</b>	<b>2,42</b>
<b>Südkorea: 9,44 % (30. Juni 2023: 10,75 %)</b>			
16	Alteogen, Inc. ....	3.260	0,06
20	Amorepacific Corp. ....	2.431	0,04
29	Celltrion Pharm, Inc. ....	1.871	0,03
124	Celltrion, Inc. ....	15.701	0,29
46	CosmoAM&T Co. Ltd. ....	4.819	0,09
100	Coway Co. Ltd. ....	4.664	0,09
42	DB Insurance Co. Ltd. ....	3.494	0,06
412	Ecopro BM Co. Ltd. ....	54.774	1,00
1.232	Ecopro Co. Ltd. ....	80.642	1,48
14	Hanmi Pharm Co. Ltd. ....	2.751	0,05
138	HLB, Inc. ....	5.865	0,11
6	HYBE Co. Ltd. ....	883	0,02
246	Kakao Corp. ....	7.265	0,13
272	KakaoBank Corp. ....	4.011	0,07
8	Krafton, Inc. ....	1.636	0,03
26	Kum Yang Co. Ltd. ....	1.624	0,03
366	L&F Co. Ltd. ....	35.975	0,66
16	LG Energy Solution Ltd. ....	3.795	0,07
10	LG H&H Co. Ltd. ....	2.510	0,05
30	Meritz Financial Group, Inc. ....	1.724	0,03
116	NAVER Corp. ....	14.065	0,26
14	NCSOFT Corp. ....	1.830	0,03
16	Netmarble Corp. ....	624	0,01
1.918	NH Investment & Securities Co. Ltd. ....	17.682	0,32
14	Orion Corp. ....	938	0,02
20	Posco DX Co. Ltd. ....	557	0,01
14	POSCO Future M Co. Ltd. ....	2.629	0,05
16	Samsung Biologics Co. Ltd. ....	8.450	0,15
1.546	Samsung Electronics Co. Ltd. ....	91.536	1,68
108	Samsung Life Insurance Co. Ltd. ....	6.944	0,13
276	Samsung SDI Co. Ltd. ....	70.980	1,30
118	SK Biopharmaceuticals Co. Ltd. ....	6.644	0,12
16	SK Bioscience Co. Ltd. ....	611	0,01
262	SK Hynix, Inc. ....	45.015	0,83
30	SK IE Technology Co. Ltd. ....	961	0,02
102	Yuhan Corp. ....	5.995	0,11
		<b>515.156</b>	<b>9,44</b>
<b>Taiwan: 19,63 % (30. Juni 2023: 14,78 %)</b>			
740	Accton Technology Corp. ....	12.660	0,23
1.263	Advantech Co. Ltd. ....	14.405	0,26
12.000	Cathay Financial Holding Co. Ltd. ....	21.824	0,40
9.120	Delta Electronics, Inc. ....	108.934	2,00
2.400	E Ink Holdings, Inc. ....	18.643	0,34
16.000	E.Sun Financial Holding Co. Ltd. ....	14.081	0,26
280	Eclat Textile Co. Ltd. ....	4.566	0,08
38	eMemory Technology, Inc. ....	3.010	0,06

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>übertragbare Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien: 99,99 % (30. Juni 2023: 99,93 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Taiwan: 19,63 % (30. Juni 2023: 14,78 %) (Fortsetzung)</b>			
210	Fubon Financial Holding Co. Ltd. ....	513	0,01
180	Globalwafers Co. Ltd. ....	2.991	0,05
110	Largan Precision Co. Ltd. ....	9.307	0,17
1.740	MediaTek, Inc. ....	75.089	1,38
14.000	Mega Financial Holding Co. Ltd. ....	17.434	0,32
960	Nanya Technology Corp. ....	2.063	0,04
260	Nien Made Enterprise Co. Ltd. ....	3.126	0,06
660	Novatek Microelectronics Corp. ....	12.329	0,23
200	PharmaEssentia Corp. ....	3.452	0,06
638	Realtek Semiconductor Corp. ....	10.738	0,20
400	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. ....	568	0,01
29.000	Taiwan High Speed Rail Corp. ....	27.175	0,50
22.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	655.087	12,01
4.800	United Microelectronics Corp. ....	8.241	0,15
220	Yageo Corp. ....	4.950	0,09
40.000	Yuanta Financial Holding Co. Ltd. ....	39.517	0,72
		<u>1.070.703</u>	<u>19,63</u>
<b>Thailand: 1,93 % (30. Juni 2023: 3,25 %)</b>			
6.800	Airports of Thailand PCL NVDR ....	10.701	0,20
66.200	Asset World Corp. PCL NVDR ....	6.278	0,11
12.400	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR ....	9.039	0,17
11.800	Bangkok Expressway & Metro PCL NVDR ....	2.460	0,05
100	Bumrungrad Hospital PCL NVDR ....	673	0,01
4.800	Central Pattana PCL NVDR ....	7.227	0,13
2.200	Delta Electronics Thailand PCL NVDR ....	4.991	0,09
7.600	Energy Absolute PCL NVDR ....	2.319	0,04
6.600	Intouch Holdings PCL NVDR ....	12.859	0,24
13.000	Krungthai Card PCL NVDR ....	14.435	0,26
12.200	SCB X PCL NVDR ....	34.242	0,63
		<u>105.224</u>	<u>1,93</u>
<b>Türkei: 0,34 % (30. Juni 2023: 0,21 %)</b>			
5.936	Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS ....	10.610	0,19
300	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS ....	921	0,02
14.464	Turkiye Is Bankasi AS ....	6.993	0,13
		<u>18.524</u>	<u>0,34</u>
<b>Vereinigte Arabische Emirate: 0,09 % (30. Juni 2023: 0,15 %)</b>			
8.938	Multiply Group PJSC ....	4.988	0,09
		<u>4.988</u>	<u>0,09</u>
<b>USA: 0,61 % (30. Juni 2023: 0,34 %)</b>			
311	Southern Copper Corp. ....	33.507	0,61
		<u>33.507</u>	<u>0,61</u>
<b>Summe Aktien</b> .....		<u>5.455.009</u>	<u>99,99</u>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....		<u>5.455.009</u>	<u>99,99</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: Null (30. Juni 2023: 0,00 %)

Devisenterminkontrakte: Null (30. Juni 2023: 0,00 %)

	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>Anlagenportfolio</b>	5.455.009	99,99
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	374	0,01
<b>Nettovermögen</b>	<u>5.455.383</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	99,20
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	0,80
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 %</b>		
	<b>Aktien: 99,92 %</b>		
	<b>Australien: 1,46 %</b>		
657	Ampol Ltd. ....	14.190	0,03
531	ASX Ltd. ....	21.278	0,04
1.224	BlueScope Steel Ltd. ....	16.701	0,03
3.771	Brambles Ltd. ....	36.593	0,08
945	CAR Group Ltd. ....	22.247	0,05
180	Cochlear Ltd. ....	39.929	0,08
1.467	Computershare Ltd. ....	25.806	0,05
4.509	Goodman Group ....	104.644	0,21
963	Macquarie Group Ltd. ....	131.644	0,27
486	Mineral Resources Ltd. ....	17.501	0,04
7.956	Mirvac Group ....	9.936	0,02
3.087	Northern Star Resources Ltd. ....	26.802	0,05
1.260	Orica Ltd. ....	15.037	0,03
7.875	Pilbara Minerals Ltd. ....	16.146	0,03
72	Pro Medicus Ltd. ....	6.889	0,01
4.113	QBE Insurance Group Ltd. ....	47.768	0,10
144	REA Group Ltd. ....	18.913	0,04
225	Reece Ltd. ....	3.782	0,01
954	SEEK Ltd. ....	13.609	0,03
342	Seven Group Holdings Ltd. ....	8.606	0,02
1.251	Sonic Healthcare Ltd. ....	21.973	0,05
4.815	Stockland ....	13.409	0,03
3.429	Suncorp Group Ltd. ....	39.870	0,08
1.116	Treasury Wine Estates Ltd. ....	9.272	0,02
405	WiseTech Global Ltd. ....	27.129	0,06
		<b>709.674</b>	<b>1,46</b>
	<b>Österreich: 0,13 %</b>		
936	Erste Group Bank AG ....	44.380	0,09
189	Verbund AG ....	14.919	0,03
180	voestalpine AG ....	4.865	0,01
		<b>64.164</b>	<b>0,13</b>
	<b>Belgien: 0,26 %</b>		
441	Ageas SA ....	20.172	0,04
63	D'ieren Group ....	13.376	0,03
90	Elia Group SA ....	8.435	0,02
126	Groupe Bruxelles Lambert NV ....	9.000	0,02
639	KBC Group NV ....	45.132	0,09
9	Sofina SA ....	2.056	0,00
81	Syensqo SA ....	7.255	0,02
423	Umicore SA ....	6.361	0,01
486	Warehouses De Pauw CVA ....	13.178	0,03
		<b>124.965</b>	<b>0,26</b>
	<b>Bermuda: 0,20 %</b>		
3.447	Aegon Ltd. ....	21.309	0,04
504	Arch Capital Group Ltd. ....	50.848	0,11
54	Everest Group Ltd. ....	20.575	0,04
1.000	Hongkong Land Holdings Ltd. ....	3.230	0,01
		<b>95.962</b>	<b>0,20</b>
	<b>Kanada: 3,65 %</b>		
1.314	Agnico Eagle Mines Ltd. ....	85.926	0,18
2.034	Alimentation Couche-Tard, Inc. ....	114.116	0,23
1.926	Bank of Montreal ....	161.627	0,33
3.222	Bank of Nova Scotia ....	147.355	0,30
117	BCE, Inc. ....	3.789	0,01
369	Brookfield Renewable Corp. ....	10.452	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Kanada: 3,65 % (Fortsetzung)</b>		
54	BRP, Inc. ....	3.459	0,01
1.134	Cameco Corp. ....	55.782	0,11
126	Canadian Utilities Ltd. ....	2.721	0,01
198	CCL Industries, Inc. ....	10.410	0,02
27	Constellation Software, Inc. ....	77.780	0,16
234	Descartes Systems Group, Inc. ....	22.667	0,05
378	Dollarama, Inc. ....	34.506	0,07
1.071	Element Fleet Management Corp. ....	19.481	0,04
36	Fairfax Financial Holdings Ltd. ....	40.946	0,08
54	FirstService Corp. ....	8.216	0,02
387	Great-West Lifeco, Inc. ....	11.288	0,02
891	Hydro One Ltd. ....	25.948	0,05
225	iA Financial Corp., Inc. ....	14.126	0,03
153	IGM Financial, Inc. ....	4.223	0,01
486	Intact Financial Corp. ....	80.983	0,17
855	Ivanhoe Mines Ltd. ....	11.028	0,02
1.647	Kinross Gold Corp. ....	13.710	0,03
882	Lundin Mining Corp. ....	9.817	0,02
891	National Bank of Canada ....	70.656	0,14
1.296	Nutrien Ltd. ....	65.967	0,13
99	Onex Corp. ....	6.730	0,01
738	Open Text Corp. ....	22.156	0,05
378	Parkland Corp. ....	10.594	0,02
666	Power Corp. of Canada ....	18.505	0,04
171	Quebecor, Inc. ....	3.608	0,01
486	RB Global, Inc. ....	37.059	0,08
495	Restaurant Brands International, Inc. ....	34.873	0,07
288	RioCan Real Estate Investment Trust ....	3.538	0,01
468	Rogers Communications, Inc. ....	17.306	0,04
3.186	Shopify, Inc. ....	210.506	0,43
270	Stantec, Inc. ....	22.599	0,05
1.539	Sun Life Financial, Inc. ....	75.446	0,15
1.296	TELUS Corp. ....	19.615	0,04
198	Thomson Reuters Corp. ....	33.369	0,07
765	TMX Group Ltd. ....	21.289	0,04
90	Toromont Industries Ltd. ....	7.967	0,02
153	West Fraser Timber Co. Ltd. ....	11.748	0,02
1.188	Wheaton Precious Metals Corp. ....	62.276	0,13
342	WSP Global, Inc. ....	53.244	0,11
		<u>1.779.407</u>	<u>3,65</u>
	<b>Cayman-Inseln: 0,02 %</b>		
1.900	CK Asset Holdings Ltd. ....	7.118	0,01
63	Futu Holdings Ltd. ADR ....	4.133	0,01
		<u>11.251</u>	<u>0,02</u>
	<b>Curaçao: 0,36 %</b>		
3.753	Schlumberger NV ....	177.067	0,36
		<u>177.067</u>	<u>0,36</u>
	<b>Dänemark: 0,52 %</b>		
243	Carlsberg AS ....	29.182	0,06
279	Demant AS ....	12.085	0,02
450	DSV AS ....	69.005	0,14
522	Orsted AS ....	27.802	0,06
225	Pandora AS ....	33.985	0,07

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Dänemark: 0,52 % (Fortsetzung)</b>		
963	Tryg AS .....	21.064	0,04
2.637	Vestas Wind Systems AS .....	61.110	0,13
		<u>254.233</u>	<u>0,52</u>
	<b>Finnland: 0,75 %</b>		
378	Elisa OYJ .....	17.355	0,04
756	Kesko OYJ .....	13.280	0,03
855	Kone OYJ .....	42.234	0,09
1.548	Metso OYJ .....	16.398	0,03
1.143	Neste OYJ .....	20.366	0,04
13.698	Nokia OYJ .....	52.242	0,11
8.325	Nordea Bank Abp .....	99.172	0,20
1.242	Sampo OYJ .....	53.378	0,11
1.467	UPM-Kymmene OYJ .....	51.287	0,10
		<u>365.712</u>	<u>0,75</u>
	<b>Frankreich: 4,26 %</b>		
99	Aéroports de Paris SA .....	12.053	0,03
702	Alstom SA .....	11.812	0,03
171	Amundi SA .....	11.042	0,02
4.788	AXA SA .....	156.871	0,32
117	BioMerieux .....	11.129	0,02
810	Bureau Veritas SA .....	22.450	0,05
198	Capgemini SE .....	39.407	0,08
1.539	Carrefour SA .....	21.772	0,05
135	Covivio SA .....	6.421	0,01
2.673	Credit Agricole SA .....	36.497	0,08
1.764	Dassault Systemes SE .....	66.737	0,14
612	Edenred SE .....	25.850	0,05
774	EssilorLuxottica SA .....	166.902	0,34
126	Gecina SA .....	11.607	0,02
783	Getlink SE .....	12.965	0,03
83	Hermes International SCA .....	190.364	0,39
72	Ipsen SA .....	8.836	0,02
432	Klepierre SA .....	11.566	0,02
693	Legrand SA .....	68.806	0,14
729	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE .....	557.540	1,14
558	Pernod Ricard SA .....	75.771	0,16
612	Publicis Groupe SA .....	65.185	0,13
81	Remy Cointreau SA .....	6.763	0,01
621	Rexel SA .....	16.080	0,03
1.440	Schneider Electric SE .....	346.167	0,71
18	SEB SA .....	1.844	0,00
153	Sodexo SA .....	13.774	0,03
81	Teleperformance SE .....	8.537	0,02
243	Unibail-Rodamco-Westfield .....	19.147	0,04
675	Vinci SA .....	71.171	0,15
		<u>2.075.066</u>	<u>4,26</u>
	<b>Deutschland: 1,54 %</b>		
837	Bayerische Motoren Werke AG .....	79.282	0,16
162	Bayerische Motoren Werke AG (Vorzugsaktien) .....	14.315	0,03
81	Bechtle AG .....	3.814	0,01
135	Brenntag SE .....	9.109	0,02
27	Carl Zeiss Meditec AG .....	1.900	0,00
2.835	Commerzbank AG .....	43.100	0,09
198	Covestro AG .....	11.629	0,02
99	CTS Eventim AG & Co. KGaA .....	8.265	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Deutschland: 1,54 % (Fortsetzung)</b>		
504	Deutsche Boerse AG .....	103.225	0,21
6.183	E.ON SE .....	81.209	0,17
621	Evonik Industries AG .....	12.679	0,03
360	GEA Group AG .....	15.009	0,03
81	Hannover Rueck SE .....	20.548	0,04
459	Henkel AG & Co. KGaA (Vorzugsaktien) .....	40.939	0,08
279	Henkel AG & Co. KGaA Anteilsklasse A .....	21.963	0,04
198	Knorr-Bremse AG .....	15.130	0,03
360	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München .....	180.183	0,37
81	Nemetschek SE .....	7.974	0,02
9	Rational AG .....	7.500	0,02
99	Scout24 SE .....	7.554	0,02
369	Symrise AG .....	45.203	0,09
90	Talanx AG .....	7.191	0,01
603	Zalando SE .....	14.147	0,03
		<hr/>	
		751.868	1,54
	<b>Hongkong: 0,82 %</b>		
29.400	AIA Group Ltd. ....	199.580	0,41
9.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd. ....	27.724	0,06
1.800	Hang Seng Bank Ltd. ....	23.147	0,05
3.200	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd. ....	102.549	0,21
1.928	Sun Hung Kai Properties Ltd. ....	16.681	0,03
500	Swire Pacific Ltd. ....	4.419	0,01
2.250	Techtronic Industries Co. Ltd. ....	25.706	0,05
		<hr/>	
		399.806	0,82
	<b>Irland: 1,15 %</b>		
4.221	AIB Group PLC .....	22.330	0,05
234	Allegion PLC .....	27.647	0,06
324	Aon PLC .....	95.120	0,19
1.620	Bank of Ireland Group PLC .....	16.959	0,03
1.098	James Hardie Industries PLC .....	34.685	0,07
441	Pentair PLC .....	33.811	0,07
702	Smurfit Kappa Group PLC .....	31.325	0,06
270	STERIS PLC .....	59.276	0,12
603	Trane Technologies PLC .....	198.345	0,41
162	Willis Towers Watson PLC .....	42.467	0,09
		<hr/>	
		561.965	1,15
	<b>Israel: 0,20 %</b>		
63	Azrieli Group Ltd. ....	3.696	0,01
108	Check Point Software Technologies Ltd. ....	17.820	0,04
117	CyberArk Software Ltd. ....	31.990	0,06
135	Global-e Online Ltd. ....	4.897	0,01
36	Monday.com Ltd. ....	8.667	0,02
171	Nice Ltd. ....	27.966	0,06
		<hr/>	
		95.036	0,20
	<b>Italien: 0,69 %</b>		
342	Amplifon SpA .....	12.184	0,03
304	Amplifon SpA (Stimmrecht) .....	-	0,00
2.655	Assicurazioni Generali SpA .....	66.272	0,14
45	DiaSorin SpA .....	4.488	0,01
1.656	FinecoBank Banca Fineco SpA .....	24.705	0,05
38.592	Intesa Sanpaolo SpA .....	143.564	0,29
1.188	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA .....	17.431	0,04
558	Moncler SpA .....	34.124	0,07
1.629	Nexi SpA .....	9.941	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Italien: 0,69 % (Fortsetzung)</b>		
1.260	Poste Italiane SpA .....	16.063	0,03
135	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA .....	7.046	0,01
2.430	Telecom Italia SpA .....	582	0,00
		<b>336.400</b>	<b>0,69</b>
	<b>Japan: 5,32 %</b>		
2.000	Advantest Corp. ....	79.883	0,16
1.800	Aeon Co. Ltd. ....	38.482	0,08
3.600	Asahi Kasei Corp. ....	23.062	0,05
1.600	Asics Corp. ....	24.478	0,05
900	Bandai Namco Holdings, Inc. ....	17.568	0,04
900	Brother Industries Ltd. ....	15.839	0,03
400	Capcom Co. Ltd. ....	7.542	0,02
900	Chiba Bank Ltd. ....	8.012	0,02
2.700	Concordia Financial Group Ltd. ....	15.882	0,03
900	Daifuku Co. Ltd. ....	16.841	0,03
900	Dai-ichi Life Holdings, Inc. ....	24.047	0,05
117	Daito Trust Construction Co. Ltd. ....	12.063	0,02
1.400	Daiwa House Industry Co. Ltd. ....	35.483	0,07
3.600	Daiwa Securities Group, Inc. ....	27.460	0,06
200	Dentsu Group, Inc. ....	5.039	0,01
120	Disco Corp. ....	45.535	0,09
7.200	ENEOS Holdings, Inc. ....	36.998	0,08
2.700	FANUC Corp. ....	74.004	0,15
200	Hitachi Construction Machinery Co. Ltd. ....	5.356	0,01
100	Hoshizaki Corp. ....	3.172	0,01
400	Hulic Co. Ltd. ....	3.542	0,01
900	Japan Exchange Group, Inc. ....	20.992	0,04
1.800	Japan Post Bank Co. Ltd. ....	17.003	0,03
100	Japan Post Insurance Co. Ltd. ....	1.940	0,00
900	Kajima Corp. ....	15.562	0,03
3.900	KDDI Corp. ....	103.137	0,21
270	Keyence Corp. ....	118.417	0,24
2.000	Kirin Holdings Co. Ltd. ....	25.774	0,05
200	Kobe Bussan Co. Ltd. ....	4.456	0,01
300	Koito Manufacturing Co. Ltd. ....	4.138	0,01
2.700	Kubota Corp. ....	37.766	0,08
900	Kyowa Kirin Co. Ltd. ....	15.372	0,03
7.200	LY Corp. ....	17.407	0,04
200	Makita Corp. ....	5.436	0,01
900	MatsukiyoCocokara & Co. ....	12.924	0,03
3.000	Mitsubishi Estate Co. Ltd. ....	46.997	0,10
900	Mitsubishi HC Capital, Inc. ....	5.942	0,01
400	Mitsui Chemicals, Inc. ....	11.041	0,02
7.200	Mitsui Fudosan Co. Ltd. ....	65.729	0,13
3.600	MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. ....	80.007	0,16
700	NEC Corp. ....	57.637	0,12
500	Nexon Co. Ltd. ....	9.247	0,02
1	Nippon Building Fund, Inc. ....	3.500	0,01
100	NIPPON EXPRESS HOLDINGS, Inc. ....	4.610	0,01
900	Nippon Paint Holdings Co. Ltd. ....	5.864	0,01
387	Nitto Denko Corp. ....	30.578	0,06
5	Nomura Real Estate Master Fund, Inc. ....	4.436	0,01
900	Nomura Research Institute Ltd. ....	25.295	0,05
900	NTT Data Group Corp. ....	13.215	0,03
1.800	Obayashi Corp. ....	21.395	0,04
90	Obic Co. Ltd. ....	11.604	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Japan: 5,32 % (Fortsetzung)</b>		
514	Omron Corp. ....	17.667	0,04
100	Oracle Corp. ....	6.900	0,01
200	Otsuka Corp. ....	3.843	0,01
1.800	Resona Holdings, Inc. ....	11.912	0,02
400	SBI Holdings, Inc. ....	10.113	0,02
81	SCREEN Holdings Co. Ltd. ....	7.301	0,02
300	SCSK Corp. ....	5.992	0,01
900	Seiko Epson Corp. ....	13.982	0,03
1.800	Sekisui House Ltd. ....	39.869	0,08
900	SG Holdings Co. Ltd. ....	8.295	0,02
2.300	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. ....	89.192	0,18
900	Shizuoka Financial Group, Inc. ....	8.639	0,02
7.200	SoftBank Corp. ....	87.930	0,18
2.200	Sompo Holdings, Inc. ....	46.979	0,10
600	Sumitomo Metal Mining Co. Ltd. ....	18.195	0,04
3.300	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. ....	220.021	0,45
1.800	Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc. ....	41.067	0,08
441	Sumitomo Realty & Development Co. Ltd. ....	12.943	0,03
100	Suntory Beverage & Food Ltd. ....	3.548	0,01
1.200	T&D Holdings, Inc. ....	20.951	0,04
200	Taisei Corp. ....	7.399	0,02
600	TIS, Inc. ....	11.630	0,02
100	Toho Co. Ltd. ....	2.924	0,01
5.100	Tokio Marine Holdings, Inc. ....	190.386	0,39
1.242	Tokyo Electron Ltd. ....	269.463	0,55
900	Tokyo Gas Co. Ltd. ....	19.330	0,04
3.600	Toray Industries, Inc. ....	17.042	0,04
144	Toyota Industries Corp. ....	12.143	0,03
180	Trend Micro, Inc. ....	7.308	0,02
200	Yakult Honsha Co. Ltd. ....	3.576	0,01
2.700	Yamaha Motor Co. Ltd. ....	24.993	0,05
400	Yaskawa Electric Corp. ....	14.365	0,03
500	Yokogawa Electric Corp. ....	12.091	0,02
300	ZOZO, Inc. ....	7.512	0,02
		<b>2.593.210</b>	<b>5,32</b>
	<b>Jersey: 0,40 %</b>		
1.368	Amcor PLC ....	13.379	0,03
720	Aptiv PLC ....	50.703	0,10
531	Ferguson PLC ....	102.828	0,21
2.889	WPP PLC ....	26.455	0,06
		<b>193.365</b>	<b>0,40</b>
	<b>Luxembourg: 0,03 %</b>		
333	InPost SA ....	5.875	0,01
657	Tenaris SA ....	10.104	0,02
		<b>15.979</b>	<b>0,03</b>
	<b>Niederlande: 4,19 %</b>		
612	ABN AMRO Bank NV ....	10.068	0,02
28	Adyen NV ....	33.406	0,07
549	AerCap Holdings NV ....	51.167	0,10
459	Akzo Nobel NV ....	27.932	0,06
126	ASM International NV ....	96.122	0,20
1.062	ASML Holding NV ....	1.097.451	2,25
441	ASR Nederland NV ....	21.037	0,04
189	BE Semiconductor Industries NV ....	31.630	0,06
2.241	CNH Industrial NV ....	22.701	0,05

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Niederlande: 4,19 % (Fortsetzung)</b>		
846	Davide Campari-Milano NV .....	8.001	0,02
90	Euronext NV .....	8.343	0,02
756	Heineken NV .....	73.165	0,15
81	IMCD NV .....	11.225	0,02
8.712	ING Groep NV .....	149.039	0,31
135	JDE Peet's NV .....	2.691	0,01
10.440	Koninklijke KPN NV .....	40.057	0,08
738	NN Group NV .....	34.367	0,07
3.744	Prosus NV .....	133.460	0,27
297	Randstad NV .....	13.474	0,03
2.277	Universal Music Group NV .....	67.794	0,14
657	Wolters Kluwer NV .....	109.001	0,22
		<u>2.042.131</u>	<u>4,19</u>
	<b>Neuseeland: 0,17 %</b>		
3.573	Auckland International Airport Ltd. ....	16.612	0,03
585	Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd. ....	10.723	0,02
3.474	Meridian Energy Ltd. ....	13.315	0,03
4.338	Spark New Zealand Ltd. ....	10.997	0,02
351	Xero Ltd. ....	31.974	0,07
		<u>83.621</u>	<u>0,17</u>
	<b>Norwegen: 0,25 %</b>		
405	Aker BP ASA .....	10.354	0,02
2.277	DNB Bank ASA .....	44.845	0,09
558	Gjensidige Forsikring ASA .....	9.999	0,02
1.278	Mowi ASA .....	21.329	0,05
1.935	Orkla ASA .....	15.765	0,03
117	Salmar ASA .....	6.176	0,01
459	Yara International ASA .....	13.260	0,03
		<u>121.728</u>	<u>0,25</u>
	<b>Portugal: 0,07 %</b>		
1.251	Galp Energia SGPS SA .....	26.440	0,05
396	Jeronimo Martins SGPS SA .....	7.745	0,02
		<u>34.185</u>	<u>0,07</u>
	<b>Singapur: 0,61 %</b>		
10.800	CapitaLand Ascendas REIT .....	20.401	0,04
14.400	CapitaLand Integrated Commercial Trust .....	21.038	0,04
1.800	DBS Group Holdings Ltd. ....	47.535	0,10
3.600	Keppel Ltd. ....	17.187	0,03
9.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. ....	95.827	0,20
1.800	Singapore Exchange Ltd. ....	12.591	0,03
3.600	United Overseas Bank Ltd. ....	83.223	0,17
		<u>297.802</u>	<u>0,61</u>
	<b>Spanien: 0,43 %</b>		
504	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA .....	21.758	0,04
1.188	Amadeus IT Group SA .....	79.119	0,16
14.049	Banco de Sabadell SA .....	27.110	0,06
5.076	CaixaBank SA .....	26.891	0,06
1.332	Cellnex Telecom SA .....	43.356	0,09
855	EDP Renovaveis SA .....	11.958	0,02
		<u>210.192</u>	<u>0,43</u>
	<b>Schweden: 1,54 %</b>		
783	Alfa Laval AB .....	34.314	0,07
2.646	Assa Abloy AB .....	74.856	0,15
7.083	Atlas Copco AB Anteilsklasse A .....	133.230	0,27

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>			
<b>Schweden: 1,54 % (Fortsetzung)</b>			
4.302	Atlas Copco AB Anteilsklasse B .....	69.525	0,14
405	Beijer Ref AB .....	6.253	0,01
657	Boliden AB .....	21.037	0,04
1.620	Epiroc AB Anteilsklasse A .....	32.354	0,07
1.071	Epiroc AB Anteilsklasse B .....	19.599	0,04
1.017	EQT AB .....	30.077	0,06
522	Fastighets AB Balder .....	3.580	0,01
234	Getinge AB .....	3.978	0,01
207	Holmen AB .....	8.155	0,02
972	Husqvarna AB .....	7.796	0,02
180	Industrivarden AB Anteilsklasse A .....	6.129	0,01
207	Industrivarden AB Anteilsklasse C .....	6.990	0,01
378	Indutrade AB .....	9.694	0,02
207	Investment AB Latour .....	5.594	0,01
108	L E Lundbergforetagen AB .....	5.344	0,01
324	Lifco AB .....	8.903	0,02
3.492	Nibe Industrier AB .....	14.818	0,03
639	Sagax AB .....	16.364	0,03
2.781	Sandvik AB .....	55.777	0,12
675	Securitas AB .....	6.705	0,01
4.131	Skandinaviska Enskilda Banken AB .....	61.047	0,13
477	Skanska AB .....	8.594	0,02
1.665	Svenska Cellulosa AB SCA .....	24.613	0,05
3.951	Svenska Handelsbanken AB .....	37.662	0,08
1.440	Tele2 AB .....	14.509	0,03
6.345	Telia Co. AB .....	17.034	0,04
1.251	Volvo Car AB .....	3.873	0,01
		<b>748.404</b>	<b>1,54</b>
<b>Schweiz: 3,26 %</b>			
4.221	ABB Ltd. ....	234.490	0,48
99	Avolta AG .....	3.845	0,01
126	Baloise Holding AG .....	22.183	0,05
81	Banque Cantonale Vaudoise .....	8.595	0,02
540	Chubb Ltd. ....	137.743	0,28
504	DSM-Firmenich AG .....	57.041	0,12
9	EMS-Chemie Holding AG .....	7.376	0,02
207	Garmin Ltd. ....	33.724	0,07
24	Givaudan SA .....	113.777	0,23
54	Helvetia Holding AG .....	7.301	0,01
558	Julius Baer Group Ltd. ....	31.173	0,06
126	Kuehne & Nagel International AG .....	36.232	0,07
405	Logitech International SA .....	39.175	0,08
27	Partners Group Holding AG .....	34.674	0,07
36	Schindler Holding AG .....	8.974	0,02
54	Schindler Holding AG (partly paid) .....	13.569	0,03
405	SGS SA .....	36.056	0,07
756	SIG Group AG .....	13.840	0,03
405	Sika AG .....	115.920	0,24
135	Sonova Holding AG .....	41.705	0,09
297	Straumann Holding AG .....	36.786	0,08
36	Swatch Group AG .....	7.373	0,02
90	Swatch Group AG REGS .....	3.676	0,01
81	Swiss Life Holding AG .....	59.547	0,12
207	Swiss Prime Site AG .....	19.627	0,04
810	Swiss Re AG .....	100.506	0,21
72	Swisscom AG .....	40.503	0,08

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweiz: 3,26 % (Fortsetzung)</b>		
414	TE Connectivity Ltd. ....	62.278	0,13
171	Temenos AG .....	11.798	0,02
72	VAT Group AG .....	40.816	0,08
387	Zurich Insurance Group AG .....	206.334	0,42
		<u>1.586.637</u>	<u>3,26</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 2,90 %</b>		
2.565	3i Group PLC .....	99.413	0,20
711	Admiral Group PLC .....	23.503	0,05
1.062	Antofagasta PLC .....	28.326	0,06
2.439	Auto Trader Group PLC .....	24.702	0,05
6.777	Aviva PLC .....	40.829	0,08
2.619	Barratt Developments PLC .....	15.633	0,03
288	Berkeley Group Holdings PLC .....	16.703	0,03
918	Bunzl PLC .....	34.929	0,07
963	Burberry Group PLC .....	10.686	0,02
12.762	Centrica PLC .....	21.763	0,05
531	Coca-Cola Europacific Partners PLC .....	38.694	0,08
2.223	Compass Group PLC .....	60.698	0,12
360	Croda International PLC .....	17.966	0,04
1.026	Halma PLC .....	35.096	0,07
3.591	Informa PLC .....	38.848	0,08
3.483	JD Sports Fashion PLC .....	5.261	0,01
5.049	Kingfisher PLC .....	15.880	0,03
1.953	Land Securities Group PLC .....	15.294	0,03
16.470	Legal & General Group PLC .....	47.261	0,10
1.233	London Stock Exchange Group PLC .....	146.512	0,30
6.201	M&G PLC .....	15.991	0,03
1.215	Mondi PLC .....	23.322	0,05
9.810	National Grid PLC .....	109.450	0,22
1.566	Pearson PLC .....	19.614	0,04
432	Persimmon PLC .....	7.383	0,02
1.530	Phoenix Group Holdings PLC .....	10.086	0,02
7.164	Prudential PLC .....	65.058	0,13
4.950	RELX PLC .....	227.703	0,47
621	Royalty Pharma PLC .....	16.376	0,03
2.763	Sage Group PLC .....	38.018	0,08
2.223	Schroders PLC .....	10.223	0,02
3.402	Segro PLC .....	38.627	0,08
171	Spirax-Sarco Engineering PLC .....	18.330	0,04
5.823	Standard Chartered PLC .....	52.704	0,11
9.774	Taylor Wimpey PLC .....	17.563	0,04
846	Wise PLC .....	7.288	0,02
		<u>1.415.733</u>	<u>2,90</u>
	<b>USA: 64,74 %</b>		
1.188	Adobe, Inc. ....	659.981	1,35
4.293	Advanced Micro Devices, Inc. ....	696.368	1,43
135	AECOM .....	11.899	0,02
720	Aflac, Inc. ....	64.303	0,13
585	Airbnb, Inc. ....	88.704	0,18
414	Akamai Technologies, Inc. ....	37.293	0,08
639	Albertsons Co., Inc. ....	12.620	0,03
99	Align Technology, Inc. ....	23.902	0,05
369	Ally Financial, Inc. ....	14.638	0,03
1.521	American Express Co. ....	352.188	0,72
549	American Homes 4 Rent .....	20.401	0,04
891	American International Group, Inc. ....	66.148	0,14

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 64,74 % (Fortsetzung)</b>		
513	American Water Works Co., Inc. ....	66.259	0,14
135	Ameriprise Financial, Inc. ....	57.671	0,12
369	AMETEK, Inc. ....	61.516	0,13
1.980	Amphenol Corp. ....	133.393	0,27
675	Annaly Capital Management, Inc. ....	12.865	0,03
225	ANSYS, Inc. ....	72.337	0,15
648	Apollo Global Management, Inc. ....	76.509	0,16
2.196	Applied Materials, Inc. ....	518.234	1,06
225	AppLovin Corp. ....	18.724	0,04
225	ARES Management Corp. ....	29.988	0,06
351	Arista Networks, Inc. ....	123.018	0,25
297	Arthur J Gallagher & Co. ....	77.015	0,16
72	Aspen Technology, Inc. ....	14.301	0,03
72	Assurant, Inc. ....	11.970	0,02
423	Atlassian Corp. ....	74.820	0,15
207	Atmos Energy Corp. ....	24.147	0,05
567	Autodesk, Inc. ....	140.304	0,29
1.098	Automatic Data Processing, Inc. ....	262.082	0,54
22	AutoZone, Inc. ....	65.210	0,13
189	AvalonBay Communities, Inc. ....	39.102	0,08
1.773	Avantor, Inc. ....	37.588	0,08
207	Avery Dennison Corp. ....	45.261	0,09
180	Axon Enterprise, Inc. ....	52.963	0,11
2.637	Baker Hughes Co. ....	92.743	0,19
1.989	Bank of New York Mellon Corp. ....	119.121	0,24
297	Bath & Body Works, Inc. ....	11.598	0,02
207	Bentley Systems, Inc. ....	10.217	0,02
198	BlackRock, Inc. ....	155.889	0,32
945	Blackstone, Inc. ....	116.991	0,24
765	Block, Inc. ....	49.335	0,10
45	Booking Holdings, Inc. ....	178.267	0,37
405	Boston Properties, Inc. ....	24.932	0,05
729	Broadcom, Inc. ....	1.170.431	2,40
324	Brown & Brown, Inc. ....	28.969	0,06
459	Brown-Forman Corp. ....	19.824	0,04
153	Builders FirstSource, Inc. ....	21.177	0,04
720	Cadence Design Systems, Inc. ....	221.580	0,45
144	Camden Property Trust ....	15.712	0,03
630	Capital One Financial Corp. ....	87.223	0,18
63	Carlisle Cos., Inc. ....	25.528	0,05
288	Carlyle Group, Inc. ....	11.563	0,02
432	CarMax, Inc. ....	31.683	0,07
144	Choe Global Markets, Inc. ....	24.489	0,05
801	CBRE Group, Inc. ....	71.377	0,15
180	CDW Corp. ....	40.291	0,08
144	Celanese Corp. ....	19.424	0,04
207	Celsius Holdings, Inc. ....	11.818	0,02
315	CH Robinson Worldwide, Inc. ....	27.758	0,06
1.989	Charles Schwab Corp. ....	146.569	0,30
162	Charter Communications, Inc. ....	48.431	0,10
612	Cheniere Energy, Inc. ....	106.996	0,22
216	Cincinnati Financial Corp. ....	25.510	0,05
342	Clorox Co. ....	46.673	0,10
396	Cloudflare, Inc. ....	32.801	0,07
477	CME Group, Inc. ....	93.778	0,19
675	Cognizant Technology Solutions Corp. ....	45.900	0,09
180	Coinbase Global, Inc. ....	40.001	0,08

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 64,74 % (Fortsetzung)</b>		
5.229	Comcast Corp. ....	204.768	0,42
504	Confluent, Inc. ....	14.883	0,03
351	Consolidated Edison, Inc. ....	31.386	0,06
279	Constellation Brands, Inc. ....	71.781	0,15
1.188	Copart, Inc. ....	64.342	0,13
81	Corpay, Inc. ....	21.579	0,04
657	CoStar Group, Inc. ....	48.710	0,10
315	CrowdStrike Holdings, Inc. ....	120.705	0,25
1.143	Crown Castle, Inc. ....	111.671	0,23
207	Crown Holdings, Inc. ....	15.399	0,03
468	Datadog, Inc. ....	60.695	0,12
153	DaVita, Inc. ....	21.201	0,04
396	Dayforce, Inc. ....	19.642	0,04
67	Deckers Outdoor Corp. ....	64.853	0,13
702	Deere & Co. ....	262.288	0,54
504	Dexcom, Inc. ....	57.143	0,12
657	Discover Financial Services ....	85.942	0,18
522	DocuSign, Inc. ....	27.927	0,06
288	Dollar General Corp. ....	38.082	0,08
270	Dollar Tree, Inc. ....	28.828	0,06
351	DoorDash, Inc. ....	38.182	0,08
360	Dover Corp. ....	64.962	0,13
486	DR Horton, Inc. ....	68.492	0,14
369	Dynatrace, Inc. ....	16.509	0,03
198	Eastman Chemical Co. ....	19.398	0,04
711	eBay, Inc. ....	38.195	0,08
675	Ecolab, Inc. ....	160.650	0,33
1.584	Edwards Lifesciences Corp. ....	146.314	0,30
693	Electronic Arts, Inc. ....	96.556	0,20
621	Elevance Health, Inc. ....	336.495	0,69
756	Emerson Electric Co. ....	83.281	0,17
360	Enphase Energy, Inc. ....	35.896	0,07
81	EPAM Systems, Inc. ....	15.237	0,03
243	Equity LifeStyle Properties, Inc. ....	15.827	0,03
369	Equity Residential ....	25.586	0,05
675	Essential Utilities, Inc. ....	25.198	0,05
90	Essex Property Trust, Inc. ....	24.498	0,05
315	Estee Lauder Cos., Inc. ....	33.516	0,07
144	Etsy, Inc. ....	8.493	0,02
900	Eversource Energy ....	51.039	0,10
243	Exact Sciences Corp. ....	10.267	0,02
2.637	Exelon Corp. ....	91.267	0,19
369	Expeditors International of Washington, Inc. ....	46.047	0,09
270	Extra Space Storage, Inc. ....	41.961	0,09
81	F5, Inc. ....	13.951	0,03
99	FactSet Research Systems, Inc. ....	40.419	0,08
63	Fair Isaac Corp. ....	93.786	0,19
765	Fastenal Co. ....	48.073	0,10
351	Fidelity National Financial, Inc. ....	17.346	0,04
1.521	Fidelity National Information Services, Inc. ....	114.623	0,24
12	First Citizens BancShares, Inc. ....	20.203	0,04
783	Fiserv, Inc. ....	116.698	0,24
612	Fortinet, Inc. ....	36.885	0,08
342	Fortune Brands Innovations, Inc. ....	22.209	0,05
396	Franklin Resources, Inc. ....	8.851	0,02
207	Gartner, Inc. ....	92.955	0,19
738	GE HealthCare Technologies, Inc. ....	57.505	0,12

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 64,74 % (Fortsetzung)</b>		
1.548	Gen Digital, Inc. ....	38.669	0,08
1.494	General Mills, Inc. ....	94.510	0,19
180	Genuine Parts Co. ....	24.898	0,05
351	Global Payments, Inc. ....	33.942	0,07
180	GoDaddy, Inc. ....	25.148	0,05
459	Graco, Inc. ....	36.389	0,07
1.215	Halliburton Co. ....	41.043	0,08
405	Hartford Financial Services Group, Inc. ....	40.719	0,08
324	Henry Schein, Inc. ....	20.768	0,04
3.582	Hewlett Packard Enterprise Co. ....	75.831	0,16
216	HF Sinclair Corp. ....	11.521	0,02
594	Hologic, Inc. ....	44.104	0,09
2.619	Home Depot, Inc. ....	901.565	1,85
72	Hubbell, Inc. ....	26.315	0,05
126	HubSpot, Inc. ....	74.314	0,15
153	Humana, Inc. ....	57.168	0,12
3.987	Huntington Bancshares, Inc. ....	52.549	0,11
207	IDEX Corp. ....	41.648	0,09
216	IDEXX Laboratories, Inc. ....	105.235	0,22
396	Illinois Tool Works, Inc. ....	93.836	0,19
234	Incyte Corp. ....	14.185	0,03
1.062	Ingersoll Rand, Inc. ....	96.472	0,20
198	Insulet Corp. ....	39.956	0,08
11.232	Intel Corp. ....	347.855	0,71
756	Intercontinental Exchange, Inc. ....	103.489	0,21
666	International Flavors & Fragrances, Inc. ....	63.410	0,13
882	International Paper Co. ....	38.058	0,08
1.026	Interpublic Group of Co., Inc. ....	29.846	0,06
738	Intuit, Inc. ....	485.021	1,00
1.026	Invitation Homes, Inc. ....	36.823	0,08
477	IQVIA Holdings, Inc. ....	100.857	0,21
108	J M Smucker Co. ....	11.776	0,02
99	Jack Henry & Associates, Inc. ....	16.436	0,03
864	Juniper Networks, Inc. ....	31.501	0,06
2.565	Kenvue, Inc. ....	46.632	0,10
2.853	Keurig Dr Pepper, Inc. ....	95.290	0,20
1.575	KeyCorp ....	22.381	0,05
468	Keysight Technologies, Inc. ....	63.999	0,13
837	Kimco Realty Corp. ....	16.288	0,03
225	KLA Corp. ....	185.515	0,38
378	Lattice Semiconductor Corp. ....	21.920	0,05
315	Lennar Corp. Anteilsklasse A ....	47.209	0,10
270	Liberty Media Corp.-Liberty Formula One ....	19.397	0,04
765	LKQ Corp. ....	31.816	0,07
1.512	Lowe's Co., Inc. ....	333.335	0,68
90	LPL Financial Holdings, Inc. ....	25.137	0,05
315	Lululemon Athletica, Inc. ....	94.090	0,19
279	M&T Bank Corp. ....	42.229	0,09
171	Manhattan Associates, Inc. ....	42.182	0,09
108	MarketAxess Holdings, Inc. ....	21.657	0,04
648	Marsh & McLennan Co., Inc. ....	136.547	0,28
2.286	Marvell Technology, Inc. ....	159.791	0,33
225	Masco Corp. ....	15.001	0,03
2.205	Mastercard, Inc. ....	972.758	2,00
639	McCormick & Co., Inc. ....	45.331	0,09
54	Mettler-Toledo International, Inc. ....	75.470	0,15
18	MicroStrategy, Inc. ....	24.795	0,05

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 64,74 % (Fortsetzung)</b>		
162	Molina Healthcare, Inc. ....	48.163	0,10
99	MongoDB, Inc. ....	24.746	0,05
81	Monolithic Power Systems, Inc. ....	66.556	0,14
999	Monster Beverage Corp. ....	49.900	0,10
432	Moody's Corp. ....	181.842	0,37
3.240	Morgan Stanley ....	314.896	0,65
441	Mosaic Co. ....	12.745	0,03
1.062	Nasdaq, Inc. ....	63.996	0,13
549	NetApp, Inc. ....	70.711	0,15
576	Netflix, Inc. ....	388.731	0,80
3.042	Newmont Corp. ....	127.369	0,26
90	Nordson Corp. ....	20.875	0,04
558	Northern Trust Corp. ....	46.861	0,10
639	Nucor Corp. ....	101.013	0,21
52.065	NVIDIA Corp. ....	6.432.110	13,20
4	NVR, Inc. ....	30.354	0,06
234	Okta, Inc. ....	21.905	0,04
243	Omnicom Group, Inc. ....	21.797	0,04
1.539	ONEOK, Inc. ....	125.505	0,26
531	Otis Worldwide Corp. ....	51.114	0,10
684	PACCAR, Inc. ....	70.411	0,14
126	Packaging Corp. of America ....	23.003	0,05
855	Paychex, Inc. ....	101.369	0,21
72	Paycom Software, Inc. ....	10.299	0,02
126	Paylocity Holding Corp. ....	16.613	0,03
1.323	PayPal Holdings, Inc. ....	76.774	0,16
1.053	PNC Financial Services Group, Inc. ....	163.720	0,34
108	Pool Corp. ....	33.192	0,07
405	Principal Financial Group, Inc. ....	31.772	0,07
774	Progressive Corp. ....	160.768	0,33
918	Prologis, Inc. ....	103.101	0,21
945	Prudential Financial, Inc. ....	110.745	0,23
324	PTC, Inc. ....	58.861	0,12
1.314	Public Service Enterprise Group, Inc. ....	96.842	0,20
270	Public Storage ....	77.665	0,16
297	PulteGroup, Inc. ....	32.700	0,07
1.476	QUALCOMM, Inc. ....	293.990	0,60
342	Raymond James Financial, Inc. ....	42.275	0,09
855	Realty Income Corp. ....	45.161	0,09
234	Regency Centers Corp. ....	14.555	0,03
2.565	Regions Financial Corp. ....	51.403	0,11
81	Reliance, Inc. ....	23.134	0,05
144	Repligen Corp. ....	18.153	0,04
198	ResMed, Inc. ....	37.901	0,08
315	Rockwell Automation, Inc. ....	86.713	0,18
171	Roku, Inc. ....	10.248	0,02
144	Roper Technologies, Inc. ....	81.167	0,17
441	Ross Stores, Inc. ....	64.086	0,13
162	RPM International, Inc. ....	17.444	0,04
846	S&P Global, Inc. ....	377.316	0,77
234	Samsara, Inc. ....	7.886	0,02
297	SBA Communications Corp. ....	58.301	0,12
540	ServiceNow, Inc. ....	424.802	0,87
315	Sherwin-Williams Co. ....	94.005	0,19
423	Simon Property Group, Inc. ....	64.211	0,13
216	Skyworks Solutions, Inc. ....	23.021	0,05
1.053	Snap, Inc. ....	17.490	0,04

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 64,74 % (Fortsetzung)</b>		
54	Snap-on, Inc. ....	14.115	0,03
387	Solventum Corp. ....	20.465	0,04
207	Stanley Black & Decker, Inc. ....	16.537	0,03
846	State Street Corp. ....	62.604	0,13
396	Steel Dynamics, Inc. ....	51.282	0,11
450	Stryker Corp. ....	153.112	0,31
171	Sun Communities, Inc. ....	20.578	0,04
1.116	Synchrony Financial ....	52.664	0,11
405	Synopsys, Inc. ....	240.999	0,49
225	T Rowe Price Group, Inc. ....	25.945	0,05
1.215	Target Corp. ....	179.869	0,37
126	Teleflex, Inc. ....	26.502	0,05
252	Teradyne, Inc. ....	37.369	0,08
1.494	TJX Co., Inc. ....	164.489	0,34
459	Toast, Inc. ....	11.828	0,02
279	Toro Co. ....	26.089	0,05
279	Tractor Supply Co. ....	75.330	0,15
144	Tradeweb Markets, Inc. ....	15.264	0,03
261	TransUnion ....	19.356	0,04
297	Travelers Co., Inc. ....	60.392	0,12
1.836	Truist Financial Corp. ....	71.329	0,15
459	Twilio, Inc. ....	26.076	0,05
54	Tyler Technologies, Inc. ....	27.150	0,06
2.052	U.S. Bancorp ....	81.464	0,17
477	UDR, Inc. ....	19.629	0,04
99	U-Haul Holding Co. ....	5.942	0,01
1.044	UiPath, Inc. ....	13.238	0,03
126	Ulta Beauty, Inc. ....	48.620	0,10
333	Unity Software, Inc. ....	5.415	0,01
441	Valero Energy Corp. ....	69.131	0,14
198	Veeva Systems, Inc. ....	36.236	0,07
648	Veralto Corp. ....	61.865	0,13
234	Verisk Analytics, Inc. ....	63.075	0,13
11.097	Verizon Communications, Inc. ....	457.640	0,94
513	Vertiv Holdings Co. ....	44.410	0,09
2.106	Visa, Inc. ....	552.762	1,13
225	Vulcan Materials Co. ....	55.953	0,11
279	W R Berkley Corp. ....	21.924	0,05
2.061	Walgreens Boots Alliance, Inc. ....	24.928	0,05
3.114	Warner Bros Discovery, Inc. ....	23.168	0,05
162	Waters Corp. ....	46.999	0,10
54	Watsco, Inc. ....	25.015	0,05
1.116	Welltower, Inc. ....	116.343	0,24
279	Westinghouse Air Brake Technologies Corp. ....	44.096	0,09
63	Westlake Corp. ....	9.124	0,02
342	Westrock Co. ....	17.189	0,04
153	Williams-Sonoma, Inc. ....	43.203	0,09
558	Workday, Inc. ....	124.746	0,26
297	WP Carey, Inc. ....	16.350	0,03
117	WW Grainger, Inc. ....	105.562	0,22
639	Xylem, Inc. ....	86.668	0,18
288	Yum! Brands, Inc. ....	38.148	0,08
72	Zebra Technologies Corp. ....	22.243	0,05

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 64,74 % (Fortsetzung)</b>		
207	Zillow Group, Inc. ....	9.603	0,02
540	Zimmer Biomet Holdings, Inc. ....	58.606	0,12
		<u>31.553.068</u>	<u>64,74</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>48.698.631</u>	<u>99,92</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>48.698.631</u>	<u>99,92</u>
		<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	48.698.631	99,92
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<u>40.602</u>	<u>0,08</u>
	<b>Nettovermögen</b>	<u>48.739.233</u>	<u>100,00</u>
			<b>% des Gesamt- vermögens</b>
	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
	An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere .....		99,90
	Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		<u>0,10</u>
	Gesamtvermögen .....		<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

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

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,11 % (30. Juni 2023: 0,13 %)</b>		
3.388	Arch Capital Group Ltd. ....	341.815	0,10
2.310	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd. ....	43.405	0,01
		<u>385.220</u>	<u>0,11</u>
	<b>Irland: 1,32 % (30. Juni 2023: 1,41 %)</b>		
8.932	Accenture PLC ....	2.710.058	0,78
1.540	Aon PLC ....	452.113	0,13
1.386	Eaton Corp. PLC ....	434.581	0,12
11.858	Medtronic PLC ....	933.343	0,27
308	Willis Towers Watson PLC ....	80.739	0,02
		<u>4.610.834</u>	<u>1,32</u>
	<b>Jersey: 0,16 % (30. Juni 2023: 0,10 %)</b>		
25.564	Amcor PLC ....	250.016	0,07
4.620	Aptiv PLC ....	325.340	0,09
		<u>575.356</u>	<u>0,16</u>
	<b>Liberia: 0,05 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
1.078	Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	171.866	0,05
		<u>171.866</u>	<u>0,05</u>
	<b>Panama: Null (30. Juni 2023: 0,03 %)</b>		
	<b>Schweiz: 0,41 % (30. Juni 2023: 0,41 %)</b>		
2.926	Chubb Ltd. ....	746.364	0,22
462	Garmin Ltd. ....	75.269	0,02
4.004	TE Connectivity Ltd. ....	602.322	0,17
		<u>1.423.955</u>	<u>0,41</u>
	<b>USA: 97,87 % (30. Juni 2023: 97,76 %)</b>		
41.118	Abbott Laboratories ....	4.272.571	1,22
38.808	AbbVie, Inc. ....	6.656.348	1,90
9.086	Adobe, Inc. ....	5.047.636	1,44
22.638	Advanced Micro Devices, Inc. ....	3.672.110	1,05
4.928	Aflac, Inc. ....	440.120	0,13
4.928	Agilent Technologies, Inc. ....	638.817	0,18
3.234	Airbnb, Inc. ....	490.371	0,14
2.772	Akamai Technologies, Inc. ....	249.702	0,07
924	Albemarle Corp. ....	88.260	0,03
2.002	Alexandria Real Estate Equities, Inc. ....	234.174	0,07
2.156	Allstate Corp. ....	344.227	0,10
44.198	Alphabet, Inc. ....	8.106.797	2,32
52.976	Alphabet, Inc. Anteilsklasse A ....	9.649.578	2,76
66.066	Amazon.com, Inc. ....	12.767.255	3,65
11.242	American Airlines Group, Inc. ....	127.372	0,04
5.082	American Express Co. ....	1.176.737	0,34
4.004	American International Group, Inc. ....	297.257	0,09
3.080	American Tower Corp. ....	598.690	0,17
1.540	American Water Works Co., Inc. ....	198.906	0,06
770	Ameriprise Financial, Inc. ....	328.936	0,09
5.852	Amgen, Inc. ....	1.828.457	0,52
924	ANSYS, Inc. ....	297.066	0,08
100.408	Apple, Inc. ....	21.147.933	6,05
5.390	Applied Materials, Inc. ....	1.271.986	0,36
1.540	Arista Networks, Inc. ....	539.739	0,15
1.078	Arthur J Gallagher & Co. ....	279.536	0,08
158.774	AT&T, Inc. ....	3.034.171	0,87
3.388	Autodesk, Inc. ....	838.361	0,24
11.088	Automatic Data Processing, Inc. ....	2.646.595	0,76
770	AvalonBay Communities, Inc. ....	159.305	0,05

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 97,87 % (30. Juni 2023: 97,76 %) (Fortsetzung)</b>		
1.232	Avery Dennison Corp. ....	269.377	0,08
616	Axon Enterprise, Inc. ....	181.252	0,05
117.040	Bank of America Corp. ....	4.654.681	1,33
13.244	Bank of New York Mellon Corp. ....	793.183	0,23
2.926	Bath & Body Works, Inc. ....	114.260	0,03
3.542	Baxter International, Inc. ....	118.480	0,03
2.310	Becton Dickinson & Co. ....	539.870	0,15
3.388	Biogen, Inc. ....	785.406	0,22
2.310	BlackRock, Inc. ....	1.818.709	0,52
2.926	Blackstone, Inc. ....	362.239	0,10
284	Booking Holdings, Inc. ....	1.125.066	0,32
2.926	Boston Properties, Inc. ....	180.125	0,05
16.940	Boston Scientific Corp. ....	1.304.549	0,37
30.492	Bristol-Myers Squibb Co. ....	1.266.333	0,36
3.388	Broadridge Financial Solutions, Inc. ....	667.436	0,19
2.772	Cadence Design Systems, Inc. ....	853.083	0,24
3.388	Campbell Soup Co. ....	153.104	0,04
2.772	Capital One Financial Corp. ....	383.783	0,11
7.700	Cardinal Health, Inc. ....	757.064	0,22
924	Choe Global Markets, Inc. ....	157.135	0,04
462	CDW Corp. ....	103.414	0,03
770	Celanese Corp. ....	103.865	0,03
5.852	Cencora, Inc. ....	1.318.456	0,38
770	CF Industries Holdings, Inc. ....	57.072	0,02
12.350	Chipotle Mexican Grill, Inc. ....	773.728	0,22
4.466	Church & Dwight Co., Inc. ....	463.035	0,13
462	Cincinnati Financial Corp. ....	54.562	0,02
1.078	Cintas Corp. ....	754.880	0,22
83.468	Cisco Systems, Inc. ....	3.965.565	1,13
21.868	Citigroup, Inc. ....	1.387.743	0,40
2.618	Citizens Financial Group, Inc. ....	94.327	0,03
1.848	Clorox Co. ....	252.197	0,07
4.774	CME Group, Inc. ....	938.568	0,27
50.358	Coca-Cola Co. ....	3.205.287	0,92
1.078	Cognizant Technology Solutions Corp. ....	73.304	0,02
13.706	Colgate-Palmolive Co. ....	1.330.030	0,38
10.780	Comcast Corp. ....	422.145	0,12
3.234	Conagra Brands, Inc. ....	91.910	0,03
14.630	Copart, Inc. ....	792.361	0,23
6.776	Corteva, Inc. ....	365.497	0,10
2.156	CoStar Group, Inc. ....	159.846	0,05
3.316	Costco Wholesale Corp. ....	2.818.567	0,81
1.694	Crown Castle, Inc. ....	165.504	0,05
33.418	CSX Corp. ....	1.117.832	0,32
10.010	CVS Health Corp. ....	591.191	0,17
7.392	Danaher Corp. ....	1.846.891	0,53
308	DaVita, Inc. ....	42.680	0,01
5.698	Dayforce, Inc. ....	282.621	0,08
154	Deckers Outdoor Corp. ....	149.064	0,04
5.082	Deere & Co. ....	1.898.788	0,54
1.386	Dexcom, Inc. ....	157.145	0,04
5.082	Digital Realty Trust, Inc. ....	772.718	0,22
1.386	Discover Financial Services ....	181.303	0,05
1.386	Dollar General Corp. ....	183.271	0,05
770	Dollar Tree, Inc. ....	82.213	0,02
1.694	Dover Corp. ....	305.682	0,09
6.314	Dow, Inc. ....	334.958	0,10

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 97,87 % (30. Juni 2023: 97,76 %) (Fortsetzung)</b>		
5.236	DR Horton, Inc. ....	737.909	0,21
17.094	eBay, Inc. ....	918.290	0,26
4.466	Ecolab, Inc. ....	1.062.908	0,30
1.540	Edison International ....	110.587	0,03
10.472	Edwards Lifesciences Corp. ....	967.299	0,28
1.232	Electronic Arts, Inc. ....	171.655	0,05
1.386	Elevance Health, Inc. ....	751.018	0,21
4.466	Eli Lilly & Co. ....	4.043.427	1,16
2.618	Equifax, Inc. ....	634.760	0,18
1.540	Equinix, Inc. ....	1.165.164	0,33
4.004	Equity Residential ....	277.637	0,08
7.392	Estee Lauder Cos., Inc. ....	786.509	0,23
3.542	Etsy, Inc. ....	208.907	0,06
6.622	Eversource Energy ....	375.534	0,11
11.858	Exelon Corp. ....	410.405	0,12
1.540	Expedia Group, Inc. ....	194.025	0,06
4.620	Expeditors International of Washington, Inc. ....	576.530	0,16
1.386	Extra Space Storage, Inc. ....	215.398	0,06
308	FactSet Research Systems, Inc. ....	125.747	0,04
6.930	Fastenal Co. ....	435.481	0,12
1.232	Federal Realty Investment Trust ....	124.395	0,04
3.388	FedEx Corp. ....	1.015.858	0,29
6.160	Fidelity National Information Services, Inc. ....	464.218	0,13
11.396	Fifth Third Bancorp ....	415.840	0,12
462	First Solar, Inc. ....	104.163	0,03
5.852	Fiserv, Inc. ....	872.182	0,25
6.776	FMC Corp. ....	389.959	0,11
4.466	Fortinet, Inc. ....	269.166	0,08
8.624	Freeport-McMoRan, Inc. ....	419.126	0,12
308	Gartner, Inc. ....	138.310	0,04
5.698	Gen Digital, Inc. ....	142.336	0,04
13.860	General Mills, Inc. ....	876.784	0,25
2.156	Genuine Parts Co. ....	298.218	0,09
18.788	Gilead Sciences, Inc. ....	1.289.045	0,37
1.540	Global Payments, Inc. ....	148.918	0,04
462	Globe Life, Inc. ....	38.013	0,01
1.540	Goldman Sachs Group, Inc. ....	696.573	0,20
3.080	Hartford Financial Services Group, Inc. ....	309.663	0,09
1.540	Hasbro, Inc. ....	90.090	0,03
7.854	Healthpeak Properties, Inc. ....	153.938	0,04
770	Henry Schein, Inc. ....	49.357	0,01
4.004	Hershey Co. ....	736.055	0,21
27.720	Hewlett Packard Enterprise Co. ....	586.832	0,17
2.310	Hilton Worldwide Holdings, Inc. ....	504.042	0,14
1.078	Hologic, Inc. ....	80.042	0,02
2.772	Home Depot, Inc. ....	954.233	0,27
8.778	Host Hotels & Resorts, Inc. ....	157.828	0,05
20.944	HP, Inc. ....	733.459	0,21
21.868	Huntington Bancshares, Inc. ....	288.220	0,08
308	Illinois Tool Works, Inc. ....	72.984	0,02
62.832	Intel Corp. ....	1.945.907	0,56
8.624	Intercontinental Exchange, Inc. ....	1.180.539	0,34
12.320	International Business Machines Corp. ....	2.130.744	0,61
3.388	International Flavors & Fragrances, Inc. ....	322.571	0,09
4.312	Interpublic Group of Co., Inc. ....	125.436	0,04
3.542	Intuit, Inc. ....	2.327.838	0,67
2.464	Iron Mountain, Inc. ....	220.824	0,06

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 97,87 % (30. Juni 2023: 97,76 %) (Fortsetzung)</b>		
1.540	J M Smucker Co. ....	167.922	0,05
308	Jack Henry & Associates, Inc. ....	51.134	0,01
1.540	JB Hunt Transport Services, Inc. ....	246.400	0,07
8.162	JPMorgan Chase & Co. ....	1.650.846	0,47
5.236	Kellanova ....	302.012	0,09
12.782	Keurig Dr Pepper, Inc. ....	426.919	0,12
5.852	KeyCorp ....	83.157	0,02
1.694	Keysight Technologies, Inc. ....	231.655	0,07
7.700	Kimco Realty Corp. ....	149.842	0,04
2.002	KLA Corp. ....	1.650.669	0,47
14.322	Kraft Heinz Co. ....	461.455	0,13
8.162	Kroger Co. ....	407.529	0,12
2.156	Lam Research Corp. ....	2.295.817	0,66
1.386	Lennar Corp. Anteilsklasse A ....	207.720	0,06
3.542	LKQ Corp. ....	147.312	0,04
6.930	Lowe's Co., Inc. ....	1.527.788	0,44
1.386	Lululemon Athletica, Inc. ....	413.998	0,12
2.002	M&T Bank Corp. ....	303.023	0,09
462	MarketAxess Holdings, Inc. ....	92.645	0,03
2.002	Marsh & McLennan Co., Inc. ....	421.861	0,12
616	Martin Marietta Materials, Inc. ....	333.749	0,10
14.938	Mastercard, Inc. ....	6.590.048	1,89
4.774	McCormick & Co., Inc. ....	338.668	0,10
5.698	McDonald's Corp. ....	1.452.078	0,42
2.618	McKesson Corp. ....	1.529.017	0,44
21.714	Merck & Co., Inc. ....	2.688.193	0,77
16.940	Meta Platforms, Inc. ....	8.541.487	2,44
4.004	MetLife, Inc. ....	281.041	0,08
203	Mettler-Toledo International, Inc. ....	283.711	0,08
12.012	Micron Technology, Inc. ....	1.579.938	0,45
54.978	Microsoft Corp. ....	24.572.417	7,03
2.618	Moderna, Inc. ....	310.888	0,09
33.418	Mondelez International, Inc. ....	2.186.874	0,63
5.236	Monster Beverage Corp. ....	261.538	0,07
4.620	Moody's Corp. ....	1.944.697	0,56
1.386	Motorola Solutions, Inc. ....	535.065	0,15
1.232	MSCI, Inc. ....	593.516	0,17
10.164	Nasdaq, Inc. ....	612.483	0,18
2.002	NetApp, Inc. ....	257.858	0,07
308	Netflix, Inc. ....	207.863	0,06
8.778	Newmont Corp. ....	367.535	0,11
1.386	News Corp. ....	38.212	0,01
16.786	NIKE, Inc. ....	1.265.161	0,36
2.464	Norfolk Southern Corp. ....	528.996	0,15
2.156	Northern Trust Corp. ....	181.061	0,05
141.680	NVIDIA Corp. ....	17.503.147	5,01
16	NVR, Inc. ....	121.417	0,03
2.926	Old Dominion Freight Line, Inc. ....	516.732	0,15
462	Omnicom Group, Inc. ....	41.441	0,01
3.850	ON Semiconductor Corp. ....	263.918	0,08
9.394	Oracle Corp. ....	1.326.433	0,38
462	O'Reilly Automotive, Inc. ....	487.900	0,14
1.078	Packaging Corp. of America ....	196.800	0,06
4.774	Palo Alto Networks, Inc. ....	1.618.434	0,46
8.470	Paychex, Inc. ....	1.004.203	0,29
462	Paycom Software, Inc. ....	66.084	0,02
22.946	PayPal Holdings, Inc. ....	1.331.556	0,38

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 97,87 % (30. Juni 2023: 97,76 %) (Fortsetzung)</b>		
18.788	PepsiCo, Inc. ....	3.098.705	0,89
56.672	Pfizer, Inc. ....	1.585.683	0,45
2.310	PNC Financial Services Group, Inc. ....	359.159	0,10
462	Pool Corp. ....	141.986	0,04
3.388	PPG Industries, Inc. ....	426.515	0,12
2.618	Principal Financial Group, Inc. ....	205.382	0,06
9.702	Procter & Gamble Co. ....	1.600.054	0,46
616	Progressive Corp. ....	127.949	0,04
14.322	Prologis, Inc. ....	1.608.504	0,46
3.696	Public Service Enterprise Group, Inc. ....	272.395	0,08
924	Public Storage ....	265.789	0,08
2.926	PulteGroup, Inc. ....	322.153	0,09
20.482	QUALCOMM, Inc. ....	4.079.605	1,17
1.848	Quanta Services, Inc. ....	469.558	0,13
616	Quest Diagnostics, Inc. ....	84.318	0,02
462	Ralph Lauren Corp. ....	80.878	0,02
1.540	Realty Income Corp. ....	81.343	0,02
1.232	Regency Centers Corp. ....	76.630	0,02
1.848	Regeneron Pharmaceuticals, Inc. ....	1.942.303	0,56
7.700	Regions Financial Corp. ....	154.308	0,04
1.386	Republic Services, Inc. ....	269.355	0,08
1.232	ResMed, Inc. ....	235.829	0,07
308	Revvity, Inc. ....	32.297	0,01
2.002	Rollins, Inc. ....	97.678	0,03
3.234	Ross Stores, Inc. ....	469.965	0,13
4.312	S&P Global, Inc. ....	1.923.152	0,55
22.484	Salesforce, Inc. ....	5.780.636	1,65
924	SBA Communications Corp. ....	181.381	0,05
3.080	ServiceNow, Inc. ....	2.422.944	0,69
6.930	Sherwin-Williams Co. ....	2.068.120	0,59
4.312	Stanley Black & Decker, Inc. ....	344.486	0,10
7.700	Starbucks Corp. ....	599.445	0,17
5.390	State Street Corp. ....	398.860	0,11
1.540	Stryker Corp. ....	523.985	0,15
3.080	Synchrony Financial ....	145.345	0,04
616	Synopsys, Inc. ....	366.557	0,10
10.010	Sysco Corp. ....	714.614	0,20
2.156	T Rowe Price Group, Inc. ....	248.608	0,07
1.386	Take-Two Interactive Software, Inc. ....	215.509	0,06
2.618	Tapestry, Inc. ....	112.024	0,03
4.928	Target Corp. ....	729.541	0,21
34.034	Tesla, Inc. ....	6.734.648	1,93
616	Thermo Fisher Scientific, Inc. ....	340.648	0,10
10.780	TJX Co., Inc. ....	1.186.878	0,34
7.700	T-Mobile U.S., Inc. ....	1.356.586	0,39
308	Tractor Supply Co. ....	83.160	0,02
1.078	Trimble, Inc. ....	60.282	0,02
14.938	Truist Financial Corp. ....	580.341	0,17
308	Tyler Technologies, Inc. ....	154.856	0,04
8.316	U.S. Bancorp ....	330.145	0,09
48.356	Uber Technologies, Inc. ....	3.514.514	1,01
770	Ulta Beauty, Inc. ....	297.120	0,09
15.246	Union Pacific Corp. ....	3.449.560	0,99
3.388	United Airlines Holdings, Inc. ....	164.860	0,05
19.404	United Parcel Service, Inc. ....	2.655.437	0,76
1.540	United Rentals, Inc. ....	995.964	0,28
13.398	UnitedHealth Group, Inc. ....	6.823.066	1,95

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,92 % (30. Juni 2023: 99,84 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 97,87 % (30. Juni 2023: 97,76 %) (Fortsetzung)</b>		
4.620	Ventas, Inc. ....	236.821	0,07
308	VeriSign, Inc. ....	54.762	0,02
5.082	Verisk Analytics, Inc. ....	1.369.853	0,39
27.566	Verizon Communications, Inc. ....	1.136.822	0,33
38.346	Visa, Inc. ....	10.064.675	2,88
1.540	Vulcan Materials Co. ....	382.967	0,11
19.250	Walgreens Boots Alliance, Inc. ....	232.829	0,07
14.784	Walt Disney Co. ....	1.467.903	0,42
7.854	Waste Management, Inc. ....	1.675.572	0,48
924	Waters Corp. ....	268.071	0,08
7.392	Welltower, Inc. ....	770.616	0,22
2.926	Westrock Co. ....	147.061	0,04
15.092	Weyerhaeuser Co. ....	428.462	0,12
4.774	Yum! Brands, Inc. ....	632.364	0,18
616	Zimmer Biomet Holdings, Inc. ....	66.854	0,02
		<u>342.122.372</u>	<u>97,87</u>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<u>349.289.603</u>	<u>99,92</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>349.289.603</u>	<u>99,92</u>

Derivative Finanzinstrumente: Null (30. Juni 2023: 0,01 %)

Terminkontrakte: Null (30. Juni 2023: 0,01 %)

	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>Anlagenportfolio</b>	349.289.603	99,92
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	265.609	0,08
<b>Nettovermögen</b>	<u>349.555.212</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	99,92
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	0,08
<b>Gesamtvermögen</b> .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %)</b>		
	<b>Österreich: 0,13 % (30. Juni 2023: 0,41 %)</b>		
78	BAWAG Group AG .....	4.610	0,01
156	Erste Group Bank AG .....	6.901	0,02
1.326	Raiffeisen Bank International AG .....	21.508	0,04
208	Verbund AG .....	15.319	0,03
416	voestalpine AG .....	10.492	0,02
169	Wienerberger AG .....	5.232	0,01
		<u>64.062</u>	<u>0,13</u>
	<b>Belgien: 1,39 % (30. Juni 2023: 1,29 %)</b>		
117	Aedifica SA .....	6.628	0,01
182	Ageas SA .....	7.768	0,02
6.435	Anheuser-Busch InBev SA .....	348.262	0,71
234	Cofinimmo SA .....	13.186	0,03
104	D'ieteren Group .....	20.602	0,04
91	Elia Group SA .....	7.958	0,02
338	Groupe Bruxelles Lambert NV .....	22.528	0,05
130	KBC Group NV .....	8.567	0,02
13	Sofina SA .....	2.772	0,00
1.027	UCB SA .....	142.445	0,29
3.484	Umicore SA .....	48.880	0,10
2.015	Warehouses De Pauw CVA .....	50.979	0,10
		<u>680.575</u>	<u>1,39</u>
	<b>Bermuda: 0,02 % (30. Juni 2023: 0,02 %)</b>		
1.287	Aegon Ltd. ....	7.423	0,01
351	Hiscox Ltd. ....	4.761	0,01
		<u>12.184</u>	<u>0,02</u>
	<b>Dänemark: 7,79 % (30. Juni 2023: 7,42 %)</b>		
663	Ambu AS .....	11.913	0,02
442	Carlsberg AS .....	49.526	0,10
351	Coloplast AS .....	39.376	0,08
1.651	Danske Bank AS .....	45.938	0,09
650	Demant AS .....	26.270	0,05
1.638	DSV AS .....	234.362	0,48
130	Genmab AS .....	30.419	0,06
949	GN Store Nord AS .....	24.700	0,05
819	ISS AS .....	13.113	0,03
52	Jyske Bank AS .....	3.863	0,01
78	NKT AS .....	6.375	0,01
16.952	Novo Nordisk AS .....	2.285.892	4,66
6.604	Novonesis (Novozymes) B .....	377.336	0,77
1.235	Pandora AS .....	174.052	0,36
26	Ringkjoebing Landbobank AS .....	4.065	0,01
182	Rockwool AS .....	68.969	0,14
78	Sydbank AS .....	3.860	0,01
260	Tryg AS .....	5.307	0,01
18.993	Vestas Wind Systems AS .....	410.679	0,84
52	Zealand Pharma AS .....	6.223	0,01
		<u>3.822.238</u>	<u>7,79</u>
	<b>Finnland: 0,83 % (30. Juni 2023: 1,02 %)</b>		
52	Cargotec OYJ .....	3.897	0,01
1.573	Elisa OYJ .....	67.387	0,14
234	Huhtamaki OYJ .....	8.766	0,02
741	Kesko OYJ .....	12.145	0,02
975	Kone OYJ .....	44.938	0,09
143	Konecranes OYJ .....	7.572	0,02
1.677	Metso OYJ .....	16.576	0,03

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Finnland: 0,83 % (30. Juni 2023: 1,02 %) (Fortsetzung)</b>			
21.931	Nokia OYJ .....	78.041	0,16
3.263	Nordea Bank Abp .....	36.268	0,07
429	Orion OYJ .....	17.100	0,04
1.079	Sampo OYJ .....	43.268	0,09
3.003	Stora Enso OYJ .....	38.303	0,08
1.456	TietoEVRY OYJ .....	26.266	0,05
182	Valmet OYJ .....	4.858	0,01
		<u>405.385</u>	<u>0,83</u>
<b>Frankreich: 21,60 % (30. Juni 2023: 23,23 %)</b>			
377	Accor SA .....	14.439	0,03
39	Aeroports de Paris SA .....	4.430	0,01
4.121	Air Liquide SA .....	664.635	1,35
2.743	Alstom SA .....	43.065	0,09
364	Alten SA .....	37.310	0,08
546	Amundi SA .....	32.897	0,07
494	Arkema SA .....	40.088	0,08
11.986	AXA SA .....	366.412	0,75
208	BioMerieux .....	18.460	0,04
1.794	BNP Paribas SA .....	106.797	0,22
1.521	Bouygues SA .....	45.584	0,09
2.756	Capgemini SE .....	511.789	1,04
3.874	Carrefour SA .....	51.137	0,10
6	Christian Dior SE .....	4.029	0,01
1.768	Cie de Saint-Gobain SA .....	128.392	0,26
117	Covivio SA .....	5.192	0,01
2.301	Credit Agricole SA .....	29.315	0,06
2.990	Danone SA .....	170.669	0,35
6.877	Dassault Systemes SE .....	242.758	0,49
1.625	Edenred SE .....	64.041	0,13
390	Eiffage SA .....	33.446	0,07
1.183	Elis SA .....	23.920	0,05
455	EssilorLuxottica SA .....	91.546	0,19
91	Eurazeo SE .....	6.766	0,01
364	Forvia SE .....	4.024	0,01
572	Gecina SA .....	49.163	0,10
6.357	Getlink SE .....	98.216	0,20
540	Hermes International SCA .....	1.155.600	2,36
494	Ipsen SA .....	56.563	0,11
1.183	Kering SA .....	400.446	0,82
923	Klepierre SA .....	23.057	0,05
1.092	La Francaise des Jeux SAEM .....	34.726	0,07
1.820	Legrand SA .....	168.605	0,34
2.938	L'Oreal SA .....	1.204.727	2,46
3.042	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE .....	2.170.771	4,43
78	Nexans SA .....	8.026	0,02
17.615	Orange SA .....	164.771	0,34
1.521	Pernod Ricard SA .....	192.711	0,39
5.291	Publicis Groupe SA .....	525.820	1,07
364	Renault SA .....	17.414	0,04
702	Rexel SA .....	16.960	0,03
10.101	Sanofi SA .....	908.484	1,85
26	Sartorius Stedim Biotech .....	3.986	0,01
1.612	Schneider Electric SE .....	361.572	0,74
364	SCOR SE .....	8.612	0,02
52	SEB SA .....	4.971	0,01
546	Societe Generale SA .....	11.968	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Frankreich: 21,60 % (30. Juni 2023: 23,23 %) (Fortsetzung)</b>		
195	Sodexo SA .....	16.380	0,03
169	SOITEC .....	17.610	0,04
195	Sopra Steria Group .....	35.315	0,07
767	SPIE SA .....	25.909	0,05
208	Teleperformance SE .....	20.455	0,04
481	Ubisoft Entertainment SA .....	9.832	0,02
377	Unibail-Rodamco-Westfield .....	27.717	0,06
364	Valeo SE .....	3.617	0,01
169	Verallia SA .....	5.726	0,01
4.212	Vivendi SE .....	41.092	0,08
39	Wendel SE .....	3.221	0,01
5.486	Worldline SA .....	55.518	0,11
		<b>10.590.702</b>	<b>21,60</b>
	<b>Deutschland: 12,41 % (30. Juni 2023: 13,71 %)</b>		
1.001	adidas AG .....	223.223	0,46
104	AIXTRON SE .....	1.907	0,00
1.157	Allianz SE .....	300.242	0,61
221	Aurubis AG .....	16.188	0,03
949	BASF SE .....	42.881	0,09
559	Bayerische Motoren Werke AG .....	49.404	0,10
234	Bechtle AG .....	10.282	0,02
988	Beiersdorf AG .....	134.911	0,28
884	Brenntag SE .....	55.657	0,11
39	Carl Zeiss Meditec AG .....	2.560	0,01
3.250	Commerzbank AG .....	46.101	0,09
156	Continental AG .....	8.252	0,02
455	Covestro AG .....	24.934	0,05
78	CTS Eventim AG & Co. KGaA .....	6.076	0,01
156	Daimler Truck Holding AG .....	5.799	0,01
598	Delivery Hero SE .....	13.246	0,03
1.378	Deutsche Bank AG .....	20.543	0,04
962	Deutsche Boerse AG .....	183.838	0,38
8.060	Deutsche Lufthansa AG .....	46.023	0,09
37.258	Deutsche Telekom AG .....	874.818	1,78
16.536	DHL Group .....	624.895	1,27
104	Dr Ing hc F Porsche AG .....	7.230	0,02
1.963	Evonik Industries AG .....	37.395	0,08
260	Freenet AG .....	6.448	0,01
208	Fresenius Medical Care AG .....	7.438	0,02
481	Fresenius SE & Co. KGaA .....	13.410	0,03
416	GEA Group AG .....	16.182	0,03
39	Gerresheimer AG .....	3.912	0,01
52	Hannover Rueck SE .....	12.308	0,03
325	Heidelberg Materials AG .....	31.467	0,06
676	Henkel AG & Co. KGaA (Vorzugsaktien) .....	56.257	0,11
624	HUGO BOSS AG .....	26.064	0,05
4.563	Infineon Technologies AG .....	156.534	0,32
559	K&S AG .....	7.029	0,01
156	KION Group AG .....	6.098	0,01
91	Knorr-Bremse AG .....	6.488	0,01
598	Lanxess AG .....	13.742	0,03
143	LEG Immobilien SE .....	10.905	0,02
1.664	Mercedes-Benz Group AG .....	107.445	0,22
754	Merck KGaA .....	116.682	0,24
13	MTU Aero Engines AG .....	3.104	0,01
260	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen .....	121.420	0,25

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Deutschland: 12,41 % (30. Juni 2023: 13,71 %) (Fortsetzung)</b>		
78	Nemetschek SE .....	7.164	0,01
442	Porsche Automobil Holding SE .....	18.657	0,04
1.105	Puma SE .....	47.371	0,10
6	Rational AG .....	4.665	0,01
9.152	SAP SE .....	1.734.487	3,54
104	Sartorius AG .....	22.776	0,05
78	Scout24 SE .....	5.554	0,01
1.300	Siemens AG .....	225.836	0,46
2.678	Siemens Healthineers AG .....	144.076	0,29
2.340	Symrise AG .....	267.462	0,55
325	TAG Immobilien AG .....	4.443	0,01
65	Talanx AG .....	4.846	0,01
5.499	Thyssenkrupp AG .....	22.205	0,05
299	Volkswagen AG .....	31.515	0,06
221	Vonovia SE .....	5.868	0,01
286	Wacker Chemie AG .....	29.115	0,06
2.262	Zalando SE .....	49.515	0,10
		<u>6.084.893</u>	<u>12,41</u>
	<b>Irland: 1,22 % (30. Juni 2023: 1,28 %)</b>		
21.892	AIB Group PLC .....	108.059	0,22
6.097	Bank of Ireland Group PLC .....	59.556	0,12
273	Flutter Entertainment PLC .....	46.577	0,09
546	Grafton Group PLC .....	5.978	0,01
559	Kerry Group PLC .....	42.288	0,09
2.743	Kingspan Group PLC .....	218.069	0,44
1.391	Ryanair Holdings PLC .....	22.715	0,05
2.314	Smurfit Kappa Group PLC .....	96.262	0,20
		<u>599.504</u>	<u>1,22</u>
	<b>Isle of Man: 0,02 % (30. Juni 2023: 0,04 %)</b>		
1.339	Entain PLC .....	9.950	0,02
		<u>9.950</u>	<u>0,02</u>
	<b>Italien: 1,36 % (30. Juni 2023: 1,20 %)</b>		
585	Amplifon SpA .....	19.445	0,04
540	Amplifon SpA (Stimmrecht) .....	-	0,00
3.146	Assicurazioni Generali SpA .....	73.270	0,15
158	Azimut Holding SpA .....	3.479	0,01
1.222	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA .....	5.358	0,01
520	Banca Popolare di Sondrio SpA .....	3.474	0,01
871	Banco BPM SpA .....	5.238	0,01
1.534	BPER Banca SpA .....	7.242	0,02
156	Buzzi SpA .....	5.862	0,01
26	DiaSorin SpA .....	2.420	0,01
351	FinecoBank Banca Fineco SpA .....	4.886	0,01
3.198	Infrastrutture Wireless Italiane SpA .....	31.181	0,06
104	Interpump Group SpA .....	4.314	0,01
52.897	Intesa Sanpaolo SpA .....	183.606	0,37
377	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA .....	5.161	0,01
2.275	Moncler SpA .....	129.812	0,27
15.756	Nexi SpA .....	89.715	0,18
455	Poste Italiane SpA .....	5.412	0,01
130	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA .....	6.331	0,01
26	Reply SpA .....	3.583	0,01
27.846	Telecom Italia SpA .....	6.224	0,01
4.303	Terna - Rete Elettrica Nazionale .....	31.059	0,06

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Italien: 1,36 % (30. Juni 2023: 1,20 %) (Fortsetzung)</b>		
1.027	UniCredit SpA .....	35.539	0,07
637	Unipol Gruppo SpA .....	5.911	0,01
		<u>668.522</u>	<u>1,36</u>
	<b>Jersey: 1,09 % (30. Juni 2023: 0,70 %)</b>		
9.594	Experian PLC .....	417.102	0,85
1.677	Man Group PLC .....	4.791	0,01
13.390	WPP PLC .....	114.405	0,23
		<u>536.298</u>	<u>1,09</u>
	<b>Luxembourg: 0,05 % (30. Juni 2023: 0,04 %)</b>		
364	Eurofins Scientific SE .....	16.944	0,04
312	Millicom International Cellular SA .....	7.092	0,01
		<u>24.036</u>	<u>0,05</u>
	<b>Malta: Null (30. Juni 2023: 0,01 %)</b>		
	<b>Niederlande: 9,46 % (30. Juni 2023: 8,77 %)</b>		
390	ABN AMRO Bank NV .....	5.987	0,01
18	Adyen NV .....	20.038	0,04
2.795	Akzo Nobel NV .....	158.700	0,32
39	Argenx SE .....	15.935	0,03
156	ASM International NV .....	111.041	0,23
2.302	ASML Holding NV .....	2.219.588	4,53
351	ASR Nederland NV .....	15.623	0,03
52	BE Semiconductor Industries NV .....	8.120	0,02
546	Davide Campari-Milano NV .....	4.818	0,01
754	Euronext NV .....	65.221	0,13
65	EXOR NV .....	6.350	0,01
156	Ferrari NV .....	59.389	0,12
143	Heineken Holding NV .....	10.532	0,02
1.534	Heineken NV .....	138.520	0,28
117	IMCD NV .....	15.128	0,03
14.014	ING Groep NV .....	223.691	0,46
598	JDE Peet's NV .....	11.123	0,02
3.146	Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	86.798	0,18
38.389	Koninklijke KPN NV .....	137.433	0,28
7.384	Koninklijke Philips NV .....	174.189	0,36
650	NN Group NV .....	28.242	0,06
234	OCI NV .....	5.333	0,01
9.321	Prosus NV .....	310.016	0,63
290	Qiagen NV .....	11.179	0,02
715	Randstad NV .....	30.266	0,06
1.248	Signify NV .....	29.078	0,06
533	Stellantis NV .....	9.845	0,02
7.059	STMicroelectronics NV .....	260.301	0,53
4.134	Universal Music Group NV .....	114.843	0,24
2.275	Wolters Kluwer NV .....	352.170	0,72
		<u>4.639.497</u>	<u>9,46</u>
	<b>Norwegen: 0,47 % (30. Juni 2023: 0,39 %)</b>		
598	DNB Bank ASA .....	10.989	0,02
2.106	Gjensidige Forsikring ASA .....	35.213	0,07
4.004	Mowi ASA .....	62.351	0,13
975	Norsk Hydro ASA .....	5.682	0,01
2.236	Orkla ASA .....	16.998	0,03
351	Salmar ASA .....	17.286	0,04
5.616	Storebrand ASA .....	53.643	0,11

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Norwegen: 0,47 % (30. Juni 2023: 0,39 %) (Fortsetzung)</b>		
1.690	Telenor ASA .....	18.023	0,04
351	Yara International ASA .....	9.461	0,02
		<u>229.646</u>	<u>0,47</u>
	<b>Polen: 0,10 % (30. Juni 2023: 0,06 %)</b>		
117	Bank Polska Kasa Opieki SA .....	4.562	0,01
195	CD Projekt SA .....	6.289	0,01
117	KGHM Polska Miedz SA .....	4.083	0,01
3	LPP SA .....	11.900	0,02
481	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA .....	7.024	0,02
702	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA .....	8.397	0,02
39	Santander Bank Polska SA .....	4.899	0,01
		<u>47.154</u>	<u>0,10</u>
	<b>Portugal: 0,03 % (30. Juni 2023: 0,04 %)</b>		
13.533	Banco Comercial Portugues SA .....	4.555	0,01
650	Jeronimo Martins SGPS SA .....	11.863	0,02
		<u>16.418</u>	<u>0,03</u>
	<b>Spanien: 5,11 % (30. Juni 2023: 5,00 %)</b>		
234	Acciona SA .....	25.810	0,05
78	Aena SME SA .....	14.664	0,03
2.379	Amadeus IT Group SA .....	147.831	0,30
19.539	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA .....	182.729	0,37
4.914	Banco de Sabadell SA .....	8.848	0,02
26.182	Banco Santander SA .....	113.381	0,23
923	Bankinter SA .....	7.039	0,02
2.236	CaixaBank SA .....	11.053	0,02
2.938	Cellnex Telecom SA .....	89.227	0,18
5.427	EDP Renovaveis SA .....	70.822	0,15
1.222	Grifols SA .....	9.605	0,02
74.100	Iberdrola SA .....	897.721	1,83
13.299	Industria de Diseno Textil SA .....	616.542	1,26
2.483	International Consolidated Airlines Group SA .....	4.752	0,01
3.133	Merlin Properties Socimi SA .....	32.583	0,07
1.027	Redeia Corp. SA .....	16.761	0,03
64.363	Telefonica SA .....	254.877	0,52
		<u>2.504.245</u>	<u>5,11</u>
	<b>Schweden: 3,24 % (30. Juni 2023: 2,53 %)</b>		
546	AAK AB .....	14.942	0,03
845	AddTech AB .....	19.610	0,04
1.573	Assa Abloy AB .....	41.521	0,08
3.029	Atlas Copco AB .....	53.161	0,11
1.638	Avanza Bank Holding AB .....	37.161	0,08
247	Axfood AB .....	6.059	0,01
379	Beijer Ref AB .....	5.460	0,01
247	Boliden AB .....	7.380	0,02
3.159	Castellum AB .....	36.015	0,07
650	Electrolux AB .....	5.032	0,01
4.212	Elekta AB .....	24.567	0,05
12.870	EQT AB .....	355.142	0,72
1.950	Essity AB .....	46.628	0,10
65	Evolution AB .....	6.322	0,01
1.248	Fastighets AB Balder .....	7.985	0,02
533	Fortnox AB .....	3.005	0,01
1.261	Getinge AB .....	20.004	0,04
8.450	H & M Hennes & Mauritz AB .....	124.814	0,25
442	Hemnet Group AB .....	12.469	0,03

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweden: 3,24 % (30. Juni 2023: 2,53 %) (Fortsetzung)</b>		
858	Hexpol AB .....	8.920	0,02
403	Holmen AB .....	14.813	0,03
962	Husqvarna AB .....	7.199	0,01
169	Industrivarden AB .....	5.325	0,01
793	Indutrade AB .....	18.976	0,04
169	Investment AB Latour .....	4.261	0,01
1.144	Investor AB .....	29.250	0,06
650	Kinnevik AB .....	4.979	0,01
104	L E Lundbergforetagen AB .....	4.801	0,01
312	Lifco AB .....	7.999	0,02
975	Nibe Industrier AB .....	3.860	0,01
273	Nordnet AB publ .....	5.325	0,01
936	Saab AB .....	21.029	0,04
273	Sagax AB .....	6.523	0,01
260	Sectra AB .....	5.548	0,01
1.274	Securitas AB .....	11.808	0,02
1.573	Skandinaviska Enskilda Banken AB .....	21.689	0,04
3.289	Skanska AB .....	55.290	0,11
741	SKF AB .....	13.893	0,03
546	Svenska Cellulosa AB SCA .....	7.531	0,02
11.180	Svenska Handelsbanken AB .....	99.438	0,20
4.927	Swedbank AB .....	94.676	0,19
169	Swedish Orphan Biovitrum AB .....	4.223	0,01
5.395	Tele2 AB .....	50.718	0,10
10.413	Telefonaktiebolaget LM Ericsson .....	60.368	0,12
23.114	Telia Co. AB .....	57.897	0,12
1.209	Thule Group AB .....	29.612	0,06
351	Trelleborg AB .....	12.753	0,03
2.496	Volvo AB .....	59.618	0,12
988	Volvo Car AB .....	2.854	0,01
1.092	Wallenstam AB .....	4.844	0,01
3.159	Wihlborgs Fastigheter AB .....	27.248	0,06
		<b>1.590.545</b>	<b>3,24</b>
	<b>Schweiz: 16,10 % (30. Juni 2023: 15,45 %)</b>		
1.430	Adecco Group AG .....	44.278	0,09
247	Alcon, Inc. ....	20.574	0,04
26	Allreal Holding AG .....	4.152	0,01
39	Bachem Holding AG .....	3.339	0,01
52	Baloise Holding AG .....	8.542	0,02
52	Banque Cantonale Vaudoise .....	5.148	0,01
19	Barry Callebaut AG .....	28.883	0,06
13	Belimo Holding AG .....	6.082	0,01
26	BKW AG .....	3.869	0,01
13	Bucher Industries AG .....	4.886	0,01
52	Cembra Money Bank AG .....	4.141	0,01
3	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG .....	32.677	0,07
6.695	Cie Financiere Richemont SA .....	974.975	1,99
936	Coca-Cola HBC AG .....	29.786	0,06
13	Comet Holding AG .....	4.886	0,01
104	DKSH Holding AG .....	6.555	0,01
2.327	DSM-Firmenich AG .....	245.731	0,50
26	Flughafen Zurich AG .....	5.364	0,01
104	Galenica AG .....	7.943	0,02
22	Geberit AG .....	12.125	0,02
134	Givaudan SA .....	592.726	1,21
39	Helvetia Holding AG .....	4.920	0,01

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Schweiz: 16,10 % (30. Juni 2023: 15,45 %) (Fortsetzung)</b>		
1.287	Holcim AG .....	106.400	0,22
3	Inficon Holding AG .....	4.255	0,01
3.588	Julius Baer Group Ltd. ....	187.023	0,38
117	Kuehne & Nagel International AG .....	31.392	0,06
1.053	Logitech International SA .....	95.036	0,19
143	Lonza Group AG .....	72.816	0,15
13.442	Nestle SA .....	1.280.171	2,61
17.043	Novartis AG .....	1.701.867	3,47
13	Partners Group Holding AG .....	15.577	0,03
65	PSP Swiss Property AG .....	7.782	0,02
2.392	Roche Holding AG .....	619.686	1,26
104	Schindler Holding AG .....	24.384	0,05
3	Siegfried Holding AG .....	2.906	0,01
2.561	SIG Group AG .....	43.744	0,09
1.105	Sika AG .....	295.103	0,60
598	Sonova Holding AG .....	172.370	0,35
221	Straumann Holding AG .....	25.540	0,05
13	Swatch Group AG .....	2.484	0,01
39	Swiss Life Holding AG .....	26.751	0,05
78	Swiss Prime Site AG .....	6.900	0,01
2.054	Swiss Re AG .....	237.802	0,48
399	Swisscom AG .....	209.428	0,43
13	Swissquote Group Holding SA .....	3.828	0,01
78	Tecan Group AG .....	24.362	0,05
650	Temenos AG .....	41.845	0,09
2.067	UBS Group AG .....	56.768	0,12
1.098	Zurich Insurance Group AG .....	546.221	1,11
		<b>7.894.023</b>	<b>16,10</b>
	<b>Vereinigtes Königreich: 17,27 % (30. Juni 2023: 17,21 %)</b>		
2.873	abrndn PLC .....	5.022	0,01
247	Admiral Group PLC .....	7.618	0,02
299	Antofagasta PLC .....	7.441	0,01
182	Ashtead Group PLC .....	11.339	0,02
403	Associated British Foods PLC .....	11.760	0,02
14.560	AstraZeneca PLC .....	2.121.909	4,33
5.434	Auto Trader Group PLC .....	51.351	0,10
33.527	Aviva PLC .....	188.467	0,38
8.866	Barclays PLC .....	21.845	0,04
4.368	Barratt Developments PLC .....	24.327	0,05
741	Beazley PLC .....	6.188	0,01
611	Bellway PLC .....	18.276	0,04
1.222	Berkeley Group Holdings PLC .....	66.128	0,13
1.573	Big Yellow Group PLC .....	21.781	0,04
2.977	British Land Co. PLC .....	14.453	0,03
1.508	Britvic PLC .....	21.006	0,04
49.010	BT Group PLC .....	81.131	0,17
1.144	Bunzl PLC .....	40.614	0,08
4.303	Burberry Group PLC .....	44.551	0,09
5.772	Compass Group PLC .....	147.051	0,30
611	Computacenter PLC .....	20.697	0,04
8.190	ConvaTec Group PLC .....	22.681	0,05
208	Cranswick PLC .....	10.905	0,02
1.131	Croda International PLC .....	52.666	0,11
689	Derwent London PLC .....	18.366	0,04
18.226	Diageo PLC .....	535.169	1,09
208	Diploma PLC .....	10.176	0,02

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 17,27 % (30. Juni 2023: 17,21 %) (Fortsetzung)</b>		
6.201	Direct Line Insurance Group PLC .....	14.686	0,03
4.979	Drax Group PLC .....	28.905	0,06
2.899	DS Smith PLC .....	14.395	0,03
2.301	easyJet PLC .....	12.422	0,03
559	Greggs PLC .....	18.277	0,04
33.046	GSK PLC .....	596.151	1,22
42.445	Haleon PLC .....	161.502	0,33
585	Hargreaves Lansdown PLC .....	7.811	0,02
23.205	Hays PLC .....	25.864	0,05
182	Hikma Pharmaceuticals PLC .....	4.059	0,01
429	Howden Joinery Group PLC .....	4.445	0,01
22.035	HSBC Holdings PLC .....	177.743	0,36
3.640	IG Group Holdings PLC .....	35.162	0,07
481	Inchcape PLC .....	4.221	0,01
325	Indivior PLC .....	4.753	0,01
11.141	Informa PLC .....	112.456	0,23
299	InterContinental Hotels Group PLC .....	29.363	0,06
689	Intermediate Capital Group PLC .....	17.732	0,04
8.619	International Distribution Services PLC .....	32.571	0,07
780	Investec PLC .....	5.276	0,01
28.561	ITV PLC .....	27.118	0,05
16.627	JD Sports Fashion PLC .....	23.435	0,05
2.951	Johnson Matthey PLC .....	54.541	0,11
4.953	Kingfisher PLC .....	14.535	0,03
5.772	Land Securities Group PLC .....	42.175	0,09
3.757	Legal & General Group PLC .....	10.059	0,02
86.216	Lloyds Banking Group PLC .....	55.665	0,11
9.568	London Stock Exchange Group PLC .....	1.060.808	2,16
1.313	LondonMetric Property PLC .....	2.995	0,01
1.794	M&G PLC .....	4.317	0,01
7.397	Marks & Spencer Group PLC .....	24.996	0,05
929	Melrose Industries PLC .....	6.064	0,01
1.288	Mondi PLC .....	23.068	0,05
51.701	NatWest Group PLC .....	190.135	0,39
1.066	Next PLC .....	113.611	0,23
5.512	Pearson PLC .....	64.414	0,13
455	Pennon Group PLC .....	3.078	0,01
1.755	Persimmon PLC .....	27.986	0,06
1.963	Phoenix Group Holdings PLC .....	12.074	0,02
1.833	QinetiQ Group PLC .....	9.582	0,02
3.302	Reckitt Benckiser Group PLC .....	166.767	0,34
5.031	RELX PLC .....	215.935	0,44
1.651	Rentokil Initial PLC .....	8.981	0,02
6.279	Rightmove PLC .....	39.770	0,08
2.262	RS Group PLC .....	18.702	0,04
403	Safestore Holdings PLC .....	3.658	0,01
6.747	Sage Group PLC .....	86.622	0,18
16.783	Schroders PLC .....	72.015	0,15
7.150	Segro PLC .....	75.747	0,15
3.718	Serco Group PLC .....	7.880	0,02
1.157	Severn Trent PLC .....	32.479	0,07
1.300	Smith & Nephew PLC .....	15.036	0,03
624	Softcat PLC .....	13.373	0,03
130	Spirax-Sarco Engineering PLC .....	13.003	0,03
1.287	Standard Chartered PLC .....	10.869	0,02
858	Tate & Lyle PLC .....	6.052	0,01
20.059	Taylor Wimpey PLC .....	33.631	0,07

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,69 % (30. Juni 2023: 99,82 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 17,27 % (30. Juni 2023: 17,21 %) (Fortsetzung)</b>		
273	Travis Perkins PLC .....	2.476	0,00
3.575	Tritax Big Box REIT PLC .....	6.540	0,01
14.235	Unilever PLC .....	729.516	1,49
1.703	UNITE Group PLC .....	17.917	0,04
2.171	United Utilities Group PLC .....	25.161	0,05
2.288	Virgin Money U.K. PLC .....	5.764	0,01
728	Vistry Group PLC .....	10.158	0,02
169.299	Vodafone Group PLC .....	139.299	0,28
1.222	Whitbread PLC .....	42.879	0,09
650	Wise PLC .....	5.225	0,01
		<u>8.466.823</u>	<u>17,27</u>
	<b>Summe Aktien .....</b>	<u>48.886.700</u>	<u>99,69</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere .....</b>	<u>48.886.700</u>	<u>99,69</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) % (30. Juni 2023: (0,00) %)

Terminkontrakte: (0,00) % (30. Juni 2023: (0,00) %)\*

Nominalwert EUR	Durchschnittli- cher Kurs EUR		Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
129.950	520	5 STOXX Europe 600 Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	(1.400)	(0,00)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten ...</b>	<u>(1.400)</u>	<u>(0,00)</u>
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente .....</b>	<u>(1.400)</u>	<u>(0,00)</u>
			<b>Beizulegender Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlagenportfolio</b>	48.885.300	99,69
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	150.894	0,31
		<b>Nettovermögen</b>	<u>49.036.194</u>	<u>100,00</u>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
		An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....		92,56
		Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		<u>7,44</u>
		Gesamtvermögen .....		<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 9.650 EUR.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,05 % (30. Juni 2023: 96,66 %)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 48,32 % (30. Juni 2023: 55,31 %)</b>		
	<b>Österreich: 0,37 % (30. Juni 2023: 1,61 %)</b>		
1.800.000	Verbund AG 0,90 % 01.04.2041 .....	1.172.216	0,37
		<u>1.172.216</u>	<u>0,37</u>
	<b>Belgien: 9,45 % (30. Juni 2023: 1,96 %)</b>		
2.000.000	Crelan SA 6,00 % 28.02.2030 .....	2.128.575	0,66
1.600.000	Elia Transmission Belgium SA 3,63 % 18.01.2033 .....	1.598.191	0,50
4.450.000	Europäische Union 0,40 % 04.02.2037 .....	3.166.064	0,98
21.700.000	Europäische Union 2,75 % 04.02.2033 .....	21.215.927	6,60
2.800.000	FLUVIUS System Operator CV 0,25 % 02.12.2030 .....	2.289.752	0,71
		<u>30.398.509</u>	<u>9,45</u>
	<b>Dänemark: 1,17 % (30. Juni 2023: 1,53 %)</b>		
2.400.000	Danske Bank AS 1,38 % 17.02.2027 .....	2.307.012	0,72
1.602.000	Orsted AS 1,75 % 09.12.3019 .....	1.439.954	0,45
		<u>3.746.966</u>	<u>1,17</u>
	<b>Finnland: 0,73 % (30. Juni 2023: 0,80 %)</b>		
2.500.000	Nordea Bank Abp 1,13 % 16.02.2027 .....	2.352.878	0,73
		<u>2.352.878</u>	<u>0,73</u>
	<b>Frankreich: 6,61 % (30. Juni 2023: 8,52 %)</b>		
3.200.000	AXA SA 1,38 % 07.10.2041 .....	2.629.309	0,82
2.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3,50 % 15.05.2031 .....	1.977.415	0,61
2.300.000	CNP Assurances SACA 2,00 % 27.07.2050 .....	1.995.031	0,62
2.800.000	Electricite de France SA 1,00 % 13.10.2026 .....	2.640.323	0,82
2.000.000	Engie SA 1,50 % 31.12.2099 .....	1.772.120	0,55
2.500.000	Engie SA 3,88 % 06.12.2033 .....	2.501.741	0,78
2.200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0,75 % 12.01.2034 .....	1.712.495	0,53
3.000.000	Societe Generale SA 0,88 % 22.09.2028 .....	2.723.667	0,85
2.500.000	Suez SACA 2,38 % 24.05.2030 .....	2.305.116	0,72
1.000.000	Valeo SE 4,50 % 11.04.2030 .....	981.110	0,31
		<u>21.238.327</u>	<u>6,61</u>
	<b>Deutschland: 3,02 % (30. Juni 2023: 8,45 %)</b>		
2.000.000	Amprion GmbH 3,97 % 22.09.2032 .....	2.030.767	0,63
2.400.000	Bayerische Landesbank 1,00 % 23.09.2031 .....	2.174.984	0,68
1.800.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1,60 % 31.12.2099 .....	1.563.978	0,48
1.700.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1,38 % 16.04.2040 .....	1.250.947	0,39
1.000.000	EnBW Energie Baden-Württemberg AG 5,25 % 23.01.2084 .....	1.028.312	0,32
2.000.000	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München 1,25 % 26.05.2041 .....	1.673.043	0,52
		<u>9.722.031</u>	<u>3,02</u>
	<b>Island: 0,69 % (30. Juni 2023: 1,12 %)</b>		
2.300.000	Arion Banki Hf. 0,38 % 14.07.2025 .....	2.216.367	0,69
		<u>2.216.367</u>	<u>0,69</u>
	<b>Indien: 0,56 % (30. Juni 2023: 0,83 %)</b>		
2.000.000	Power Finance Corp. Ltd. 1,84 % 21.09.2028 .....	1.803.562	0,56
		<u>1.803.562</u>	<u>0,56</u>
	<b>Irland: 1,40 % (30. Juni 2023: 1,49 %)</b>		
2.400.000	AIB Group PLC 3,63 % 04.07.2026 .....	2.394.881	0,74
2.000.000	Bank of Ireland Group PLC 5,00 % 04.07.2031 .....	2.119.305	0,66
		<u>4.514.186</u>	<u>1,40</u>
	<b>Italien: 3,17 % (30. Juni 2023: 3,66 %)</b>		
1.500.000	Aeroporti di Roma SpA 1,63 % 02.02.2029 .....	1.376.147	0,43
1.700.000	Assicurazioni Generali SpA 5,27 % 12.09.2033 .....	1.785.130	0,56
950.000	Banco BPM SpA 4,88 % 17.01.2030 .....	972.306	0,30
2.500.000	ERG SpA 0,88 % 15.09.2031 .....	1.999.258	0,62

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,05 % (30. Juni 2023: 96,66 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 48,32 % (30. Juni 2023: 55,31 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Italien: 3,17 % (30. Juni 2023: 3,66 %) (Fortsetzung)</b>		
1.500.000	Intesa Sanpaolo SpA 6,50 % 14.03.2029 .....	1.801.664	0,56
2.600.000	Iren SpA 0,88 % 14.10.2029 .....	2.249.594	0,70
		<u>10.184.099</u>	<u>3,17</u>
	<b>Japan: 0,64 % (30. Juni 2023: 1,09 %)</b>		
2.000.000	East Japan Railway Co. 3,98 % 05.09.2032 .....	2.068.255	0,64
		<u>2.068.255</u>	<u>0,64</u>
	<b>Luxembourg: 1,32 % (30. Juni 2023: 1,71 %)</b>		
2.100.000	Segro Capital SARL 0,50 % 22.09.2031 .....	1.673.025	0,52
3.000.000	SELP Finance SARL 0,88 % 27.05.2029 .....	2.579.082	0,80
		<u>4.252.107</u>	<u>1,32</u>
	<b>Niederlande: 7,19 % (30. Juni 2023: 11,13 %)</b>		
2.200.000	Enel Finance International NV 1,50 % 21.07.2025 .....	2.152.542	0,67
2.600.000	Enexis Holding NV 0,63 % 17.06.2032 .....	2.109.787	0,66
1.500.000	ING Groep NV 1,13 % 07.12.2028 .....	1.555.442	0,48
2.500.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV 0,25 % 09.09.2029 .....	2.136.466	0,66
2.000.000	Nederlandse Gasunie NV 3,88 % 22.05.2033 .....	2.048.994	0,64
2.000.000	NN Group NV 6,00 % 03.11.2043 .....	2.162.340	0,67
1.000.000	PostNL NV 0,63 % 23.09.2026 .....	932.401	0,29
2.000.000	Stedin Holding NV 0,00 % 16.11.2026 .....	1.840.942	0,57
2.000.000	Swisscom Finance BV 0,38 % 14.11.2028 .....	1.765.846	0,55
1.800.000	Telefonica Europe BV 6,14 % 31.12.2099 .....	1.889.444	0,59
1.500.000	TenneT Holding BV 4,88 % 31.12.2099 .....	1.497.300	0,47
2.300.000	Vesteda Finance BV 1,50 % 24.05.2027 .....	2.166.233	0,67
1.000.000	VZ Vendor Financing II BV 2,88 % 15.01.2029 .....	864.500	0,27
		<u>23.122.237</u>	<u>7,19</u>
	<b>Norwegen: 2,52 % (30. Juni 2023: 3,24 %)</b>		
2.500.000	DNB Bank ASA 4,00 % 14.03.2029 .....	2.537.326	0,79
2.000.000	Sparebank 1 Oestlandet 1,75 % 27.04.2027 .....	1.905.460	0,59
2.000.000	SpareBank 1 SR-Bank ASA 2,88 % 20.09.2025 .....	1.980.587	0,62
1.700.000	Statkraft AS 3,13 % 13.12.2031 .....	1.665.709	0,52
		<u>8.089.082</u>	<u>2,52</u>
	<b>Portugal: 0,42 % (30. Juni 2023: 0,77 %)</b>		
1.300.000	EDP - Energias de Portugal SA 5,94 % 23.04.2083 .....	1.356.085	0,42
		<u>1.356.085</u>	<u>0,42</u>
	<b>Rumänien: 0,20 % (30. Juni 2023: 0,28 %)</b>		
600.000	Banca Comerciala Romana SA 7,63 % 19.05.2027 .....	630.059	0,20
		<u>630.059</u>	<u>0,20</u>
	<b>Spanien: 3,62 % (30. Juni 2023: 3,09 %)</b>		
3.000.000	Abanca Corp. Bancaria SA 0,50 % 08.09.2027 .....	2.793.669	0,87
2.000.000	Banco de Sabadell SA 1,13 % 11.03.2027 .....	1.919.347	0,60
2.300.000	CaixaBank SA 0,50 % 09.02.2029 .....	2.047.891	0,64
2.000.000	Ibercaja Banco SA 4,38 % 30.07.2028 .....	2.021.579	0,63
2.200.000	Iberdrola Finanzas SA 1,58 % 31.12.2099 .....	2.012.340	0,62
800.000	Unicaja Banco SA 6,50 % 11.09.2028 .....	844.303	0,26
		<u>11.639.129</u>	<u>3,62</u>
	<b>Schweden: 3,38 % (30. Juni 2023: 3,51 %)</b>		
2.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,13 % 29.06.2027 .....	2.043.618	0,64
2.500.000	Swedbank AB 0,30 % 20.05.2027 .....	2.353.227	0,73
2.000.000	Telia Co. AB 1,38 % 11.05.2081 .....	1.894.418	0,59
1.400.000	Vattenfall AB 2,50 % 29.06.2083 .....	1.429.118	0,45
1.500.000	Vattenfall AB 6,88 % 17.08.2083 .....	1.809.140	0,56
1.400.000	Volvo Car AB 2,50 % 07.10.2027 .....	1.329.570	0,41
		<u>10.859.091</u>	<u>3,38</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,05 % (30. Juni 2023: 96,66 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 48,32 % (30. Juni 2023: 55,31 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 0,41 % (30. Juni 2023: 0,52 %)</b>		
1.300.000	Whitbread Group PLC 3,00 % 31.05.2031 .....	1.318.589	0,41
		<u>1.318.589</u>	<u>0,41</u>
	<b>USA: 1,45 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
2.700.000	Autoliv, Inc. 3,63 % 07.08.2029 .....	2.676.634	0,83
2.000.000	PVH Corp. 4,13 % 16.07.2029 .....	1.993.628	0,62
		<u>4.670.262</u>	<u>1,45</u>
	<b>Summe Unternehmensanleihen .....</b>	<b>155.354.037</b>	<b>48,32</b>
	<b>Staatsanleihen: 47,93 % (30. Juni 2023: 41,35 %)</b>		
	<b>Österreich: 6,67 % (30. Juni 2023: 2,31 %)</b>		
20.000.000	Schatzanweisungen Österreich 0,00 % 29.08.2024 .....	19.883.244	6,18
2.050.000	Staatsanleihen Republik Österreich 1,85 % 23.05.2049 .....	1.559.226	0,49
		<u>21.442.470</u>	<u>6,67</u>
	<b>Belgien: 6,51 % (30. Juni 2023: 4,95 %)</b>		
16.300.000	Staatsanleihen Königreich Belgien 1,25 % 22.04.2033 .....	14.126.680	4,39
6.800.000	Region Wallonne Belgien 3,75 % 22.04.2039 .....	6.811.322	2,12
		<u>20.938.002</u>	<u>6,51</u>
	<b>Chile: 0,67 % (30. Juni 2023: 0,93 %)</b>		
2.600.000	Internationale Staatsanleihen Chile 0,83 % 02.07.2031 .....	2.156.811	0,67
		<u>2.156.811</u>	<u>0,67</u>
	<b>Frankreich: 3,38 % (30. Juni 2023: 5,35 %)</b>		
5.900.000	Staatsanleihen Republik Frankreich OAT 1,75 % 25.06.2039 .....	4.730.686	1,47
100.000	Staatsanleihen Republik Frankreich OAT 3,00 % 25.06.2049 .....	89.716	0,03
3.000.000	Societe Des Grands Projets EPIC 0,00 % 25.11.2030 .....	2.438.201	0,76
4.200.000	Societe Nationale SNCF SACA 0,63 % 17.04.2030 .....	3.605.718	1,12
		<u>10.864.321</u>	<u>3,38</u>
	<b>Deutschland: 9,83 % (30. Juni 2023: 16,55 %)</b>		
8.300.000	Bundesobligation 0,00 % 10.10.2025 .....	7.996.734	2,49
5.800.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,30 % 15.02.2033 .....	5.739.028	1,78
21.650.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,80 % 15.08.2053 .....	17.878.440	5,56
		<u>31.614.202</u>	<u>9,83</u>
	<b>Island: 1,89 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
6.000.000	Internationale Staatsanleihen Island 3,50 % 21.03.2034 .....	6.064.290	1,89
		<u>6.064.290</u>	<u>1,89</u>
	<b>Irland: 3,26 % (30. Juni 2023: 3,38 %)</b>		
11.500.000	Staatsanleihen Irland 1,35 % 18.03.2031 .....	10.495.610	3,26
		<u>10.495.610</u>	<u>3,26</u>
	<b>Italien: 0,02 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
100.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,50 % 30.04.2045 .....	61.189	0,02
		<u>61.189</u>	<u>0,02</u>
	<b>Niederlande: 4,53 % (30. Juni 2023: 3,46 %)</b>		
20.750.000	Staatsanleihen Niederlande 0,50 % 15.01.2040 .....	14.562.755	4,53
		<u>14.562.755</u>	<u>4,53</u>
	<b>Rumänien: 2,00 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
6.600.000	Internationale Staatsanleihen Rumänien 5,63 % 22.02.2036 .....	6.441.682	2,00
		<u>6.441.682</u>	<u>2,00</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,05 % (30. Juni 2023: 96,66 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 47,93 % (30. Juni 2023: 41,35 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Spanien: 4,53 % (30. Juni 2023: 3,78 %)</b>		
3.450.000	Autonome Kommune Madrid 0,83 % 30.07.2027 .....	3.212.002	1,00
17.700.000	Staatsanleihen Spanien 1,00 % 30.07.2042 .....	11.344.195	3,53
		<u>14.556.197</u>	<u>4,53</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 4,64 % (30. Juni 2023: 0,64 %)</b>		
6.750.000	Vereinigtes Königreich Gilt 1,50 % 31.07.2053 .....	4.017.154	1,25
12.250.000	Vereinigtes Königreich Gilt 0,88 % 31.07.2033 .....	10.916.534	3,39
		<u>14.933.688</u>	<u>4,64</u>
	<b>Summe Staatsanleihen</b> .....	<u>154.131.217</u>	<u>47,93</u>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen: 2,80 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
	<b>Irland: 2,80 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
42.000	Franklin Sustainable Euro Green Corp. 1-5 Year UCITS ETF .....	1.100.232	0,34
300.000	Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF .....	7.907.400	2,46
		<u>9.007.632</u>	<u>2,80</u>
	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen</b> .....	<u>9.007.632</u>	<u>2,80</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>318.492.886</u>	<u>99,05</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,09) % (30. Juni 2023: (0,07) %)

Terminkontrakte: (0,01) % (30. Juni 2023: 0,03 %)\*

Nominalwert EUR	Durchschnittli- cher Kurs EUR		Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) EUR	% des Netto- vermögens
(5.867.550)	(131)	45 Euro-Bund Short-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	(55.350)	(0,02)
(3.491.700)	(116)	30 Euro-Btp Short-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	<u>33.000</u>	<u>0,01</u>
		<b>Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten</b>	<u>33.000</u>	<u>0,01</u>
		<b>Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten</b>	<u>(55.350)</u>	<u>(0,02)</u>
		<b>Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Terminkontrakten</b> .....	<u>(22.350)</u>	<u>(0,01)</u>

Devisenterminkontrakte: (0,08) % (30. Juni 2023: (0,10) %)

Erfüllungstag	Betrag Käufe	Betrag Verkäufe	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermögens
24/07/2024	EUR 17.106.359	GBP 14.690.000	Citibank	(204.488)	(0,06)
24/07/2024	EUR 3.251.673	GBP 2.792.000	Citibank	(38.449)	(0,01)
24/07/2024	EUR 704.675	GBP 605.000	Citibank	(8.263)	(0,00)
24/07/2024	GBP 523.000	EUR 608.696	Citibank	7.612	0,00
24/07/2024	EUR 1.349.217	GBP 1.165.000	Citibank	(23.630)	(0,01)

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Erfüllungstag	Betrag Käufe	Betrag Verkäufe	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
24/07/2024	EUR 427.848	GBP 365.000	Citibank	(2.271)	(0,00)
24/07/2024	EUR 562.304	GBP 475.000	Citibank	2.559	0,00
		<b>Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten</b>		10.171	0,00
		<b>Nicht realisierte Verluste aus Devisenterminkontrakten</b>		(277.101)	(0,08)
		<b>Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten (netto)</b>		(266.930)	(0,08)
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente</b>		(289.280)	(0,09)
				<b>Beizulegender Zeitwert EUR</b>	<b>% des Nettovermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>			318.203.606	98,96
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			3.335.563	1,04
	<b>Nettovermögen</b>			<u>321.539.169</u>	<u>100,00</u>
					<b>% des Gesamtvermögens</b>
	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>				
	An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....				97,74
	Börsengehandelte Derivate .....				0,01
	Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....				2,25
	Gesamtvermögen .....				<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 282.900 EUR.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024

## Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 93,65 %</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 90,06 %</b>		
	<b>Belgien: 0,70 %</b>		
200.000	Crelan SA 6,00 % 28.02.2030 .....	212.858	0,70
		<u>212.858</u>	<u>0,70</u>
	<b>Kanada: 1,64 %</b>		
500.000	Bank of Nova Scotia 3,50 % 17.04.2029 .....	496.708	1,64
		<u>496.708</u>	<u>1,64</u>
	<b>Dänemark: 2,53 %</b>		
525.000	Danske Bank AS 0,75 % 09.06.2029 .....	467.414	1,54
300.000	Sydbank AS 4,13 % 30.09.2027 .....	301.412	0,99
		<u>768.826</u>	<u>2,53</u>
	<b>Finnland: 1,64 %</b>		
530.000	Nordea Bank Abp 1,13 % 16.02.2027 .....	498.810	1,64
		<u>498.810</u>	<u>1,64</u>
	<b>Frankreich: 15,49 %</b>		
500.000	Arkema SA 0,13 % 14.10.2026 .....	463.498	1,53
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3,50 % 15.05.2031 .....	494.354	1,63
500.000	BNP Paribas SA 4,38 % 13.01.2029 .....	509.089	1,68
	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 0,75 % 07.07.2028 .....	440.485	1,45
500.000	Credit Agricole SA 0,38 % 21.10.2025 .....	479.307	1,58
500.000	Engie SA 1,75 % 27.03.2028 .....	469.241	1,55
310.000	RCI Banque SA 4,88 % 14.06.2028 .....	320.082	1,05
400.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 3,50 % 07.12.2031 .....	399.355	1,32
500.000	Societe Generale SA 0,88 % 22.09.2028 .....	453.944	1,49
500.000	Suez SACA 1,88 % 24.05.2027 .....	474.941	1,56
200.000	Valeo SE 4,50 % 11.04.2030 .....	196.222	0,65
		<u>4.700.518</u>	<u>15,49</u>
	<b>Deutschland: 7,68 %</b>		
400.000	Amprion GmbH 3,88 % 07.09.2028 .....	404.251	1,33
500.000	Deutsche Bank AG 3,25 % 24.05.2028 .....	491.025	1,62
300.000	EnBW Energie Baden-Württemberg AG 5,25 % 23.01.2084 .....	308.494	1,02
1.100.000	Kreditanstalt für Wiederaufbau 3,25 % 24.03.2031 .....	1.125.936	3,71
		<u>2.329.706</u>	<u>7,68</u>
	<b>Ungarn: 0,99 %</b>		
300.000	OTP Bank Nyrt 4,75 % 12.06.2028 .....	299.531	0,99
		<u>299.531</u>	<u>0,99</u>
	<b>Island: 0,95 %</b>		
300.000	Arion Banki Hf. 0,38 % 14.07.2025 .....	289.091	0,95
		<u>289.091</u>	<u>0,95</u>
	<b>Irland: 3,40 %</b>		
500.000	AIB Group PLC 0,50 % 17.11.2027 .....	462.415	1,52
100.000	Bank of Ireland Group PLC 1,38 % 11.08.2031 .....	94.545	0,31
460.000	Bank of Ireland Group PLC 4,88 % 16.07.2028 .....	475.138	1,57
		<u>1.032.098</u>	<u>3,40</u>
	<b>Italien: 5,81 %</b>		
300.000	Banco BPM SpA 4,88 % 17.01.2030 .....	307.044	1,01
530.000	ERG SpA 0,50 % 11.09.2027 .....	478.452	1,58
150.000	Intesa Sanpaolo SpA 6,50 % 14.03.2029 .....	180.166	0,59
300.000	Intesa Sanpaolo SpA 5,00 % 08.03.2028 .....	308.891	1,02
500.000	Iren SpA 1,95 % 19.09.2025 .....	489.321	1,61
		<u>1.763.874</u>	<u>5,81</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 93,65 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 90,06 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Japan: 1,03 %</b>		
330.000	NTT Finance Corp. 0,08 % 13.12.2025 .....	314.115	1,03
		<u>314.115</u>	<u>1,03</u>
	<b>Luxembourg: 0,73 %</b>		
230.000	Segro Capital SARL 1,25 % 23.03.2026 .....	220.844	0,73
		<u>220.844</u>	<u>0,73</u>
	<b>Niederlande: 11,14 %</b>		
400.000	ABN AMRO Bank NV 4,00 % 16.01.2028 .....	404.885	1,33
500.000	ASR Nederland NV 3,63 % 12.12.2028 .....	500.784	1,65
500.000	De Volksbank NV 1,75 % 22.10.2030 .....	482.061	1,59
310.000	Enel Finance International NV 1,13 % 16.09.2026 .....	294.733	0,97
500.000	ING Groep NV 0,88 % 06.09.2032 .....	454.302	1,50
100.000	ING Groep NV 1,13 % 12.07.2028 .....	103.696	0,34
500.000	Nationale-Niederlanden Bank NV 0,50 % 21.09.2028 .....	441.225	1,45
200.000	TenneT Holding BV 4,63 % 31.12.2099 .....	199.171	0,66
530.000	Vesteda Finance BV 1,50 % 24.05.2027 .....	499.176	1,65
		<u>3.380.033</u>	<u>11,14</u>
	<b>Norwegen: 4,27 %</b>		
480.000	DNB Bank ASA 4,50 % 19.07.2028 .....	491.810	1,62
530.000	Sparebank 1 Oestlandet 1,75 % 27.04.2027 .....	504.947	1,67
300.000	Statkraft AS 3,13 % 13.12.2026 .....	298.366	0,98
		<u>1.295.123</u>	<u>4,27</u>
	<b>Portugal: 2,01 %</b>		
100.000	EDP - Energias de Portugal SA 5,94 % 23.04.2083 .....	104.314	0,35
500.000	EDP - Energias de Portugal SA 3,88 % 26.06.2028 .....	504.377	1,66
		<u>608.691</u>	<u>2,01</u>
	<b>Rumänien: 1,38 %</b>		
400.000	Banca Comerciala Romana SA 7,63 % 19.05.2027 .....	420.039	1,38
		<u>420.039</u>	<u>1,38</u>
	<b>Spanien: 13,04 %</b>		
100.000	Abanca Corp. Bancaria SA 5,25 % 14.09.2028 .....	103.842	0,34
300.000	Acciona Energia Financiacion Filiales SA 0,38 % 07.10.2027 .....	269.158	0,89
400.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1,00 % 21.06.2026 .....	380.788	1,25
400.000	Banco de Sabadell SA 1,13 % 11.03.2027 .....	383.869	1,27
200.000	Banco de Sabadell SA 5,13 % 10.11.2028 .....	208.645	0,69
400.000	Banco Santander SA 0,30 % 10.04.2026 .....	372.875	1,23
300.000	Bankinter SA 0,63 % 06.10.2027 .....	272.566	0,90
500.000	CaixaBank SA 0,50 % 09.02.2029 .....	445.194	1,47
530.000	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU 1,66 % 04.12.2026 .....	506.892	1,67
100.000	Ibercaja Banco SA 4,38 % 30.07.2028 .....	101.079	0,33
100.000	Iberdrola Finanzas SA 1,58 % 31.12.2099 .....	91.470	0,30
400.000	Iberdrola Finanzas SA 3,13 % 22.11.2028 .....	397.307	1,31
400.000	Unicaja Banco SA 6,50 % 11.09.2028 .....	422.152	1,39
		<u>3.955.837</u>	<u>13,04</u>
	<b>Schweden: 9,06 %</b>		
400.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,13 % 29.06.2027 .....	408.724	1,35
525.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,00 % 09.11.2026 .....	528.630	1,74
525.000	Svenska Handelsbanken AB 0,01 % 12.02.2027 .....	468.484	1,55
430.000	Swedbank AB 0,30 % 20.05.2027 .....	404.755	1,33
380.000	Swedbank AB 4,25 % 11.07.2028 .....	388.909	1,28
580.000	Telia Co. AB 1,38 % 11.05.2081 .....	549.381	1,81
		<u>2.748.883</u>	<u>9,06</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 93,65 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 90,06 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Vereinigtes Königreich: 1,77 %</b>		
410.000	NatWest Group PLC 4,07 % 06.09.2028 .....	414.324	1,37
130.000	Vodafone Group PLC 0,90 % 24.11.2026 .....	122.751	0,40
		<u>537.075</u>	<u>1,77</u>
	<b>USA: 4,80 %</b>		
500.000	Autoliv, Inc. 3,63 % 07.08.2029 .....	495.673	1,64
460.000	Citigroup, Inc. 3,71 % 22.09.2028 .....	461.735	1,52
500.000	PVH Corp. 4,13 % 16.07.2029 .....	498.407	1,64
		<u>1.455.815</u>	<u>4,80</u>
	<b>Summe Unternehmensanleihen</b> .....	<u>27.328.475</u>	<u>90,06</u>
	<b>Staatsanleihe: 3,59 %</b>		
	<b>Spanien: 3,59 %</b>		
1.100.000	Instituto de Credito Oficial 3,05 % 30.04.2031 .....	1.090.361	3,59
		<u>1.090.361</u>	<u>3,59</u>
	<b>Summe Staatsanleihe</b> .....	<u>1.090.361</u>	<u>3,59</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>28.418.836</u>	<u>93,65</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) %

Devisenterminkontrakte: (0,01) %

Erfüllungstag	Betrag Käufe	Betrag Verkäufe	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
24/07/2024	EUR 267.917	GBP 230.000	BNP Paribas	(3.118)	(0,01)
		<b>Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten (netto)</b>		<u>(3.118)</u>	<u>(0,01)</u>
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente</b> .....		<u>(3.118)</u>	<u>(0,01)</u>
				<b>Beizulegender Zeitwert EUR</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
				28.415.718	93,64
				1.928.544	6,36
				<u>30.344.262</u>	<u>100,00</u>
					<b>% des Gesamt- vermögens</b>
					93,63
					6,37
					<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024

## Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,31 %</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 28,78 %</b>		
	<b>Belgien: 16,57 %</b>		
4.250.000	Europäische Union 0,40 % 04.02.2037 .....	3.023.769	5,43
5.300.000	Europäische Union 2,75 % 04.02.2033 .....	5.181.770	9,30
900.000	Europäische Union 2,63 % 04.02.2048 .....	778.808	1,40
300.000	FLUVIUS System Operator CV 0,25 % 02.12.2030 .....	245.331	0,44
		<u>9.229.678</u>	<u>16,57</u>
	<b>Deutschland: 10,20 %</b>		
400.000	Bayerische Landesbank 1,00 % 23.09.2031 .....	362.497	0,65
5.350.000	Kreditanstalt für Wiederaufbau 2,75 % 15.05.2030 .....	5.320.824	9,55
		<u>5.683.321</u>	<u>10,20</u>
	<b>Niederlande: 2,01 %</b>		
700.000	Enexis Holding NV 0,63 % 17.06.2032 .....	568.019	1,02
600.000	Stedin Holding NV 0,00 % 16.11.2026 .....	552.283	0,99
		<u>1.120.302</u>	<u>2,01</u>
	<b>Summe Unternehmensanleihen</b>	<u>16.033.301</u>	<u>28,78</u>
	<b>Staatsanleihen: 70,53 %</b>		
	<b>Österreich: 7,00 %</b>		
1.400.000	Schatzanweisungen Österreich 0,00 % 29.08.2024 .....	1.391.793	2,50
3.300.000	Staatsanleihen Republik Österreich 1,85 % 23.05.2049 .....	2.509.973	4,50
		<u>3.901.766</u>	<u>7,00</u>
	<b>Belgien: 7,45 %</b>		
3.400.000	Staatsanleihen Königreich Belgien 1,25 % 22.04.2033 .....	2.946.669	5,29
1.200.000	Region Wallonne Belgien 3,75 % 22.04.2039 .....	1.201.998	2,16
		<u>4.148.667</u>	<u>7,45</u>
	<b>Chile: 1,19 %</b>		
800.000	Internationale Staatsanleihen Chile 0,83 % 02.07.2031 .....	663.705	1,19
		<u>663.705</u>	<u>1,19</u>
	<b>Frankreich: 7,37 %</b>		
1.700.000	Staatsanleihen Republik Frankreich OAT 1,75 % 25.06.2039 .....	1.363.079	2,45
2.000.000	Societe Des Grands Projets EPIC 0,00 % 25.11.2030 .....	1.625.467	2,92
1.300.000	Societe Nationale SNCF SACA 0,63 % 17.04.2030 .....	1.116.056	2,00
		<u>4.104.602</u>	<u>7,37</u>
	<b>Deutschland: 13,79 %</b>		
4.050.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,30 % 15.02.2033 .....	4.007.425	7,19
4.450.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,80 % 15.08.2053 .....	3.674.783	6,60
		<u>7.682.208</u>	<u>13,79</u>
	<b>Island: 2,00 %</b>		
1.100.000	Internationale Staatsanleihen Island 3,50 % 21.03.2034 .....	1.111.786	2,00
		<u>1.111.786</u>	<u>2,00</u>
	<b>Irland: 6,31 %</b>		
3.850.000	Staatsanleihen Irland 1,35 % 18.03.2031 .....	3.513.748	6,31
		<u>3.513.748</u>	<u>6,31</u>
	<b>Niederlande: 10,33 %</b>		
8.200.000	Staatsanleihen Niederlande 0,50 % 15.01.2040 .....	5.754.920	10,33
		<u>5.754.920</u>	<u>10,33</u>
	<b>Rumänien: 2,10 %</b>		
1.200.000	Internationale Staatsanleihen Rumänien 5,63 % 22.02.2036 .....	1.171.215	2,10
		<u>1.171.215</u>	<u>2,10</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,31 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Staatsanleihen: 70,53 % (Fortsetzung)</b>		
	<b>Spanien: 7,49 %</b>		
800.000	Autonome Kommune Madrid 3,36 % 31.10.2028 .....	805.804	1,45
5.250.000	Staatsanleihen Spanien 1,00 % 30.07.2042 .....	3.364.804	6,04
		<u>4.170.608</u>	<u>7,49</u>
	<b>Vereinigtes Königreich: 5,50 %</b>		
1.500.000	Vereinigtes Königreich Gilt 1,50 % 31.07.2053 .....	892.701	1,60
2.440.000	Vereinigtes Königreich Gilt 0,88 % 31.07.2033 .....	2.174.395	3,90
		<u>3.067.096</u>	<u>5,50</u>
	<b>Summe Staatsanleihen</b> .....	<u>39.290.321</u>	<u>70,53</u>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<u>55.323.622</u>	<u>99,31</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,09) %

Terminkontrakte: (0,03) % \*

Nominalwert EUR	Durchschnittli- cher Kurs EUR		Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
(4.458.420)	(131)	34 Euro-Bund Short-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	(16.660)	(0,03)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten</b> ...	<u>(16.660)</u>	<u>(0,03)</u>

Devisenterminkontrakte: (0,06) %

Erfüllungstag	Betrag Käufe	Betrag Verkäufe	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
24/07/2024	EUR 2.780.509	GBP 2.387.000	BNP Paribas	(32.356)	(0,06)
24/07/2024	EUR 295.902	GBP 254.000	BNP Paribas	(3.414)	(0,00)
		<b>Nicht realisierte Gewinne aus Devisenterminkontrakten (netto)</b>		<u>(35.770)</u>	<u>(0,06)</u>
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente</b> .....		<u>(52.430)</u>	<u>(0,09)</u>

	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
<b>Anlagenportfolio</b>	55.271.192	99,22
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	435.854	0,78
<b>Nettovermögen</b>	<u>55.707.046</u>	<u>100,00</u>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	97,87
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	2,13
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 136.631 EUR.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %)</b>		
	<b>Aktien: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %)</b>		
	<b>Bermuda: 0,21 % (30. Juni 2023: 0,12 %)</b>		
1.260	Arch Capital Group Ltd. ....	127.127	0,13
315	Assured Guaranty Ltd. ....	24.303	0,02
595	Genpact Ltd. ....	19.155	0,02
19	White Mountains Insurance Group Ltd. ....	34.532	0,04
		<u>205.117</u>	<u>0,21</u>
	<b>Guernsey: 0,16 % (30. Juni 2023: 0,25 %)</b>		
1.960	Amdocs Ltd. ....	154.683	0,16
		<u>154.683</u>	<u>0,16</u>
	<b>Irland: 1,46 % (30. Juni 2023: 1,71 %)</b>		
3.395	Accenture PLC ....	1.030.080	1,07
1.155	Allegion PLC ....	136.463	0,14
735	Trane Technologies PLC ....	241.767	0,25
		<u>1.408.310</u>	<u>1,46</u>
	<b>Jersey: 0,42 % (30. Juni 2023: 0,20 %)</b>		
18.410	Ancor PLC ....	180.054	0,19
1.155	Ferguson PLC ....	223.668	0,23
		<u>403.722</u>	<u>0,42</u>
	<b>Niederlande: 0,48 % (30. Juni 2023: 0,55 %)</b>		
4.830	LyondellBasell Industries NV ....	462.038	0,48
		<u>462.038</u>	<u>0,48</u>
	<b>Schweiz: 0,14 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
490	Bunge Global SA ....	52.319	0,05
525	Garmin Ltd. ....	85.535	0,09
		<u>137.854</u>	<u>0,14</u>
	<b>USA: 96,87 % (30. Juni 2023: 97,05 %)</b>		
1.785	A O Smith Corp. ....	145.978	0,15
5.915	AbbVie, Inc. ....	1.014.541	1,05
105	Acuity Brands, Inc. ....	25.352	0,03
875	Agree Realty Corp. ....	54.198	0,06
3.710	Albertsons Co., Inc. ....	73.277	0,08
1.610	Allison Transmission Holdings, Inc. ....	122.199	0,13
2.975	Alphabet, Inc. Anteilsklasse A ....	541.901	0,56
2.520	Alphabet, Inc. Anteilsklasse C ....	462.222	0,48
20.615	Altria Group, Inc. ....	939.015	0,98
3.115	Amgen, Inc. ....	973.282	1,01
3.885	Amphenol Corp. ....	261.748	0,27
1.190	Antero Midstream Corp. ....	17.545	0,02
4.235	APA Corp. ....	124.682	0,13
4.970	Apple, Inc. ....	1.046.783	1,09
4.445	Applied Materials, Inc. ....	1.048.989	1,09
6.965	Archer-Daniels-Midland Co. ....	421.036	0,44
245	Armstrong World Industries, Inc. ....	27.744	0,03
52.360	AT&T, Inc. ....	1.000.603	1,04
3.885	Automatic Data Processing, Inc. ....	927.311	0,96
455	AutoNation, Inc. ....	72.518	0,08
300	AutoZone, Inc. ....	889.230	0,92
1.435	AvalonBay Communities, Inc. ....	296.888	0,31
3.745	Best Buy Co., Inc. ....	315.667	0,33
1.470	BJ's Wholesale Club Holdings, Inc. ....	129.126	0,13
1.715	BorgWarner, Inc. ....	55.294	0,06
718	Broadcom, Inc. ....	1.152.780	1,20
665	Broadridge Financial Solutions, Inc. ....	131.006	0,14
1.610	Builders FirstSource, Inc. ....	222.841	0,23
840	BWX Technologies, Inc. ....	79.801	0,08

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 96,87 % (30. Juni 2023: 97,05 %) (Fortsetzung)</b>		
3.220	Cadence Design Systems, Inc. ....	990.956	1,03
1.890	Cardinal Health, Inc. ....	185.827	0,19
175	Carlisle Cos., Inc. ....	70.912	0,07
665	Carter's, Inc. ....	41.210	0,04
560	Casey's General Stores, Inc. ....	213.674	0,22
2.835	Caterpillar, Inc. ....	944.344	0,98
560	Cboe Global Markets, Inc. ....	95.235	0,10
560	Cencora, Inc. ....	126.170	0,13
2.660	CF Industries Holdings, Inc. ....	197.160	0,20
1.925	CH Robinson Worldwide, Inc. ....	169.631	0,18
245	Chemed Corp. ....	132.932	0,14
1.470	Chesapeake Energy Corp. ....	120.820	0,13
5.880	Chevron Corp. ....	919.750	0,96
10.780	Chipotle Mexican Grill, Inc. ....	675.380	0,70
175	Chord Energy Corp. ....	29.345	0,03
3.745	Church & Dwight Co., Inc. ....	388.282	0,40
2.765	Cigna Group ....	914.028	0,95
1.315	Cintas Corp. ....	920.842	0,96
20.510	Cisco Systems, Inc. ....	974.441	1,01
15.330	Citigroup, Inc. ....	972.844	1,01
3.570	Citizens Financial Group, Inc. ....	128.631	0,13
385	Civitas Resources, Inc. ....	26.567	0,03
1.015	Clorox Co. ....	138.518	0,14
15.155	Coca-Cola Co. ....	964.618	1,00
7.665	Cognizant Technology Solutions Corp. ....	521.221	0,54
105	Columbia Sportswear Co. ....	8.304	0,01
22.645	Comcast Corp. ....	886.821	0,92
140	Comfort Systems USA, Inc. ....	42.577	0,04
6.230	Conagra Brands, Inc. ....	177.059	0,18
8.190	ConocoPhillips ....	936.776	0,97
6.545	Copart, Inc. ....	354.484	0,37
1.178	Costco Wholesale Corp. ....	1.001.293	1,04
12.285	Coterra Energy, Inc. ....	327.643	0,34
490	Cousins Properties, Inc. ....	11.345	0,01
350	Crane NXT Co. ....	21.498	0,02
210	Crocs, Inc. ....	30.648	0,03
2.310	Cummins, Inc. ....	639.708	0,66
13.720	CVS Health Corp. ....	810.310	0,84
945	Darden Restaurants, Inc. ....	142.999	0,15
228	Deckers Outdoor Corp. ....	220.693	0,23
2.170	Delta Air Lines, Inc. ....	102.953	0,11
9.065	Devon Energy Corp. ....	429.685	0,45
2.275	Diamondback Energy, Inc. ....	455.434	0,47
840	Dick's Sporting Goods, Inc. ....	180.474	0,19
350	Domino's Pizza, Inc. ....	180.716	0,19
735	Donaldson Co., Inc. ....	52.598	0,05
9.345	Dow, Inc. ....	495.754	0,52
4.690	DR Horton, Inc. ....	660.963	0,69
455	Eagle Materials, Inc. ....	98.944	0,10
2.975	eBay, Inc. ....	159.823	0,17
3.640	Electronic Arts, Inc. ....	507.162	0,53
1.155	Eli Lilly & Co. ....	1.045.722	1,09
350	EMCOR Group, Inc. ....	127.778	0,13
7.560	EOG Resources, Inc. ....	951.582	0,99
805	EPR Properties ....	33.794	0,04
490	Evercore, Inc. ....	102.131	0,11
2.625	Expeditors International of Washington, Inc. ....	327.574	0,34

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 96,87 % (30. Juni 2023: 97,05 %) (Fortsetzung)</b>		
8.120	Exxon Mobil Corp. ....	934.821	0,97
595	FactSet Research Systems, Inc. ....	242.921	0,25
9.975	Fastenal Co. ....	626.831	0,65
1.225	FedEx Corp. ....	367.306	0,38
2.835	Flowers Foods, Inc. ....	62.937	0,07
700	FMC Corp. ....	40.286	0,04
3.920	FNB Corp. ....	53.627	0,06
3.570	Fox Corp. Anteilsklasse A ....	122.701	0,13
3.185	Gaming & Leisure Properties, Inc. ....	143.996	0,15
3.185	General Dynamics Corp. ....	924.097	0,96
8.960	General Mills, Inc. ....	566.810	0,59
4.060	General Motors Co. ....	188.644	0,20
3.920	Gentex Corp. ....	132.143	0,14
2.590	Graco, Inc. ....	205.335	0,21
525	Grand Canyon Education, Inc. ....	73.453	0,08
1.400	H&R Block, Inc. ....	75.923	0,08
2.905	Halliburton Co. ....	98.143	0,10
2.695	Hershey Co. ....	495.422	0,51
16.065	Hewlett Packard Enterprise Co. ....	340.101	0,35
1.715	HF Sinclair Corp. ....	91.480	0,10
350	Highwoods Properties, Inc. ....	9.196	0,01
4.235	Hormel Foods Corp. ....	129.125	0,13
17.955	HP, Inc. ....	628.785	0,65
735	Hubbell, Inc. ....	268.628	0,28
630	Huntington Ingalls Industries, Inc. ....	155.188	0,16
1.155	IDEXX Laboratories, Inc. ....	562.716	0,58
3.920	Illinois Tool Works, Inc. ....	928.885	0,96
1.050	Ingredion, Inc. ....	120.435	0,13
5.705	International Business Machines Corp. ....	986.681	1,02
4.970	International Paper Co. ....	214.456	0,22
5.915	Interpublic Group of Co., Inc. ....	172.068	0,18
1.120	Jack Henry & Associates, Inc. ....	185.942	0,19
6.510	Johnson & Johnson ....	951.506	0,99
910	Kellanova ....	52.492	0,05
980	Kilroy Realty Corp. ....	30.548	0,03
4.690	Kimberly-Clark Corp. ....	648.160	0,67
1.260	KLA Corp. ....	1.038.891	1,08
2.905	Kraft Heinz Co. ....	93.611	0,10
10.500	Kroger Co. ....	524.266	0,54
1.023	Lam Research Corp. ....	1.089.347	1,13
1.190	Lamb Weston Holdings, Inc. ....	100.056	0,10
595	Landstar System, Inc. ....	109.766	0,11
420	Leidos Holdings, Inc. ....	61.271	0,06
105	Lennar Corp. ....	14.640	0,02
3.360	Lennar Corp. Anteilsklasse A ....	503.564	0,52
105	Lennox International, Inc. ....	56.173	0,06
805	Lincoln Electric Holdings, Inc. ....	151.855	0,16
560	Lincoln National Corp. ....	17.418	0,02
2.030	Lockheed Martin Corp. ....	948.214	0,98
4.305	Lowe's Co., Inc. ....	949.080	0,99
665	LPL Financial Holdings, Inc. ....	185.735	0,19
385	Lululemon Athletica, Inc. ....	115.001	0,12
770	Manhattan Associates, Inc. ....	189.944	0,20
7.595	Marathon Oil Corp. ....	217.752	0,23
5.390	Marathon Petroleum Corp. ....	935.059	0,97
2.835	Marsh & McLennan Co., Inc. ....	597.397	0,62
1.330	Masco Corp. ....	88.674	0,09

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Aktien: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 96,87 % (30. Juni 2023: 97,05 %) (Fortsetzung)</b>		
2.135	Mastercard, Inc. ....	941.877	0,98
420	Matador Resources Co. ....	25.034	0,03
3.675	McDonald's Corp. ....	936.540	0,97
665	MDU Resources Group, Inc. ....	16.694	0,02
210	Medpace Holdings, Inc. ....	86.489	0,09
7.595	Merck & Co., Inc. ....	940.266	0,98
2.030	Meta Platforms, Inc. ....	1.023.577	1,06
3.640	MGIC Investment Corp. ....	78.443	0,08
2.310	Microsoft Corp. ....	1.032.455	1,07
10.990	Monster Beverage Corp. ....	548.952	0,57
2.415	Moody's Corp. ....	1.016.546	1,06
3.920	Mosaic Co. ....	113.290	0,12
735	MSC Industrial Direct Co., Inc. ....	58.293	0,06
175	Murphy USA, Inc. ....	82.156	0,09
1.225	National Fuel Gas Co. ....	66.383	0,07
3.745	NetApp, Inc. ....	482.357	0,50
105	NewMarket Corp. ....	54.135	0,06
3.115	NNN REIT, Inc. ....	132.700	0,14
4.235	Nucor Corp. ....	669.469	0,70
52	NVR, Inc. ....	394.605	0,41
3.010	Old Dominion Freight Line, Inc. ....	531.566	0,55
3.115	Omega Healthcare Investors, Inc. ....	106.690	0,11
3.325	Omnicom Group, Inc. ....	298.253	0,31
1.120	OneMain Holdings, Inc. ....	54.310	0,06
4.340	ONEOK, Inc. ....	353.932	0,37
875	O'Reilly Automotive, Inc. ....	924.053	0,96
4.095	Organon & Co. ....	84.768	0,09
350	Oshkosh Corp. ....	37.871	0,04
2.800	Ovintiv, Inc. ....	131.238	0,14
910	Owens Corning ....	158.086	0,16
8.155	PACCAR, Inc. ....	839.478	0,87
1.505	Packaging Corp. of America ....	274.753	0,29
1.680	Palo Alto Networks, Inc. ....	569.540	0,59
5.355	Paychex, Inc. ....	634.890	0,66
315	Penske Automotive Group, Inc. ....	46.941	0,05
5.530	PepsiCo, Inc. ....	912.065	0,95
33.320	Pfizer, Inc. ....	932.316	0,97
9.415	Philip Morris International, Inc. ....	954.023	0,99
5.740	Phillips 66 ....	810.318	0,84
700	Polaris, Inc. ....	54.817	0,06
1.715	Premier, Inc. ....	32.020	0,03
5.810	Procter & Gamble Co. ....	958.186	1,00
2.730	Public Storage ....	785.285	0,82
3.745	PulteGroup, Inc. ....	412.325	0,43
4.690	QUALCOMM, Inc. ....	934.172	0,97
1.575	Quest Diagnostics, Inc. ....	215.586	0,22
140	Ralph Lauren Corp. ....	24.509	0,03
1.785	Range Resources Corp. ....	59.853	0,06
11.830	Realty Income Corp. ....	624.865	0,65
980	Regeneron Pharmaceuticals, Inc. ....	1.030.012	1,07
945	Reliance, Inc. ....	269.892	0,28
5.425	Rithm Capital Corp. ....	59.190	0,06
1.855	Robert Half, Inc. ....	118.683	0,12
3.885	Rollins, Inc. ....	189.550	0,20
560	Ryder System, Inc. ....	69.373	0,07
280	Science Applications International Corp. ....	32.915	0,03
1.680	SEI Investments Co. ....	108.680	0,11

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
<b>übertragbare Wertpapiere: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien: 99,74 % (30. Juni 2023: 99,88 %) (Fortsetzung)</b>			
<b>USA: 96,87 % (30. Juni 2023: 97,05 %) (Fortsetzung)</b>			
1.995	Simon Property Group, Inc. ....	302.845	0,31
2.625	Skyworks Solutions, Inc. ....	279.773	0,29
700	SLM Corp. ....	14.556	0,02
840	Snap-on, Inc. ....	219.568	0,23
1.295	Southern Copper Corp. ....	139.524	0,14
3.185	Starwood Property Trust, Inc. ....	60.325	0,06
2.940	Steel Dynamics, Inc. ....	380.731	0,40
6.125	Synchrony Financial ....	289.041	0,30
2.835	Sysco Corp. ....	202.396	0,21
3.220	T Rowe Price Group, Inc. ....	371.299	0,39
1.855	Tapestry, Inc. ....	79.378	0,08
1.505	Target Corp. ....	222.806	0,23
350	Tenet Healthcare Corp. ....	46.562	0,05
4.900	Texas Instruments, Inc. ....	953.203	0,99
245	Texas Pacific Land Corp. ....	179.896	0,19
560	Texas Roadhouse, Inc. ....	96.158	0,10
1.295	Toll Brothers, Inc. ....	149.159	0,15
175	TopBuild Corp. ....	67.423	0,07
1.855	Tractor Supply Co. ....	500.850	0,52
2.765	U.S. Steel Corp. ....	104.517	0,11
595	Ulta Beauty, Inc. ....	229.593	0,24
4.095	Union Pacific Corp. ....	926.536	0,96
6.825	United Parcel Service, Inc. ....	934.006	0,97
385	United Rentals, Inc. ....	248.992	0,26
560	United Therapeutics Corp. ....	178.388	0,19
1.925	UnitedHealth Group, Inc. ....	980.327	1,02
2.345	Unum Group ....	119.854	0,12
4.760	Valero Energy Corp. ....	746.179	0,78
23.170	Verizon Communications, Inc. ....	955.535	0,99
2.100	Vertex Pharmaceuticals, Inc. ....	984.317	1,02
13.720	VICI Properties, Inc. ....	392.948	0,41
350	Viper Energy, Inc. ....	13.137	0,01
3.500	Visa, Inc. ....	918.646	0,95
14.525	Walmart, Inc. ....	983.499	1,02
525	Watsco, Inc. ....	243.201	0,25
5.530	Western Union Co. ....	67.578	0,07
1.330	Williams-Sonoma, Inc. ....	375.552	0,39
770	WW Grainger, Inc. ....	694.725	0,72
3.640	Yum! Brands, Inc. ....	482.156	0,50
		<b>93.252.086</b>	<b>96,87</b>
	<b>Summe Aktien</b> .....	<b>96.023.810</b>	<b>99,74</b>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b> .....	<b>96.023.810</b>	<b>99,74</b>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.



# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,00) % (30. Juni 2023: 0,00 %)

Terminkontrakte: (0,00) % (30. Juni 2023: 0,00 %)\*

Nominalwert USD	Durchschnittli- cher Kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermögens
776.484	5.546	28 S&P 500 Mic Emin Long-Terminkontrakte mit Fälligkeit im September 2024 .....	(3.474)	(0,00)
		<b>Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten ...</b>	<b>(3.474)</b>	<b>(0,00)</b>
		<b>Summe derivative Finanzinstrumente .....</b>	<b>(3.474)</b>	<b>(0,00)</b>
			<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
		<b>Anlagenportfolio</b>	96.020.336	99,74
		<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	249.900	0,26
		<b>Nettovermögen</b>	<b>96.270.236</b>	<b>100,00</b>
				<b>% des Gesamt- vermögens</b>
		<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
		An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....		89,13
		Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....		10,87
		Gesamtvermögen .....		<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

\* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte ist J.P. Morgan. Der Wert der Variationsmarge des Brokers zum 30. Juni 2024 beträgt 33.108 USD.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,70 % (30. Juni 2023: 98,60 %)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 97,47 % (30. Juni 2023: 94,32 %)</b>		
	<b>Österreich: 0,28 % (30. Juni 2023: 0,69 %)</b>		
30.000	Suzano Austria GmbH 3,75 % 15.01.2031 .....	26.157	0,28
		26.157	0,28
	<b>Bermuda: 0,88 % (30. Juni 2023: 0,79 %)</b>		
115.000	Arch Capital Group Ltd. 3,64 % 30.06.2050 .....	82.914	0,88
		82.914	0,88
	<b>Kanada: 2,95 % (30. Juni 2023: 1,48 %)</b>		
115.000	Bank of Montreal 5,72 % 25.09.2028 .....	117.364	1,26
165.000	Toronto-Dominion Bank 1,15 % 12.06.2025 .....	158.525	1,69
		275.889	2,95
	<b>Dänemark: 2,41 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
225.000	Danske Bank AS 5,43 % 01.03.2028 .....	225.235	2,41
		225.235	2,41
	<b>Frankreich: 3,19 % (30. Juni 2023: 5,18 %)</b>		
200.000	BNP Paribas SA, 3,38 % , 01.09.25 .....	197.414	2,11
85.000	Orange SA 9,00 % 01.03.2031 .....	101.422	1,08
		298.836	3,19
	<b>Irland: 1,49 % (30. Juni 2023: 1,44 %)</b>		
150.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust 2,45 % 29.10.2026	139.976	1,49
		139.976	1,49
	<b>Japan: Null (30. Juni 2023: 1,51 %)</b>		
	<b>Luxembourg: 0,72 % (30. Juni 2023: Null)</b>		
70.000	Medtronic Global Holdings SCA 4,50 % 30.03.2033 .....	67.323	0,72
		67.323	0,72
	<b>Niederlande: 3,89 % (30. Juni 2023: 3,79 %)</b>		
200.000	EDP Finance BV 1,71 % 24.01.2028 .....	176.858	1,89
200.000	Enel Finance International NV 3,50 % 06.04.2028 .....	187.178	2,00
		364.036	3,89
	<b>Norwegen: 1,47 % (30. Juni 2023: 1,43 %)</b>		
150.000	Aker BP ASA 3,75 % 15.01.2030 .....	137.443	1,47
		137.443	1,47
	<b>Singapur: 0,88 % (30. Juni 2023: 1,17 %)</b>		
85.000	Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,30 % 19.05.2053 .....	82.043	0,88
		82.043	0,88
	<b>Spanien: 0,70 % (30. Juni 2023: 1,05 %)</b>		
60.000	Telefonica Emisiones SA 7,05 % 20.06.2036 .....	65.315	0,70
		65.315	0,70
	<b>Schweiz: 1,94 % (30. Juni 2023: 1,83 %)</b>		
225.000	UBS Group AG 2,10 % 11.02.2032 .....	181.189	1,94
		181.189	1,94
	<b>Vereinigtes Königreich: 1,52 % (30. Juni 2023: 3,61 %)</b>		
55.000	AstraZeneca PLC 4,38 % 16.11.2045 .....	47.813	0,51
60.000	Royalty Pharma PLC 3,35 % 02.09.2051 .....	38.455	0,41
65.000	Vodafone Group PLC 4,88 % 19.06.2049 .....	56.309	0,60
		142.577	1,52
	<b>USA: 75,15 % (30. Juni 2023: 70,35 %)</b>		
80.000	AbbVie, Inc. 4,25 % 21.11.2049 .....	66.716	0,71
85.000	Aflac, Inc. 4,75 % 15.01.2049 .....	75.177	0,80
100.000	Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,95 % 15.03.2034 .....	81.033	0,87
120.000	American Express Co. 3,30 % 03.05.2027 .....	114.196	1,22
70.000	Amgen, Inc. 5,60 % 02.03.2043 .....	69.032	0,74

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,70 % (30. Juni 2023: 98,60 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 97,47 % (30. Juni 2023: 94,32 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 75,15 % (30. Juni 2023: 70,35 %) (Fortsetzung)</b>		
25.000	Amgen, Inc. 5,65 % 02.03.2053 .....	24.638	0,26
	Anheuser-Busch Cos. LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,70 % 01.02.2036 .....	95.379	1,02
100.000	Apple, Inc. 2,70 % 05.08.2051 .....	95.346	1,02
150.000	AT&T, Inc. 3,50 % 01.06.2041 .....	107.027	1,14
140.000	Athene Holding Ltd. 6,25 % 04.01.2054 .....	45.068	0,48
45.000	Baker Hughes Holdings LLC/Baker Hughes Co.-Obligor, Inc. 4,08 % 15.12.2047 .....	88.052	0,94
110.000	Bank of New York Mellon Corp. 4,95 % 26.04.2027 .....	119.306	1,27
120.000	BlackRock Funding, Inc. 5,25 % 14.03.2054 .....	48.354	0,52
50.000	BP Capital Markets America, Inc. 4,81 % 13.02.2033 .....	82.445	0,88
85.000	Bristol-Myers Squibb Co. 5,00 % 15.08.2045 .....	83.558	0,89
90.000	Brixmor Operating Partnership LP 4,13 % 15.05.2029 .....	23.609	0,25
25.000	Carrier Global Corp. 3,58 % 04.05.2050 .....	61.896	0,66
85.000	Centene Corp. 3,38 % 15.02.2030 .....	53.302	0,57
60.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital 2,80 % 01.04.2031 .....	65.420	0,70
80.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital 5,38 % 01.04.2038 .....	34.857	0,37
40.000	Church & Dwight Co., Inc. 5,60 % 15.11.2032 .....	46.661	0,50
45.000	Cigna Group 3,05 % 15.10.2027 .....	9.392	0,10
10.000	Cisco Systems, Inc. 5,30 % 26.02.2054 .....	98.014	1,05
100.000	Citigroup, Inc. 3,67 % 24.07.2028 .....	200.238	2,14
210.000	Citigroup, Inc. 6,27 % 17.11.2033 .....	78.586	0,84
75.000	Comcast Corp. 4,65 % 15.02.2033 .....	120.736	1,29
125.000	Conagra Brands, Inc. 5,40 % 01.11.2048 .....	55.313	0,59
60.000	Constellation Energy Generation LLC 6,13 % 15.01.2034 .....	99.057	1,06
95.000	CSX Corp. 3,25 % 01.06.2027 .....	71.574	0,76
75.000	CVS Health Corp. 5,30 % 12.05.2043 .....	113.891	1,22
125.000	Dell International LLC/EMC Corp. 6,02 % 15.06.2026 .....	51.553	0,55
51.000	Dell International LLC/EMC Corp. 5,40 % 15.04.2034 .....	34.645	0,37
35.000	Dick's Sporting Goods, Inc. 4,10 % 15.01.2052 .....	35.290	0,38
50.000	Elevance Health, Inc. 4,10 % 03.01.2028 .....	125.673	1,34
130.000	Enterprise Products Operating LLC 4,80 % 02.01.2049 .....	71.002	0,76
80.000	Essex Portfolio LP 2,65 % 15.03.2032 .....	29.032	0,31
35.000	FedEx Corp. 4,75 % 15.11.2045 .....	69.056	0,74
80.000	Fiserv, Inc. 3,20 % 01.07.2026 .....	129.582	1,38
135.000	FMC Corp. 5,65 % 18.05.2033 .....	44.344	0,47
45.000	Ford-Stiftung 2,82 % 01.06.2070 .....	116.404	1,24
200.000	Freeport-McMoRan, Inc. 5,45 % 15.03.2043 .....	47.528	0,51
50.000	Gilead Sciences, Inc. 5,25 % 15.10.2033 .....	60.466	0,65
60.000	Global Payments, Inc. 5,95 % 15.08.2052 .....	67.512	0,72
70.000	Goldman Sachs Group, Inc. 2,64 % 24.02.2028 .....	111.949	1,20
120.000	Goldman Sachs Group, Inc. 3,10 % 24.02.2033 .....	76.894	0,82
90.000	Goldman Sachs Group, Inc. 4,48 % 23.08.2028 .....	39.102	0,42
40.000	Home Depot, Inc. 3,35 % 15.04.2050 .....	71.077	0,76
100.000	Ingersoll Rand, Inc. 5,18 % 15.06.2029 .....	60.018	0,64
60.000	Intuit, Inc. 5,50 % 15.09.2053 .....	35.191	0,38
35.000	IQVIA, Inc. 6,25 % 01.02.2029 .....	56.571	0,60
55.000	Jefferies Financial Group, Inc. 6,20 % 14.04.2034 .....	50.669	0,54
50.000	Kaiser Foundation Hospitals 2,81 % 01.06.2041 .....	75.963	0,81
105.000	Kraft Heinz Foods Co. 4,25 % 03.01.2031 .....	18.977	0,20
20.000	Lowe's Co., Inc. 5,63 % 15.04.2053 .....	48.450	0,52
50.000	LYB International Finance III LLC 5,63 % 15.05.2033 .....	75.942	0,81
75.000	McCormick & Co., Inc. 4,95 % 15.04.2033 .....	73.228	0,78
75.000	MetLife, Inc. 6,40 % 15.12.2036 .....	45.614	0,49
45.000	Morgan Stanley 3,59 % 22.07.2028 .....	209.259	2,24

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Halte-	Verwaltungs-	Beizulegender Zeitwert USD	% des Netto- vermögens
	<b>übertragbare Wertpapiere: 98,70 % (30. Juni 2023: 98,60 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>Unternehmensanleihen: 97,47 % (30. Juni 2023: 94,32 %) (Fortsetzung)</b>		
	<b>USA: 75,15 % (30. Juni 2023: 70,35 %) (Fortsetzung)</b>		
135.000	Morgan Stanley 5,25 % 21.04.2034	132.950	1,42
85.000	Motorola Solutions, Inc. 4,60 % 23.05.2029	82.858	0,89
25.000	Nasdaq, Inc. 5,55 % 15.02.2034	25.046	0,27
30.000	Netflix, Inc. 5,88 % 15.11.2028	30.918	0,33
60.000	Netflix, Inc. 4,88 % 15.06.2030	59.078	0,63
85.000	Northern Trust Corp. 4,00 % 10.05.2027	82.997	0,89
85.000	Otis Worldwide Corp. 2,57 % 15.02.2030	74.640	0,80
65.000	Owens Corning 5,70 % 15.06.2034	65.629	0,70
115.000	PepsiCo, Inc. 3,90 % 18.07.2032	107.403	1,15
90.000	PNC Financial Services Group, Inc. 5,30 % 21.01.2028	89.898	0,96
35.000	PNC Financial Services Group, Inc. 5,68 % 22.01.2035	35.202	0,38
120.000	Public Service Electric & Gas Co. 3,10 % 15.03.2032	104.783	1,12
60.000	Public Service Electric & Gas Co. 5,13 % 15.03.2053	56.964	0,61
50.000	Regal Rexnord Corp. 6,40 % 15.04.2033	51.189	0,55
95.000	Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 1,75 % 15.09.2030	78.273	0,84
100.000	RELX Capital, Inc. 3,00 % 22.05.2030	89.761	0,96
100.000	Roper Technologies, Inc. 1,75 % 15.02.2031	80.538	0,86
40.000	Salesforce, Inc. 2,70 % 15.07.2041	28.013	0,30
105.000	ServiceNow, Inc. 1,40 % 01.09.2030	85.284	0,91
65.000	Simon Property Group LP 3,38 % 12.01.2027	61.516	0,66
120.000	Southern California Gas Co. 6,35 % 15.11.2052	129.535	1,38
75.000	State Street Corp. 5,16 % 18.05.2034	74.152	0,79
55.000	Sysco Corp. 6,60 % 01.04.2050	61.283	0,65
70.000	Targa Resources Corp. 6,50 % 15.02.2053	73.606	0,79
55.000	Target Corp. 4,80 % 15.01.2053	49.892	0,53
110.000	Thermo Fisher Scientific, Inc. 1,22 % 18.10.2024	108.594	1,16
85.000	Thermo Fisher Scientific, Inc. 5,00 % 31.01.2029	85.213	0,91
155.000	T-Mobile USA, Inc. 3,38 % 15.04.2029	143.260	1,53
150.000	Toyota Motor Credit Corp. 2,15 % 13.02.2030	129.605	1,39
150.000	Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC 7,85 % 01.02.2026	154.397	1,65
50.000	Truist Financial Corp. 5,71 % 24.01.2035	49.804	0,53
80.000	Veralto Corp. 5,45 % 18.09.2033	79.886	0,85
240.000	Verizon Communications, Inc. 2,85 % 09.03.2041	168.263	1,80
45.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 4,70 % 15.09.2028	44.130	0,47
		<b>7.033.424</b>	<b>75,15</b>
	<b>Summe Unternehmensanleihen</b>	<b>9.122.357</b>	<b>97,47</b>
	<b>Staatsanleihe: 1,23 % (30. Juni 2023: 4,28 %)</b>		
	<b>USA: 1,23 % (30. Juni 2023: 4,28 %)</b>		
115.000	US-Schatzanweisungen mit variablem Zinssatz 5,55 % 31.01.2026	115.188	1,23
		<b>115.188</b>	<b>1,23</b>
	<b>Summe Staatsanleihe</b>	<b>115.188</b>	<b>1,23</b>
	<b>Summe übertragbare Wertpapiere</b>	<b>9.237.545</b>	<b>98,70</b>
		<b>Beizulegender Zeitwert USD</b>	<b>% des Netto- vermögens</b>
	<b>Anlagenportfolio</b>	<b>9.237.545</b>	<b>98,70</b>
	<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>121.441</b>	<b>1,30</b>
	<b>Nettovermögen</b>	<b>9.358.986</b>	<b>100,00</b>

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# ANLAGENPORTFOLIO ZUM 30. JUNI 2024 (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamtvermögens</b>
An einer offiziellen Börse notierte übertragbare Wertpapiere.....	98,67
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte .....	1,33
Gesamtvermögen .....	<u>100,00</u>

Die Länderklassifizierungen basieren auf dem Land der Unternehmensgründung und/oder dem Land des Firmensitzes.

Die Anhänge sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

# OFFENLEGUNG DER VERGÜTUNGEN (UNGEPRÜFT)

## Vergütungsrichtlinie

FTIS ist eine für die Verwaltung von OGAW-Fonds zugelassene Verwaltungsgesellschaft und unterliegt seit 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.

## Zweck und Anwendungsbereich der Erklärung zur Vergütungspolitik

Die Vergütungsrichtlinie von FTIS wurde so konzipiert, dass sie die persönlichen Ziele der Beschäftigten mit den langfristigen Interessen von FTIS und den von FTIS verwalteten OGAW und AIF in Einklang bringt. Sie soll Anreize verringern, die Arbeitnehmer dazu veranlassen könnten, unnötige Risiken einzugehen.

Die Richtlinie gilt für eine bestimmte Kategorie von Mitarbeitenden, die so genannten „identifizierten Mitarbeitenden“, zu denen die Mitglieder des Verwaltungsrats, die leitenden Angestellten, die Mitglieder der Kontrollfunktionen, die Risikoträger und alle Mitarbeitenden gehören, die laut Vergütung der gleichen Kategorie wie die leitenden Angestellten oder die Risikoträger angehören und deren Tätigkeiten sich wesentlich auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder der von ihr verwalteten OGAW auswirken.

## Beschreibung der Vergütungsstruktur

Die Vergütung umfasst eine feste und eine variable Komponente.

**Feste Vergütung:** Die feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt plus wesentliche vom Unternehmen bereitgestellte Leistungen. Möglich sind unter anderem Dienstwagen, Beiträge zur betrieblichen Altersversorgung und Prämien für private Kranken- und Lebensversicherungen.

Die Höhe des Grundgehalts (einschließlich Zusatzleistungen) wird auf der Grundlage von Marktvergleichsdaten (Externe Branchenerhebungen) festgelegt, die regelmäßig überprüft werden.

Der Anteil der Festgehälter an der Gesamtvergütung ist so hoch angesetzt, dass FTIS eine vollkommen flexible Bonuspolitik anwenden kann – auch mit der Möglichkeit, keinen Bonus zu zahlen.

**Variable Vergütung:** Die variable Vergütung ist definiert als jährliche Boni laut Annual Incentive Plan (AIP), Long Term Awards in Form von gewährten Performance-Anteilen und Umsatzbonuszahlungen. Die Höhe der Boni richtet sich nach dem Gesamtergebnis des Unternehmens und des Geschäftsbereichs sowie nach der individuellen Leistung bei FTIS.

## Vergütung

Franklin Templeton International Services S.à r.l. („FTIS“), eine für OGAW zugelassene Verwaltungsgesellschaft (die „Verwaltungsgesellschaft“), wendet eine Vergütungsrichtlinie (die „Richtlinie“) an, die für alle von ihr verwalteten OGAW-Fonds (jeweils ein „OGAW“ und gemeinsam die „OGAW“) gilt. Die Richtlinie ist darauf ausgerichtet, das Eingehen übermäßiger Risiken zu verhindern. Die entsprechenden Performance-Managementsysteme umfassen Risikokriterien, die für die hiervon abgedeckten Geschäftsbereiche spezifisch sind. Die Governance-Struktur der Richtlinie zielt darauf ab, interne Interessenkonflikte zu verhindern.

Es bestehen definierte Verfahren für die Erstellung, Aktualisierung, Überprüfung und Genehmigung der Richtlinie sowie für die Kommunikation und Umsetzung der Richtlinie. Sowohl die Geschäftsleitung als auch die Personalabteilung, die Compliance-Beauftragten und andere Abteilungen sind in dieses Verfahren eingebunden. Die Richtlinie wird von der Geschäftsführung und vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft genehmigt.

Die feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt zuzüglich sonstiger Leistungen, zu denen Pensionsbeiträge, Lebensversicherungsprämien oder Beiträge zur privaten Krankenversicherung zählen können. Die Höhe der festen Vergütung wird in Abhängigkeit von der Komplexität der Aufgabe, dem Grad der Verantwortung, der Leistung und den Marktvergleichsdaten festgelegt. Sie wird regelmäßig überprüft.

Die variable Vergütung ist definiert als jährliche Boni, langfristige Zusagen in Form von gewährten Performance-Anteilen oder Vertriebsbonuszahlungen. Die Höhe der variablen Vergütung richtet sich nach dem Gesamtergebnis des Unternehmens und des Geschäftsbereichs sowie nach der individuellen Leistung.

Die vollständige Richtlinie ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich. Die für Franklin Templeton Investment Services relevanten quantitativen Informationen sind nachfolgend aufgeführt.

Gesamtbetrag der festen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 gezahlt wurde*. **.***	EUR 547.734
Gesamtbetrag der variablen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 gezahlt wurde*. **.***	EUR 444.117
Anzahl der Mitarbeitenden von FTIS und seinen Beauftragten zum 30. September 2023	601
Gesamtbetrag der Vergütung, die FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 an die Geschäftsleitung gezahlt haben*. **.***	EUR 277.621
Von FTIS und seinen Beauftragten an andere Mitarbeitende, die während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 erheblichen Einfluss auf das OGAW-Profil hatten, gezahlter Gesamtbetrag*. **.***	EUR Null

\* Der Gesamtbetrag der von FTIS gezahlten Vergütung wurde jeder Gesellschaft auf der Grundlage ihres anteiligen Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen von FTIS am Monatsende für das am 30. September 2023 zu Ende gegangene Jahr zugewiesen.

\*\* Der Gesamtbetrag der von den Beauftragten von FTIS gezahlten Vergütung wurde jeder Gesellschaft auf der Grundlage ihres anteiligen Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen von den Beauftragten von FTIS am Monatsende für das am 30. September 2023 zu Ende gegangene Jahr zugewiesen.

\*\*\* Bei den Beauftragten handelt es sich um Anlageverwaltungsgesellschaften, die aufsichtsrechtlichen Anforderungen unterliegen, die ebenso wirksam sind wie die des Artikels 69(3)(a) der OGAW-Richtlinie.

Einzelheiten zur Vergütungspolitik sind auf der Website der Verwaltungsgesellschaft abrufbar:

<https://www.franklintempleton.lu/investor/our-approach/our-company/regulatory-information>

Eine Papierversion der FTIS-Vergütungspolitik ist auf Anfrage kostenlos in unserem Büro erhältlich.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT)

## Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Intel Corp. ....	4.855	181.098
CrowdStrike Holdings, Inc. ....	406	156.160
International Business Machines Corp. ....	830	140.536
Super Micro Computer, Inc. ....	157	120.515
NetEase, Inc. ....	6.200	116.474
Samsung Electronics Co. Ltd. ....	1.898	105.278
Accenture PLC ....	215	66.188
Adobe, Inc. ....	131	61.294
C3.ai, Inc. ....	1.929	60.397
Universal Display Corp. ....	240	42.906
SoundHound AI, Inc. ....	7.977	37.093
Perficient, Inc. ....	523	35.903
Five9, Inc. ....	785	34.454
Upstart Holdings, Inc. ....	1.411	34.316
CorVel Corp. ....	135	31.751
PKSHA Technology, Inc. ....	1.320	31.050
Block, Inc. ....	433	28.289
Mitek Systems, Inc. ....	2.406	27.452
nCino, Inc. ....	899	27.348
Ambarella, Inc. ....	453	27.130
Cerence, Inc. ....	8.402	26.970
Microsoft Corp. ....	66	26.717
Globant SA ....	143	25.916
Apple, Inc. ....	129	25.514
Canaan, Inc. ADR ....	23.762	25.425
UiPath, Inc. ....	2.106	24.872
BlackBerry Ltd. ....	8.913	24.590
PayPal Holdings, Inc. ....	409	24.057
fuboTV, Inc. ....	17.740	23.903
Innodata, Inc. ....	1.540	23.593
DigitalOcean Holdings, Inc. ....	595	22.295
Autodesk, Inc. ....	99	22.199
Consensus Cloud Solutions, Inc. ....	1.093	21.882
Cirrus Logic, Inc. ....	267	21.731
Verint Systems, Inc. ....	578	21.178

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
NVIDIA Corp. ....	1.397	182.747
PayPal Holdings, Inc. ....	1.915	124.031
Advanced Micro Devices, Inc. ....	834	112.097



# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin AI, Metaverse and Blockchain UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Coinbase Global, Inc. ....	626	103.632
Samsung Electronics Co. Ltd. ....	1.898	103.322
Electronic Arts, Inc. ....	748	102.299
Autodesk, Inc. ....	479	101.306
MicroStrategy, Inc. ....	101	93.122
Robinhood Markets, Inc. ....	3.463	80.409
Cleanspark, Inc. ....	5.179	75.825
Meta Platforms, Inc. ....	158	67.609
Marathon Digital Holdings, Inc. ....	3.181	56.941
NAVER Corp. ....	429	52.981
Terawulf, Inc. ....	11.919	41.417
Beyond, Inc. ....	2.206	39.974
fuboTV, Inc. ....	12.758	39.148
Snap, Inc. ....	2.442	38.464
AAC Technologies Holdings, Inc. ....	11.800	38.277
QUALCOMM, Inc. ....	189	36.888
Iris Energy Ltd. ....	2.730	33.715
Riot Platforms, Inc. ....	3.068	33.514
Cirrus Logic, Inc. ....	267	31.967
Galaxy Digital Holdings Ltd. ....	2.621	26.874
Namuga Co. Ltd. ....	2.662	26.175
Block, Inc. ....	400	25.667
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. ....	3.700	24.759
InterDigital, Inc. ....	187	21.704
Nordic Semiconductor ASA ....	1.608	21.197
Zhen Ding Technology Holding Ltd. ....	6.000	20.887

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Rumänien, internationale Staatsanleihe 5,25 % 30.05.2032 .....	2.000.000	2.160.669
Brasilien, internationale Staatsanleihe 2,88 % 6.6.2025 .....	300.000	287.535
Rumänien, internationale Staatsanleihe 2,88 % 28.10.2024 .....	200.000	214.701
Chile, internationale Staatsanleihe 1,63 % 30.1.2025 .....	200.000	212.777
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 1,13 % 7.8.2026 .....	200.000	203.871
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 2,75 % 25.5.2032 .....	200.000	201.216
Philippinische internationale Staatsanleihe 4,20 % 21.1.2024 .....	200.000	199.518
Dominikanische Republik, Internationale Staatsanleihe, 6,00 %, 19.7.2028 .....	200.000	191.400
Internationale Staatsanleihen der Republik Kenia 6,88 % 24.6.2024 .....	200.000	191.200
Rumänien, internationale Staatsanleihe 2,88 % 11.3.2029 .....	200.000	191.084
Philippinische internationale Staatsanleihen 3,00 % 2.1.2028 .....	200.000	184.228
Chile, internationale Staatsanleihen 0,56 % 21.1.2029 .....	200.000	183.848
Internationale Staatsanleihen der Republik Südafrika 5,88 % 22.6.2030 .....	200.000	181.700
Koreanische Staatsanleihen 2,50 % 19.6.2029 .....	200.000	177.938
Mongolische internationale Staatsanleihen 3,50 % 07.07.2027 .....	200.000	171.838
Internationale Anleihe der Regierung von Costa Rica, 5,63 % 30.4.2043.....	200.000	165.280
Panamesische Staatsanleihen 3,16 % 23.1.2030 .....	200.000	164.000
Chile, internationale Staatsanleihen 4,34 % 7.3.2042 .....	200.000	163.800
Chile, internationale Staatsanleihen 2,55 % 27.7.2033 .....	200.000	155.590
Philippinische internationale Staatsanleihen 1,65 % 6.10.2031 .....	200.000	154.660
Philippinische internationale Staatsanleihen 3,70 % 2.2.2042 .....	200.000	153.320
Internationale Anleihen der Republik Armenien 3,60 % 2.2.2031 .....	200.000	152.300
Brasilien, internationale Staatsanleihen 4,75 % 14.1.2050 .....	200.000	140.195
Panamesische internationale Staatsanleihen 2,25 % 29.9.2032 .....	200.000	138.700
Internationale Staatsanleihen der Republik Südafrika 5,75 % 30.9.2049 .....	200.000	138.200
Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 4,13 %, 22.2.2042 .....	200.000	126.700
Peru, internationale Staatsanleihen 2,78 % 23.1.2031 .....	150.000	123.975
Peru, internationale Staatsanleihen 3,60 % 15.1.2072 .....	200.000	121.680
Bulgarien, internationale Staatsanleihen 1,38 % 23.9.2050 .....	200.000	117.381
Ungarn, internationale Staatsanleihen 144A 3,13 % 21.9.2051 .....	200.000	115.486
Ungarn, internationale Staatsanleihen 3,13 % 21.9.2051 .....	200.000	115.460
Albanien, internationale Staatsanleihen 3,50 % 16.6.2027 .....	100.000	103.013
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 1,00 % 25.10.2028 .....	100.000	97.076
Chile, internationale Staatsanleihen 1,44 % 1.2.2029 .....	100.000	96.149
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 3,25 % 4.6.2026 .....	100.000	95.843
Montenegro, internationale Staatsanleihen 2,88 % 16.12.2027 .....	100.000	94.002
Bulgarien, internationale Staatsanleihen 3,13 % 26.3.2035 .....	100.000	93.178
Nordmazedonien, internationale Staatsanleihen 1,63 % 10.3.2028 .....	100.000	90.509
Internationale Staatsanleihen der uruguayischen Regierung 4,98 % 20.4.2055 .....	100.000	88.250

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Rumänien, internationale Staatsanleihe 2,88 % 28.10.2024 .....	2.300.000	2.494.192
Chile, internationale Staatsanleihe 1,63 % 30.1.2025 .....	1.300.000	1.375.585
Chile, internationale Staatsanleihen 2,55 % 27.7.2033 .....	880.000	708.884
Brasilien, internationale Staatsanleihe 2,88 % 6.6.2025 .....	600.000	579.960
Peru, internationale Staatsanleihen 2,78 % 23.1.2031 .....	600.000	510.000
Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 7,38 %, 18.9.2037 .....	500.000	490.560
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 3,25 % 4.6.2026 .....	500.000	487.565
Rumänien, internationale Staatsanleihe 4,63 % 3.4.2049 .....	500.000	455.729
Internationale Staatsanleihen der Regierung Paraguays 6,10 % 8.11.2044 .....	430.000	410.650
Chile, internationale Staatsanleihen 0,56 % 21.1.2029 .....	400.000	375.871
Internationale Staatsanleihen der Republik Südafrika 5,88 % 22.6.2030 .....	400.000	370.000
Philippinische internationale Staatsanleihen 3,70 % 2.2.2042 .....	450.000	364.774
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 1,13 % 7.8.2026 .....	300.000	311.687
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 2,75 % 25.5.2032 .....	300.000	307.536
Internationale Staatsanleihen der Republik Polen 1,00 % 25.10.2028 .....	300.000	299.481
Dominikanische Republik, Internationale Staatsanleihe, 6,00 %, 19.7.2028 .....	300.000	299.250
Rumänien, internationale Staatsanleihe 2,88 % 11.3.2029 .....	300.000	297.861
Brasilien, internationale Staatsanleihen 4,75 % 14.1.2050 .....	400.000	296.200
Philippinische internationale Staatsanleihen 3,00 % 2.1.2028 .....	300.000	278.295
Israel, internationale Staatsanleihen 2,75 % 3.7.2030 .....	250.000	213.750
Dominikanische Republik, internationale Staatsanleihen, 5,88 %, 30.1.2060 .....	250.000	210.652
Panamesische internationale Staatsanleihen 2,25 % 29.9.2032 .....	300.000	210.117
Chile, internationale Staatsanleihen 4,34 % 7.3.2042 .....	230.000	198.375
Peru, internationale Staatsanleihen 3,60 % 15.1.2072 .....	300.000	196.899
Chile, internationale Staatsanleihen 1,44 % 1.2.2029 .....	200.000	196.177
Serbien, internationale Staatsanleihen 1,50 % 26.6.2029 .....	200.000	182.515
Koreanische Staatsanleihen 2,50 % 19.6.2029 .....	200.000	180.644
Philippinische internationale Staatsanleihe 1,20 % 28.4.2033 .....	200.000	172.699
Ungarn, internationale Staatsanleihen 3,13 % 21.9.2051 .....	270.000	167.805
Philippinische internationale Staatsanleihen 1,65 % 6.10.2031 .....	200.000	158.862
Internationale Staatsanleihen der Regierung Paraguays 5,00 % 15.4.2026 .....	150.000	148.440
Israel, internationale Staatsanleihen 3,88 % 3.7.2050 .....	200.000	146.760
Panamesische Staatsanleihen 3,87 % 23.7.2060 .....	250.000	139.820

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Quanta Computer, Inc. ....	51.200	434.169
OTP Bank Nyrt .....	6.458	284.485
Emirates NBD Bank PJSC .....	54.117	248.716
WEG SA .....	33.600	240.083
Dr Reddy's Laboratories Ltd. ....	3.381	235.697
ASE Technology Holding Co. Ltd. ....	51.900	227.641
Hyundai Mobis Co. Ltd. ....	1.232	191.373
Adani Power Ltd. ....	25.830	179.044
Bharat Petroleum Corp. Ltd. ....	26.546	170.708
Accton Technology Corp. ....	10.220	169.552
Ambev SA ADR .....	66.400	150.419
Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co. ....	2.627	148.948
Nongfu Spring Co. Ltd. ....	26.600	146.315
HDFC Asset Management Co. Ltd. ....	3.517	145.100
Saudi Telecom Co. ....	14.216	142.087
PRIO SA .....	16.100	138.878
Vale SA ADR .....	11.437	137.071
Telkom Indonesia Persero Tbk. PT .....	658.000	134.616
Wiwynn Corp. ....	2.110	133.959
Saudi Arabian Oil Co. ....	17.030	133.623

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
POSCO Holdings, Inc. ....	1.440	537.887
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	145.600	392.459
Samsung Electronics Co. Ltd. ....	6.748	360.444
Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd. ....	46.760	298.205
Asustek Computer, Inc. ....	23.040	289.259
Tata Steel Ltd. ....	178.080	272.852
Anglogold Ashanti PLC .....	13.952	268.182
Largan Precision Co. Ltd. ....	3.616	255.231
Formosa Plastics Corp. ....	96.000	247.490
Nan Ya Plastics Corp. ....	112.160	243.704
Lenovo Group Ltd. ....	184.000	227.092
Wistron Corp. ....	64.000	221.620
MediaTek, Inc. ....	6.040	193.245
Yang Ming Marine Transport Corp. ....	87.584	189.341
Impala Platinum Holdings Ltd. ....	38.102	189.047
Aldar Properties PJSC .....	126.720	188.657
KB Financial Group, Inc. ....	3.727	180.644
China Overseas Land & Investment Ltd. ....	96.000	177.296

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Taiwan Mobile Co. Ltd. ....	53.880	174.456
Southern Copper Corp. ....	2.288	164.575
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	7.150	163.461
Micro-Star International Co. Ltd. ....	26.000	153.280
PetroChina Co. Ltd. 'H' Shares ....	154.000	143.398
HMM Co. Ltd. ....	10.384	135.390

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF\*

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
Commerzbank AG 5,13 % 18.1.2030 .....	200.000	208.359
Ceska sporitelna AS 5,74 % 08.03.2028 .....	200.000	206.836
Ibercaja Banco SA 4,38 % 30.7.2028 .....	200.000	200.740
Leasys SpA 4,50 % 26.07.2026 .....	200.000	200.713
Novo Nordisk Finance Netherlands BV 3,25 % 21.01.2031 .....	200.000	198.812
Barry Callebaut Services NV 4,00 % 14.6.2029 .....	200.000	198.790
Engie SA 3,88 % 06.03.2036 .....	200.000	198.213
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3,50 % 15.5.2031 .....	200.000	197.602
Mercedes-Benz International Finance BV 3,25 % 15.11.2030 .....	200.000	197.330
Netflix, Inc. 3,63 % 15.06.2030 .....	200.000	195.835
Medtronic Global Holdings SCA 3,00 % 15.10.2028 .....	200.000	194.596
Arkema SA 3,50 % 23.01.2031 .....	200.000	192.889
Compass Group Finance Netherlands BV 3,00 % 08.3.2030 .....	200.000	192.713
Assicurazioni Generali SpA 5,27 % 12.09.2033 .....	200.000	191.690
de Volksbank NV 1,75 % 22.10.2030 .....	200.000	188.266
Unicaja Banco SA 1,00 % 01.12.2026 .....	200.000	187.348
Visa, Inc. 2,00 % 15.06.2029 .....	200.000	185.366
Logicor Financing SARL 1,50 % 13.07.2026 .....	200.000	184.140
RCI Banque SA 4,63 % 02.10.2026 .....	180.000	181.648
Barclays PLC 0,58 % 09.08.2029 .....	200.000	173.896
Coca-Cola Europacific Partners PLC 0,20 % 02.12.2028 .....	200.000	169.558
Heathrow Funding Ltd. 1,13 % 08.10.2030 .....	200.000	169.008
UBS AG 0,50 % 31.03.2031 .....	200.000	161.220
Prologis Euro Finance LLC 0,63 % 10.09.2031 .....	200.000	160.247

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Assicurazioni Generali SpA 5,27 % 12.09.2033 .....	200.000	201.800
Intesa Sanpaolo SpA 4,88 % 19.05.2030 .....	100.000	105.960
Commerzbank AG 5,25 % 25.03.2029 .....	100.000	104.756
Banco Santander SA 4,88 % 18.10.2031 .....	100.000	104.590
Aena SME SA 4,25 % 13.10.2030 .....	100.000	104.368
DS Smith PLC 4,50 % 27.07.2030 .....	100.000	104.200
Robert Bosch GmbH 4,00 % 06.02.2035 .....	100.000	102.558
Prologis Euro Finance LLC 3,88 % 31.01.2030 .....	100.000	102.500
Linde PLC 3,63 % 06.12.2034 .....	100.000	102.065
La Poste SA 3,75 % 12.06.2030 .....	100.000	101.641
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 4,13 % 18.01.2027 .....	100.000	101.535
Vestas Wind Systems AS 4,13 % 15.06.2031 .....	100.000	101.500
Veralto Corp. 4,15 % 19.09.2031 .....	100.000	101.471

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Carrier Global Corp. 4,50 % 29.11.2032 .....	100.000	101.269
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 3,50 % 07.12.2031 .....	100.000	100.665
Tele2 AB 3,75 % 22.11.2029 .....	100.000	100.652
Elia Transmission Belgium SA 3,63 % 18.01.2033 .....	100.000	100.598
Abertis Infraestructuras SA 4,13 % 31.01.2028 .....	100.000	100.449
Sage Group PLC 3,82 % 15.02.2028 .....	100.000	100.350
Orange SA 4,50 % Perpetual 31.12.2099 .....	100.000	100.236
Credit Agricole SA 3,75 % 22.01.2034 .....	100.000	99.970
U.S. Bancorp 4,01 % 21.05.2032 .....	100.000	98.995
Koninklijke KPN NV 3,88 % 16.02.2036 .....	100.000	98.928
Compass Group Finance Netherlands BV 3,00 % 08.3.2030 .....	100.000	98.050
Teleperformance SE 3,75 % 24.06.2029 .....	100.000	97.710
Segro Capital SARL 1,25 % 23.03.2026 .....	100.000	95.430
Unicaja Banco SA 1,00 % 01.12.2026 .....	100.000	94.531
Telia Co. AB 1,38 % 11.05.2081 .....	100.000	94.331
Vodafone Group PLC 0,90 % 24.11.2026 .....	100.000	94.146
Swedbank AB 0,30 % 20.05.2027 .....	100.000	93.651
Banco Santander SA 0,50 % 24.03.2027 .....	100.000	91.522
Anheuser-Busch InBev SA 1,50 % 18.04.2030 .....	100.000	91.386
Verizon Communications, Inc. 1,25 % 04.08.2030 .....	100.000	88.157
Experian Europe DAC 1,56 % 16.05.2031 .....	100.000	87.837
Societe Generale SA 0,50 % 06.12.2029 .....	100.000	87.568
Johnson & Johnson 1,65 % 20.05.2035 .....	100.000	86.602
Power Finance Corp. Ltd. 1,84 % 21.09.2028 .....	100.000	85.560
Münchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in München 1,25 % 26.05.2041 .....	100.000	83.429
HSBC Holdings PLC 0,77 % 13.11.2031 .....	100.000	82.995
Mercedes-Benz Finance Canada, Inc. 3,00 % 23.02.2027 .....	75.000	74.368

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 29.08.2024 .....	55.000.000	54.453.019
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 23.05.2024 .....	53.000.000	52.532.010
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 29.02.2024 .....	50.000.000	49.528.000
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 20.11.2023 .....	40.000.000	39.672.913
Königreich Belgien, Schatzwechsel 0,00 % 09.01.2025 .....	30.000.000	29.238.729
Europäische Union 0,00 % 04.11.2025 .....	29.000.000	27.161.230
Dänemark, Internationale Anleihen 2,50 %, 18.11.2024 .....	25.000.000	24.726.750
Bundesobligation 0,00 % 10.10.2025 .....	20.000.000	18.982.000
Europäische Union, Schatzwechsel 0,00 % 08.12.2023 .....	10.000.000	9.966.600
Deutschland, Schatzwechsel 0,00 % 22.11.2023 .....	10.000.000	9.878.034
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0,00 % 04.12.2024 .....	10.000.000	9.873.950
Deutschland, Schatzwechsel 0,00 % 15.5.2024 .....	10.000.000	9.705.126
Mercedes-Benz International Finance BV 4,11 % 01.12.2025 .....	5.000.000	5.000.000
Deutschland, Schatzwechsel 0,00 % 23.8.2023 .....	5.000.000	4.984.465
Frankreich, Schatzwechsel mit Abschlag 0,00 % 10.4.2024 .....	5.000.000	4.970.687
Toyota Motor Finance BV 0,00 % 28.02.2024 .....	4.500.000	4.443.713
NatWest Markets PLC 4,49 % 09.01.2026 .....	4.200.000	4.200.000
Nestle Finance International Ltd. 0,00 % 14.08.2024 .....	4.000.000	3.980.337
Deutsche Bank AG 0,00 % 15.07.2024 .....	4.000.000	3.961.656
Frankreich, Schatzwechsel BTF 0,00 % 30.10.2024 .....	4.000.000	3.922.783

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Deutschland, Schatzwechsel 0,00 % 22.11.2023 .....	44.000.000	43.630.875
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 24.8.2023 .....	40.000.000	39.967.425
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,00 % 29.11.2023 .....	14.000.000	13.885.190
Dänemark, Internationale Anleihen 2,50 %, 18.11.2024 .....	13.500.000	13.346.096
Bundesobligation 0,00 % 10.10.2025 .....	9.200.000	8.684.336
Deutschland, Schatzwechsel 0,00 % 15.5.2024 .....	8.500.000	8.313.452
Toronto-Dominion Bank 4,44 % 20.01.2025 .....	5.000.000	5.013.971
Heineken NV 3,88 % 23.09.2024 .....	5.000.000	4.993.565
UBS Group AG 1,00 % 21.03.2025 .....	4.000.000	3.985.629
Europäische Union 0,00 % 04.11.2025 .....	4.000.000	3.758.573
Schneider Electric SE 3,38 % 06.04.2025 .....	2.900.000	2.882.770
ABN AMRO Bank NV 3,75 % 20.04.2025 .....	2.500.000	2.491.470
Linde PLC 3,63 % 06.12.2025 .....	2.000.000	2.000.505
Volvo Treasury AB 2,13 % 01.09.2024 .....	2.000.000	1.961.260
Europäische Union, Schatzwechsel 0,00 % 08.12.2023 .....	1.800.000	1.787.622
ATF Netherlands BV 7,08 % 29.12.2049 .....	2.400.000	1.672.800
Litauen, internationale Anleihen 3,38 %, 22.1.2024 .....	1.600.000	1.596.281
Rumänien, internationale Staatsanleihe 2,88 % 28.10.2024 .....	1.600.000	1.576.646



# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Instituto de Credito Oficial 1,30 % 31.10.2026 .....	1.600.000	1.504.372
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,25 % 30.6.2025 .....	1.300.000	1.235.245

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF\*

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
Kuehne & Nagel International AG .....	3	849
UniCredit SpA .....	34	763
Novartis AG .....	8	749
GSK PLC .....	45	741
Bayerische Motoren Werke AG (preferred stock) .....	6	597
Sanofi SA .....	6	594
DHL Group .....	12	521
BNP Paribas SA .....	9	512
Shell PLC .....	18	509
Erste Group Bank AG .....	15	488
Next PLC .....	6	480
TotalEnergies SE .....	9	479
Eni SpA .....	33	472
Orange SA .....	45	468
Barratt Developments PLC .....	87	463
Norsk Hydro ASA .....	90	461
Endesa SA .....	24	461
Commerzbank AG .....	45	457
Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	15	453
Imperial Brands PLC .....	21	450
Atlas Copco AB 'A' Shares .....	36	439
RELX PLC .....	15	438
Boliden AB .....	15	432
Repsol SA .....	33	427
Unilever PLC .....	8	376
Rio Tinto PLC .....	6	345
Assicurazioni Generali SpA .....	16	313
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA .....	42	310
HSBC Holdings PLC .....	42	310
Anglo American PLC .....	12	306
Equinor ASA .....	10	304
Banco Santander SA .....	88	303
Glencore PLC .....	58	301
British American Tobacco PLC .....	10	291
Pandora AS .....	3	287
Stellantis NV .....	16	285
Tenaris SA .....	18	259
Wacker Chemie AG .....	2	251

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
UniCredit SpA .....	5.095	121.311
Stellantis NV .....	6.496	120.841
Equinor ASA .....	3.895	119.060
Novo Nordisk AS .....	1.296	115.568
RELX PLC .....	3.471	114.822
Ferrari NV .....	363	112.802
Banco Santander SA .....	31.321	112.798
Industria de Diseno Textil SA .....	3.186	112.449
TotalEnergies SE .....	1.785	112.009
Shell PLC .....	3.609	109.080
Rio Tinto PLC .....	1.761	108.638
Glencore PLC .....	19.987	106.740
HSBC Holdings PLC .....	14.241	101.808
GSK PLC .....	6.114	100.534
BAE Systems PLC .....	8.106	99.286
Wolters Kluwer NV .....	807	97.131
British American Tobacco PLC .....	3.265	97.095
BNP Paribas SA .....	1.674	97.003
Novartis AG .....	1.079	96.936
Hermes International SCA .....	50	95.179
Anglo American PLC .....	3.702	94.851
DHL Group .....	2.373	94.773
ASML Holding NV .....	155	93.510
Unilever PLC .....	2.039	92.741
Eni SpA .....	6.003	91.401
Sanofi SA .....	987	88.628
Partners Group Holding AG .....	78	88.062
Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	3.171	87.779
Mercedes-Benz Group AG .....	1.404	86.210
Roche Holding AG .....	324	82.312
Bayerische Motoren Werke AG .....	819	79.100
Imperial Brands PLC .....	3.753	77.581
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA .....	9.750	77.222
Repsol SA .....	5.262	75.971
Atlas Copco AB 'A' Shares .....	4.791	64.066
Assicurazioni Generali SpA .....	3.106	61.323
Kuehne & Nagel International AG .....	225	59.558
Orange SA .....	5.385	59.228
Geberit AG .....	120	58.084

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Equity UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Volkswagen AG (Vorzugspapier) .....	468	51.406

\*Der Teilfonds wurde in der Rechnungsperiode zum 30. Juni 2023 aufgelöst. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Quality Dividend UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
Equinor ASA .....	73.218	1.944.446
Novartis AG .....	20.348	1.937.891
Elisa OYJ .....	34.801	1.454.439
Swisscom AG .....	2.594	1.380.299
Tryg AS .....	67.512	1.305.036
Orion OYJ .....	35.473	1.298.624
Sanofi SA .....	14.487	1.273.309
Intermediate Capital Group PLC .....	42.484	1.155.762
Snam SpA .....	245.423	1.121.525
TotalEnergies SE .....	17.313	1.083.554
Yara International ASA .....	35.083	1.072.421
Hannover Rueck SE .....	4.835	1.060.345
Gaztransport Et Technigaz SA .....	8.467	1.054.405
Zurich Insurance Group AG .....	2.266	1.041.561
Allianz SE .....	4.379	1.037.476
BAE Systems PLC .....	81.584	1.037.408
Rio Tinto PLC .....	16.327	1.026.809
Bankinter SA .....	149.142	1.023.085
Admiral Group PLC .....	32.805	1.018.210
UPM-Kymmene OYJ .....	31.380	1.013.696
Koninklijke KPN NV .....	315.541	1.011.567
Iberdrola SA .....	87.973	1.002.618
GSK PLC .....	58.996	1.000.269
Imperial Brands PLC .....	46.730	1.000.207
Assicurazioni Generali SpA .....	49.872	978.336
Anglo American PLC .....	38.449	945.319
Swiss Prime Site AG .....	10.245	932.253
Telenor ASA .....	92.063	920.817
Redeia Corp. SA .....	59.716	918.838
Endesa SA .....	46.383	882.026
Kesko OYJ .....	51.126	879.679
Poste Italiane SpA .....	68.424	862.056
BE Semiconductor Industries NV .....	6.875	841.240
Azimut Holding SpA .....	36.144	831.479
IG Group Holdings PLC .....	98.699	812.925
AP Moller - Maersk AS Klasse „B“ .....	511	752.293
Helvetia Holding AG .....	5.545	685.924
Telecom Plus PLC .....	34.446	663.821
Tele2 AB .....	85.288	659.947
Axfood AB .....	25.522	593.498
Freenet AG .....	22.420	559.633

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin European Quality Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
MONY Group PLC .....	174.342	532.790
Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
GSK PLC .....	146.054	2.969.780
BE Semiconductor Industries NV .....	22.227	2.847.236
Admiral Group PLC .....	85.397	2.668.066
Anglo American PLC .....	91.193	2.485.119
Orion OYJ .....	35.473	1.373.367
Axfood AB .....	55.010	1.349.292
BAE Systems PLC .....	88.971	1.284.418
Allianz SE .....	3.914	958.799
Telenor ASA .....	89.766	918.696
Assicurazioni Generali SpA .....	43.106	913.816
Gaztransport Et Technigaz SA .....	7.101	897.775
Hannover Rueck SE .....	3.671	833.279
TotalEnergies SE .....	13.774	827.623
Rio Tinto PLC .....	13.169	826.307
UPM-Kymmene OYJ .....	26.290	792.533
Zurich Insurance Group AG .....	1.497	695.189
Imperial Brands PLC .....	31.668	689.154
Iberdrola SA .....	61.235	661.908
IG Group Holdings PLC .....	79.942	634.590
Koninklijke KPN NV .....	194.802	632.359
Sanofi SA .....	7.162	622.061
Swisscom AG .....	1.165	621.565
Elisa OYJ .....	14.684	611.499
Snam SpA .....	135.675	590.675
Swiss Prime Site AG .....	6.182	567.002
Endesa SA .....	30.213	533.990
Redeia Corp. SA .....	35.954	528.695
Tryg AS .....	27.090	519.558
Azimut Holding SpA .....	18.782	478.635
Kesko OYJ .....	25.294	446.953
Bankinter SA .....	74.273	420.346
Yara International ASA .....	13.074	398.059
Europris ASA .....	62.536	387.595
AP Moller - Maersk AS Klasse „B“ .....	244	380.724
BW LPG Ltd. ....	22.143	380.309

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	252.110	6.170.842
Samsung Electronics Co. Ltd. ....	48.807	2.825.359
Reliance Industries Ltd. ....	36.974	1.225.899
HDFC Bank Ltd. ....	61.047	1.085.897
AIA Group Ltd. ....	126.400	1.065.458
SK Hynix, Inc. ....	5.931	782.168
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. ....	131.700	625.346
DBS Group Holdings Ltd. ....	21.400	556.159
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd. ....	14.050	525.781
Infosys Ltd. ....	30.291	521.912
MediaTek, Inc. ....	12.900	471.249
ICICI Bank Ltd. ....	34.461	457.825
Bharti Airtel Ltd. ....	28.544	440.130
Tata Consultancy Services Ltd. ....	9.204	421.763
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. ....	38.900	404.877
Samsung Electronics Co. Ltd. (Vorzugsaktien) ....	8.441	398.137
Axis Bank Ltd. ....	25.270	341.029
Larsen & Toubro Ltd. ....	7.504	303.339
Mahindra & Mahindra Ltd. ....	10.592	297.562
United Overseas Bank Ltd. ....	13.500	297.047

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Kweichow Moutai Co. Ltd. ....	775	194.266
POSCO Holdings, Inc. ....	508	189.471
Bank of China Ltd. Klasse „H“ ....	506.000	185.735
China Construction Bank Corp. Klasse "H" ....	318.000	183.834
MediaTek, Inc. ....	6.010	181.734
PetroChina Co. Ltd. 'H' Shares ....	264.000	173.214
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Klasse "H" ....	358.000	171.244
United Microelectronics Corp. ....	101.000	159.529
China Shenhua Energy Co. Ltd. Klasse „H“ ....	48.500	158.487
ITC Ltd. ....	28.414	148.204
China Petroleum & Chemical Corp. Klasse „H“ ....	284.000	146.018
KB Financial Group, Inc. ....	3.301	141.671
Tata Consultancy Services Ltd. ....	3.306	139.339
Bank Central Asia Tbk. PT ....	228.400	132.292
Agricultural Bank of China Ltd. Klasse "H" ....	328.000	121.236
HCL Technologies Ltd. ....	7.540	121.049
Novatek Microelectronics Corp. ....	6.660	108.710
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT ....	313.200	106.563

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Asia ex China ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Telkom Indonesia Persero Tbk. PT .....	434.800	105.219
Nongfu Spring Co. Ltd. ....	18.000	102.676
Chunghwa Telecom Co. Ltd. ....	26.650	101.634
Infosys Ltd. ....	5.744	100.631
Kia Corp. ....	1.490	99.530
Shinhan Financial Group Co. Ltd. ....	3.488	99.513
Hana Financial Group, Inc. ....	2.900	94.675
Sun Hung Kai Properties Ltd. ....	9.500	93.131



# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Vale SA ADR .....	89.689	1.187.368
Petroleo Brasileiro SAADR (Vorzugsaktien) .....	62.914	885.620
Itau Unibanco Holding SA ADR .....	110.126	681.824
Petroleo Brasileiro SAADR .....	40.892	606.265
Banco Bradesco SAADR .....	117.239	352.751
Itausa SA .....	167.700	338.301
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	123.600	326.957
Banco BTG Pactual SA .....	42.400	290.761
WEG SA .....	35.100	265.140
Ambev SA ADR .....	99.407	260.932
Centrais Eletricas Brasileiras SA .....	30.800	234.437
Localiza Rent a Car SA 'A' Shares .....	19.548	226.814
Banco do Brasil SA .....	27.500	219.326
Aliansce Sonae Einkaufszentrum .....	39.200	189.716
Suzano SA .....	16.900	175.486
Equatorial Energia SA Stammscheine .....	22.954	147.986
PRIIO SA .....	16.300	145.152
Raia Drogasil SA .....	25.600	140.271
JBS SA ADR .....	12.859	125.360
Rumo SA .....	28.200	125.261
BRF SA .....	56.200	120.494
Gerdau SA .....	27.220	120.417
Rede D'Or Sao Luiz SA .....	19.400	114.298
Vibra Energia SA .....	25.700	106.670
BB Seguridade Participacoes SA .....	16.300	105.382

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Vale SA ADR .....	70.020	870.264
Petroleo Brasileiro SAADR (Vorzugsaktien) .....	48.237	714.169
Itau Unibanco Holding SA ADR .....	83.021	508.760
Petroleo Brasileiro SAADR .....	30.908	478.912
Itausa SA .....	150.667	292.922
Banco Bradesco SAADR .....	90.095	250.215
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	106.700	243.939
WEG SA .....	27.300	193.221
Ambev SA ADR .....	76.618	183.666
Centrais Eletricas Brasileiras SA .....	24.300	181.867
Banco BTG Pactual SA .....	26.800	174.451
Eneva SA .....	67.400	169.605
Banco do Brasil SA .....	21.000	166.467

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
BRF SA .....	62.700	161.607
Localiza Rent a Car SA 'A' Shares .....	15.600	159.737
Suzano SA .....	13.600	156.780
PRIO SA .....	12.400	118.574
Raia Drogasil SA .....	20.400	104.658
EDP - Energias do Brasil SA .....	20.800	102.185
Equatorial Energia SA Stammscheine .....	16.200	101.277
Rumo SA .....	23.000	98.702
Vibra Energia SA .....	20.500	93.233
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP .....	6.200	92.149
Gerdau SA .....	19.900	86.358

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Tencent Holdings Ltd. ....	1.021.400	41.078.783
Alibaba Group Holding Ltd. ....	2.775.142	26.481.971
PDD Holdings, Inc. ADR ....	144.352	18.448.700
Meituan ....	871.933	10.376.118
China Construction Bank Corp. Klasse "H" ....	15.285.000	9.958.669
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Klasse "H" ....	12.860.000	6.897.547
NetEase, Inc. ....	294.745	6.183.189
Bank of China Ltd. Klasse „H“ ....	14.583.000	6.175.886
JD.com, Inc. ....	388.850	5.220.940
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Klasse „H“ ....	1.027.950	4.899.159
Baidu, Inc. ....	365.750	4.847.347
Xiaomi Corp. ....	2.387.200	4.657.750
BYD Co. Ltd. Klasse „H“ ....	161.040	4.143.649
Trip.com Group Ltd. ....	86.650	4.063.022
Kweichow Moutai Co. Ltd. ....	13.000	3.069.747
Kuaishou Technologie ....	469.000	2.983.465
Li Auto, Inc. ....	180.640	2.944.207
NIO, Inc. ....	378.300	2.902.605
PetroChina Co. Ltd. 'H' Shares ....	3.388.000	2.852.634
Yum China Holdings, Inc. ....	63.550	2.574.791

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Tencent Holdings Ltd. ....	187.600	7.887.033
Alibaba Group Holding Ltd. ....	565.002	5.474.721
Meituan ....	171.929	2.356.351
PDD Holdings, Inc. ADR ....	17.107	2.282.127
China Construction Bank Corp. Klasse "H" ....	3.029.000	1.993.854
NIO, Inc. ADR ....	153.754	1.631.148
ZTO Express Cayman, Inc. ....	53.100	1.377.566
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Klasse "H" ....	2.495.000	1.311.767
NetEase, Inc. ....	66.045	1.261.732
Bank of China Ltd. Klasse „H“ ....	2.624.000	1.126.463
BYD Co. Ltd. Klasse „H“ ....	35.328	1.047.362
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Klasse „H“ ....	212.450	1.042.482
JD.com, Inc. ....	73.000	1.016.596
Xiaomi Corp. ....	445.400	921.472
Baidu, Inc. ....	72.350	918.323
China Mengniu Dairy Co. Ltd. ....	344.000	798.693
Trip.com Group Ltd. ....	18.100	786.561
Yum China Holdings, Inc. ....	14.500	604.362

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
China Petroleum & Chemical Corp. Klasse „H“ .....	900.000	513.852
China Shenhua Energy Co. Ltd. Klasse „H“ .....	125.200	490.901

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Developed World UCITS ETF\*

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Microsoft Corp. ....	832	372.476
Apple, Inc. ....	1.626	338.449
NVIDIA Corp. ....	2.661	314.303
Amazon.com, Inc. ....	1.041	193.186
Meta Platforms, Inc. ....	245	122.238
Alphabet, Inc. Klasse „A“ ....	659	118.111
Alphabet, Inc. ....	552	99.800
Eli Lilly & Co. ....	95	84.564
Berkshire Hathaway, Inc. ....	204	84.455
Broadcom, Inc. ....	51	81.206
JPMorgan Chase & Co. ....	321	63.843
Exxon Mobil Corp. ....	503	57.369
Tesla, Inc. ....	312	56.967
UnitedHealth Group, Inc. ....	103	50.470
Visa, Inc. ....	177	48.907
Novo Nordisk AS ....	343	48.771
ASML Holding NV ....	44	44.782
Procter & Gamble Co. ....	264	44.473
Mastercard, Inc. ....	93	42.499
Costco Wholesale Corp. ....	50	42.410

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

In dem am 30. Juni 2024 endenden Geschäftsjahr gab es keine Verkaufstransaktionen.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
HDFC Bank Ltd. ....	2.375.117	43.734.559
Reliance Industries Ltd. ....	1.054.520	35.721.217
Infosys Ltd. ....	1.110.905	20.389.635
ICICI Bank Ltd. ....	1.362.511	18.002.309
Tata Consultancy Services Ltd. ....	340.905	15.832.672
Bharti Airtel Ltd. ....	918.637	13.476.921
Axis Bank Ltd. ....	725.803	9.437.304
Larsen & Toubro Ltd. ....	232.639	9.394.148
Hindustan Unilever Ltd. ....	280.963	8.072.113
Mahindra & Mahindra Ltd. ....	314.564	7.676.985
Bajaj Finance Ltd. ....	80.356	6.716.502
Tata Motors Ltd. ....	584.483	6.297.997
Maruti Suzuki Indien Ltd. ....	45.214	6.282.646
Sun Pharmaceutical Industries Ltd. ....	344.873	5.974.649
HCL Technologies Ltd. ....	335.406	5.862.535
NTPC Ltd. ....	1.500.084	5.817.089
Titan Co. Ltd. ....	130.523	5.448.777
Kotak Mahindra Bank Ltd. ....	247.681	5.224.000
Asian Paints Ltd. ....	144.639	5.161.266
State Bank of India ....	567.235	4.958.698

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Reliance Industries Ltd. ....	39.596	1.247.982
Adani Enterprises Ltd. ....	20.558	770.714
Tata Consultancy Services Ltd. ....	13.348	611.242
HDFC Bank Ltd. ....	27.924	566.485
Infosys Ltd. ....	30.804	558.846
Tata Power Co. Ltd. ....	108.074	540.324
Grasim Industries Ltd. ....	19.017	540.115
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. ....	34.464	441.977
Larsen & Toubro Ltd. ....	10.874	438.904
Tube Investments of India Ltd. ....	6.702	312.008
Axis Bank Ltd. ....	20.758	271.059
Bharti Airtel Ltd. ....	20.940	251.576
Hindustan Unilever Ltd. ....	8.156	250.812
Jio Financial Services Ltd. ....	87.160	250.432
Titan Co. Ltd. ....	5.460	229.547
Max Healthcare Institute Ltd. ....	30.153	218.916
Tata Motors Ltd. Klasse "A" ....	27.642	204.944
Bajaj Finance Ltd. ....	2.187	200.528

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Vedanta Ltd. ....	67.956	195.982
Wipro Ltd. ....	34.735	183.886
ICICI Bank Ltd. ....	14.315	169.748
InterGlobe Aviation Ltd. ....	5.421	165.869
PB Fintech Ltd. ....	17.564	162.293
Maruti Suzuki Indien Ltd. ....	1.317	161.523
Asian Paints Ltd. ....	4.020	160.936
HCL Technologies Ltd. ....	9.647	159.005

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Samsung Electronics Co. Ltd. ....	1.838.128	104.072.118
SK Hynix, Inc. ....	238.496	31.678.354
Samsung Electronics Co. Ltd. (Vorzugsaktien) ....	315.342	14.832.677
Ecopro Co. Ltd. ....	50.976	10.197.510
Hyundai Motor Co. ....	56.519	9.998.908
POSCO Holdings, Inc. ....	32.867	9.459.427
Kia Corp. ....	112.007	9.353.398
Celltrion, Inc. ....	69.522	9.129.354
KB Financial Group, Inc. ....	159.443	8.029.843
NAVER Corp. ....	58.957	8.016.441
Shinhan Financial Group Co. Ltd. ....	221.402	7.090.666
Samsung SDI Co. Ltd. ....	22.972	6.902.458
LG Chem Ltd. ....	20.843	5.975.123
LG Energy Solution Ltd. ....	19.692	5.607.329
Kakao Corp. ....	160.576	5.427.200
Hyundai Mobis Co. Ltd. ....	31.293	5.331.794
Hana Financial Group, Inc. ....	113.974	4.662.664
Samsung Biologics Co. Ltd. ....	7.715	4.321.684
Samsung C&T Corp. ....	36.513	3.751.472
Krafton, Inc. ....	19.209	3.677.599

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Samsung Electronics Co. Ltd. ....	410.082	22.178.220
SK Hynix, Inc. ....	49.814	4.919.168
KB Financial Group, Inc. ....	69.109	3.429.482
Samsung Electronics Co. Ltd. (Vorzugsaktien) ....	71.546	3.091.429
Celltrion, Inc. ....	22.356	2.691.327
POSCO Holdings, Inc. ....	6.800	2.503.761
NAVER Corp. ....	15.089	2.159.779
Hyundai Motor Co. ....	12.670	1.898.675
Samsung SDI Co. Ltd. ....	4.768	1.796.982
Kia Corp. ....	25.820	1.741.685
LG Chem Ltd. ....	4.338	1.636.664
Hana Financial Group, Inc. ....	36.778	1.377.484
Shinhan Financial Group Co. Ltd. ....	38.686	1.134.275
LG Energy Solution Ltd. ....	2.894	959.530
Kakao Corp. ....	27.808	953.293
Woori Financial Group, Inc. ....	89.287	880.658
Samsung Biologics Co. Ltd. ....	1.508	833.556
Ecopro BM Co. Ltd. ....	4.126	799.942



# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
LG Electronics, Inc. ....	10.084	773.465
Hyundai Mobis Co. Ltd. ....	4.326	729.608

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	115.500	2.478.125
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. ....	103.800	441.350
MediaTek, Inc. ....	12.830	409.700
Delta Electronics, Inc. ....	18.820	193.406
Quanta Computer, Inc. ....	23.220	190.916
United Microelectronics Corp. ....	100.910	161.810
CTBC Financial Holding Co. Ltd. ....	160.000	150.769
Fubon Financial Holding Co. Ltd. ....	65.945	141.746
ASE Technology Holding Co. Ltd. ....	29.300	126.838
Chunghwa Telecom Co. Ltd. ....	33.090	126.084
Cathay Financial Holding Co. Ltd. ....	79.900	123.757
Mega Financial Holding Co. Ltd. ....	99.251	118.229
E.Sun Financial Holding Co. Ltd. ....	130.000	106.936
Uni-President Enterprises Corp. ....	41.200	97.185
Alchip Technologies Ltd. ....	1.016	92.459
Yuanta Financial Holding Co. Ltd. ....	106.000	92.232
Wistron Corp. ....	25.065	90.780
Asustek Computer, Inc. ....	6.120	85.469
China Steel Corp. ....	104.000	82.178
Nan Ya Plastics Corp. ....	43.130	79.923

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	63.200	1.563.080
MediaTek, Inc. ....	4.170	156.004
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. ....	33.400	111.124
Delta Electronics, Inc. ....	6.060	60.387
Quanta Computer, Inc. ....	7.480	56.965
United Microelectronics Corp. ....	31.910	52.137
CTBC Financial Holding Co. Ltd. ....	52.000	48.699
ASE Technology Holding Co. Ltd. ....	9.500	46.721
Fubon Financial Holding Co. Ltd. ....	21.450	46.580
Mega Financial Holding Co. Ltd. ....	32.464	40.747
Chunghwa Telecom Co. Ltd. ....	10.590	40.303
Cathay Financial Holding Co. Ltd. ....	26.000	37.403
E.Sun Financial Holding Co. Ltd. ....	40.802	32.575
Uni-President Enterprises Corp. ....	13.600	32.370
Yuanta Financial Holding Co. Ltd. ....	34.930	31.072
Wistron Corp. ....	8.433	30.496
Novatek Microelectronics Corp. ....	1.650	30.105
Nan Ya Plastics Corp. ....	15.950	28.391

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Asustek Computer, Inc. ....	1.960	27.610
China Steel Corp. ....	34.000	26.178

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Future of Food UCITS ETF\*

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Xylem, Inc. ....	1.369	151.355
Bayer AG ....	3.118	135.217
Hitachi Ltd. ....	1.966	123.971
Deere & Co. ....	302	121.661
Danone SA ....	1.977	121.559
American Water Works Co., Inc. ....	791	113.871
Unilever PLC ....	2.044	106.303
Ecolab, Inc. ....	575	106.270
Nutrien Ltd. ....	1.761	103.804
DuPont de Nemours, Inc. ....	1.462	102.835
Sysco Corp. ....	1.343	99.662
Dow, Inc. ....	1.842	98.996
Kellanova ....	1.231	83.750
FMC Corp. ....	895	82.598
Reckitt Benckiser Group PLC ....	1.237	81.987
DSM-Firmenich AG ....	767	81.281
Kubota Corp. ....	5.160	75.072
International Flavors & Fragrances, Inc. ....	948	74.535
CNH Industrial NV (USD gehandelt) ....	5.097	73.067
Clorox Co. ....	432	66.961
CNH Industrial NV (EUR gehandelt) ....	4.825	65.391
Mosaic Co. ....	1.834	64.316
John Bean Technologies Corp. ....	504	58.878
Essential Utilities, Inc. ....	1.408	56.495
Eastman Chemical Co. ....	654	54.253
Salmar ASA ....	1.252	52.017
Croda International PLC ....	742	51.746
Green Plains, Inc. ....	1.643	49.884
AGCO Corp. ....	404	49.533
Mowi ASA ....	2.567	48.870
Univar Solutions, Inc. ....	1.323	47.366
Huhtamaki OYJ ....	1.395	46.218
Pentair PLC ....	713	45.726
China Mengniu Dairy Co. Ltd. ....	19.000	45.373
AO Smith Corp. ....	604	43.228
Sealed Air Corp. ....	1.029	40.457
Badger Meter, Inc. ....	261	39.916
SJW Group ....	567	39.573
Energy Recovery, Inc. ....	1.859	39.466
Bucher Industries AG ....	89	38.608
United Natural Foods, Inc. ....	2.066	38.513

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Future of Food UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Watts Water Technologies, Inc. ....	211	37.837
Hain Celestial Gruppe, Inc. ....	3.031	37.307
Severn Trent PLC .....	1.162	36.271

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Xylem, Inc. ....	655	70.189
CNH Industrial NV (USD gehandelt) .....	5.097	69.013
Hitachi Ltd. ....	900	68.387
Kellanova .....	1.231	67.953
International Flavors & Fragrances, Inc. ....	948	64.786
Eastman Chemical Co. ....	654	59.635
CNH Industrial NV (EUR gehandelt) .....	4.825	59.053
Ecolab, Inc. ....	241	47.631
Sealed Air Corp. ....	1.029	38.026
Danone SA .....	580	35.274
SJW Group .....	567	33.542
Ardagh Metal Packaging SA .....	8.661	30.225
Salmar ASA .....	504	28.793
Hain Celestial Gruppe, Inc. ....	3.031	28.659
Huhtamaki OYJ .....	796	27.861
Nissui Corp. ....	4.800	26.890
Essential Utilities, Inc. ....	684	25.166
Deere & Co. ....	47	18.817
GrainCorp Ltd. ....	3.399	17.335
Sysco Corp. ....	220	17.190
Kubota Corp. ....	1.060	16.374
DSM-Firmenich AG .....	135	15.386
Bucher Industries AG .....	31	12.512
John Bean Technologies Corp. ....	113	12.214
AO Smith Corp. ....	147	12.185
Middlesex Water Co. ....	228	11.752
American Water Works Co., Inc. ....	80	10.431

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF\*

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Eli Lilly & Co. ....	265	124.508
Intuitive Surgical, Inc. ....	286	96.108
Merck & Co., Inc. ....	816	92.912
AstraZeneca PLC ....	669	90.922
Novartis AG ....	908	89.974
Pfizer, Inc. ....	2.577	88.388
Medtronic PLC ....	1.017	88.085
Sanofi SA ....	820	86.546
Novo Nordisk AS ....	533	85.290
Stryker Corp. ....	276	82.945
Bristol-Myers Squibb Co. ....	1.251	78.767
Roche Holding AG ....	275	78.002
Abbott Laboratories ....	757	77.995
UnitedHealth Group, Inc. ....	157	75.429
AbbVie, Inc. ....	537	74.308
Thermo Fisher Scientific, Inc. ....	137	71.664
Vertex Pharmaceuticals, Inc. ....	195	68.220
Boston Scientific Corp. ....	1.130	61.366
HCA Healthcare, Inc. ....	195	58.210
Gilead Sciences, Inc. ....	731	56.500
L'Oreal SA ....	125	55.864
Edwards Lifesciences Corp. ....	596	54.052
Dexcom, Inc. ....	419	53.693
Elevance Health, Inc. ....	110	49.724
ResMed, Inc. ....	205	43.072
Biogen, Inc. ....	148	42.135
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. ....	49	41.387
Bayer AG ....	879	41.374
adidas AG ....	213	40.791
Koninklijke Philips NV ....	1.899	40.773
Sleep Number Corp. ....	1.837	37.956
IDEXX Laboratories, Inc. ....	73	36.239

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Eli Lilly & Co. ....	148	93.972
Novartis AG ....	908	91.585
UnitedHealth Group, Inc. ....	157	76.795
Gilead Sciences, Inc. ....	731	55.336
Koninklijke Philips NV ....	1.899	40.977
CRISPR Therapeutics AG ....	533	38.857

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Garmin Ltd. ....	239	38.261
BioNTech SE ....	269	31.728
Intuitive Surgical, Inc. ....	97	29.328
Vertex Pharmaceuticals, Inc. ....	70	24.776
Stryker Corp. ....	81	24.277
Novo Nordisk AS ....	121	23.845
Sanofi SA ....	211	23.087
Inogen, Inc. ....	3.208	23.051
Medtronic PLC ....	275	22.385
Teladoc Health, Inc. ....	908	20.693
Eisai Co. Ltd. ....	426	20.285
Novo Nordisk AS ....	154	20.202
Merck & Co., Inc. ....	156	18.641
Boston Scientific Corp. ....	319	17.404
HCA Healthcare, Inc. ....	57	15.531
Shockwave Medical, Inc. ....	45	15.063
Kainos Group PLC ....	969	14.992
AbbVie, Inc. ....	81	13.693
EngageSmart, Inc. ....	722	12.707
adidas AG ....	66	12.613
Pro Medicus Ltd. ....	202	12.599
Tenet Healthcare Corp. ....	146	12.088
Sonova Holding AG ....	45	11.704
Maravai LifeSciences Holdings, Inc. ....	1.121	11.681
Cochlear Ltd. ....	60	11.571
Edwards Lifesciences Corp. ....	152	11.380
Sarepta Therapeutics, Inc. ....	95	11.248
Bristol-Myers Squibb Co. ....	184	11.189

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Adobe, Inc. ....	405	228.472
NVIDIA Corp. ....	228	225.644
Cigna-Gruppe ....	585	201.532
Cheniere Energy, Inc. ....	1.150	201.177
Progressive Corp. ....	935	197.453
Zurich Insurance Group AG ....	375	196.905
Applied Materials, Inc. ....	890	191.421
CRH PLC ....	2.295	187.639
Lam Research Corp. ....	245	175.400
DR Horton, Inc. ....	1.180	174.404
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Klasse "H" ....	255.000	144.225
Bridgestone Corp. ....	3.200	135.144
3i Group PLC ....	3.505	128.403
Hartford Financial Services Group, Inc. ....	1.030	106.554
Koninklijke Ahold Delhaize NV ....	3.340	103.483
LyondellBasell Industries NV ....	910	90.472
Renesas Electronics Corp. ....	4.300	78.753
Steel Dynamics, Inc. ....	585	78.314
Williams-Sonoma, Inc. ....	265	77.703
Dollarama, Inc. ....	930	77.236
Lennox International, Inc. ....	170	75.740

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Newmont Corp. ....	9.921	401.484
ASML Holding NV ....	412	341.266
Microsoft Corp. ....	884	339.424
Fastenal Co. ....	5.137	323.448
L'Oreal SA ....	626	292.386
T Rowe Price Group, Inc. ....	2.631	289.092
Gilead Sciences, Inc. ....	3.548	274.552
Biogen, Inc. ....	1.111	259.642
DHL Group ....	6.180	259.195
Intact Financial Corp. ....	1.618	256.577
HCA Healthcare, Inc. ....	991	247.552
STMicroelectronics NV ....	5.278	217.509
Mettler-Toledo International, Inc. ....	200	217.295
Astellas Pharma, Inc. ....	18.300	202.524
Old Dominion Freight Line, Inc. ....	493	190.501
Phillips 66 ....	1.610	189.356
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. ....	3.800	188.865



# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Builders FirstSource, Inc. ....	1.236	184.084
Hologic, Inc. ....	2.492	180.523
Coles Group Ltd. ....	16.617	177.701
Advantest Corp. ....	4.900	176.352
Valero Energy Corp. ....	1.327	170.498
Coloplast AS ....	1.477	170.344

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
AbbVie, Inc. ....	5.978	863.259
Chevron Corp. ....	5.908	857.827
EOG Resources, Inc. ....	6.804	847.931
Exxon Mobil Corp. ....	8.022	831.912
Clorox Co. ....	2.982	408.394
Astellas Pharma, Inc. ....	32.200	353.324
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. ....	16.800	351.004
Roche Holding AG ....	1.251	334.779
Fifth Third Bancorp ....	9.940	326.071
United Parcel Service, Inc. ....	2.102	299.739
Snap-on, Inc. ....	1.050	286.554
KDDI Corp. ....	10.200	284.087
Johnson & Johnson ....	1.850	277.512
Cummins, Inc. ....	973	272.205
Kimberly-Clark Corp. ....	1.896	243.575
Sompo Holdings, Inc. ....	11.070	238.776
Nitto Denko Corp. ....	3.123	232.594
Garmin Ltd. ....	1.413	230.343
Cisco Systems, Inc. ....	4.867	229.379
HCL Technologies Ltd. ....	14.224	227.377
Al Rajhi Bank ....	10.308	214.410
Watsco, Inc. ....	477	211.257
Computershare Ltd. ....	11.900	200.724
Synchrony Financial ....	4.904	196.441
T Rowe Price Group, Inc. ....	1.646	191.284
Coca-Cola Co. ....	3.096	189.328
ITC Ltd. ....	36.269	185.962
Unilever PLC ....	3.443	175.776
Novartis AG ....	1.684	173.380
ORIX Corp. ....	8.000	173.290
Merck & Co., Inc. ....	1.517	171.279
Lockheed Martin Corp. ....	365	169.594
3M Co. ....	1.591	160.052
NetApp, Inc. ....	1.348	159.027
Pfizer, Inc. ....	5.188	158.430
Sun Life Financial, Inc. ....	3.176	158.193

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	53.760	1.264.460
Nucor Corp. ....	6.670	1.120.813

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Global Quality Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Royal Bank of Canada .....	10.604	1.116.293
Rio Tinto PLC .....	15.104	1.032.056
Bank of Nova Scotia .....	19.740	924.973
Rio Tinto Ltd. ....	10.956	890.943
Pfizer, Inc. ....	30.292	889.180
Macquarie Group Ltd. ....	7.901	879.186
Broadcom, Inc. ....	748	745.116
Eaton Corp. PLC .....	2.726	695.041
QUALCOMM, Inc. ....	4.397	662.505
Principal Financial Group, Inc. ....	5.264	386.999
Amgen, Inc. ....	1.374	372.009
Seagate Technology Holdings PLC .....	4.640	358.901
Tokio Marine Holdings, Inc. ....	13.600	358.448
Legal & General Group PLC .....	114.657	354.930
Emerson Electric Co. ....	3.517	343.311
ConocoPhillips .....	2.417	285.328
Texas Instruments, Inc. ....	1.537	261.596
Merck & Co., Inc. ....	2.293	257.286
Paychex, Inc. ....	2.113	251.230
Allianz SE .....	1.016	246.936
Partners Group Holding AG .....	198	236.357
Johnson & Johnson .....	1.430	228.244
AP Moller - Maersk AS Klasse „B“ .....	125	224.155
Al Rajhi Bank .....	11.774	223.467
Commonwealth Bank of Australia .....	3.205	216.390

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Tencent Holdings Ltd. ....	9.110	389.755
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd. ....	394.500	278.634
Alibaba Group Holding Ltd. ....	24.165	276.697
PDD Holdings, Inc. ADR ....	1.307	151.595
Li Auto, Inc. ....	12.500	142.263
Kweichow Moutai Co. Ltd. ....	500	116.772
Hygon Information Technology Co. Ltd. ....	8.865	87.624
LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. ....	26.100	86.001
Yum China Holdings, Inc. ....	1.990	83.339
MINISO Group Holding Ltd. ....	10.800	72.606
Baidu, Inc. ....	3.800	69.185
China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co. Ltd. ....	9.900	67.372
BYD Co. Ltd. Klasse „H“ ....	1.920	63.546
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd. ....	1.700	56.218
Nongfu Spring Co. Ltd. ....	9.900	56.113
NetEase, Inc. ....	2.600	55.249
Ping An Healthcare & Technology Co. Ltd. ....	23.400	52.527
Meituan ....	3.028	50.078
Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co. Ltd. ....	1.500	49.227
Anhui Gujing Distillery Co. Ltd. b"-Aktien ....	3.100	48.588
Kingdee International Software Group Co. Ltd. ....	42.000	48.392
Everdisplay Optronics Shanghai Co. Ltd. ....	126.261	47.578
East Money Information Co. Ltd. ....	23.400	47.277
SUPCON Technology Co. Ltd. ....	7.219	44.588

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Tencent Holdings Ltd. ....	47.544	1.845.500
Alibaba Group Holding Ltd. ....	128.175	1.203.063
PDD Holdings, Inc. ADR ....	3.537	526.698
BYD Co. Ltd. Klasse „H“ ....	13.470	367.360
Baidu, Inc. ....	19.500	280.626
East Money Information Co. Ltd. ....	127.720	245.452
NetEase, Inc. ....	12.330	232.646
NARI Technology Co. Ltd. ....	56.400	176.638
Kweichow Moutai Co. Ltd. ....	740	175.328
LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. ....	56.100	174.494
Meituan ....	17.000	172.376
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd. ....	232.200	158.835
China Conch Venture Holdings Ltd. ....	206.730	154.675
China Construction Bank Corp. Klasse "H" ....	255.000	148.518

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
China Three Gorges Renewables Group Co. Ltd. ....	231.300	143.748
Sungrow Power Supply Co. Ltd. ....	12.000	143.600
Contemporary Ampere Technology Co. Ltd. ....	5.660	133.731
Tongwei Co. Ltd. ....	39.600	133.533
Li Auto, Inc. ....	7.600	133.191
China Life Insurance Co. Ltd. ....	98.670	124.831

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Ecopro Co. Ltd. ....	1.176	87.393
Suzlon Energy Ltd. ....	114.022	66.798
Ecopro BM Co. Ltd. ....	412	62.637
Budimex SA .....	184	34.939
L&F Co. Ltd. ....	290	32.764
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA .....	680	32.559
HDFC Bank Ltd. ....	1.696	31.711
Energisa SA .....	3.500	30.452
Prologis Property Mexico SA de CV .....	7.184	30.134
Infosys Ltd. ....	1.746	29.617
Cia Paranaense de Energia - Copel .....	15.600	26.961
Macrotech Developers Ltd. ....	1.594	26.428
Southern Copper Corp. ....	308	22.284
CPFL Energia SA .....	3.300	21.419
E Ink Holdings, Inc. ....	2.400	14.932
Godrej Properties Ltd. ....	632	14.242
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	680	12.995
Samsung SDI Co. Ltd. ....	44	12.839
Wipro Ltd. ....	2.217	11.553
Mabatee Co. KPSC .....	4.150	11.265
Komerčni Banka AS .....	304	10.392
Gold Fields Ltd. ....	656	10.224

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Samsung Electronics Co. Ltd. ....	1.542	81.703
Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd. ....	678	75.944
ICICI Bank Ltd. ....	4.942	66.300
Housing Development Finance Corp. Ltd. ....	1.606	53.124
Alibaba Group Holding Ltd. ....	4.400	42.087
Old Mutual Ltd. ....	45.884	27.842
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ....	1.080	27.225
JD.com, Inc. ....	1.700	23.199
China Longyuan Power Group Corp. Ltd. ....	28.000	20.950
Bharat Forge Ltd. ....	1.116	20.763
Samsung Heavy Industries Co. Ltd. ....	2.896	17.872
Bharat Electronics Ltd. ....	4.972	17.610
China Conch Venture Holdings Ltd. ....	22.000	16.460
BTS Gruppe Holdings PCL NVDR .....	118.000	15.574

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
SABIC Agri-Nutrients Co. ....	424	14.732
Terna Energy SA .....	810	14.587
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai .....	2.600	14.537
China Resources Land Ltd. ....	3.400	12.359
First Financial Holding Co. Ltd. ....	14.420	12.203
Xinyi Solar Holdings Ltd. ....	18.300	12.035
Yum China Holdings, Inc. ....	318	11.371
Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd. ....	14.000	10.771
Growthpoint Properties Ltd. ....	18.006	10.071
Srisawad Corp. PCL NVDR .....	6.800	9.901
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. ....	360	9.780

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF\*

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
NVIDIA Corp. ....	10.449	5.503.648
Broadcom, Inc. ....	758	1.061.328
ASML Holding NV ....	1.111	1.056.767
Mastercard, Inc. ....	2.296	1.044.873
Home Depot, Inc. ....	2.717	908.839
Advanced Micro Devices, Inc. ....	4.433	719.473
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE ....	750	623.564
Visa, Inc. ....	2.176	602.427
Adobe, Inc. ....	1.239	590.887
Intuit, Inc. ....	766	480.371
Applied Materials, Inc. ....	2.196	477.576
Verizon Communications, Inc. ....	11.475	459.881
ServiceNow, Inc. ....	561	418.093
S&P Global, Inc. ....	881	381.922
Netflix, Inc. ....	604	379.592
American Express Co. ....	1.591	378.371
Costco Wholesale Corp. ....	476	375.399
Schneider Electric SE ....	1.475	369.742
Intel Corp. ....	11.526	362.889
Lowe's Co., Inc. ....	1.568	350.984

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Costco Wholesale Corp. ....	476	385.497
Lam Research Corp. ....	283	263.873
Carrier Global Corp. ....	1.729	109.252
Digital Realty Trust, Inc. ....	651	94.614
Alcon, Inc. ....	1.057	94.130
Constellation Energy Corp. ....	420	91.242
Quanta Services, Inc. ....	308	84.987
Woodside Energy Group Ltd. ....	4.067	74.922
Ashtead Group PLC ....	938	67.928
Kraft Heinz Co. ....	1.841	65.114
O'Reilly Automotive, Inc. ....	63	60.684
Fortescue Ltd. ....	3.626	59.660
Ferrari NV ....	133	54.491
Fujitsu Ltd. ....	3.500	50.525
ASML Holding NV ....	49	46.322
Geberit AG ....	70	42.707
Snowflake, Inc. ....	301	40.989
Mastercard, Inc. ....	91	40.682



# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Martin Marietta Materials, Inc. ....	70	40.044
Broadcom, Inc. ....	29	38.527

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

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

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Microsoft Corp. ....	32.066	12.694.906
Apple, Inc. ....	66.584	12.358.020
NVIDIA Corp. ....	24.725	10.824.859
Visa, Inc. ....	28.459	7.740.843
Amazon.com, Inc. ....	46.403	7.582.485
Alphabet, Inc. Klasse „A“ ....	40.521	5.987.790
Meta Platforms, Inc. ....	12.048	5.203.603
Alphabet, Inc. ....	33.696	5.023.953
Tesla, Inc. ....	24.860	4.955.004
AbbVie, Inc. ....	29.394	4.887.502
UnitedHealth Group, Inc. ....	9.603	4.725.469
Salesforce, Inc. ....	18.084	4.570.263
Mastercard, Inc. ....	10.097	4.504.764
Advanced Micro Devices, Inc. ....	23.195	3.664.643
Uber Technologies, Inc. ....	48.356	3.549.129
Abbott Laboratories ....	32.493	3.460.394
Adobe, Inc. ....	6.410	3.419.269
Cisco Systems, Inc. ....	64.529	3.105.925
Bank of America Corp. ....	79.240	2.861.081
QUALCOMM, Inc. ....	14.293	2.659.025
Eli Lilly & Co. ....	3.829	2.623.919

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
NVIDIA Corp. ....	53.592	15.543.261
Apple, Inc. ....	28.816	5.678.429
Amazon.com, Inc. ....	30.014	5.397.127
Broadcom, Inc. ....	2.425	3.816.321
JPMorgan Chase & Co. ....	19.563	3.716.372
Microsoft Corp. ....	9.104	3.552.798
Alphabet, Inc. Klasse „A“ ....	21.388	3.536.198
Alphabet, Inc. ....	18.904	3.132.505
Eli Lilly & Co. ....	3.539	2.966.931
Costco Wholesale Corp. ....	3.112	2.522.484
Thermo Fisher Scientific, Inc. ....	3.866	2.160.025
Netflix, Inc. ....	2.986	1.961.702
Home Depot, Inc. ....	4.927	1.740.700
Vertex Pharmaceuticals, Inc. ....	3.367	1.557.929
Morgan Stanley ....	15.964	1.523.068
Goldman Sachs Group, Inc. ....	3.007	1.317.688
Meta Platforms, Inc. ....	2.938	1.272.786

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Procter & Gamble Co. ....	7.151	1.153.672
Caterpillar, Inc. ....	3.496	1.143.102
Charles Schwab Corp. ....	15.728	1.135.491

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE .....	1.791	1.334.371
Nestle SA .....	9.028	943.152
AstraZeneca PLC .....	6.989	892.965
ASML Holding NV .....	1.236	823.907
SAP SE .....	5.360	805.735
Novartis AG .....	8.555	791.104
L'Oreal SA .....	1.653	688.899
London Stock Exchange Group PLC .....	6.254	672.337
Novo Nordisk AS .....	5.649	580.618
Hermes International SCA .....	275	541.085
Sanofi SA .....	5.079	470.276
Cie Financiere Richemont SA .....	3.031	405.794
Deutsche Telekom AG .....	19.126	404.880
Iberdrola SA .....	33.370	380.478
Roche Holding AG .....	1.434	373.391
Unilever PLC .....	6.751	323.265
DHL Group .....	7.487	312.530
GSK PLC .....	17.820	305.711
Air Liquide SA .....	1.745	286.312
Prosus NV .....	9.219	284.317
Zurich Insurance Group AG .....	598	283.705
Diageo PLC .....	8.024	282.566
Experian PLC .....	7.370	282.418
Novo Nordisk AS Klasse "B" .....	1.940	281.874
Industria de Diseno Textil SA .....	6.833	268.558
Kering SA .....	617	267.698

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Novo Nordisk AS .....	10.037	1.099.202
ASML Holding NV .....	968	829.304
SAP SE .....	3.138	491.225
Siemens AG .....	2.191	397.741
Allianz SE .....	1.532	385.172
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE .....	396	334.390
Hermes International SCA .....	131	294.155
AstraZeneca PLC .....	2.212	264.013
Roche Holding AG .....	932	242.342
Air Liquide SA .....	1.353	232.599

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
BNP Paribas SA .....	3.364	204.989
CRH PLC .....	2.860	200.297
Cie Financiere Richemont SA .....	1.178	172.797
Capgemini SE .....	810	166.129
Unilever PLC .....	3.496	162.382
RELX PLC .....	3.715	147.393
Nestle SA .....	1.436	142.378
Deutsche Telekom AG .....	5.871	131.266
Novartis AG .....	1.385	129.184
Verbund AG .....	1.661	128.314

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
Europäische Union 2,75 % 04.02.2033 .....	26.050.000	25.633.832
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,80 % 15.8.2053 .....	26.050.000	21.716.316
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 29.08.2024 .....	20.000.000	19.826.645
Königreich Belgien, Staatsanleihen 1,25 % 22.4.2033 .....	15.100.000	13.092.860
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 23.05.2024 .....	12.100.000	12.050.886
Vereinigtes Königreich, Gilt, 0,88 % 31.7.2033 .....	14.000.000	11.913.793
Staatsanleihen der Republik Österreich 1,85 % 23.5.2049 .....	14.100.000	10.758.463
Niederlande, Staatsanleihen 0,50 % 15.01.2040 .....	14.250.000	10.048.638
Spanische Staatsanleihen 1,00 % 30.7.2042 .....	12.750.000	8.313.862
Bundesobligation 0,00 % 10.10.2025 .....	8.500.000	8.150.517
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF .....	300.000	7.853.669
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,30 % 15.2.2033 .....	6.800.000	6.775.540
Rumänien, internationale Staatsanleihen 5,63 % 22.2.2036 .....	6.800.000	6.751.398
Europäische Union 0,40 % 04.02.2037 .....	9.450.000	6.553.201
Island, internationale Staatsanleihen 3,50 % 21.3.2034 .....	6.150.000	6.189.566
Bundesobligation 1,30 % 15.10.2027 .....	6.000.000	5.714.460
Irland, Staatsanleihen 1,35 % 18.03.2031 .....	5.950.000	5.447.729
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,50 % 31.7.2053 .....	6.750.000	3.991.309
Engie SA 3,88 % 6.12.2033 .....	3.200.000	3.211.718
Region Wallonien Belgien 3,75 % 22.04.2039 .....	3.000.000	3.049.270
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 20.11.2023 .....	3.000.000	2.990.659
Autoliv, Inc. 3,63 % 7.8.2029 .....	2.700.000	2.705.142

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Bundesobligation 0,00 % 10.10.2025 .....	19.000.000	17.876.603
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,00 % 15.8.2030 .....	18.400.000	15.870.935
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,00 % 15.6.2029 .....	12.500.000	10.665.785
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,00 % 15.8.2050 .....	19.200.000	9.626.880
Staatsanleihen der Republik Österreich 1,85 % 23.5.2049 .....	12.050.000	9.046.924
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 24.8.2023 .....	6.000.000	5.984.880
Königreich Belgien, Staatsanleihen 1,25 % 22.4.2033 .....	6.700.000	5.850.334
Bundesobligation 1,30 % 15.10.2027 .....	6.000.000	5.731.719
Niederlande, Staatsanleihen 0,50 % 15.01.2040 .....	6.200.000	4.351.679
Europäische Union 2,75 % 04.02.2033 .....	4.350.000	4.343.277
BPCE SA 0,13 % 12.4.2024 .....	4.000.000	3.857.561
NTT Finance Corp. 0,08 % 13.12.2025 .....	4.100.000	3.850.077
Irland, Staatsanleihen 1,35 % 18.03.2031 .....	4.150.000	3.805.452
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,80 % 15.8.2053 .....	4.400.000	3.680.920
Europäische Union 0,40 % 04.02.2037 .....	5.000.000	3.442.741
Vereinigtes Königreich, Gilt, 0,88 % 31.7.2033 .....	3.750.000	3.290.469

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 23.05.2024 .....	3.000.000	2.984.978
Stellantis NV 4,38 % 14.03.2030 .....	2.800.000	2.867.733
Spanische Staatsanleihen 1,00 % 30.7.2042 .....	4.450.000	2.787.914
TenneT Holding BV 1,50 % 03.06.2039 .....	3.350.000	2.731.775
Vinci SA 0,00 % 27.11.2028 .....	3.000.000	2.525.327
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 4,13 % 18.01.2027 .....	2.500.000	2.512.185
Eurogrid GmbH 1,11 % 15.05.2032 .....	3.100.000	2.490.963
Republik Frankreich, Staatsanleihen OAT 1,75 % 25.06.2039 .....	2.850.000	2.344.638
Region Wallonien Belgien 3,75 % 22.04.2039 .....	2.200.000	2.224.646
PostNL NV 0,63 % 23.09.2026 .....	2.400.000	2.208.022
Statkraft AS 2,88 % 13.09.2029 .....	2.100.000	2.074.926
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 20.11.2023 .....	2.000.000	1.996.490

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF\*

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,25 % 24.03.2031 .....	1.100.000	1.129.575
Instituto de Credito Oficial 3,05 % 30.04.2031 .....	1.100.000	1.103.733
RCI Banque SA 4,88 % 14.06.2028 .....	660.000	663.741
EDP - Energias de Portugal SA 3,88 % 26.06.2028 .....	600.000	597.041
DNB Bank ASA 4,50 % 19.07.2028 .....	580.000	583.715
Bank of Ireland Group PLC 4,88 % 16.07.2028 .....	560.000	566.446
Citigroup, Inc. 3,71 % 22.09.2028 .....	560.000	552.013
Engie SA 1,75 % 27.03.2028 .....	600.000	550.569
Svenska Handelsbanken AB 0,01 % 02.12.2027 .....	625.000	533.089
Telia Co. AB 1,38 % 11.05.2081 .....	580.000	527.501
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,00 % 09.11.2026 .....	525.000	522.793
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,10 % 10.08.2027 .....	600.000	518.896
Mercedes-Benz International Finance BV 3,50 % 30.05.2026 .....	510.000	507.601
Achmea BV 3,63 % 29.11.2025 .....	510.000	507.370
Nationale-Nederlanden Bank NV 0,50 % 21.09.2028 .....	600.000	507.057
BNP Paribas SA 4,38 % 13.01.2029 .....	500.000	501.026
Intesa Sanpaolo SpA 4,88 % 19.05.2030 .....	500.000	500.508
Autoliv, Inc. 3,63 % 7.8.2029 .....	500.000	500.466
ASR Nederland NV 3,63 % 12.12.2028 .....	500.000	500.369
PVH Corp. 4,13 % 16.07.2029 .....	500.000	500.095
Bank of Nova Scotia 3,50 % 17.04.2029 .....	500.000	498.965
Amprion GmbH 3,88 % 07.09.2028 .....	500.000	498.800
Banque Federative du Credit Mutuel SA 3,50 % 15.5.2031 .....	500.000	497.484
Sparebank 1 Oestlandet 1,75 % 27.04.2027 .....	530.000	495.756
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU 1,66 % 04.12.2026 .....	530.000	490.676
Iren SpA 1,95 % 19.09.2025 .....	500.000	484.179
Vesteda Finance BV 1,50 % 24.05.2027 .....	530.000	484.088
Nordea Bank Abp 1,13 % 16.02.2027 .....	530.000	483.965
de Volksbank NV 1,75 % 22.10.2030 .....	500.000	477.835
Credit Agricole SA 0,38 % 21.10.2025 .....	500.000	472.852
Deutsche Bank AG 3,25 % 24.05.2028 .....	500.000	470.108
Suez SACA 1,88 % 24.05.2027 .....	500.000	463.959
ERG SpA 0,50 % 11.09.2027 .....	530.000	459.992
PostNL NV 0,63 % 23.09.2026 .....	500.000	452.879
Arkema SA 0,13 % 14.10.2026 .....	500.000	451.129
Danske Bank AS 0,75 % 09.06.2029 .....	525.000	444.590
AIB Group PLC 0,50 % 17.11.2027 .....	500.000	443.090
Bankinter SA 0,63 % 06.10.2027 .....	500.000	438.434
Societe Generale SA 0,88 % 22.09.2028 .....	500.000	437.498
ING Groep NV 0,88 % 09.06.2032 .....	500.000	430.682



# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
CaixaBank SA 0,50 % 09.02.2029 .....	500.000	423.249
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 0,75 % 07.07.2028 .....	500.000	420.966
Banca Comerciala Romana SA 7,63 % 19.05.2027 .....	400.000	415.267
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,13 % 29.06.2027 .....	400.000	407.643
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 3,50 % 07.12.2031 .....	400.000	404.604
NatWest Group PLC 4,07 % 06.09.2028 .....	410.000	403.084
Unicaja Banco SA 6,50 % 11.09.2028 .....	400.000	399.339
ABN AMRO Bank NV 4,00 % 16.01.2028 .....	400.000	398.268
Iberdrola Finanzas SA 3,13 % 22.11.2028 .....	400.000	394.392
Swedbank AB 0,30 % 20.05.2027 .....	430.000	387.411
Swedbank AB 4,25 % 11.07.2028 .....	380.000	377.803
Banco de Sabadell SA 1,13 % 11.03.2027 .....	400.000	370.489
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1,00 % 21.06.2026 .....	400.000	370.328
Banco Santander SA 0,30 % 04.10.2026 .....	400.000	364.371

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Banque Federative du Credit Mutuel SA 0,10 % 10.08.2027 .....	600.000	535.455
Intesa Sanpaolo SpA 4,88 % 19.05.2030 .....	500.000	528.102
Mercedes-Benz International Finance BV 3,50 % 30.05.2026 .....	510.000	512.448
Achmea BV 3,63 % 29.11.2025 .....	510.000	508.266
PostNL NV 0,63 % 23.09.2026 .....	500.000	460.474
RCI Banque SA 4,88 % 14.06.2028 .....	350.000	362.674
Coca-Cola HBC Finance BV 2,75 % 23.09.2025 .....	310.000	305.865
National Grid Electricity Transmission PLC 0,19 % 20.01.2025 .....	310.000	301.528
Danske Bank AS 1,38 % 17.02.2027 .....	310.000	295.988
ING Groep NV 2,13 % 23.05.2026 .....	300.000	294.084
CaixaBank SA 1,25 % 18.06.2031 .....	300.000	280.506
Apple, Inc. 0,00 % 15.11.2025 .....	225.000	213.444
DS Smith PLC 4,38 % 27.07.2027 .....	210.000	213.274
SpareBank 1 SR-Bank ASA 2,88 % 20.09.2025 .....	210.000	207.293
Enel Finance International NV 1,50 % 21.07.2025 .....	210.000	204.687
BPCE SA 0,13 % 12.4.2024 .....	200.000	195.472
Iberdrola Finanzas SA 0,88 % 16.06.2025 .....	200.000	193.976
Banco Santander SA 1,13 % 23.06.2027 .....	200.000	185.640
Bankinter SA 0,63 % 06.10.2027 .....	200.000	180.472
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 29.02.2024 .....	140.000	139.056
Westpac Banking Corp. 0,63 % 22.11.2024 .....	110.000	107.757
Credit Suisse AG 0,45 % 19.05.2025 .....	110.000	106.273
Bank of Ireland Group PLC 4,88 % 16.07.2028 .....	100.000	103.021
DNB Bank ASA 4,50 % 19.07.2028 .....	100.000	102.581
Amprion GmbH 3,88 % 07.09.2028 .....	100.000	101.668

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
EDP - Energias de Portugal SA 3,88 % 26.06.2028 .....	100.000	101.543
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 4,13 % 18.01.2027 .....	100.000	101.535
Citigroup, Inc. 3,71 % 22.09.2028 .....	100.000	100.355
BNP Paribas SA 1,00 % 17.04.2024 .....	100.000	99.256
Iberdrola International BV 3,25 % 31.12.2099 .....	100.000	99.010
Naturgy Finance BV 0,88 % 15.05.2025 .....	100.000	97.037
Volvo Car AB 2,50 % 10.07.2027 .....	100.000	94.585
Engie SA 1,75 % 27.03.2028 .....	100.000	94.016
Svenska Handelsbanken AB 0,01 % 02.12.2027 .....	100.000	87.735
Nationale-Nederlanden Bank NV 0,50 % 21.09.2028 .....	100.000	87.506

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF\*

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis EUR
Niederlande, Staatsanleihen 0,50 % 15.01.2040 .....	8.400.000	5.789.935
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,75 % 15.05.2030 .....	5.450.000	5.403.837
Europäische Union 2,75 % 04.02.2033 .....	5.300.000	5.222.360
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,30 % 15.2.2033 .....	4.050.000	4.034.460
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,80 % 15.8.2053 .....	4.450.000	3.655.676
Irland, Staatsanleihen 1,35 % 18.03.2031 .....	3.950.000	3.584.310
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,00 % 15.8.2030 .....	3.950.000	3.374.820
Spanische Staatsanleihen 1,00 % 30.7.2042 .....	5.250.000	3.308.479
Staatsanleihen der Republik Österreich 1,85 % 23.5.2049 .....	4.350.000	3.232.640
Europäische Union 0,40 % 04.02.2037 .....	4.250.000	2.990.912
Königreich Belgien, Staatsanleihen 1,25 % 22.4.2033 .....	3.400.000	2.921.891
Vereinigtes Königreich, Gilt, 0,88 % 31.7.2033 .....	3.140.000	2.705.878
Societe Des Grands Projets EPIC 0,00 % 25.11.2030 .....	2.000.000	1.614.097
Republik Frankreich, Staatsanleihen OAT 1,75 % 25.06.2039 .....	1.800.000	1.471.092
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 29.08.2024 .....	1.400.000	1.388.182
Rumänien, internationale Staatsanleihen 5,63 % 22.2.2036 .....	1.200.000	1.193.119
Region Wallonien Belgien 3,75 % 22.04.2039 .....	1.200.000	1.193.035
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 23.05.2024 .....	1.170.000	1.162.856
Autonomous Community of Madrid 3,36 % 31.10.2028 .....	1.150.000	1.149.566
Island, internationale Staatsanleihen 3,50 % 21.3.2034 .....	1.100.000	1.109.308
Societe Nationale SNCF SACA 0,63 % 17.04.2030 .....	1.300.000	1.096.537
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,00 % 15.6.2029 .....	1.100.000	933.086
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,50 % 31.7.2053 .....	1.500.000	886.108
Instituto de Credito Oficial 3,05 % 31.10.2027 .....	850.000	840.552
Europäische Union 2,63 % 04.02.2048 .....	900.000	768.184
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 29.02.2024 .....	720.000	713.238

Wichtige Verkäufe**	Anteile	Erlöse EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,00 % 15.8.2030 .....	3.950.000	3.419.428
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 23.05.2024 .....	1.170.000	1.164.796
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,00 % 15.6.2029 .....	1.100.000	952.552
Instituto de Credito Oficial 3,05 % 31.10.2027 .....	850.000	849.065
Staatsanleihen der Republik Österreich 1,85 % 23.5.2049 .....	1.050.000	791.490
Vereinigtes Königreich, Gilt, 0,88 % 31.7.2033 .....	700.000	614.059
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 29.02.2024 .....	550.000	545.237
Autonomous Community of Madrid 3,36 % 31.10.2028 .....	350.000	352.754
Bundesobligation 0,00 % 10.10.2025 .....	230.000	217.309
Niederlande, Staatsanleihen 0,50 % 15.01.2040 .....	200.000	139.444
Österreichische Schatzwechsel 0,00 % 20.11.2023 .....	125.000	124.688
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,75 % 15.05.2030 .....	100.000	99.140

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF\* (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe**	Anteile	Erlöse EUR
Irland, Staatsanleihen 1,35 % 18.03.2031 .....	100.000	91.093
Republik Frankreich, Staatsanleihen OAT 1,75 % 25.06.2039 .....	100.000	82.066

\*Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2023 aufgelegt. Einzelheiten sind den Teilfonds und Anteilklassen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ zu entnehmen.

\*\*Alle Verkäufe des Jahres sind in der obigen Tabelle aufgeführt.

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
Visa, Inc. ....	7.490	1.966.687
Adobe, Inc. ....	3.080	1.778.024
Comcast Corp. ....	37.135	1.586.424
Caterpillar, Inc. ....	4.725	1.441.160
Pfizer, Inc. ....	39.588	1.134.177
United Parcel Service, Inc. ....	7.385	1.133.224
Texas Instruments, Inc. ....	6.367	1.075.442
Accenture PLC ....	3.227	1.056.665
Cisco Systems, Inc. ....	21.036	1.048.052
McDonald's Corp. ....	3.697	1.032.426
PepsiCo, Inc. ....	5.966	1.025.129
Merck & Co., Inc. ....	8.840	1.024.188
Bristol-Myers Squibb Co. ....	19.782	1.017.391
Johnson & Johnson ....	6.438	1.010.530
CVS Health Corp. ....	14.170	1.001.601
Costco Wholesale Corp. ....	1.178	1.001.293
Meta Platforms, Inc. ....	2.575	990.375
Cigna Group ....	3.063	954.498
Lowe's Co., Inc. ....	4.279	953.619
EOG Resources, Inc. ....	7.792	953.464

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Exxon Mobil Corp. ....	24.138	2.745.721
Eli Lilly & Co. ....	3.128	2.400.261
Meta Platforms, Inc. ....	5.135	2.349.623
Broadcom, Inc. ....	1.626	2.288.476
KLA Corp. ....	3.087	2.216.392
QUALCOMM, Inc. ....	12.143	2.141.312
Applied Materials, Inc. ....	9.910	2.103.107
Lam Research Corp. ....	2.064	1.968.046
Northrop Grumman Corp. ....	4.305	1.890.659
Home Depot, Inc. ....	5.417	1.889.610
Air Products & Chemicals, Inc. ....	7.080	1.841.902
Vertex Pharmaceuticals, Inc. ....	3.885	1.736.702
Adobe, Inc. ....	3.080	1.693.210
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. ....	1.696	1.681.980
Bristol-Myers Squibb Co. ....	38.520	1.681.666
Emerson Electric Co. ....	17.189	1.643.607
Walmart, Inc. ....	22.739	1.622.806
Amgen, Inc. ....	5.396	1.596.577

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Colgate-Palmolive Co. ....	16.758	1.583.044
International Business Machines Corp. ....	9.240	1.546.672

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

In Übereinstimmung mit den OGAW-Verordnungen werden in dieser Aufstellung die gesamten Käufe und Verkäufe eines Wertpapiers aufgeführt, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe oder Verkäufe des Jahres oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe übersteigen.

Wichtige Käufe	Anteile	Preis USD
US-Schatzanweisungen mit variablem Zinssatz 5,55 % 31.01.2026 .....	385.000	385.355
Danske Bank AS 5,43 % 01.03.2028 .....	225.000	225.000
U.S. Treasury Notes 4,88 % 30.11.2025 .....	200.000	201.564
Barclays PLC 5,67 % 12.03.2028 .....	200.000	200.000
Morgan Stanley 5,25 % 21.04.2034 .....	180.000	175.464
Bank of Montreal 5,72 % 25.09.2028 .....	160.000	159.129
Cisco Systems, Inc. 5,30 % 26.02.2054 .....	135.000	136.425
Constellation Energy Generation LLC 6,13 % 15.01.2034 .....	130.000	130.434
Thermo Fisher Scientific, Inc. 5,00 % 31.01.2029 .....	125.000	126.936
U.S. Bancorp 5,68 % 23.01.2035 .....	125.000	124.780
PNC Financial Services Group, Inc. 5,30 % 21.01.2028 .....	120.000	120.272
United States Treasury Bonds 3,88 % 15.08.2033 .....	120.000	110.362
Variabel verzinsliche United States Treasury Note 5,32 % 31.01.2024 .....	110.000	110.009
U.S. Treasury Notes 5,00 % 31.08.2025 .....	110.000	109.925
Citigroup, Inc. 6,27 % 17.11.2033 .....	100.000	105.311
State Street Corp. 5,16 % 18.05.2034 .....	105.000	103.783
McCormick & Co., Inc. 4,95 % 15.04.2033 .....	105.000	102.489
Veralto Corp. 5,45 % 18.09.2033 .....	100.000	101.412
Dell International LLC.EMC Corp. 6,02 % 15.06.2026 .....	100.000	101.172
Targa Resources Corp. 6,50 % 15.02.2053 .....	95.000	101.055
United States Treasury Note 4,25 % 31.12.2025 .....	100.000	99.855
United States Treasury Note 3,75 % 31.12.2028 .....	100.000	98.641
Morgan Stanley 3,59 % 22.07.2028 .....	100.000	94.041
Nasdaq, Inc. 5,55 % 15.02.2034 .....	90.000	89.846
Medtronic Global Holdings SCA 4,50 % 30.03.2033 .....	95.000	88.806
Citigroup, Inc. 3,67 % 24.07.2028 .....	90.000	84.867
Gilead Sciences, Inc. 5,25 % 15.10.2033 .....	85.000	83.988
Global Payments, Inc. 5,95 % 15.08.2052 .....	85.000	82.633
JPMorgan Chase & Co. 5,35 % 06.01.2034 .....	85.000	81.811

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Variabel verzinsliche United States Treasury Note 5,32 % 31.01.2024 .....	330.000	329.987
US-Schatzanweisungen mit variablem Zinssatz 5,55 % 31.01.2026 .....	270.000	270.487
HSBC Holdings PLC 1,65 % 18.04.2026 .....	250.000	238.802
JPMorgan Chase & Co. 2,52 % 22.04.2031 .....	240.000	205.416
Electricite de France SA 5,70 % 23.05.2028 .....	200.000	205.146
U.S. Treasury Notes 4,88 % 30.11.2025 .....	200.000	201.539
Barclays PLC 5,67 % 12.03.2028 .....	200.000	199.820
Warnermedia Holdings, Inc. 4,28 % 15.03.2032 .....	220.000	194.576
JPMorgan Chase & Co. 0,77 % 08.09.2025 .....	150.000	146.506

# VERÄNDERUNGEN IN DER ZUSAMMENSETZUNG DES PORTFOLIOS (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

## Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

### Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024

Wichtige Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 3,18 % 07.09.2050 .....	200.000	138.442
AT&T, Inc. 3,50 % 01.06.2041 .....	175.000	131.736
MPLX LP 4,13 % 03.01.2027 .....	135.000	130.975
U.S. Bancorp 5,68 % 23.01.2035 .....	125.000	124.989
UnitedHealth Group, Inc. 3,05 % 15.05.2041 .....	160.000	119.245
United States Treasury Bonds 3,88 % 15.08.2033 .....	120.000	110.714
U.S. Treasury Notes 5,00 % 31.08.2025 .....	110.000	110.232
Energy Transfer LP 5,15 % 15.03.2045 .....	115.000	104.066
AstraZeneca PLC 4,38 % 16.11.2045 .....	120.000	104.028
Comcast Corp. 4,65 % 15.02.2033 .....	105.000	102.563
Public Service Electric & Gas Co. 3,10 % 15.03.2032 .....	115.000	100.148
United States Treasury Note 4,25 % 31.12.2025 .....	100.000	98.871
United States Treasury Note 3,75 % 31.12.2028 .....	100.000	98.633
ServiceNow, Inc. 1,40 % 01.09.2030 .....	115.000	93.231
Verizon Communications, Inc. 2,85 % 03.09.2041 .....	130.000	91.142
Allstate Corp. 4,20 % 15.12.2046 .....	110.000	87.469
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,30 % 19.05.2053 .....	90.000	86.962
American Express Co. 3,30 % 03.05.2027 .....	90.000	85.532
JPMorgan Chase & Co. 5,35 % 06.01.2034 .....	85.000	84.490
Albemarle Corp. 5,05 % 01.06.2032 .....	85.000	82.278
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01.04.2031 .....	100.000	81.071
Kraft Heinz Foods Co. 4,25 % 01.03.2031 .....	85.000	80.820
Celanese U.S. Holdings LLC 6,05 % 15.03.2025 .....	79.000	79.029
Target Corp. 4,80 % 15.01.2053 .....	85.000	76.691
Citigroup, Inc. 3,67 % 24.07.2028 .....	80.000	75.919
Morgan Stanley 3,59 % 22.07.2028 .....	80.000	75.789



# VERORDNUNG ÜBER NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGSPFLICHTEN („SFDR“) UND TAXONOMIEVERORDNUNG (UNGEPRÜFT)

## Transparenz bei der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und von nachhaltigen Anlagezielen in regelmäßigen Berichten

Die EU-Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten (Verordnung (EU) 2019/2088, die „SFDR“) schreibt vor, dass die ICAV in ihre regelmäßigen Berichte eine Beschreibung aufnehmen muss, inwieweit jeder nach Artikel 8 SFDR klassifizierte Fonds (ein „Artikel 8-Fonds“) seinen ökologischen oder sozialen Merkmalen gerecht wird bzw. jeder nach Artikel 9 SFDR klassifizierte Fonds (ein „Artikel-9-Fonds“) sein nachhaltiges Anlageziel erreicht hat. Gemäß SFDR sind zudem die Europäische Bankenaufsicht, die Europäische Aufsichtsbehörde für das Versicherungswesen und die betriebliche Altersversorgung und die Europäische Wertpapieraufsichtsbehörde (zusammen die „europäischen Aufsichtsbehörden“) befugt, Entwürfe für technische Regulierungsstandards („RTS“) auszuarbeiten, die Inhalt und Format der Informationen für die regelmäßigen Berichte vorgeben. Die folgenden Angaben, die für Artikel-8- und Artikel-9-Fonds nach SFDR vorgeschrieben sind, wurden unter Anwendung der einheitlichen Vorgaben für Nachhaltigkeitsangaben bzw. die diesbezügliche Berichterstattung gemäß den RTS gemacht. Diese Vorgaben traten am 1. Januar 2023 in Kraft. Die Klassifizierungen der Anlagen in den folgenden Angaben basieren auf dem MSCI und können sich von der Klassifizierung der Wertpapiere im Anlagenportfolio unterscheiden.

Im Folgenden sind die Angaben für die jeweilige Klassifikation dargestellt:

Name des Teilfonds	SFDR-Klassifizierung
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Euro Short Maturity UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Future of Food UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Future of Health & Wellness UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Global Equity SRI UCITS ETF	Artikel 8
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 8
Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 8
Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF	Artikel 8
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 8
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 8
Franklin USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Sustainable Euro Green Bond UCITS ETF	Artikel 9
Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF	Artikel 9
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF	Artikel 9

# Der Franklin Catholic Principles Emerging Markets 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- Es wurden damit **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
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt**: 0,00%

**NEIN**

- Es wurden damit **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
- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds hat alle festgelegten ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich beworben. Im Folgenden ist für jedes der folgenden Merkmale die Erfolgsquote angegeben:

- Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen (THG-Emissionen) in den nationalen Volkswirtschaften:

Die Anlagepolitik des Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des Index so genau wie möglich nachzubilden, ungeachtet dessen, ob der Index steigt oder fällt. Dabei ist der Tracking Error (Nachbildungsfehler) zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und der des Index möglichst gering zu halten. Der Index basiert auf dem ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index (der „Hauptindex“) und setzt sich aus auf USD und EUR lautenden Schwellenländer-Staatsanleihen zusammen. Indexwertpapiere werden von staatlichen Emittenten begeben, unter anderem von Regierungsbehörden und quasi-staatlichen Stellen. Der Index (i) schließt Wertpapiere des Hauptindex aus, die von Ländern begeben werden, welche bestimmte vom Indexanbieter festgelegte 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 beginnt mit dem Anlageuniversum des Hauptindex und schließt die Anleihen von Ländern aus, die im Hinblick auf die folgenden Kriterien schlecht abschneiden, die vom Indexanbieter als römisch-katholische Grundsätze identifiziert wurden, also unter anderem Sorge für den Planeten (d. h. Reduzierung von Treibhausgasemissionen). Diese Kriterien beruhen jeweils auf Rating-Daten für die Bereiche Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“), die von Sustainalytics, einem führenden unabhängigen Research-, Rating- und Analyseunternehmen für ESG und Corporate Governance, und der Emissions Database for Global Atmospheric Research („EDGAR“), einer multifunktionalen und unabhängigen globalen Datenbank für anthropogene Treibhausgasemissionen und Luftverschmutzung, bereitgestellt werden.

Die Anlageverwaltung verpflichtet sich, auf die 5 % der Emittenten einzuwirken, die den schlechtesten Score auf der Grundlage ihrer Exponierung gegenüber dem obligatorischen PAI Nr. 15 (THG-Intensität) aufweisen. Die Anlageverwaltung schloss 2023 die obligatorische Einflussnahme auf 5 % der Beteiligungen erfolgreich ab, die in Bezug auf ihre Gesamtexponierung gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

- Gute Governance-Praktiken für Länder (vor allem Rechtsstaatlichkeit und Korruptionsbekämpfung) und soziale Gerechtigkeit (vor allem politische Stabilität, politische Rechte und Freiheiten und die Abschaffung der Todesstrafe):

Die Anlageverwaltung überwachte die Emittenten im Hinblick auf die Schwellenwerte verschiedener Ausschlusskriterien, darunter: Korruptionskontrolle, Rechtsstaatlichkeit, effiziente Regierungsführung, politische Stabilität, Qualität der regulatorischen Rahmenbedingungen, politische Rechte, bürgerliche Rechte, politische Freiheit und Todesstrafe. Die Verpflichtung, nicht in Emittenten zu investieren, die den aufgeführten Ausschlusskriterien entsprechen, wurde eingehalten. Die Anlageverwaltung ist zur Einflussnahme verpflichtet und hält daher eine Reihe von Sitzungen mit den 5 % der Emittenten mit dem schlechtesten Score auf der Grundlage ihrer Exponierung gegenüber dem obligatorischen PAI Nr. 16 (Länder, in denen investiert wird und in denen

Verstöße gegen soziale Bestimmungen vorkommen), und den optionalen sozialen PAIs Nr. 18 (Einkommensungleichheit) bis Nr. 24 (Rechtsstaatlichkeit) ab. Neben seinem freiwilligen Dialog mit anderen staatlichen Emittenten liegt der Fonds hinsichtlich der Vorschrift zur obligatorischen Einflussnahme bis zum Ende des Kalenderjahres 2024 im Zeitplan.

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 zum Referenzindex, 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 während des Referenzzeitraums ab.

## ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Exponierung zu den Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs): Die Ergebnisse ähneln denen des Vorjahres. Der obligatorische PAI Nr. 15 (THG-Intensität) für die Offenlegung 2023 betrug 571,77 tCO<sub>2</sub>e je Million Euro Umsatz, für die Offenlegung 2024 betrug er 650,97 tCO<sub>2</sub>e je Million Euro Umsatz. Ein weiterer obligatorischer PAI, Nr. 16, steht für Länder, in denen investiert wird und in denen Verstöße gegen soziale Bestimmungen vorkommen. In der Offenlegung für 2023 und auch für 2024 waren keine Länder verzeichnet, in denen solche Verstöße vorkommen. Der Fonds überwacht auch die zusätzlichen PAIs. Der zusätzliche PAI Nr. 18 steht für den durchschnittlichen Score der Einkommensungleichheit. In der Offenlegung 2023 lag der durchschnittliche Wert bei 41,82, in der Offenlegung 2024 lag der durchschnittliche Score bei 42,11. PAI Nr. 19 steht für den durchschnittlichen Score der Meinungsfreiheit. In der Offenlegung für 2023 lag er bei 60,90, in der Offenlegung für 2024 bei 61,29. Ein weiterer zusätzlicher PAI, Nr. 20, steht für die durchschnittliche Performance bei Menschenrechten. Er lag in der Offenlegung 2023 und 2024 jeweils bei 0,59. Der PAI Nr. 21 steht für den durchschnittlichen Korruptions-Score. Er betrug in der Offenlegung für 2023 46,44 und in der Offenlegung für 2024 45,79. Der PAI Nr. 22 steht für kooperationsunwillige Steuergebiete. In der Offenlegung für 2023 betrug der Wert 6,07, in der Offenlegung für 2024 noch 4,94 %. Der zusätzliche PAI Nr. 23 steht für die durchschnittliche politische Stabilität. Für 2023 betrug der Score bei der Offenlegung 5,88, im Jahr 2024 lag er bei 6,38. PAI Nr. 24 ist der durchschnittliche Score für die Rechtsstaatlichkeit. Er betrug für 2023 0,12 und für 2024 0,10.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	650,97	95,00%	571,77	92,42%
Benchmark – THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	806,24	98,03%	750,69	95,76%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	95,00%	0,00	82,66%
Benchmark – Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	5,25	98,06%	5,00	92,88%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Einkommensungleichheit	Durchschnittlicher Score	42,11	95,00%	41,82	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Einkommensungleichheit	Durchschnittlicher Score	40,61	95,03%	40,47	94,23%
Zusätzliche Indikatoren:	Durchschnittlicher Score	61,29	95,00%	60,90	92,42%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Durchschnittlicher Score für Meinungsfreiheit					
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Meinungsfreiheit	Durchschnittlicher Score	52,44	97,24%	52,10	98,87%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittliche Leistung Menschenrechte	Durchschnittliche Leistung	0,59	89,05%	0,59	86,47%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittliche Leistung Menschenrechte	Durchschnittliche Leistung	0,53	81,81%	0,53	82,30%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Korruption	Durchschnittlicher Score	45,79	95,00%	46,44	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Korruption	Durchschnittlicher Score	43,86	98,06%	43,89	100,00%
Zusätzliche Indikatoren: Kooperationsunwillige Steuergebiete	Gewichtung (in %)	4,94%	95,00%	6,07%	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Kooperationsunwillige Steuergebiete	Gewichtung (in %)	2,42%	98,03%	3,72%	100,00%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für politische Stabilität	Durchschnittlicher Score	6,38	95,00%	5,88	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für politische Stabilität	Durchschnittlicher Score	6,12	98,06%	5,63	100,00%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Rechtsstaatlichkeit	Durchschnittlicher Score	0,10	95,00%	0,12	92,42%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Rechtsstaatlichkeit	Durchschnittlicher Score	0,02	98,06%	0,03	100,00%

● **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.

● **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.

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, welche 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 Anlageverwaltung schloss 2023 die obligatorische Einflussnahme auf 5 % der Beteiligungen erfolgreich ab, 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	650,97	95,00%
Benchmark – THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	806,24	98,03%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	95,00%
Benchmark – Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	5,25	98,06%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Einkommensungleichheit	Durchschnittlicher Score	42,11	95,00%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Einkommensungleichheit	Durchschnittlicher Score	40,61	95,03%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Meinungsfreiheit	Durchschnittlicher Score	61,29	95,00%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Meinungsfreiheit	Durchschnittlicher Score	52,44	97,24%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittliche Leistung Menschenrechte	Durchschnittliche Leistung	0,59	89,05%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittliche Leistung Menschenrechte	Durchschnittliche Leistung	0,53	81,81%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Korruption	Durchschnittlicher Score	45,79	95,00%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Korruption	Durchschnittlicher Score	43,86	98,06%
Zusätzliche Indikatoren: Kooperationsunwillige Steuergebiete	Gewichtung (in %)	4,94%	95,00%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Kooperationsunwillige Steuergebiete	Gewichtung (in %)	2,42%	98,03%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für politische Stabilität	Durchschnittlicher Score	6,38	95,00%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für politische Stabilität	Durchschnittlicher Score	6,12	98,06%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Rechtsstaatlichkeit	Durchschnittlicher Score	0,10	95,00%
Benchmark – zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Rechtsstaatlichkeit	Durchschnittlicher Score	0,02	98,06%



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Brazilian Government International Bond 2.875% 06/06/2025	Staatsanleihen	4,67%	Brasilien
Colombia Government International Bond 7.375% 09/18/2037	Staatsanleihen	4,45%	Kolumbien
Romanian Government International Bond 4.625% 04/03/2049 REG S	Staatsanleihen	4,32%	Rumänien
Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 06/22/2030	Staatsanleihen	3,58%	Südafrika
Peruvian Government International Bond 2.783% 01/23/2031	Staatsanleihen	3,57%	Peru
Chile Government International Bond .555% 01/21/2029	Staatsanleihen	3,56%	Chile
Israel Government International Bond 2.75% 07/03/2030	Staatsanleihen	3,26%	Israel
Philippine Government International Bond 3.70% 02/02/2042	Staatsanleihen	3,13%	Philippinen
Republic of Poland Government International Bond 1.125% 08/07/2026 REG S	Staatsanleihen	3,10%	Polen
Romanian Government International Bond 2.875% 10/28/2024 REG S	Staatsanleihen	2,96%	Rumänien
Brazilian Government International Bond 4.75% 01/14/2050	Staatsanleihen	2,94%	Brasilien
Dominican Republic International Bond 6% 07/19/2028 REG S	Staatsanleihen	2,63%	Dominikanische Republik
Philippine Government International Bond 3% 02/01/2028	Staatsanleihen	2,48%	Philippinen
Republic of Poland Government International Bond 2.75% 05/25/2032 REG S	Staatsanleihen	2,36%	Polen
Romanian Government International Bond 2.875% 03/11/2029 REG S	Staatsanleihen	2,27%	Rumänien



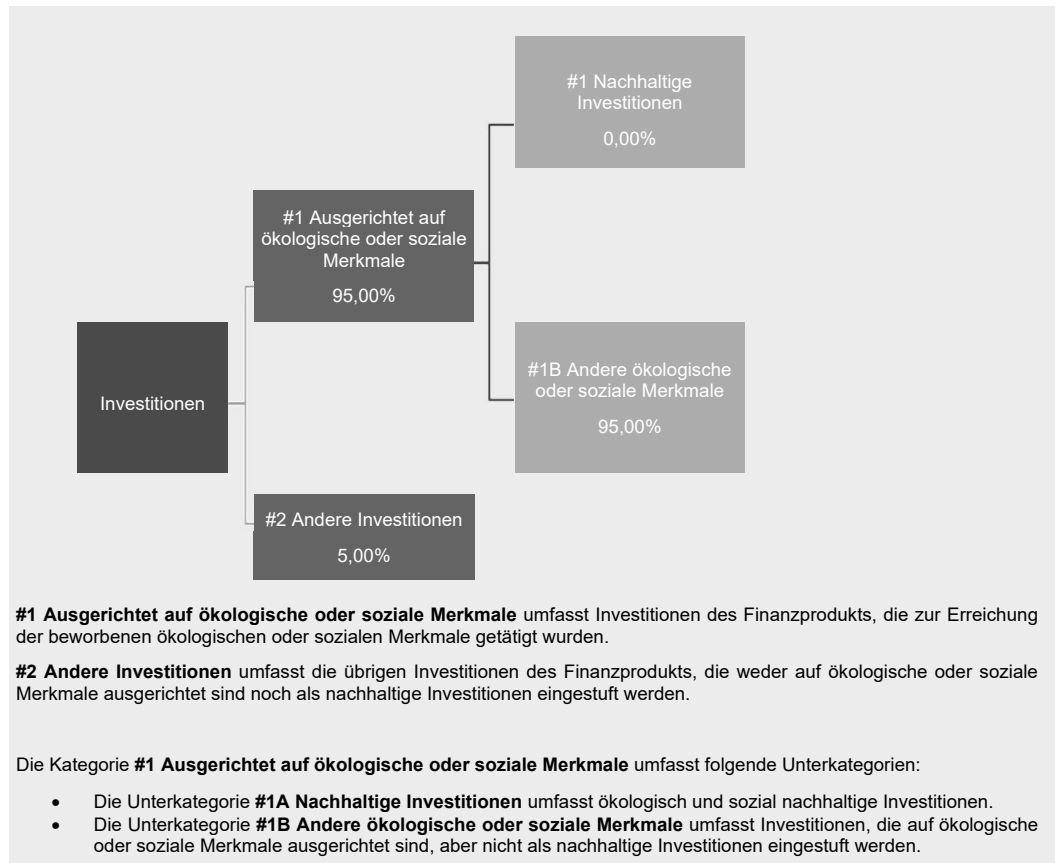
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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?

95 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (5 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.





● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	94,99%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	94,99%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

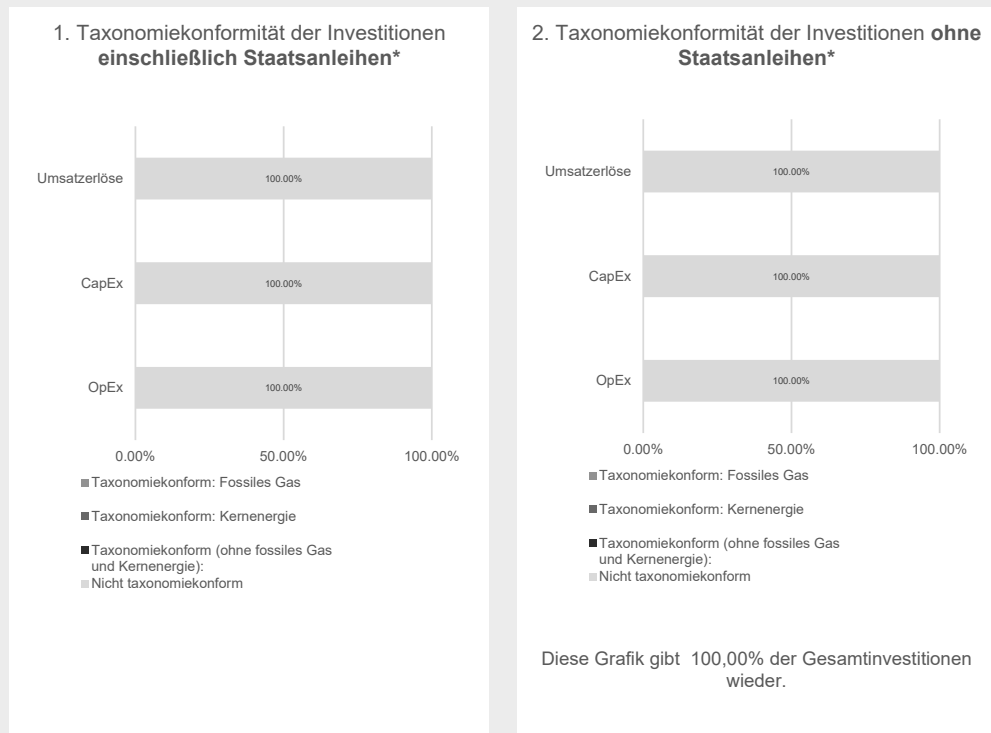
Nicht zutreffend.

## 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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Portfoliounternehmen widerspiegeln - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Portfoliounternehmen widerspiegeln

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?

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.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.



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 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 5 % 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 Anlageverwaltung wandte verschiedene Methoden an, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale einzubeziehen und gleichzeitig die obligatorischen Bestandteile der Anlagestrategie einzuhalten. Diese Methoden, die im Folgenden aufgeführt werden, umfassen eine Synthese von IT-Anwendungen, qualitativen und quantitativen Analysen und Interaktionen mit den verschiedenen Stakeholdern (unter anderem). Durch die Umsetzung dieser Methoden hat der Fonds seine zugesagten ökologischen und sozialen Merkmale erreicht.

1. 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 Einwirken auf die 5 % der Emittenten mit dem schlechtesten Score, basierend auf deren Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI-Indikatoren). 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.

2. Um ökologische und soziale Merkmale zu fördern und das obligatorische Einwirken auf Emittenten zu gewährleisten, die am stärksten in die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen involviert sind, kommunizierte die Anlageverwaltung bei persönlichen Treffen, Internetmeetings und schriftlich mit den Emittenten. Diese Kommunikation erfolgte mit Portfoliounternehmen, die an dieser und anderen von der Anlageverwaltung gemanagten Strategien beteiligt sind.

- Internetmeetings sind nach wie vor die kosteneffizienteste Lösung, denn sie ermöglichen der Anlageverwaltung den Dialog mit der Geschäftsleitung, Investor Relations und Nachhaltigkeitsfachleuten zur Diskussion über Themen mit Nachhaltigkeitsbezug. Bei diesen Gesprächen wurden die Emittenten unter anderem zu bestimmten Kontroversen befragt, um ihre Positionen besser zu verstehen. Bei Bedarf wurden sie aufgefordert, zur Abhilfe gegenüber betroffenen Bevölkerungsgruppen und Ökosystemen eine proaktivere Haltung einzunehmen. Zudem besprach das Team bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken oder -chancen, die für einzelne Emittenten wesentlich oder Teil eines thematischen Dialogs zu vorab ausgewählten Themen waren, wie zum Beispiel Sicherheit der künstlichen Intelligenz und Reduzierung von Methan-Emissionen.
- Die schriftliche Kommunikation umfasste Briefe an Emittenten, in denen die Anlageverwaltung ihre Meinung zu Themen äußerte, die sie für den Emittenten oder dessen Wirtschaftszweig als wichtig erachtete. Die Anlageverwaltung bat Portfoliounternehmen aus bestimmten Sektoren auch darum, Fragebogen zur Informationsbeschaffung auszufüllen, um bessere Investitionsentscheidungen zu ermöglichen. So wurden zum Beispiel Umfragen an Finanzinstitute verschickt, in denen deren Beteiligung an Krediten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen erfragt wurde, um Investitionen in diejenigen zu fördern, bei denen eine strategische Verpflichtung besteht, nicht in Öl-, Gas- und Kohleprojekte zu investieren.
- Schließlich hatten die VertreterInnen der Anlageverwaltung bei Branchenveranstaltungen wie der EuroMoney Conference in Wien im Januar 2024, der Erste Group ESG CEE Konferenz in Wien im Mai 2024 und dem Investor Relations Forum 2024 in Breslau die Gelegenheit, eine größere Gruppe von Stakeholdern persönlich zu treffen. Bei diesen Konferenzen hielten die VertreterInnen der Anlageverwaltung Workshops und nahmen an Panels teil und konnten so über die Best Practices des nachhaltigen Investierens informieren.



● **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 zu seinen Regeln und seine Wertentwicklung, sind unter dem folgenden Link erhältlich: <https://indices.ice.com/>. 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 Qualify-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 CO2-Kennzahl für den Hauptindex wird auf Basis der durchschnittlichen Pro-Kopf-CO2-Emissionen der einzelnen Länder in Tonnen CO2 berechnet. Liegt die CO2-Kennzahl des Index mindestens 30 % unter derjenigen des Hauptindex, ist keine weitere Anpassung notwendig. Liegt die CO2-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-CO2-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
	Der Franklin Catholic Principles Emerging Markets 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)	650,97	629,29	806,24
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	0,00	5,25
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Einkommensungleichheit	42,11	41,71	40,61
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Meinungsfreiheit	61,29	60,92	52,44
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittliche Leistung Menschenrechte	0,59	0,58	0,53
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Korruption	45,79	45,26	43,86
Zusätzliche Indikatoren: Kooperationsunwillige Steuergebiete (Gewichtung)	4,94%	4,59%	2,42%
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für politische Stabilität	6,38	6,42	6,12
Zusätzliche Indikatoren: Durchschnittlicher Score für Rechtsstaatlichkeit	0,10	0,09	0,02

# Franklin Euro IG Corporate UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
254900LQFNBJ2SFDA22



FRANKLIN  
TEMPLETON

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

JA

Es wurden damit 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

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

NEIN

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 34,76 % 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

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds hat alle festgelegten ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich beworben. Im Folgenden ist für jedes der folgenden Merkmale die Erfolgsquote angegeben:

(i) Reduzierung von THG-Emissionen und (ii) Energieeinsparung:

Die Anlageverwaltung strebte ein Engagement an in „Unternehmen, die basierend auf der Treibhausgasintensität zu den oberen 20 % ihrer Branchenvergleichsgruppe zählen“. Am Ende des Berichtszeitraums lag die Allokation des Fonds in Umweltchampions bei 36,5 % seines Nettoinventarwerts (NIW). Darüber hinaus wurden die unteren 20 %, die sogenannten Umweltnachzügler, aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen. Zudem investierte die Anlageverwaltung (wie in den vorvertraglichen Informationen des Fonds beschrieben) nicht in Emittenten, deren Beteiligung an der Förderung fossiler Brennstoffe oder an der Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen über das von der Anlageverwaltung für akzeptabel erachtete Niveau hinausging.

Ein Beispiel für die Unterstützung des Fonds für die Entwicklung von grüner Energie ist die Investition das spanische Energieunternehmen Iberdrola International. Der 2022 Green Report beschreibt Iberdrolas umfassendes Konzept für grüne Finanzierungen, das den Green Bond Principles (GBP) und den Green Loan Principles (GLP) entspricht. So zeichnete Iberdrola zum Beispiel Kredite zur Finanzierung der Anlage zur Herstellung von grünem Wasserstoff und Solarenergie in Puertollano, eines Portfolios von Solar- und Windkraftwerken an mehreren Standorten in Spanien und Solarkraftwerken in Portugal.

iii) Schutz der Artenvielfalt:

Die Anlageverwaltung hat den Fonds hinsichtlich der Auswirkungen auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität (PAI Nr. 7 – Aktivitäten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken) überwacht. Zum Zeitpunkt der Offenlegung enthielt das Fondsportfolio keine Emittenten, die aktiv gegen PAI Nr. 7 verstoßen.

Die Investition in einen vom italienischen Finanzanbieter Intesa Sanpaolo emittierten Fonds ist ein Beispiel für Anlagen des Fonds in die Minderung negativer Auswirkungen auf die Biodiversität. 2021 veröffentlichte Intesa Sanpaolo ein Green Bond Framework. Im Rahmen des Framework erklärt der Emittent seine Bereitschaft, Projekte zu finanzieren, die in die folgende Kategorie fallen: Bewirtschaftung von lebenden natürlichen Ressourcen und Landnutzung nach ökologisch nachhaltigen Grundsätzen, biodiversitätserhaltende Landwirtschaft, nachhaltige Forstwirtschaft und Stadtbegrünung. Für die Finanzierung vorgeschlagene Projekte umfassen: nachhaltige Lebensmittelproduktionssysteme, resiliente Landwirtschaftspraktiken, die zur Erhaltung von Ökosystemen beitragen, sowie nachhaltige Forstwirtschaft, die die Voraussetzungen für die Anpassung an den Klimawandel, extreme Wetterbedingungen, Dürren, Überschwemmungen und andere Katastrophen verbessert.

(iv) Ausrichtung an den internationalen Grundsätzen für unternehmerisches Handeln und den politischen Grundfreiheiten:

Im Berichtszeitraum war der Fonds auf die internationalen Grundsätze für unternehmerisches Handeln ausgerichtet und beachtete die Vorgaben des 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. Der Fonds vermied Anlagen in Emittenten, die diese Standards nicht einhielten.

Zudem förderte der Fonds im Veranlagungszeitraum die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

(i) verantwortungsvolle Bewirtschaftung fester und flüssiger Abfälle und (ii) Entwicklung der Kreislaufwirtschaft:

Die Anlageverwaltung förderte eine verantwortungsvolle Bewirtschaftung fester und flüssiger Abfälle und die Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft durch Engagement und Investitionen in Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung für zulässige Projekte, wie unter anderem zur Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, für nachhaltige Wasser- und Abwasserbewirtschaftung oder ökoefiziente und/oder zirkuläre Produkte, Produktionstechnologien und -prozesse.

iii) Verringerung des Einkommensgefälles zwischen Männern und Frauen und/oder Steigerung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- oder Kontrollorganen:

Ähnlich wie bei der Förderung der Merkmale Verringerung von THG-Emissionen und Energieeinsparung führte die Anlageverwaltung auch bereichsübergreifende Dialogkampagnen zu Details der Diversitätsstrategie von Unternehmen durch.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- Exponierung gegenüber den Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) im Vergleich zum Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	29,18%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	4,91%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Nachhaltigkeitsanleihen	0,67%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden	36,50%
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	109,00

## ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

## ● **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,
- sozialer Integration,
- guten Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten eine Allokation von 20 % seines Portfolios 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:

- die Mittel für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- der Rahmen einem der internationalen Standards entsprach 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 wurde mindestens 1 % des Nettoinventarwerts des Fonds in nachhaltige soziale Aktivitäten investiert. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- die Mittel für geeignete soziale Projekte genutzt wurden,
- der Rahmen mit internationalen Standards laut ICMA Social Bond Principles in Einklang stand, und
- 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. Alle Emittenten wurden mit Hilfe der Principal Adverse Impact Risk App (die „PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten verschiedener externer Anbieter, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche Wirtschaftstätigkeiten und/oder Kontroversen involviert sind, und solche Emittenten aus dem Anlageuniversum auszuschließen. Ein zweites proprietäres Tool, die ESG Credit App, ordnete die Unternehmensemittenten nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer Treibhausgasintensität ein und verwendete dazu verschiedene Punkte wie z. B. Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen und die historische Entwicklung der Emissionen bei den Emittenten. Unternehmensemittenten, die zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehören (d. h. Klima-Nachzügler), wurden auf der Grundlage der ESG Credit App ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen. Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den 21 % des Fondsportfolios, die für ökologische und soziale Ziele zugesagt sind, führten die Anlageverwalter (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Erfüllung des DNSH-Kriteriums („Do Not Significant Harm“) für das Projekt durch.

## **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Bei der Beurteilung dessen, ob die Anlagen des Fonds den „Do No Significant Harm“-Grundsätzen entsprechen, berücksichtigte die Anlageverwaltung alle verpflichtenden PAI-Indikatoren von Tabelle 1 in Anhang I der in der SFDR vorgesehenen technischen Regulierungsstandards („RTS“), sofern diese für die vom Fonds beabsichtigten Anlagen relevant waren. DIE ANLAGEVERWALTUNG führte diese Analyse auf der Ebene der einzelnen nachhaltigen Investitionen durch, sodass die Relevanz und Wesentlichkeit der PAI-Indikatoren bei verschiedenen Anlagen jeweils unterschiedlich sein können. Emittenten, die nach Einschätzung des Anlageverwalters gegen diese Indikatoren verstießen, wurden nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft. Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüften und dokumentierten die Anlageverwalter die Wesentlichkeit der relevanten PAIs für das Projekt und die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten. Wenn die Anlageverwaltung beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserten sie sich, dass die finanzierten Projekte das Risiko von PAIs im Zusammenhang mit Treibhausgasemissionen verringerten.

## **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:**

Die nachhaltigen Investitionen standen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Diese Konformität wurde mit Hilfe von MSCI-Daten überwacht. Von diesem Dienstleister festgestellte Verstöße wurden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit die Anlageverwaltung sie untersuchen konnte. Ergab die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht eingehalten hat, wurde 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, welche 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:

- Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten,
- Einschränkung des Fonds-Anlageuniversums,
- Hilfestellung für thematisches Engagement und
- Anwendung von Ausschlüssen.

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds strebte ein Engagement in Anleihen von Unternehmen an, die von den Anlageverwaltern als Umweltchampions eingestuft wurden. Umwelt-Champions wurden identifiziert als Unternehmensemittenten, die auf der Grundlage der Treibhausgasintensität zu den besten 20 % ihrer Branchenvergleichsgruppe zählen. Bei der Einschränkung des Fonds-Anlageuniversums wurden Unternehmensemittenten, die zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehörten (d. h. Klima-Nachzügler), auf der Grundlage der ESG Credit App ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwaltung schloss 2023 die obligatorische Einflussnahme auf 5 % der Beteiligungen erfolgreich ab, die in Bezug auf ihre Gesamtexponierung gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

Anwendung von Ausschlüssen

Der Fonds berücksichtigte Verstöße gegen UNGC, nachteilige Auswirkungen auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität und die Verbindung zu umstrittenen Waffen bei der Anwendung spezifischer ESG-Ausschlüsse, wie im Abschnitt über die Anlagestrategie beschrieben.

PAI-Kennzahlen entsprechen den Durchschnittswerten am 29. Dezember 2023, 29. März 2024 und 30. Juni 2024.

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	164,58	81,14%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	142,28	87,99%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	42,58	81,14%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	26,24	87,99%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	1 386,95	81,14%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	996,34	87,90%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	207,16	81,14%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	168,53	87,99%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	1 594,11	81,14%
Benchmark – THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	1 164,86	87,99%
CO2-Bilanz 1&2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	26,42	81,14%
Benchmark – CO2-Bilanz 1 & 2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	73,09	87,99%
Geschätzte CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	202,11	81,14%
Benchmark – Geschätzte CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	505,19	87,99%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	58,86	94,92%
Benchmark – THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	106,36	98,53%
Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	545,01	94,92%
Benchmark – Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	868,61	98,53%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	6,47%	92,22%
Benchmark– Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	12,24%	96,59%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	62,99%	73,58%
Benchmark – Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	67,89%	76,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	43,02%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	72,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	43,02%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,14	72,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,33	45,95%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,42	72,66%



PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,31	45,21%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,85	72,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,28	43,27%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,15	72,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,16	43,57%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,16	72,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	43,02%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,35	72,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,14	43,27%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,79	72,66%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	43,02%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,58	72,66%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,63%
Benchmark – Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	8,16%	96,17%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%
Benchmark – Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,87	1,32%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,79	44,58%
Benchmark – Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	6,27	49,96%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,74%
Benchmark – Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,22%	98,19%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	6,19%	92,22%
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	6,91%	96,59%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	15,50%	46,49%
Benchmark – Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	13,95%	46,22%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	40,95%	91,96%
Benchmark – Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	39,13%	96,40%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,22%
Benchmark – Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,59%



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 31.10.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Leasys Spa 4.5% 07/26/2026 REG S	Zyklische Konsumgüter	1,38%	Italien
Netflix Inc 3.625% 06/15/2030 REG S	Kommunikationsdienste	1,37%	USA
Arkema SA 3.5% 01/23/2031 REG S	Grundstoffe	1,35%	Frankreich
Medtronic Global Holdings SCA 10/15/2028	Gesundheitssektor	1,35%	USA
De Volksbank NV 1.75% 10/22/2030 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,30%	Niederlande
Visa Inc 2% 06/15/2029	Finanzsektor	1,30%	USA
Logicor Financing Sarl 1.5% 07/13/2026 REG S	Immobilien	1,28%	Luxemburg
Coca-Cola Europacific Partners PLC .2% 12/02/2028 REG S	Basiskonsumgüter	1,18%	Vereinigtes Königreich
NN Group NV 6% 11/03/2043 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,17%	Niederlande
RCI Banque SA 4.625% 10/02/2026 REG S	Zyklische Konsumgüter	1,16%	Frankreich
Banca Comerciala Romana SA FRN 05/19/2027 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,14%	Rumänien
KBC Group NV 4.375% 12/06/2031 REG S	Finanzsektor	1,14%	Belgien
Fiserv Inc 4.5% 05/24/2031	Finanzsektor	1,14%	USA
Banco De Sabadell SA 5.125% 11/10/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,13%	Spanien
BNP Paribas SA 4.125% 09/26/2032 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,12%	Frankreich



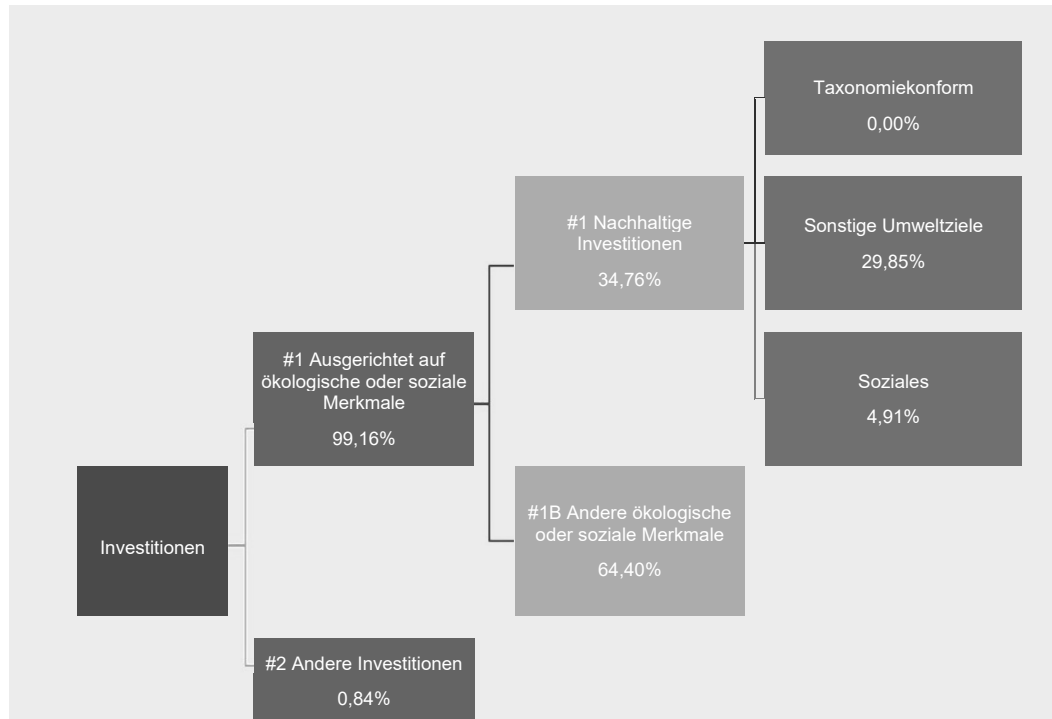
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 34,76 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,16 % des Fonds-Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Die verbleibenden 0,84 % des Fonds-Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Für das Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 34,76 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen, dabei war der Anteil der Anlagen auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet.



**#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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

<b>Wichtigster Sektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Finanzsektor	51,59%
Versorgungsunternehmen	11,21%
Industrie	7,71%
Kommunikationsdienste	7,66%
Basiskonsumgüter	5,84%
Zyklische Konsumgüter	5,08%
Immobilien	4,23%
Gesundheitssektor	3,50%
Grundstoffe	2,05%
Informationstechnologie	0,28%
<b>Wichtigster Teilsektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Banken	33,76%
Stromversorger	8,27%
Finanzdienstleistungen	6,74%
Versicherungen	6,51%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	5,49%
Getränke	3,89%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	3,46%
Kapitalmärkte	3,31%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,32%
Automobilindustrie	2,31%
Fahrzeugkomponenten	1,81%
Chemische Erzeugnisse	1,77%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	1,66%
Bau- u. Ingenieurwesen	1,56%
Elektronikgeräte	1,44%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

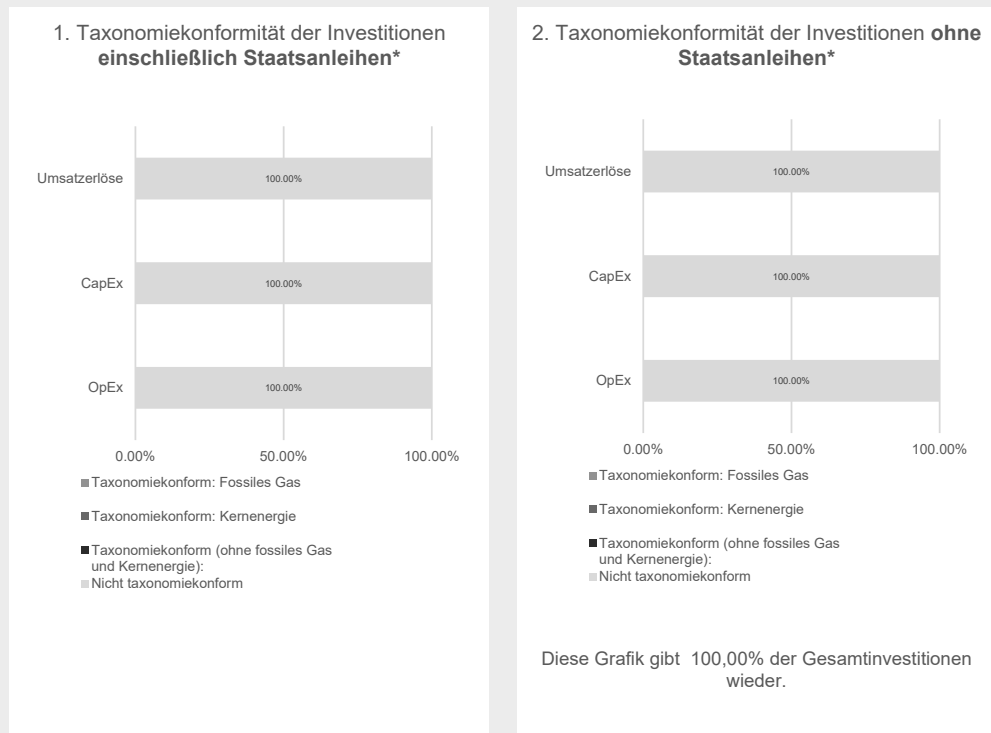
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?

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.

## ● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Gemäß der Verpflichtung des Fonds bestand das Portfolio zu 29,85 % aus „nachhaltigen Anlagen“ laut EU-Taxonomie, deren ökologische Zielsetzung nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.



## ● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 4,91 %.



## ● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil der unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 0,84 % und bestand unter anderem aus liquiden Vermögenswerten (ergänzende liquide Vermögenswerte, Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds), die zur Deckung des täglichen Bedarfs des Teilfonds gehalten werden, sowie Derivaten, die zu Absicherungszwecken, für ein effizientes Portfoliomanagement oder hilfsweise für Investitionen gehalten werden. Zur Verdeutlichung: Dies schließt gewisse Geldmarktinstrumente wie Staatsanleihen nicht ein, für die die Anlageverwaltung bestätigt hat, dass sie mit vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen im Einklang standen. Ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz besteht nicht.



## ● **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Die Anlageverwaltung wandte verschiedene Methoden an, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale einzubeziehen und gleichzeitig die obligatorischen Bestandteile der Anlagestrategie einzuhalten. Diese Methoden, die im Folgenden aufgeführt werden, umfassen eine Synthese von IT-Anwendungen, qualitativen und quantitativen Analysen und Interaktionen mit den verschiedenen Stakeholdern (unter anderem). Durch die Umsetzung dieser Methoden hat der Fonds seine zugesagten ökologischen und sozialen Merkmale erreicht.

1. Der Fonds weist einen Teil seines Nettovermögens nachhaltigen Investitionen zu. Das Erreichen dieser Verpflichtung wurde durch Investitionen in Instrumente mit fester Mittelverwendung erfüllt. Diese Finanzinstrumente werden für die Finanzierung von Projekten mit positiven ökologischen oder sozialen Auswirkungen konzipiert. Um die Eignung jedes Wertpapiers als nachhaltige Anlage gemäß der Definition der Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) (siehe Abschnitt 2.17) festzustellen, führt die Anlageverwaltung eine gründliche Bewertung durch. Dabei wird unter anderem geprüft, ob die Erlöse aus grünen, sozialen oder Nachhaltigkeitsanleihen für Investitionsausgaben verwendet werden, die ökologische oder soziale Ziele fördern. Darüber hinaus untersucht die Anlageverwaltung die Indikatoren für wesentliche negative Auswirkungen (PAII) in Bezug auf den Emittenten und die möglichen Auswirkungen der Finanzierung von Investitionsausgaben auf diese PAII. Bei der Bewertung wird auch geprüft, ob die gesamten wirtschaftlichen Aktivitäten des Emittenten und die finanzierten Investitionsausgaben potenziell erheblichen Schaden anrichten könnten und die Governance-Praktiken des Emittenten werden auf ihre Nachhaltigkeit hin untersucht. Dieser strenge Überprüfungsprozess gewährleistet, dass nur geprüfte grüne, soziale und nachhaltige Anleihen als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

2. Die Anlageverwaltung bediente sich einer Reihe von ESG-IT-Lösungen, die nahtlos in die Compliance- und Handelsstrukturen integriert sind. Diese Systeme wurden bei der Überwachung und dem Ausschluss von Emittenten eingesetzt, die gegen zwingende Vorschriften mit Bezug auf schädliche wirtschaftliche Aktivitäten oder umstrittene Geschäftspraktiken verstießen. Diese ESG-IT-Lösungen enthielten zentrale Anwendungen – die ESG Credit Application, die die THG-Emissionen von Emittenten mit einer bestimmten Branchen-Vergleichsgruppe abglich und so die schlechtesten 20 % der Emittenten – die als „Nachzügler“ gelten – als nicht-investierbare Unternehmen identifizierte. Zusätzlich nutzte die Anlageverwaltung sowohl interne als auch externe Informationen, wie z. B. MSCI-Daten und Datensätze von Sustainability, um zu untersuchen, ob die Emittenten in kontroverse Geschäftspraktiken hinsichtlich einer Abweichung von den internationalen Grundsätzen für unternehmerisches Handeln verwickelt sind oder ihre Umsatzerlöse aus schädlichen Aktivitäten stammen, wie z. B. der Rüstung, dem Abbau von Kraftwerkskohle oder der Tabakerzeugung. Eine umfassende Liste der Ausschlüsse ist in den vorvertraglichen Informationen enthalten. Dieses strenge Verfahren stellte den Ausschluss aller unzulässiger Emittenten vor der Transaktion sicher. Nach einer Transaktion überwachten die IT-Systeme diese Beschränkungen weiterhin und meldeten alle Emittenten, deren nachhaltige Merkmale eine Verschlechterung aufwiesen, um so die Notwendigkeit einer zeitnahen Veräußerung zu signalisieren.

3. Um die in den vorvertraglichen Offenlegungen beschriebene Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale zu gewährleisten, nutzte die Anlageverwaltung die „PAII App“. Diese Anwendung lieferte Informationen zu den Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAII) jedes Emittenten in Bezug auf das Anlageuniversum. Da die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds mit bestimmten PAIIs korrelieren, können Portfoliomanager im Entscheidungsfindungsprozess bei der Investition mit diesem Instrument neben anderen finanziellen und nicht-finanziellen Eigenschaften Risiken einer Exposition in bestimmten PAII gewichten. Darüber hinaus bemühte sich die Anlageverwaltung, die Exposition auf Fondsebene mit dem Referenzindex zu vergleichen, obwohl der Fonds nicht verpflichtet ist, seine durchschnittliche PAII-Exposition unter der Benchmark zu halten. Durch diese Überwachung konnte die Effizienz des Fonds beim Erreichen der gewünschten Merkmale beurteilt und bei Bedarf die Umsetzung korrigierender Maßnahmen gesteuert werden.

4. Um ökologische und soziale Merkmale zu fördern und das obligatorische Einwirken auf Emittenten zu gewährleisten, die am stärksten in die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen involviert sind, kommunizierte die Anlageverwaltung bei persönlichen Treffen, Internetmeetings und schriftlich mit den Emittenten. Diese Kommunikation erfolgte mit Portfoliounternehmen, die an dieser und anderen von der Anlageverwaltung gemanagten Strategien beteiligt sind.

- Internetmeetings sind nach wie vor die kosteneffizienteste Lösung, denn sie ermöglichen der Anlageverwaltung den Dialog mit der Geschäftsleitung, Investor Relations und Nachhaltigkeitsfachleuten zur Diskussion über Themen mit Nachhaltigkeitsbezug.

Bei diesen Gesprächen wurden die Emittenten unter anderem zu bestimmten Kontroversen befragt, um ihre Positionen besser zu verstehen. Bei Bedarf wurden sie aufgefordert, zur Abhilfe gegenüber betroffenen Bevölkerungsgruppen und Ökosystemen eine proaktivere Haltung einzunehmen. Zudem besprach die Anlageverwaltung bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken oder -chancen, die für Emittenten wesentlich oder Teil eines thematischen Dialogs zu vorab ausgewählten Themen waren, wie zum Beispiel Schutz der Artenvielfalt, Auslaufen der Kohleförderung und -nutzung, geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Sicherheit der künstlichen Intelligenz (KI) und Verringerung von Methanemissionen.

- Die schriftliche Kommunikation umfasste Briefe an Emittenten, in denen die Anlageverwaltung ihre Meinung zu Themen äußerte, die sie für den Emittenten oder dessen Wirtschaftszweig als wichtig erachtete. Die Anlageverwaltung bat Portfoliounternehmen aus bestimmten Sektoren auch darum, Fragebogen zur Informationsbeschaffung auszufüllen, um bessere Investitionsentscheidungen zu ermöglichen. So wurden zum Beispiel Umfragen an Finanzinstitute verschickt, in denen deren Beteiligung an Krediten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen erfragt wurde, um Investitionen in diejenigen zu fördern, bei denen eine strategische Verpflichtung besteht, nicht in Öl-, Gas- und Kohleprojekte zu investieren.
- Schließlich hatte die Anlageverwaltung bei Branchenveranstaltungen wie der EuroMoney Conference in Wien im Januar 2024, der Erste Group ESG CEE Konferenz in Wien im Mai 2024 und dem Investor Relations Forum 2024 in Breslau die Gelegenheit, eine größere Gruppe von Stakeholdern persönlich zu treffen. Bei diesen Konferenzen hielt die Anlageverwaltung Workshops und nahm an Panels teil und konnte so über die Best Practices des nachhaltigen Investierens informieren.



## 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 Euro Short Maturity UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
549300WLCPUYDYKVK0X09



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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- Es wurden damit 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
- Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

NEIN

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 37,14 % 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
- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds hat alle festgelegten ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich beworben. Im Folgenden ist für jedes der folgenden Merkmale die Erfolgsquote angegeben:

(i) Reduzierung von THG-Emissionen und (ii) Energieeinsparung:

Um die Energieeinsparung und die Reduzierung von Treibhausgasemissionen zu fördern waren die Anlageverwalter bestrebt, in sogenannte 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 durchschnittliche Allokation des Fonds in Umweltchampions bei 41,89 % seines Nettoinventarwerts (NIW).

Emittenten, die unter die untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppe fielen (ermittelt durch proprietäre Tools), wurden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Zudem investierte der Fonds auch nicht in Emittenten, deren Beteiligung an der Förderung fossiler Brennstoffe oder an der Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen über das von den Anlageverwaltern 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, als nicht investierbar erachtet).

Im Referenzzeitraum betrug die durchschnittliche THG-Intensität der Portfoliounternehmen (Scope 1, 2 und 3) beim Fonds 923,39 und beim Referenzindex 1112,77. Die Scope 1- und 2-THG-Intensität betrug beim Fonds 25,93 und beim Referenzindex 57,63. Die THG-Intensität des Fonds ist niedriger als die des Referenzindex – darin zeigt sich die strategische Portfolioauswahl zur Verringerung der Treibhausgasintensität. Die Ausrichtung des Fonds auf Unternehmen mit geringerer CO<sub>2</sub>-Intensität erlaubt es dem Fonds zum einen, seine ökologischen Ziele zu erfüllen, und zum anderen, die potenziellen Risiken im Zusammenhang mit Klimaschutzvorschriften und den Veränderungen des Marktumfelds in Richtung nachhaltigerer Praktiken zu reduzieren.

Darüber hinaus war die durchschnittliche Treibhausgasintensität der Portfolioländer beim Fonds niedriger als beim Referenzindex (194,13 beim Fonds, 222,44 beim Referenzindex).

Um diese Merkmale weiter zu fördern, traten die Anlageverwalter mit verschiedenen staatlichen und Unternehmensemittenten in einen Dialog.

Ein Beispiel für die Förderung der Reduzierung von THG-Emissionen und der Energieeinsparung durch Investitionen in Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung ist die grüne Anleihe des Instituto De Credito Oficial (ICO). Die grüne Anleihe des ICO trug zur Mobilisierung von Mitteln in Höhe von 7.861 Mio. EUR bei – 100 % der Mittel wurden im ersten Jahr nach Auflegung verwendet. Finanziert wurde unter anderem die Installation von Wind-, Solar- und Wasserkraftwerken, die Herstellung von grünem Wasserstoff und saubere Transportinfrastruktur in mehreren Ländern, zum Beispiel Spanien, Portugal, Chile und Kolumbien. Die finanzierten

Projekte brachten auch deutliche Umweltvorteile, beispielsweise die Installation von 3.184 MW Kapazität in erneuerbarer Energie oder 770 Ladepunkte für den Verkehr.

iii) Schutz der Artenvielfalt:

Um den Schutz der biologischen Vielfalt zu unterstützen, hielt sich der Fonds von Emittenten mit negativen Auswirkungen auf die Artenvielfalt in sensiblen Bereichen fern. Am Ende des Berichtszeitraums lag der Anteil der Investitionen des Fonds in Portfoliounternehmen mit Standorten in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, in denen sich ihre Aktivitäten nachteilig auswirkten (PAi Nr. 7), bei 0 %.

Die Anlageverwaltung führte einen aktiven Dialog mit mehreren Emittenten, um die kritische Notwendigkeit des Erhalts und des Schutzes der Artenvielfalt zu verdeutlichen.

Ein Beispiel für die Förderung des Schutzes der Biodiversität durch Investitionen in Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung ist die grüne Anleihe der Bundesrepublik Deutschland. Mit den durch die Anleihe aufbrachten Mitteln finanzierte die Bundesregierung verschiedene Programme für den Erhalt der biologischen Vielfalt und den Schutz gefährdeter Arten. Das Programm GAK (Verbesserung der Agrarstruktur und des Küstenschutzes), das von der Bundesregierung und den Ländern gemeinsam finanziert wird, unterstützt eine an den Markt und lokal angepasste umweltfreundliche Landwirtschaft, darunter den Erhalt der Natur und das Landschaftsmanagement, wobei der Fokus auf nachhaltigen Praktiken im Acker-, Pflanzen- und Obstbau liegt. Das Bundesprogramm „Biologische Vielfalt“ ist das primäre Finanzierungsinstrument des Umweltministeriums für die Verbesserung der Biodiversität und konzentriert sich auf die Bekämpfung des Insektensterbens durch Erhaltungsprojekte in städtischen und geschützten Bereichen sowie durch Aufklärung über Insekten. Das Programm „chance.natur“ unterstützt die Schaffung und den Erhalt wichtiger natürlicher Bereiche und trägt so zum Schutz der biologischen Vielfalt und des natürlichen Erbes Deutschlands bei. Der „Wildnisfonds“ fördert den Kauf von Wäldern und Mooren, um das Ziel der Regierung, 2 Prozent der Landfläche Deutschlands als Wildnisbereiche zu erhalten.

(iv) Ausrichtung an den internationalen Grundsätzen für unternehmerisches Handeln und den politischen Grundfreiheiten:

Im Berichtszeitraum war der Fonds auf die internationalen Grundsätze für unternehmerisches Handeln ausgerichtet und beachtete die Vorgaben des 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. Im Referenzzeitraum lag der Anteil der Investitionen in Unternehmen, die an Verstößen gegen die UNGC-Prinzipien oder die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren (PAI Nr. 10), bei 0 %. Insgesamt hielt sich der Fonds von Emittenten fern, die nicht die vorgenannten Standards beachteten.

Im Hinblick auf staatliche Emittenten förderte der Fonds die Ausrichtung an politischen Grundfreiheiten. Dementsprechend investierte er nicht in Länder, die nach dem anerkannten Thinktank Freedom House als „Unfrei“ bewertet waren. Der Fonds investierte sogar nur in Länder oder in Regionen in Ländern, die den höchsten Freedom House Index Score („Frei“) aufwiesen. Darüber hinaus vermied der Fonds Investitionen in Emittenten, bei denen es sich um Staaten handelt, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen gegen soziale Bestimmungen verstoßen. Während des Bezugszeitraums hielt der Fonds 0 % an Investitionen in Länder, die an sozialen Verstößen beteiligt sind (absolute Zahl), wie sie in internationalen Abkommen und Konventionen, den Grundsätzen der Vereinten Nationen und gegebenenfalls in nationalem Recht genannt sind (PAI Nr. 16).

Zudem verfolgte der Fonds ein sekundäres Ziel und unterstützte:

(i) die Verringerung des Einkommensgefälles zwischen Männern und Frauen und/oder die Steigerung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- oder Kontrollorganen:

Die Anlageverwalter förderten die Verringerung des Einkommensgefälles zwischen Männern und Frauen und die Steigerung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- oder Kontrollorganen durch Engagement und Investitionen in Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung.

Im Hinblick auf relevante PAIs betrug die durchschnittliche Geschlechtervielfalt im Vorstand beim Unternehmensteil des Fondsportfolios 42,31 %, gegenüber 17,73 % beim Referenzindex. Das durchschnittliche unbereinigte geschlechtsspezifische Lohngefälle der Portfoliounternehmen betrug 20,40 % beim Fonds und 9,45 % beim Referenzindex.

Wenngleich sich der Fonds nicht dazu verpflichtet hat, auf Fondsebene PAIs zu erzielen, die besser sind als bei der Benchmark, betrachten die Anlageverwalter die durchschnittliche Outperformance des PAI Nr. 13 gegenüber der Benchmark als positiven Beitrag zur Förderung sozialer Merkmale. Die Datenqualität des PAI Nr. 12 lässt aufgrund von weitgehend länderabhängigen Unterschieden bei der Datentransparenz noch zu wünschen übrig. Die Anlageverwaltung hofft daher, dass die Umsetzung neuer Offenlegungsvorschriften wie der CSDR oder der EU-Transparenzrichtlinie sowie ein proaktives direktes Engagement eine Verbesserung dieser Aspekte bewirkt.

Darüber hinaus hat die Anlageverwaltung eine besondere Privatplatzierung abgeschlossen, aus der die erste Gender-Diversity-Staatsanleihe der Republik Island hervorging. Zu den finanzierten Projekten gehören die Erhöhung des Kapitalbeitrags für bezahlbare Unterkünfte für schutzbedürftige Frauen und besser bezahlten Elternurlaub. Island gilt als eine der führenden Nationen im Bereich der Geschlechtergleichstellung und steht im Global Gender Gap Index des Weltwirtschaftsforums schon seit Jahren ganz oben. Trotz dieser Fortschritte bleibt das Land der vollumfänglichen Geschlechtergleichstellung verpflichtet und setzt sich weiterhin für die soziale und wirtschaftliche Förderung von Frauen in seiner Gesellschaft ein. Nach Überzeugung der Anlageverwalter werden die über die Anleihe beschafften Mittel weiterhin zur Stärkung der Frauen in dem Land beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- 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 während des Referenzzeitraums ab.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	30,17%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	6,97%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden	41,89%

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
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 Anteilhaber ausgelöst wurde)	0,27%
Anzahl der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter im Rahmen eines Engagements zusammenarbeitete	99,00

### ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Wir weisen darauf hin, dass aufgrund einer Umstellung der Methodik einige Nachhaltigkeitsindikatoren aus diesem Bezugszeitraum (Umweltchampions, Prozentsatz der Investitionen in grüne, soziale und nachhaltige Anleihen und PAI) auf dem Durchschnitt zum Quartalsende basieren und der vorherige Bezugszeitraum nur die Werte am letzten Tag des Geschäftsjahres (30. Juni 2023) widerspiegelt.

Im aktuellen Referenzzeitraum, der am 30. Juni 2024 endete, erhöhte der Fonds seine durchschnittliche Allokation in nachhaltige Anlagen deutlich gegenüber dem vorherigen Referenzzeitraum. Am 30. Juni 2023 betrug das Engagement in grünen Anleihen 20,84 % und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 stieg die durchschnittliche Allokation auf 30,17 %. Am 30. Juni 2023 betrug das Engagement in sozialen Anleihen 1,54 % und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 stieg die durchschnittliche Allokation auf 6,97 %.

Insgesamt betrug der Prozentsatz der Investitionen in grüne, soziale und nachhaltige Anleihen 22,38 % (Stand: 30. Juni 2023), und die durchschnittliche Allokation erhöhte sich im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 auf 37,14 %.

Im aktuellen Referenzzeitraum, der am 30. Juni 2024 endete, erhöhte der Fonds seine durchschnittliche Allokation in Umweltchampions deutlich gegenüber dem vorherigen Referenzzeitraum. Am 30. Juni 2023 betrug das Engagement in Umweltchampions 32,30 % und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 stieg die durchschnittliche Allokation auf 41,89 %.

Am Ende des vorherigen Bezugszeitraums wies der Fonds ein Engagement von 0,99 % in den ausgeschlossenen Sektoren und weiteren Ausschlüssen auf bzw. stand mit ihnen in Verbindung. Wertpapiere, bei denen der prozentuale Anteil der Umsätze aus ausgeschlossenen Sektoren nach dem Ersterwerb über die im Verkaufsprospekt vorgegebenen Grenzen gestiegen war, lösten einen Plan zur zeitnahen Veräußerung der Wertpapiere im besten Interesse der Anteilhaber aus und wurden verkauft.

Am Ende des aktuellen Referenzzeitraums war der Fonds mit 0,27 % in einem Unternehmen engagiert, das unter die zusätzlichen Ausschlüsse fiel, weil die Position als Umweltnachzügler umklassifiziert wurde. Dies erfolgte am letzten Geschäftstag im Juni, dem Ende des aktuellen Referenzzeitraums. Die Anlageverwalter werden dieses Wertpapier so bald wie möglich (spätestens an dem in den vorvertraglichen Informationen angegebenen verbindlichen Datum) unter Berücksichtigung der Interessen der Anteilhaber verkaufen. Abgesehen davon wies der Fonds kein Engagement in den ausgeschlossenen Sektoren und weiteren Ausschlüssen gemäß den vorvertraglichen Informationen des Fonds auf oder stand mit ihnen in Verbindung.

In beiden Bezugszeiträumen war das Investmentteam sehr aktiv im Bereich Nachhaltigkeitsengagement. Unterstrichen wird dies durch die Tatsache, dass im vorherigen Referenzzeitraum mit mehr als 70 Emittenten ein Dialog geführt wurde und die Anlageverwalter ihre Bemühungen in diesem Bereich ausgeweitet haben, sodass es im aktuellen Referenzzeitraum 99 Emittenten waren.

Hinweis: Benchmark PAI 1 bzw. finanzierte Emissionen ist für die Benchmark-Analyse nicht vergleichbar. Bei der Berechnung der Kennzahl „Investor Stake“ (Marktwert der Anlage/EVIC) gibt es eine Verzerrung, da die Inputs aus verschiedenen Datenquellen stammen (Factset BDF und MSCI ESG). Dies hat eine Inkongruenz beim Bewertungsdatum sowie bei der Maßeinheit zur Folge. Benchmark PAI 1 Kennzahlen zum 30. Juni 2023 wurden gegenüber der vorherigen Berichterstattung des Fonds angepasst.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	30,17%	20,84%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	6,97%	1,54%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden	41,89%	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 Anteilhaber ausgelöst wurde)	0,27%	0,99%
Anzahl der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter im Rahmen eines Engagements zusammenarbeitete	99,00	76,00

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	2 151,85	37,70%	6 014,33	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	19,49	26,04%	17,16	24,67%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	431,04	37,70%	1 165,49	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	3,51	26,04%	3,23	24,67%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	23 254,20	37,70%	47 124,27	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	153,49	26,04%	136,14	24,60%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	2 582,89	37,70%	7 179,81	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	23,00	26,04%	20,39	24,67%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	25 837,09	37,70%	54 304,08	42,62%
Benchmark – THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	176,49	26,04%	156,53	24,67%
CO2-Bilanz 1&2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	16,74	37,70%	33,12	42,62%
Benchmark – CO2-Bilanz 1 & 2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	63,92	26,04%	59,41	24,67%
Geschätzte CO2- Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	178,21	37,70%	250,49	42,62%
Benchmark – Geschätzte CO2- Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	489,13	26,04%	456,15	24,67%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	25,93	49,05%	47,21	50,34%
Benchmark – THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	57,63	41,61%	57,97	39,72%
Geschätzte THG- Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	923,39	49,05%	660,38	50,34%
Benchmark – Geschätzte THG- Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	1 112,77	41,62%	774,58	39,72%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	1,82%	45,96%	1,51%	49,07%
Benchmark- Engagement in	Investierter prozentualer Anteil	2,53%	40,27%	2,72%	38,73%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	des Fondsvermögens				
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	58,94%	36,36%	61,91%	47,54%
Benchmark – Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	62,82%	30,10%	61,81%	34,66%
Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	27,92%	0,00	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,42	27,92%	0,00	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs : Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,20	22,92%	0,23	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	27,92%	0,52	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs : Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	4,08	22,51%	9,55	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,87	27,92%	2,93	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,73	27,92%	3,95	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs : Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,17	27,92%	0,25	24,75%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,44	27,92%	0,58	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,08	22,74%	0,11	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,75	27,92%	0,58	24,75%
Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%	0,00	34,44%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,55	27,92%	0,56	24,75%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	45,78%	0,00%	49,07%
Benchmark – Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	1,23%	56,74%	0,09%	38,73%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
Benchmark – Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	1,49	0,25%	0,00	0,07%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,23	14,23%	0,26	15,47%
Benchmark – Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	8,54	13,85%	20,81	9,80%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	48,40%	0,00%	49,21%
Benchmark – Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,29%	41,14%	0,77%	38,77%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	6,49%	45,96%	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	9,45%	40,27%	13,73%	38,73%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	20,40%	20,62%	19,47%	16,04%
Benchmark – Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	17,73%	18,86%	17,94%	10,99%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	42,31%	44,38%	40,96%	46,70%
Benchmark – Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	38,68%	33,01%	38,23%	31,38%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	47,66%	0,00%	49,07%
Benchmark – Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	40,48%	0,00%	38,73%
THG-Intensität der Länder, in die	tCO2e/Mio. € Umsatz	194,13	43,36%	k. A.	k. A.

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
investiert wird (EUR)					
Benchmark – THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	222,44	52,32%	k. A.	k. A.
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	43,36%	k. A.	k. A.
Benchmark – Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,67	52,32%	k. A.	k. A.

**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:

- a) der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- b) der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- c) der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- d) der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- e) der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- f) 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.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen.

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.

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.

Die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

### **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Indikatoren für nachteilige Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die nach Einschätzung des Anlageverwalters Aufschluss über nachteilige Auswirkungen geben, wurden verwendet, um:

- a) dem Ausschluss von Emittenten, die dem Portfolio wesentlich schaden, und
- b) die Anlageverwaltung 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 aufgeführt).

Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüfte und dokumentierte die Anlageverwaltung die Wesentlichkeit der relevanten PAI für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

Wenn die Anlageverwaltung beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte sie 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 die Anlageverwaltung 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 von der Anlageverwaltung 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, welche 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:

- Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten,
- Beschränkung des Anlageuniversums des Fonds und
- Hilfestellung für thematisches Engagement

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die von den Anlageverwaltern als „Umweltchampions“ eingestuft wurden. „Umweltchampions“ wurden anhand von zwei proprietären ESG-Rankings identifiziert:

- Der Energy and Environment Transition Index (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 verwendete 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 Anlageverwaltung schloss 2023 die obligatorische Einflussnahme auf 5 % der Beteiligungen erfolgreich ab, die in Bezug auf ihre Gesamtexponierung gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

PAI-Kennzahlen entsprechen den Durchschnittswerten am 29. September 2023, 29. Dezember 2023, 29. März 2024 und 30. Juni 2024.

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	2 151,85	37,70%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	19,49	26,04%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	431,04	37,70%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	3,51	26,04%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	23 254,20	37,70%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	153,49	26,04%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	2 582,89	37,70%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	23,00	26,04%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	25 837,09	37,70%
Benchmark – THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	176,49	26,04%
CO2-Bilanz 1&2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	16,74	37,70%
Benchmark – CO2-Bilanz 1 & 2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	63,92	26,04%
Geschätzte CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	178,21	37,70%
Benchmark – Geschätzte CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	489,13	26,04%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	25,93	49,05%
Benchmark – THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	57,63	41,61%
Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	923,39	49,05%
Benchmark – Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	1 112,77	41,62%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	1,82%	45,96%
Benchmark– Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	2,53%	40,27%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	58,94%	36,36%
Benchmark – Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	62,82%	30,10%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	27,92%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,42	27,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,20	22,92%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	27,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	4,08	22,51%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,87	27,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,73	27,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,17	27,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,44	27,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,08	22,74%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,75	27,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	22,38%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,55	27,92%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	45,78%
Benchmark – Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	1,23%	56,74%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%
Benchmark – Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	1,49	0,25%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,23	14,23%
Benchmark – Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	8,54	13,85%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	48,40%
Benchmark – Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,29%	41,14%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	6,49%	45,96%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
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	9,45%	40,27%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	20,40%	20,62%
Benchmark – Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	17,73%	18,86%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	42,31%	44,38%
Benchmark – Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	38,68%	33,01%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	47,66%
Benchmark – Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	40,48%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	194,13	43,36%
Benchmark – THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	222,44	52,32%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	43,36%
Benchmark – Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,67	52,32%



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Denmark Government International Bond 2.5% 11/18/2024 REG S	Staatsanleihen	10,30%	Dänemark
Bundesobligation 10/10/2025 REG S	Staatsanleihen	7,65%	Deutschland
European Union 11/04/2025 REG S	Staatsanleihen	5,79%	Supranational
Austria Treasury Bill 05/23/2024 TBLM	Staatsanleihen	3,70%	Österreich
Austria Treasury Bill 08/29/2024 TBLM	Staatsanleihen	3,63%	Österreich
Austria Treasury Bill 02/29/2024 TBLM	Staatsanleihen	3,47%	Österreich
German Treasury Bill 05/15/2024 TBLM	Staatsanleihen	2,64%	Deutschland
Instituto De Credito Oficial 1.3% 10/31/2026 REG S	Staatsanleihen	2,22%	Spanien
Kingdom of Belgium Treasury Bill 01/09/2025 TBLM	Staatsanleihen	1,96%	Belgien
Austria Treasury Bill 11/30/2023 TBLM	Staatsanleihen	1,77%	Österreich
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 11/29/2023 REG S	Staatsanleihen	1,42%	Italien
Italy Buoni Ordinari Del Tesoro BOT 04/12/2024 TBLM	Staatsanleihen	1,39%	Italien
Kreditanstalt Fuer Wiederaufbau .25% 06/30/2025	Staatsanleihen	1,14%	Deutschland
Romanian Government International Bond 2.875% 10/28/2024 REG S	Staatsanleihen	1,09%	Rumänien
Mercedes-Benz International Finance BV FRN 12/01/2025 REG S	Zyklische Konsumgüter	1,03%	Deutschland



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

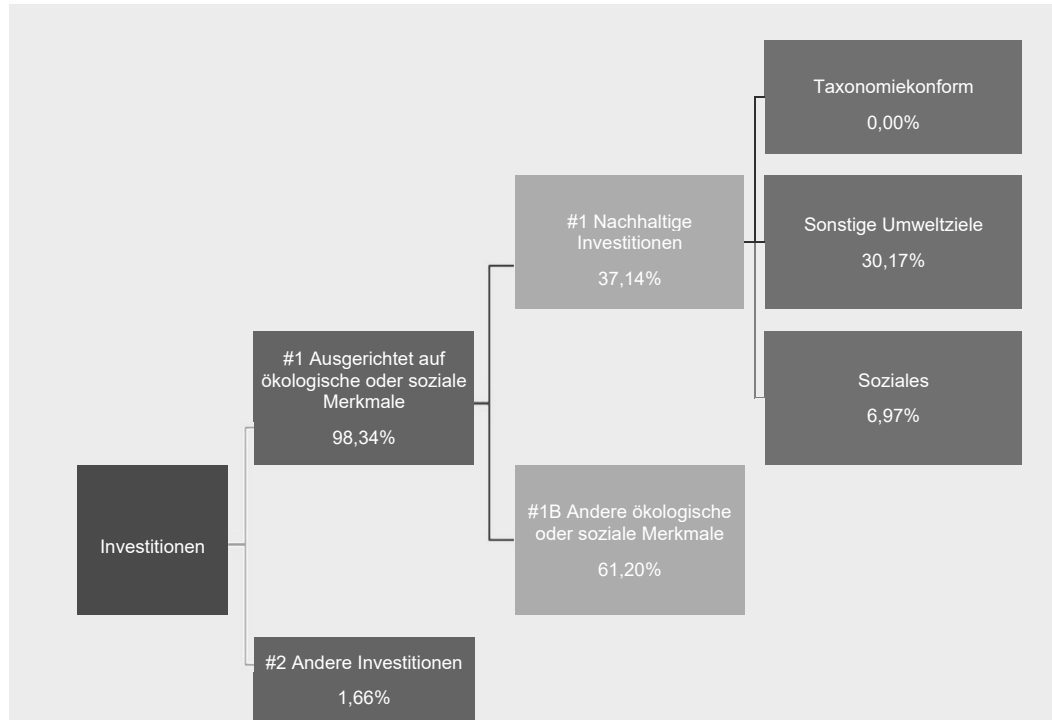
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 37,14 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,34 % des Fonds-Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,66 %) 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 37,14 % 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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

<b>Wichtigster Sektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Staatsanleihen	53,32%
Finanzsektor	32,55%
Industrie	3,51%
Gesundheitssektor	2,34%
Basiskonsumgüter	1,48%
Zyklische Konsumgüter	1,46%
Immobilien	1,37%
Versorgungsunternehmen	0,89%
Kommunikationsdienste	0,88%
Informationstechnologie	0,32%
Grundstoffe	0,19%
<b>Wichtigster Teilsektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Staatsanleihen	53,32%
Banken	23,52%
Finanzdienstleistungen	4,40%
Versicherungen	2,11%
Kapitalmärkte	1,88%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	1,19%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	1,11%
Automobilindustrie	1,10%
Pharmaindustrie	0,99%
Baustoffe	0,83%
Verkehrsinfrastruktur	0,81%
Produkte für den persönlichen Bedarf	0,79%
Getränke	0,70%
Kundenkreditgeschäft	0,65%
Industriekonzerne	0,63%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

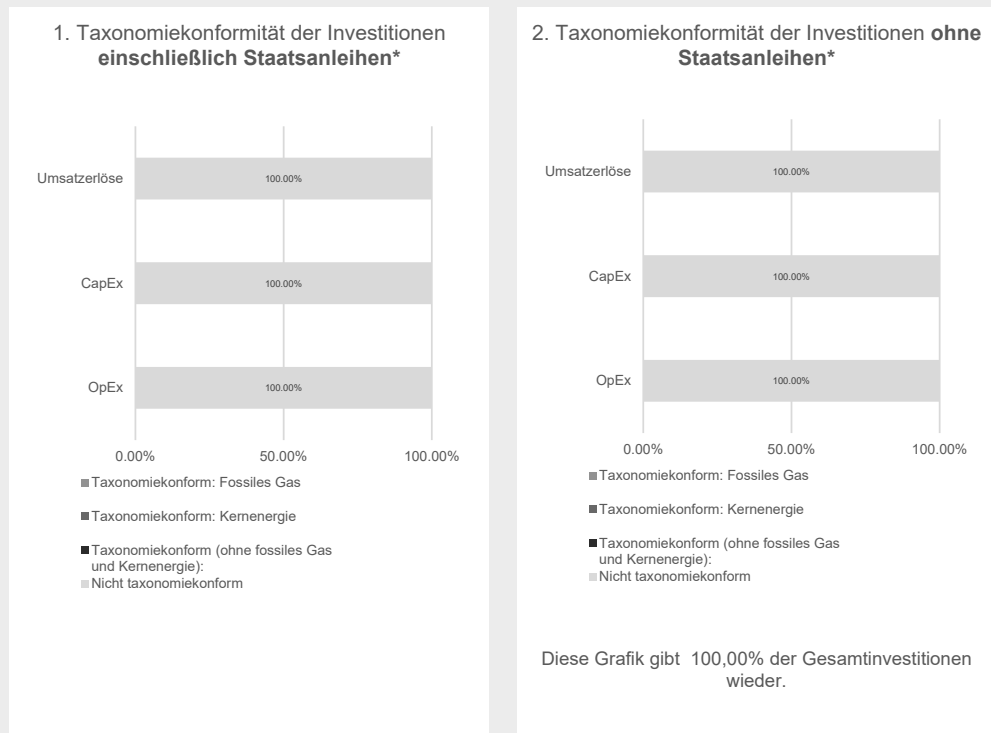
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?


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.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.


 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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Gemäß der Verpflichtung des Fonds bestand das Portfolio zu 30,17 % aus „nachhaltigen Anlagen“ laut EU-Taxonomie, deren ökologische Zielsetzung nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 6,97 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil der unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 1,66 % 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?**

Die Anlageverwaltung wandte verschiedene Methoden an, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale einzubeziehen und gleichzeitig die obligatorischen Bestandteile der Anlagestrategie einzuhalten. Diese Methoden, die im Folgenden aufgeführt werden, umfassen eine Synthese von IT-Anwendungen, qualitativen und quantitativen Analysen und Interaktionen mit den verschiedenen Stakeholdern (unter anderem). Durch die Umsetzung dieser Methoden hat der Fonds seine zugesagten ökologischen und sozialen Merkmale erreicht.

1. Der Fonds weist einen Teil seines Nettovermögens nachhaltigen Investitionen zu. Das Erreichen dieser Verpflichtung wurde durch Investitionen in Instrumente mit fester Mittelverwendung erfüllt. Diese Finanzinstrumente werden für die Finanzierung von Projekten mit positiven ökologischen oder sozialen Auswirkungen konzipiert. Um die Eignung jedes Wertpapiers als nachhaltige Anlage gemäß der Definition der Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) (siehe Abschnitt 2.17) festzustellen, führt die Anlageverwaltung eine gründliche Bewertung durch. Dabei wird unter anderem geprüft, ob die Erlöse aus grünen, sozialen oder Nachhaltigkeitsanleihen für Investitionsausgaben verwendet werden, die ökologische oder soziale Ziele fördern. Ferner untersucht die Anlageverwaltung die Indikatoren für wesentliche negative Auswirkungen (PAII) in Bezug auf den Emittenten sowie die möglichen Auswirkungen der Finanzierung von Investitionsausgaben auf diese PAII. Bei der Bewertung wird auch geprüft, ob die gesamten wirtschaftlichen Aktivitäten des Emittenten und die finanzierten Investitionsausgaben potenziell erheblichen Schaden anrichten könnten und die Governance-Praktiken des Emittenten werden auf ihre Nachhaltigkeit hin untersucht. Dieser strenge Überprüfungsprozess gewährleistet, dass nur geprüfte grüne, soziale und nachhaltige Anleihen als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

2. Die Anlageverwaltung bediente sich einer Reihe von ESG-IT-Lösungen, die nahtlos in die Compliance- und Handelsstrukturen integriert sind. Diese Systeme wurden bei der Überwachung und dem Ausschluss von Emittenten eingesetzt, die gegen zwingende Vorschriften in Bezug auf schädliche wirtschaftliche Aktivitäten oder umstrittene Geschäftspraktiken verstießen (dazu gehören auch demokratische Standards für staatliche Emittenten). Diese IT-Lösungen enthielten zwei zentrale Anwendungen – die ESG Credit Application und der Energy and Environmental Transition Index (EETI). Die Letztere glied die THG-Emissionen von Emittenten mit einer bestimmten Vergleichsgruppe innerhalb der Branche ab und identifizierte so die schlechtesten 20 % der Emittenten – die als „Nachzügler“ gelten – als nicht-investierbare Unternehmen. Zusätzlich nutzte die Anlageverwaltung sowohl interne als auch externe Informationen, wie z. B. MSCI-Daten und Datensätze von Sustainalytics, um zu untersuchen, ob die Emittenten in kontroverse Geschäftspraktiken hinsichtlich einer Abweichung von den internationalen Grundsätzen für unternehmerisches Handeln verwickelt sind oder ihre Umsatzerlöse aus schädlichen Aktivitäten stammen, wie z. B. der Rüstung, dem Abbau von Kraftwerkskohle oder der Tabakerzeugung. Eine umfassende Liste der Ausschlüsse ist in den vorvertraglichen Informationen enthalten. Dieses strenge Verfahren stellte den Ausschluss aller unzulässiger Emittenten vor der Transaktion sicher. Nach einer Transaktion überwachten die IT-Systeme diese Beschränkungen weiterhin und meldeten alle Emittenten, deren nachhaltige Merkmale eine Verschlechterung aufwiesen, um so die Notwendigkeit einer zeitnahen Veräußerung zu signalisieren.

3. Um die in den vorvertraglichen Offenlegungen beschriebene Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale zu gewährleisten, nutzte die Anlageverwaltung die „PAII App“. Diese Anwendung lieferte Informationen zu den Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAII) jedes Emittenten in Bezug auf das Anlageuniversum. Da die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds mit bestimmten PAIIs korrelieren, können Portfoliomanager im Entscheidungsfindungsprozess bei der Investition mit diesem Instrument neben anderen finanziellen und nicht-finanziellen Eigenschaften Risiken einer Exponierung in bestimmten PAII gewichten. Darüber hinaus bemühte sich die Anlageverwaltung, die Exposition auf Fondsebene mit dem Referenzindex zu vergleichen, obwohl der Fonds nicht verpflichtet ist, seine durchschnittliche PAII-Exposition unter der Benchmark zu halten. Durch diese Überwachung konnte die Effizienz des Fonds beim Erreichen der gewünschten Merkmale beurteilt und bei Bedarf die Umsetzung korrigierender Maßnahmen gesteuert werden.

4. Um ökologische und soziale Merkmale zu fördern und das obligatorische Einwirken auf Emittenten zu gewährleisten, die am stärksten in die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen involviert sind, kommunizierte die Anlageverwaltung bei persönlichen Treffen, Internetmeetings und schriftlich mit den Emittenten. Diese Kommunikation erfolgte mit Portfoliounternehmen, die an dieser und anderen von der Anlageverwaltung gemanagten Strategien beteiligt sind.

- Internetmeetings sind nach wie vor die kosteneffizienteste Lösung, denn sie ermöglichen der Anlageverwaltung den Dialog mit der Geschäftsleitung, Investor Relations und Nachhaltigkeitsfachleuten zur Diskussion über Themen mit Nachhaltigkeitsbezug. Bei diesen Gesprächen wurden die Emittenten unter anderem zu bestimmten Kontroversen befragt, um ihre Positionen besser zu verstehen. Bei Bedarf wurden sie aufgefordert, zur Abhilfe gegenüber betroffenen Bevölkerungsgruppen und Ökosystemen eine proaktivere Haltung einzunehmen. Zudem besprach die Anlageverwaltung bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken oder -chancen, die für Emittenten wesentlich oder Teil eines thematischen Dialogs zu vorab ausgewählten Themen waren, wie zum

Beispiel Schutz der Artenvielfalt, Auslaufen der Kohleförderung und -nutzung, geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle, Sicherheit der künstlichen Intelligenz (KI) und Verringerung von Methanemissionen.

- Die schriftliche Kommunikation umfasste Briefe an Emittenten, in denen die Anlageverwaltung ihre Meinung zu Themen äußerte, die sie für den Emittenten oder dessen Wirtschaftszweig als wichtig erachtete. Die Anlageverwaltung bat Portfoliounternehmen aus bestimmten Sektoren auch darum, Fragebogen zur Informationsbeschaffung auszufüllen, um bessere Investitionsentscheidungen zu ermöglichen. So wurden zum Beispiel Umfragen an Finanzinstitute verschickt, in denen deren Beteiligung an Krediten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen erfragt wurde, um Investitionen in diejenigen zu fördern, bei denen eine strategische Verpflichtung besteht, nicht in Öl-, Gas- und Kohleprojekte zu investieren.
- Schließlich hatte die Anlageverwaltung bei Branchenveranstaltungen wie der EuroMoney Conference in Wien im Januar 2024, der Erste Group ESG CEE Konferenz in Wien im Mai 2024 und dem Investor Relations Forum 2024 in Breslau die Gelegenheit, eine größere Gruppe von Stakeholdern persönlich zu treffen. Bei diesen Konferenzen hielt die Anlageverwaltung Workshops und nahm an Panels teil und konnte so über die Best Practices des nachhaltigen Investierens informieren.



## 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 Future of Food UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
254900T2UOKB4G772S89



**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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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**

- Es wurden damit 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
- Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

**NEIN**

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,89 % 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
- Es wurden damit 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/oder soziale Merkmale durch Abbildung des Solactive Sustainable Food Index. Durch seine Konzeption bietet der Solactive Sustainable Food Index ein Engagement in Unternehmen mit Verbindung zur Lebensmittelindustrie, die nachhaltige Methoden und Prozesse anwenden. Unternehmen in Index mussten einen positiven Beitrag zur einigen der wichtigsten nachhaltigen Entwicklungszielen der UN leisten, unter anderem SDG 2 (Hunger beenden), SDG 9 (Industrie, Innovation und Infrastruktur), SDG 12 (verantwortungsvoller Konsum und Produktion), SDG 13 (Maßnahmen zum Klimaschutz), SDG 14 (Leben unter Wasser) oder SDG 15 (Leben an Land). Zusätzlich wurden alle Unternehmen, die eines der 17 UN-SDGs wesentlich behinderten, aus dem Index und dem Fonds ausgeschlossen.

Der Index förderte ökologische Merkmale durch Ausschluss von Unternehmen, die einen Bezug zu Aktivitäten wie fossilen Brennstoffen, Aktivitäten, die sich negativ auf die Artenvielfalt auswirkten oder Aktivitäten, die der Umwelt schaden hatten oder Erträge daraus erzielten. Unternehmen mit überdurchschnittlich hohen CO<sub>2</sub>-Emissionen im Vergleich zur Peer Group wurden ebenfalls ausgeschlossen. 27,7 % des gesamten Fonds bestand aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischer Zielsetzung.

Der Fonds förderte auch soziale Merkmale, indem er Unternehmen ausschloss, die an der Herstellung von Waffen oder Aktivitäten wie Alkohol, Glücksspiel, Pornografie oder Tabak beteiligt waren. Alle Unternehmen, die gegen internationale Standards wie den UN Global Compact (UNGC) verstießen, wurden ebenfalls vom Index ausgeschlossen. Alle Unternehmen ohne weibliche Geschäftsleitungsmitglieder waren vom Index ausgeschlossen. 8,19 % des gesamten Fonds bestand aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischer Zielsetzung.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

- 1) Am Ende des Berichtszeitraums lag der Prozentsatz des Portfolios, der zu den UN-SDs beitrug, bei 100 %.
- 2) Am Ende des Berichtszeitraums lag der Prozentsatz des Portfolios, der auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet war, bei 99,84 %.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der zu den unten genannten UN-SDGs beiträgt, als Antwort auf die Frage „Welche Ziele verfolgen die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei“.	100,00%	91,76%

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die oben angeführten ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist und eine Antwort auf die Frage „Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?“ liefert.	99,84%	71,97%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Mit seinen nachhaltigen Investitionen zielte der Fonds darauf ab, die Bereitstellung von Waren oder Dienstleistungen im Zusammenhang mit der nachhaltigen Lebensmittelproduktion zu fördern. Die Unternehmen waren Bestandteile des Index. Der ist ein diversifizierter Aktien-Richtindex und besteht aus Unternehmen, die durch ihre innovativen Methoden und Prozesse ein nachhaltiges Lebensmittel-Ökosystem schaffen. Die Unternehmen mussten zudem einen positiven Beitrag zu mehreren relevanten UN-SDGs leisten. Der Referenzindex schließt zudem Unternehmen aus, die nicht mit spezifischen ökologischen und sozialen Bewertungs-Screenings vereinbar sind, und enthält Unternehmen mit starken Nachhaltigkeitsprofilen. Die nachhaltigen Investitionen waren auch in der Lage, mit einem Umwelt- oder sozialen Ziel Umsätze zu generieren und erfüllten die DNSH-Kriterien („Do No Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Das Anlageziel des Fonds sah zwar keine nachhaltigen Investitionen vor, aber mindestens 15 % des Fonds war in Wertpapiere investiert, 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 Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 27,70 % der Wertpapiere des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel angelegt.

Das Anlageziel des Fonds sah zwar keine nachhaltigen Investitionen vor, aber mindestens 5 % des Fonds waren in Wertpapiere investiert, 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 8,19 % 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 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 Kraftwerkskohle
- Weniger als 5 % Umsatz aus tabakbezogenen Aktivitäten
- Ist kein Tabakhersteller
- Keine Beteiligung an schwerwiegenden ESG-Kontroversen.

Am Ende des Berichtszeitraums lag der Prozentsatz der Unternehmen, die eines der SDGs wesentlich behinderten, bei 0 %.

Darüber hinaus waren keine Unternehmen mit einem Governance-Score von D oder niedriger im Fonds enthalten.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Index, den der Fonds nachbildete, enthält 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)
- Aktivitäten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (Nr. 7)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact (Nr. 10)
- Fehlende Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (Nr. 13)
- 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, welche 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 Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Hitachi Ltd ORD JPY NPV	Industrie	4,24%	Japan
DuPont de Nemours Inc COM USD 0.01	Grundstoffe	4,19%	USA
Dow Inc COM USD 0.01	Grundstoffe	3,96%	USA
Deere & Co COM USD1	Industrie	3,94%	USA
Unilever PLC ORD GBP.0311	Basiskonsumgüter	3,92%	Vereinigtes Königreich
Xylem Inc/NY COM USD NPV	Industrie	3,91%	USA
Danone SA ORD EUR.25	Basiskonsumgüter	3,79%	Frankreich
American Water Works Co Inc COM USD NPV	Versorgungsunternehmen	3,76%	USA
Nutrien Ltd ORD CAD 1	Grundstoffe	3,74%	Kanada
Sysco Corp COM USD1	Basiskonsumgüter	3,58%	USA
Bayer AG ORD EUR NPV *REGISTERED SHARES*	Gesundheitssektor	3,35%	Deutschland
Ecolab Inc COM USD1	Grundstoffe	3,16%	USA
DSM-Firmenich AG ORD EUR 0.01	Grundstoffe	2,91%	Schweiz
Kubota Corp ORD JPY NPV	Industrie	2,65%	Japan
Mosaic Co/The COM USD NPV	Grundstoffe	2,33%	USA



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

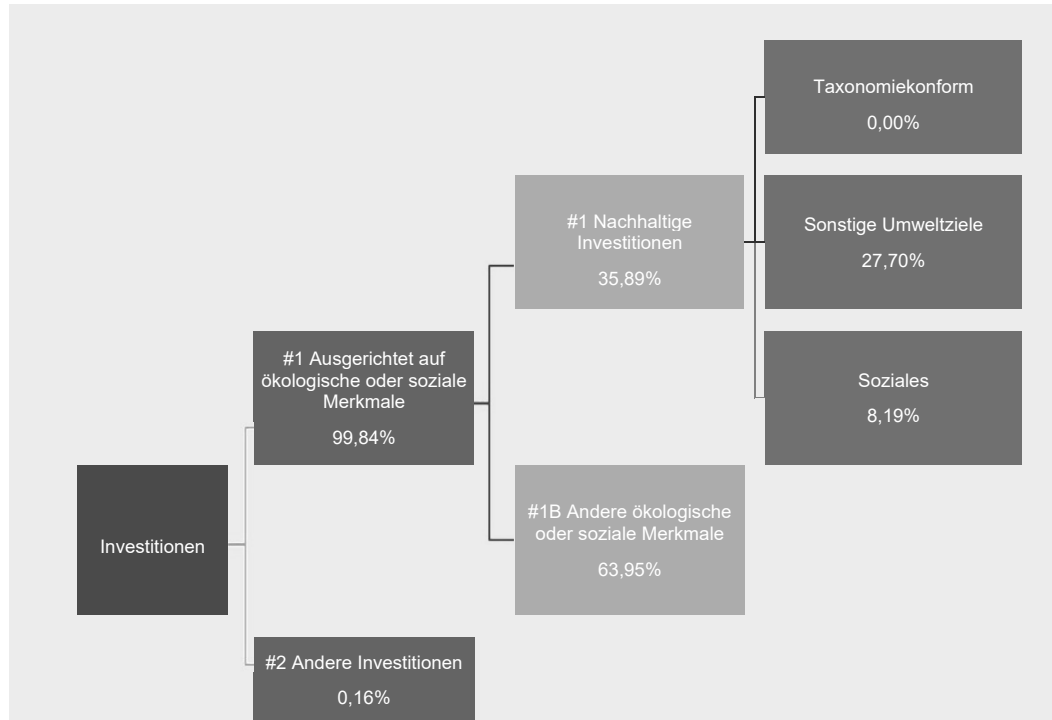
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 35,89 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,84 % des Fonds-Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,16 %) 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 35,89 % 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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Grundstoffe	31,43%
Industrie	28,47%
Basiskonsumgüter	22,38%
Versorgungsunternehmen	11,23%
Gesundheitssektor	3,35%
Informationstechnologie	1,70%
Energie	1,27%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Chemische Erzeugnisse	26,77%
Maschinen	20,79%
Wasserversorger	11,23%
Lebensmittel	10,34%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	5,45%
Behältnisse u. Verpackungen	4,66%
Industriekonzerne	4,24%
Produkte für den persönlichen Bedarf	3,92%
Pharmaindustrie	3,35%
Haushaltsartikel	2,67%
Baustoffe	2,42%
Elektronische Ausrüstung, Geräte u. Komponenten	1,70%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	1,27%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	1,01%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

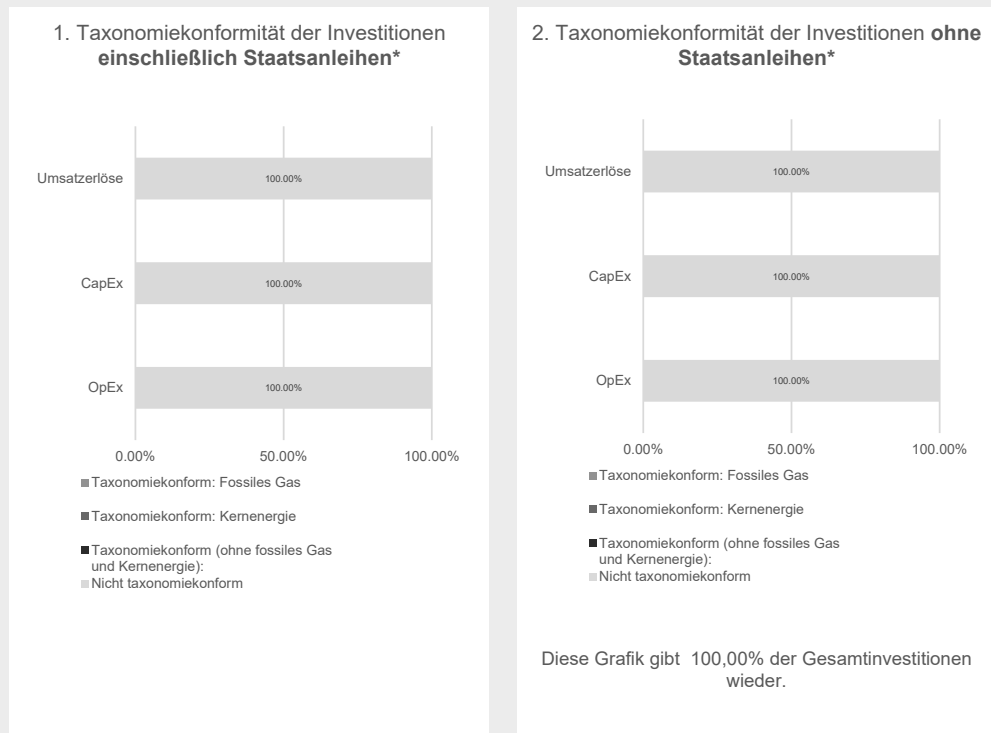
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?


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.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.


 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 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 27,70 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 8,19 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil der Investitionen, die unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ fielen, betrug 0,16 % und umfasste hauptsächlich liquide Mittel oder Emittenten 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 schloss der Index Aktien von Unternehmen aus, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds zu fördern. Darüber hinaus überprüfte der ESG-Datenanbieter alle Aktien im Hauptindex, um sicherzustellen, dass die in der Fondsbenchmark enthaltenen Wertpapiere einen positiven Beitrag zu den genannten UN-SDGs leisteten. Wertpapiere, die eines der UN-SDGs wesentlich behinderten, waren nicht im Referenzindex des Fonds enthalten.

Der Index wird halbjährlich überprüft und neu gewichtet und alle Wertpapiere wurden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Die Anlageverwaltung überwachte das Portfolio regelmäßig, stellte sicher, dass der Fonds weiterhin die Index-Methodik einhält und analysierte die Investments auf Portfolioebene auf mögliche nachteilige Auswirkungen der Indexnachbildung. Die Anlageverwaltung stellte sicher, dass die Fondsanlagen den Index weiterhin eng nachbildeten und gewährleistete so die Einhaltung der ESG-Merkmale des Index.

Wertpapiere, die die Kriterien für den Verbleib im Index nicht mehr erfüllten, werden bei der Neugewichtung aus dem Portfolio herausgenommen und vom Fonds abgestoßen.

Für alle unsere ETF Fondsreihen erfolgt eine Stimmrechtsvertretung, die sich an den Sustainability Voting Guidelines von ISS (Institutional Shareholder Services), unserem Berater für die Stimmrechtsausübung, orientiert. Die letztendliche Entscheidung liegt bei unseren PortfoliomanagerInnen, die auf den Versammlungen nach ihrem eigenen Ermessen abstimmen können und sich an den Abstimmungsleitlinien des Franklin Templeton Stewardship Team orientieren. 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.

Weitere Informationen über den Index enthält die Indexmethodik unter <https://www.solactive.com/documents/equity-index-methodology>

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Breite Marktindizes sind nach Marktkapitalisierung gewichtet, außer Größe und Investierbarkeit gibt es keine weiteren Ausschlusskriterien. Der Index konzentriert sich auf Unternehmen, die nachhaltige Praktiken anwenden, Technologien einsetzen und Innovationen in der Lebensmittelindustrie demonstrieren sowie die durch traditionelle Methoden der Lebensmittelproduktion verursachten Umweltschäden mindern. Die Indexgewichtung richtet sich auch nach dem Beitrag des Unternehmens zu den nachhaltigen Entwicklungszielen der UN. Die Indexmethodik umfasst zudem eine Reihe wertebasierter sozialer und ökologischer Ausschlusskriterien sowie Ausschlüsse von Unternehmen mit schlechter Governance und Unternehmen, die gegen internationale Standards wie zum Beispiel den UN Global Compact verstoßen.

### ● **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 Future of Food UCITS ETF	Solactive Sustainable Food Index-NR	Solactive GBS Developed Markets All Cap Index
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der zu den unten genannten UN-SDGs beiträgt, als Antwort auf die Frage „Welche Ziele verfolgen die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“	100,00%	100,00%	91,76%
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die oben angeführten ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist und eine Antwort auf die Frage „Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?“ liefert.	99,84%	100,00%	71,97%

# Franklin Future of Health and Wellness UCITS ETF (der „Fonds“)



**FRANKLIN  
TEMPLETON**

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
2549006ZSE31T4A6XW64

## 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- Es wurden damit **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
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt**: 0,00%

**NEIN**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 38,00 % 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
- Es wurden damit **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/oder soziale Merkmale, indem er den Solactive Sustainable Health and Wellness Index abbildete. Er zielt darauf ab, ein Engagement in Unternehmen zu ermöglichen, die weltweit nachhaltige Produkte und Dienstleistungen in den Bereichen Gesundheit und Wohlergehen anbieten. Unternehmen im Index müssen einen positiven Beitrag zum UN-SDG 3 (Gesundheit und Wohlergehen) leisten. Darüber hinaus wurde jedes Unternehmen, das eines der 17 UN-SDGs wesentlich behinderte, aus dem Index und dem Fonds ausgeschlossen.

Der Index förderte ökologische und soziale Merkmale durch Ausschluss von Unternehmen, die einen Bezug zu Aktivitäten wie fossile Brennstoffe, Herstellung von Waffen, Alkohol, Glücksspiel, Erwachsenenunterhaltung oder Tabak hatten oder daraus Umsätze erzielten. Darüber hinaus wurde jedes Unternehmen, das gegen internationale Standards wie UNGC verstieß oder an schwerwiegenden ESG-Kontroversen beteiligt war, aus dem Fonds ausgeschlossen.

32,7 % des Gesamtvermögens des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel und 5,3 % des Portfolios auf nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

- 1) Am Ende des Berichtszeitraums lag der Prozentsatz des Portfolios, der zu UN-SDG 3 (Gesundheit und Wohlergehen) beitrug, bei 100 %.
- 2) Am Ende des Berichtszeitraums lag der Prozentsatz des Portfolios, der auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet war, bei 99,89 %.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der zum SDG 3 (Gesundheit und Wohlergehen) beiträgt und unten in der Antwort auf die Frage „Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“ aufgeführt ist.	100,00%	60,58%

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die oben angeführten ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist und eine Antwort auf die Frage „Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?“ liefert.	99,89%	81,00%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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 Produkten und Dienstleistungen, die zu Gesundheit und Wohlergehen beitragen. Die Unternehmen waren Bestandteile des Index. Bei dem Index handelt es sich um eine diversifizierte Aktienbenchmark, die sich aus Unternehmen zusammensetzt, die in der Gesundheitsbranche Technologien einsetzen und Innovationen vorweisen können, sowie aus Unternehmen, die den Zugang zu Pflege-, Gesundheits- oder Wellnessangeboten für ein breites Spektrum von Verbrauchern, einschließlich älterer Menschen, ermöglichen.

Die Unternehmen mussten auch einen positiven Beitrag zu UN-SDG 3 (Gesundheit und Wohlergehen) leisten. Die Benchmark schließt zudem Unternehmen aus, die nicht mit spezifischen ökologischen und sozialen Bewertungs-Screenings vereinbar sind, und enthält Unternehmen mit starken Nachhaltigkeitsprofilen. Die nachhaltigen Investitionen waren zudem in der Lage, mit einem Umwelt- oder sozialen Ziel Umsätze zu generieren und erfüllten die DNSH-Kriterien („Do No Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, wurden mindestens 5 % des Fonds in Wertpapiere investiert, 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 Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 5,30 % der Wertpapiere des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel angelegt.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, wurden mindestens 15 % des Fonds in Wertpapiere investiert, 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 („Do No Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 32,70 % 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?**

Durch Nachbildung des Index konnte der Fonds darüber hinaus die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen 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 basierend auf Geschäftstätigkeiten erfüllt, wie zum Beispiel:

- Umstrittene Waffen
- Konventionelle Waffen
- Verstöße gegen internationale Standards, einschließlich UNGC und OECD
- Tabak, Erwachsenenunterhaltung, Alkohol und Glücksspiel
- Fossile Brennstoffe
- Tätigkeiten, die Umweltschäden verursachen
- Tätigkeiten, die sich nachteilig auf die biologische Vielfalt auswirken

Am Ende des Berichtszeitraums lag der Prozentsatz der Unternehmen, die eines der SDGs wesentlich behinderten, bei 0 %.

Darüber hinaus waren keine Unternehmen mit einem Governance-Score von D oder niedriger im Fonds enthalten.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Index, den der Fonds nachbildete, 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)
- Aktivitäten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (Nr. 7)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact (Nr. 10)
- Fehlende Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (Nr. 13)
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (Nr. 14)

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.

## 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, welche 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 Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Eli Lilly & Co COM NPV	Gesundheitssektor	3,68%	USA
Novo Nordisk A/S ORD DKK.1 CL B	Gesundheitssektor	3,48%	Dänemark
AstraZeneca PLC ORD GBP.25	Gesundheitssektor	3,37%	Vereinigtes Königreich
Merck & Co Inc COM USD.5	Gesundheitssektor	3,27%	USA
Abbott Laboratories COM NPV	Gesundheitssektor	3,09%	USA
AbbVie Inc COM USD NPV	Gesundheitssektor	3,09%	USA
Thermo Fisher Scientific Inc COM USD1	Gesundheitssektor	2,87%	USA
Roche Holding AG ORD CHF NPV	Gesundheitssektor	2,83%	Schweiz
Intuitive Surgical Inc COM USD.001	Gesundheitssektor	2,65%	USA
Pfizer Inc COM USD.05	Gesundheitssektor	2,63%	USA
Stryker Corp COM USD.1	Gesundheitssektor	2,34%	USA
Medtronic PLC ORD USD.1	Gesundheitssektor	2,22%	USA
Sanofi SA ORD EUR2	Gesundheitssektor	2,21%	Frankreich
Elevance Health Inc COM USD.01	Gesundheitssektor	2,09%	USA
L'Oreal SA ORD EUR.2	Basiskonsumgüter	2,08%	Frankreich



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

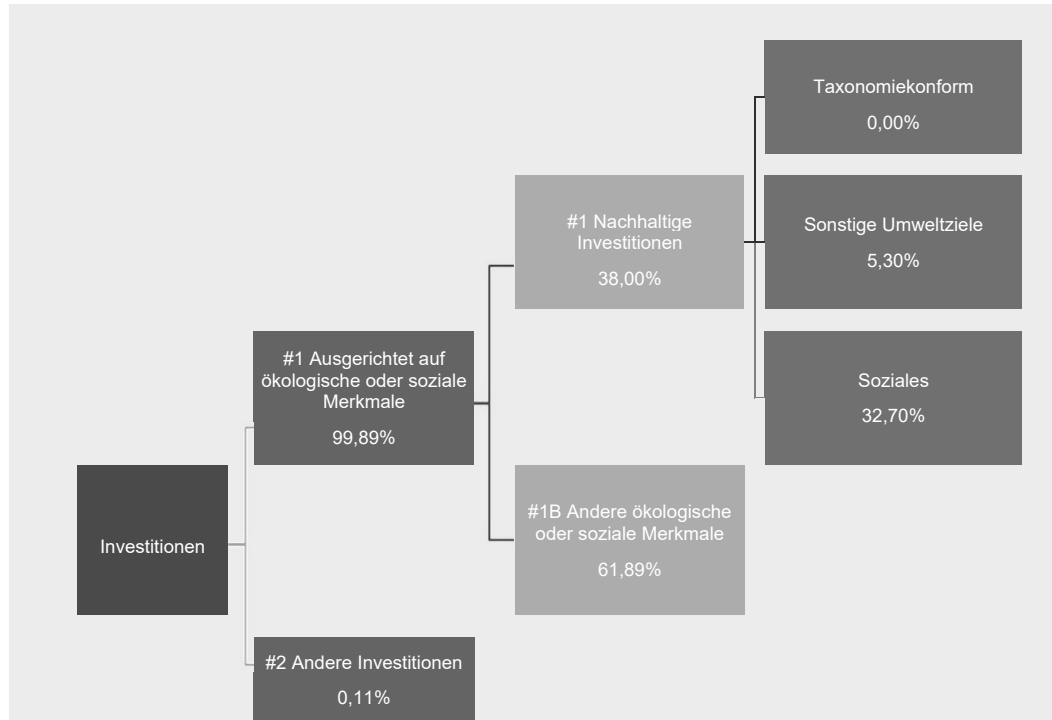
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 38,00 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,89 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,11 %) 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 38,00 % 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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

<b>Wichtigster Sektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Gesundheitssektor	88,89%
Zyklische Konsumgüter	4,91%
Basiskonsumgüter	2,70%
Informationstechnologie	1,88%
Industrie	1,50%
<b>Wichtigster Teilsektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	29,00%
Pharmaindustrie	27,08%
Biotechnologie	14,67%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	11,04%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	5,26%
Produkte für den persönlichen Bedarf	2,08%
Gesundheitstechnologie	1,84%
Langlebige Haushaltsgüter	1,40%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	1,17%
Elektronische Ausrüstung, Geräte u. Komponenten	0,96%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	0,93%
Fachhandel	0,74%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	0,73%
Diversifizierte Verbraucherdienstleistungen	0,65%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	0,62%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

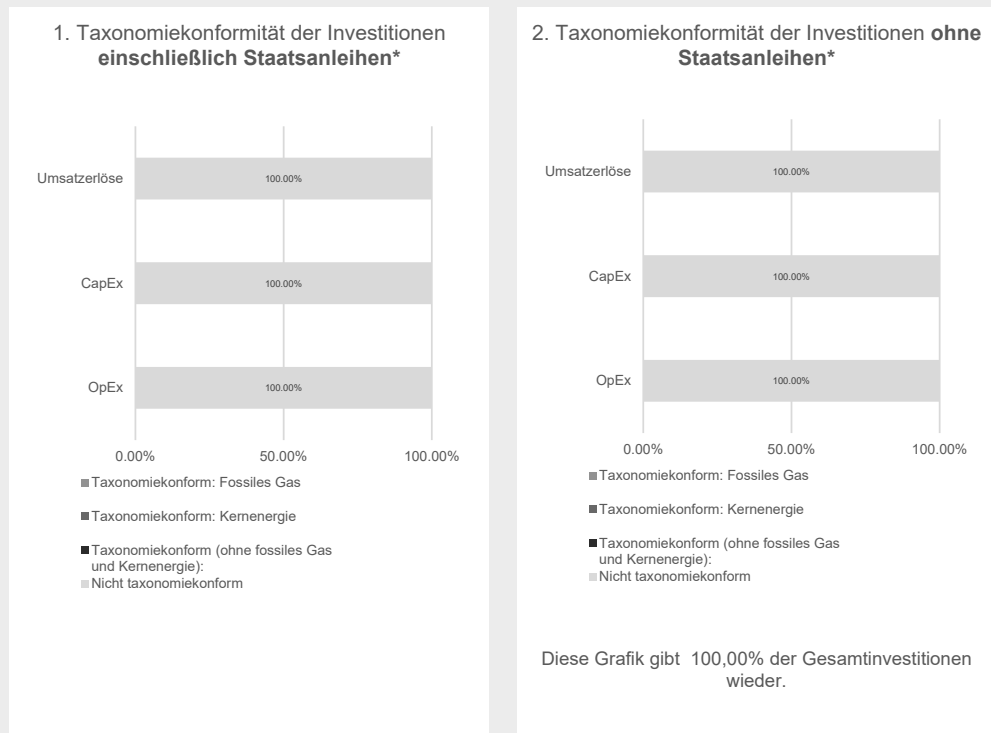
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?

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.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.



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 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 können, enthielt der Fonds 5,3 % „nachhaltige Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 32,70 %.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil der Investitionen, die unter „#2 Andere Investitionen“ fielen, betrug 0,11 % und umfasste hauptsächlich liquide Mittel oder Emittenten 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, schloss der Index Aktien von Unternehmen aus, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds zu fördern. Darüber hinaus überprüfte der ESG-Datenanbieter alle Aktien im Hauptindex, um sicherzustellen, dass die in der Fondsbenchmark enthaltenen Wertpapiere einen positiven Beitrag zu UN-SDG 3 leisteten. Wertpapiere, die eines der UN-SDGs wesentlich behinderten, waren nicht im Fonds enthalten. Unternehmen mit der schlechtesten Leistung gemessen am Governance-Score (D oder niedriger) wurden aus dem Index ausgeschlossen. Darüber hinaus wurden nur Unternehmen aufgenommen, in deren Leitungs- und Kontrollorganen Frauen vertreten sind.

Der Index wird halbjährlich überprüft und neu gewichtet und alle Wertpapiere wurden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwachte das Portfolio regelmäßig und stellte sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtete. Er überprüfte die Investments auf Portfolioebene auf mögliche nachteilige Auswirkungen durch die Indexnachbildung. Der Anlageverwalter stellte sicher, dass die Fondsanlagen den Index stets eng nachbildeten, damit die Ausrichtung auf die ESG-Merkmale des Index gewährleistet war.

Wertpapiere, die die Kriterien für den Verbleib im Index nicht mehr erfüllten, werden bei der Neugewichtung aus dem Portfolio herausgenommen und vom Fonds abgestoßen.

Für alle unsere ETF Fondsreihe erfolgt eine Stimmrechtsvertretung, die sich an den Sustainability Voting Guidelines von ISS (Institutional Shareholder Services), unserem Berater für die Stimmrechtsausübung, orientiert. Die letztendliche Entscheidung liegt bei unseren Portfoliomanagern, die auf den Versammlungen nach ihrem eigenen Ermessen abstimmen können und sich an den Abstimmungsleitlinien des Franklin Templeton Stewardship Team orientieren. 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.

Weitere Informationen über den Index enthält die Indexmethodik unter <https://www.solactive.com/documents/equity-index-methodology>

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Breite Marktindizes sind nach Marktkapitalisierung gewichtet, außer Größe und Investierbarkeit gibt es keine weiteren Ausschlusskriterien. Der Index konzentriert sich auf Unternehmen, die nachhaltige Praktiken anwenden, Technologien einsetzen und Innovationen in der Lebensmittelindustrie demonstrieren sowie die durch traditionelle Methoden der Lebensmittelproduktion verursachten Umweltschäden mindern. Die Indexgewichtung richtet sich auch nach dem Beitrag des Unternehmens zu den nachhaltigen Entwicklungszielen der UN. Die Indexmethodik umfasst zudem eine Reihe wertebasierter sozialer und ökologischer Ausschlusskriterien sowie Ausschlüsse von Unternehmen mit schlechter Governance und Unternehmen, die gegen internationale Standards wie zum Beispiel den UN Global Compact verstoßen.

### ● **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 Future of Health and Wellness UCITS ETF	Solactive Health and Wellness Index-NR	Solactive GBS Developed Markets All Cap Index
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der zum SDG 3 (Gesundheit und Wohlergehen) beiträgt und unten in der Antwort auf die Frage „Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“ aufgeführt ist.	100,00%	100,00%	60,58%
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die oben angeführten ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist und eine Antwort auf die Frage „Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?“ liefert.	99,89%	100,00%	81,00%

# 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- Es wurden damit 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
- Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

NEIN

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 20,56 % 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
- Es wurden damit 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 folgenden ökologischen und sozialen Merkmale:

- i) Investition in ökologisch und sozial verantwortungsvolle Unternehmen und
- ii) 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 beachtetten.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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 21 % niedriger als beim Hauptindex (850 gegenüber 1075). Als Grundlage dienten Daten von MSCI. Der Index erreichte zudem einen ESG-Score von 8,5 (Hauptindex MSCI ACWI: 6,85).

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
MSCI ESG-Rating-Score der Referenz-Benchmark im Vergleich zum Hauptindex	8,50	6,85

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
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)	850,00	1 075,00

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die CO2-Intensität des Fonds erhöhte sich im Beobachtungszeitraum, hauptsächlich aufgrund höherer Scope 3-CO2-Emissionen. Die durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO2-Intensität im Jahr 2024 war um 29,7 % höher als 2023. Der MSCI ESG Score des Fonds hat sich im Beobachtungszeitraum von 8,4 auf 8,5 verbessert.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2024		2023	
	Wert	Referenzwert	Wert	Referenzwert
MSCI ESG-Rating-Score der Referenz-Benchmark im Vergleich zum Hauptindex	8,50	6,85	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)	850,00	1 075,00	654,80	973,00

### 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 Unternehmen waren Bestandteil des Index. Bei dem Index handelt es sich um eine diversifizierte SRI-Benchmark, die Unternehmen ausschließt, die nicht mit spezifischen ökologischen und sozialen Bewertungs-Screenings vereinbar sind, und enthält Unternehmen mit starken Nachhaltigkeitsprofilen. 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, wurden 5 % des Fonds in Wertpapiere investiert, die als nachhaltig mit Umweltziel 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 10,18 % der Wertpapiere des Fonds in nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel angelegt.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, wurden mindestens 5 % des Fonds in Wertpapiere investiert, 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 beitragen und die DNSH-Kriterien („Do No Significant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 10,38 % 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?

Durch Nachbildung des Index konnte der Fonds darüber hinaus die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen 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

### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Index, den der Fonds nachbildete, 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)

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.

## 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, welche 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?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Phillips 66 COM USD NPV	Energie	1,15%	USA
Valero Energy Corp COM USD.01	Energie	1,13%	USA
Old Dominion Freight Line Inc COM USD.1	Industrie	1,09%	USA
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc ORD JPY NPV	Finanzsektor	1,08%	Japan
Home Depot Inc/The COM USD0.05	Zyklische Konsumgüter	1,08%	USA
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ORD TWD10	Informationstechnologie	1,08%	Taiwan
Novo Nordisk A/S ORD DKK.1 CL B	Gesundheitssektor	1,07%	Dänemark
Cummins Inc COM USD2.5	Industrie	1,07%	USA
Bank of New York Mellon Corp/The COM USD.01	Finanzsektor	1,06%	USA
Amgen Inc COM USD.0001	Gesundheitssektor	1,06%	USA
RELX PLC ORD GBP.144397	Industrie	1,06%	Vereinigtes Königreich
Travelers Cos Inc/The COM USD NPV	Finanzsektor	1,03%	USA
WW Grainger Inc COM USD.5	Industrie	1,03%	USA
SoftBank Corp ORD JPY 1	Kommunikationsdienste	1,02%	Japan
Moody's Corp COM USD1	Finanzsektor	1,02%	USA



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

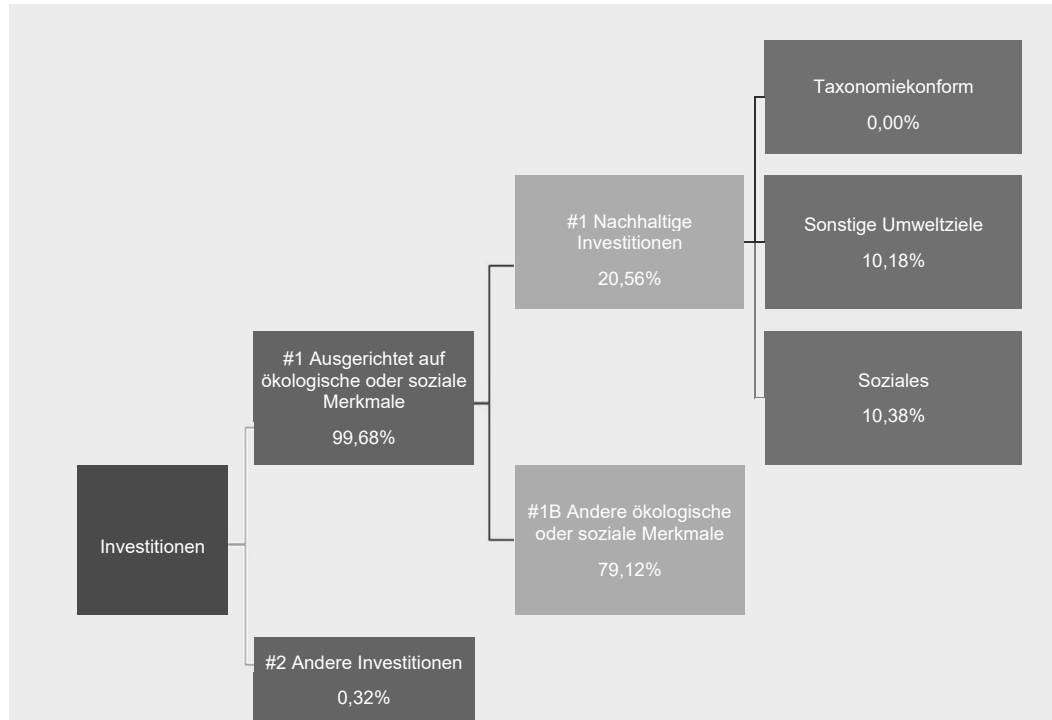
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 20,56 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,68 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,32 %) 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 20,56 % 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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	20,35%
Industrie	17,11%
Basiskonsumgüter	10,95%
Zyklische Konsumgüter	10,60%
Kommunikationsdienste	8,43%
Informationstechnologie	8,29%
Gesundheitssektor	7,84%
Grundstoffe	7,80%
Energie	4,03%
Versorgungsunternehmen	2,30%
Immobilien	1,99%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	8,22%
Versicherungen	6,95%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	6,03%
Kapitalmärkte	4,18%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,03%
Metalle u. Bergbau	3,61%
Lebensmittel	3,55%
Fachhandel	3,12%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	3,07%
Fachdienstleistungen	2,92%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	2,83%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	2,78%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,69%
Überlandtransport	2,64%
Produkte für den persönlichen Bedarf	2,63%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

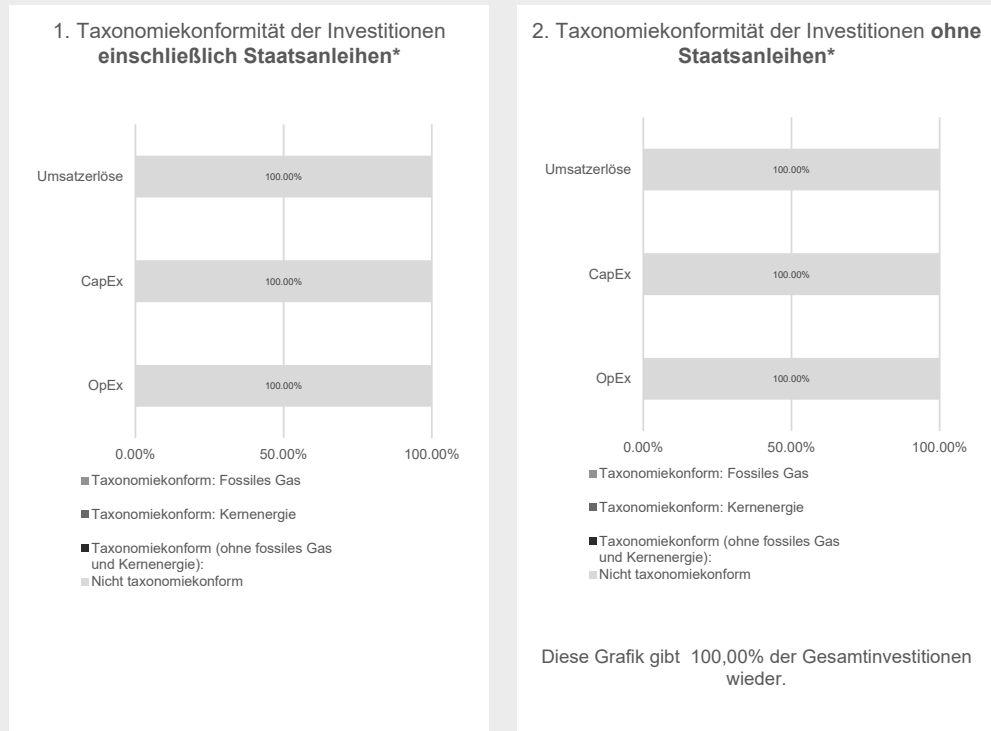
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?

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.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.



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 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 können, enthielt der Fonds 10,18 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



**Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 10,38 %.



**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 0,32 % 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, schloss der Index Aktien von Unternehmen aus, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird halbjährlich überprüft und 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.

Für alle unsere ETF Fondsreihe erfolgt eine Stimmrechtsvertretung, die sich an den Sustainability Voting Guidelines von ISS (Institutional Shareholder Services), unserem Berater für die Stimmrechtsausübung, orientiert. Die letztendliche Entscheidung liegt bei unseren Portfoliomanagern, die auf den Versammlungen nach ihrem eigenen Ermessen abstimmen können und sich an den Abstimmungsleitlinien des Franklin Templeton Stewardship Team orientieren. 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:

1. [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)
2. [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 All Cap World 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)	850,00	849,60	1 075,00
MSCI ESG Rating Score des Index im Vergleich zum Hauptindex	8,50	8,50	6,85

# 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- Es wurden damit **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
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt**: 0,00%

**NEIN**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 10,90 % 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
- Es wurden damit **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 Merkmale durch Nachbildung des MSCI China Climate Paris Aligned Net Total Return Index (der „Referenzindex“), der auf die Mindestanforderungen für die EU Paris Aligned Benchmarks (EU-PABs) ausgelegt ist. Der Fonds investierte in ein Portfolio aus chinesischen Large- und Mid-Cap-Aktien, zu denen auch alle oder ein Großteil der im zugrunde liegenden 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.

Der Index förderte zudem ökologische Merkmale durch Reduzierung der Intensität der CO<sub>2</sub>-Emissionen im Vergleich zum MSCI China Index (dem Hauptindex), reduzierte die Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen und erhöhte sein Engagement in potenziellen klimawandelbezogenen Chancen.

Weitere Ausschlüsse betrafen Aktien von Unternehmen, die einen Bezug zu umstrittenen Waffen, ESG-Kontroversen, Tabak, Abbau von Kraftwerkskohle, Stromerzeugung mit Öl, Gas und Kraftwerkskohle hatten.

Der Index schloss zudem Unternehmen aus, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform waren.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/\$ Umsatz) war um 72,3 % niedriger als beim Hauptindex (350,9 gegenüber 1.267,4). 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	Referenzwert
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)	350,90	1 267,40

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

2024 war die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/investierte Mio. USD) um 16,8 % niedriger als 2023.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2024		2023	
	Wert	Referenzwert	Wert	Referenzwert
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)	350,90	1 267,40	422,50	954,10

● **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 MSCI China Climate Paris Aligned Index, einer EU Paris-Aligned Benchmark, sind, umgesetzt. Die nachhaltigen Investitionen erfüllten auch die DNSH-Kriterien („Do No Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, wurden mindestens 10 % des Fonds in Wertpapiere investiert, 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 Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 10,90 % der Wertpapiere 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 darüber hinaus die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen 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

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Index, den der Fonds nachbildete, 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, welche 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?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Tencent Holdings Ltd ORD HKD 0.000020	Kommunikationsdienste	16,57%	China
Alibaba Group Holding Ltd ORD HKD 0.000003125	Zyklische Konsumgüter	10,41%	China
PDD Holdings Inc SPONSORED ADR	Zyklische Konsumgüter	3,96%	China
Baidu Inc ORD HKD 0.000000625 CL A	Kommunikationsdienste	2,51%	China
Netease Inc ORD HKD.0001	Kommunikationsdienste	2,25%	China
BYD Co Ltd ORD HKD1	Zyklische Konsumgüter	1,94%	China
East Money Information Co Ltd ORD CNY 1 CL A *XSEC SZ-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Finanzsektor	1,90%	China
Meituan ORD HKD 0.000010 CL B	Zyklische Konsumgüter	1,87%	China
Kweichow Moutai Co Ltd ORD CNY1 CL A *XSSC SS-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Basiskonsumgüter	1,84%	China
NARI Technology Co Ltd ORD CNY1 CL A *XSSC SS-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Industrie	1,63%	China
Li Auto Inc ORD HKD 0.0001 CL A	Zyklische Konsumgüter	1,52%	China
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd ORD CNY 1 CL A *XSSC SS-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Industrie	1,33%	China
LONGi Green Energy Technology Co Ltd ORD CNY 1 CL A *XSSC SS-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Informationstechnologie	1,32%	China
Yum China Holdings Inc COM USD.01	Zyklische Konsumgüter	1,28%	China
Sungrow Power Supply Co Ltd ORD CNY 1 *XSEC SZ-HK STOCK CONNECT NORTHBOUND*	Industrie	1,25%	China



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

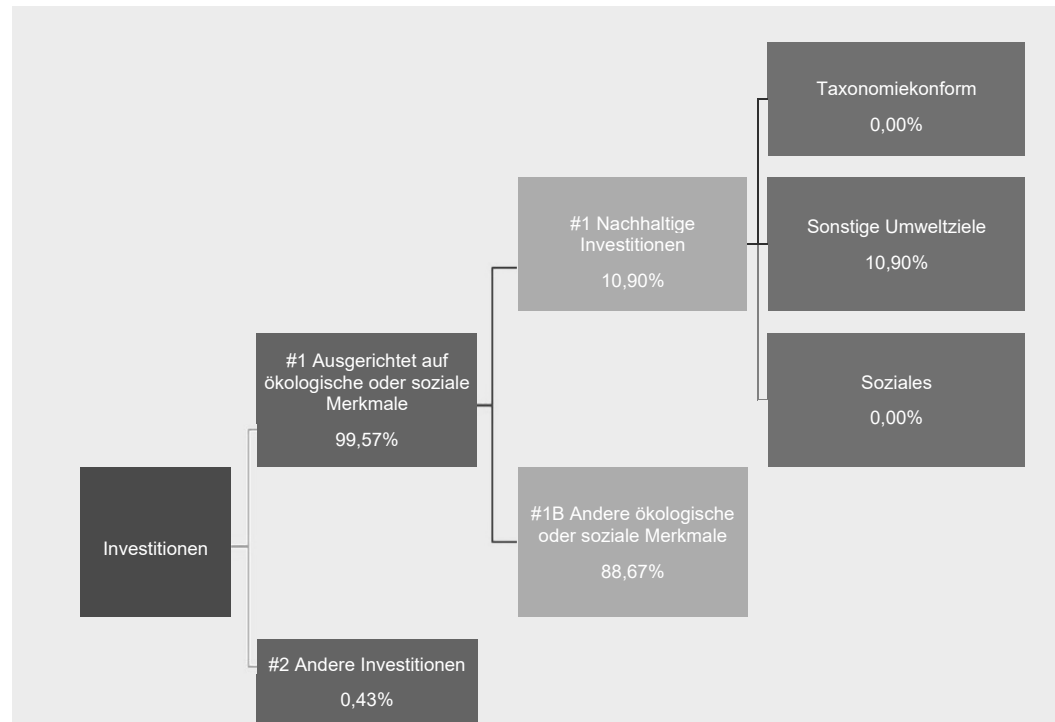
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 10,90 %.

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 (0,43 %) 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 Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 10,90 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen.



**#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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Zyklische Konsumgüter	25,95%
Kommunikationsdienste	24,29%
Finanzsektor	10,61%
Gesundheitssektor	9,76%
Informationstechnologie	9,25%
Industrie	8,67%
Basiskonsumgüter	5,26%
Versorgungsunternehmen	3,49%
Immobilien	1,90%
Grundstoffe	0,40%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	20,91%
Allgemeiner Einzelhandel	14,65%
Kapitalmärkte	7,76%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	5,17%
Getränke	4,47%
Elektronikgeräte	4,42%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	4,31%
Automobilindustrie	3,85%
Biotechnologie	3,56%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	3,37%
Pharmaindustrie	3,21%
Software	3,18%
Unterhaltung	3,13%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	1,90%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	1,65%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-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 CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

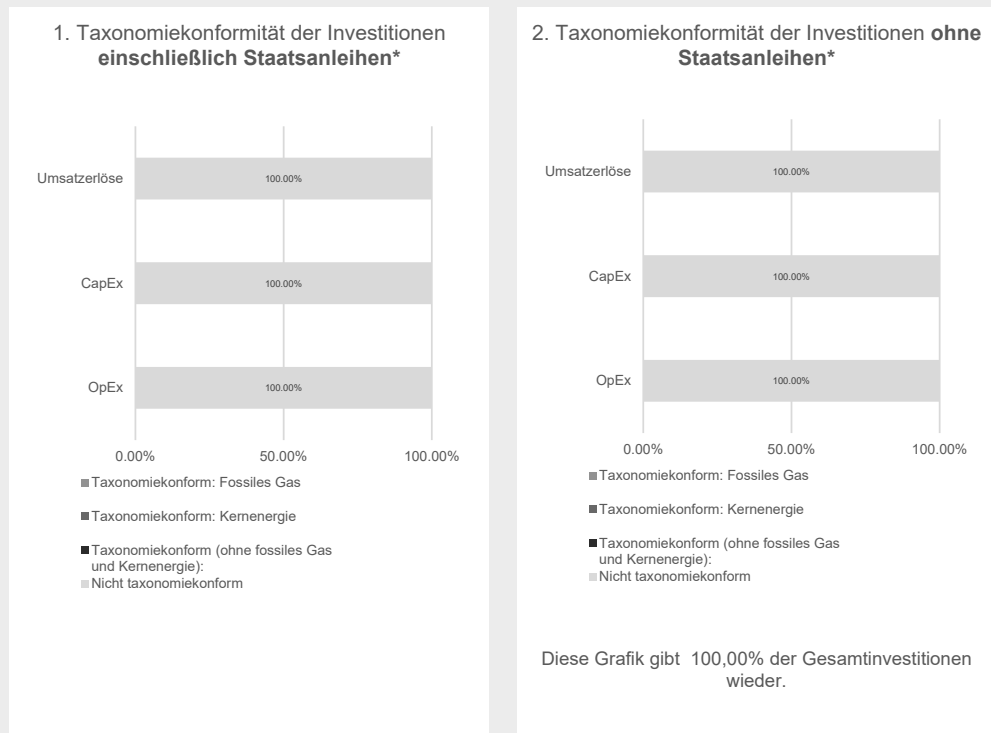
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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.

<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.




- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermögliche Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.

 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 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 können, enthielt der Fonds 10,90 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

0,0 %. Der Fonds hat keinen Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen festgelegt.



### **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 0,43 % 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, schloss der Referenzindex Aktien von Unternehmen aus, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird halbjährlich im Mai und November überprüft und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwachte das Portfolio regelmäßig und stellte sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtete. Er überprüfte 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.

Für alle unsere ETF Fondsreihe erfolgt eine Stimmrechtsvertretung, die sich an den Sustainability Voting Guidelines von ISS (Institutional Shareholder Services), unserem Berater für die Stimmrechtsausübung, orientiert. Die letztendliche Entscheidung liegt bei unseren Portfoliomanagern, die auf den Versammlungen nach ihrem eigenen Ermessen abstimmen können und sich an den Abstimmungsleitlinien des Franklin Templeton Stewardship Team orientieren. 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. (tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. USD)	350,90	351,50	1 267,40

# Franklin MSCI Emerging Markets Paris Aligned Climate UCITS ETF (der „Fonds“)



**FRANKLIN  
TEMPLETON**

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
254900TC8K24IWIZL578

## 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- Es wurden damit **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
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt**: 0,00%

**NEIN**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 13,70 % 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
- Es wurden damit **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 Merkmale durch Nachbildung des Emerging Markets Climate Paris Aligned Net Total Return Index (der „Referenzindex“), der auf die Mindestanforderungen für die EU Paris Aligned Benchmarks (EU-PABs) ausgelegt ist. Der Fonds investierte in ein Portfolio aus Large- und Mid-Cap-Aktien aus Schwellenländern, zu denen auch alle oder ein Großteil der im zugrunde liegenden 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.

Der Index förderte zudem ökologische Merkmale durch Reduzierung der Intensität der CO<sub>2</sub>-Emissionen im Vergleich zum MSCI Emerging Markets Index (dem Hauptindex), reduzierte die Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen und erhöhte sein Engagement in potenziellen klimawandelbezogenen Chancen.

Weitere Ausschlüsse betrafen Aktien von Unternehmen, die einen Bezug zu umstrittenen Waffen, ESG-Kontroversen, Tabak, Abbau von Kraftwerkskohle, Stromerzeugung mit Öl, Gas und Kraftwerkskohle hatten.

Der Index schloss zudem Unternehmen aus, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform waren.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/investierter Mio. \$) war um 66,8 % niedriger als beim Hauptindex (490,4 gegenüber 1.480,6). 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	Referenzwert
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)	490,40	1 480,60

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

2024 war die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO<sub>2</sub>-Intensität (Tonnen CO<sub>2</sub>e/investierte Mio. USD) um 8,12 % niedriger als 2023.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2024		2023	
	Wert	Referenzwert	Wert	Referenzwert
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)	490,40	1 480,60	533,60	1 203,70

● **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 MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned Index, einer EU Paris-Aligned Benchmark, sind, umgesetzt. Die nachhaltigen Investitionen erfüllten auch die DNSH-Kriterien („Do No Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, wurden mindestens 10 % des Fonds in Wertpapiere investiert, 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 Signifikant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR erfüllten. Am Ende des Referenzzeitraums waren 13,70 % der Wertpapiere 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 darüber hinaus die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen 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

**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Index, den der Fonds nachbildete, enthält 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, welche 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?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ORD TWD10	Informationstechnologie	9,65%	Taiwan
Tencent Holdings Ltd ORD HKD 0.000020	Kommunikationsdienste	4,14%	China
Samsung Electronics Co Ltd ORD KRW 100	Informationstechnologie	3,00%	Südkorea
Alibaba Group Holding Ltd ORD HKD 0.000003125	Zyklische Konsumgüter	2,42%	China
Delta Electronics Inc ORD TWD10	Informationstechnologie	1,87%	Taiwan
Bharat Electronics Ltd ORD INR1	Industrie	1,84%	Indien
Samsung SDI Co Ltd ORD KRW5000	Informationstechnologie	1,59%	Südkorea
Infosys Ltd ORD INR5 (DEMAT)	Informationstechnologie	1,33%	Indien
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV ORD MXN NPV B SHARES	Industrie	1,32%	Mexiko
Al Rajhi Bank ORD SAR10	Finanzsektor	1,18%	Saudi-Arabien
MediaTek Inc ORD TWD10	Informationstechnologie	1,13%	Taiwan
BYD Co Ltd ORD HKD1	Zyklische Konsumgüter	1,09%	China
Meituan ORD HKD 0.000010 CL B	Zyklische Konsumgüter	0,96%	China
Tata Consumer Products Ltd ORD INR1 (DEMAT)	Basiskonsumgüter	0,96%	Indien
Saudi National Bank/The ORD SAR10	Finanzsektor	0,89%	Saudi-Arabien



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

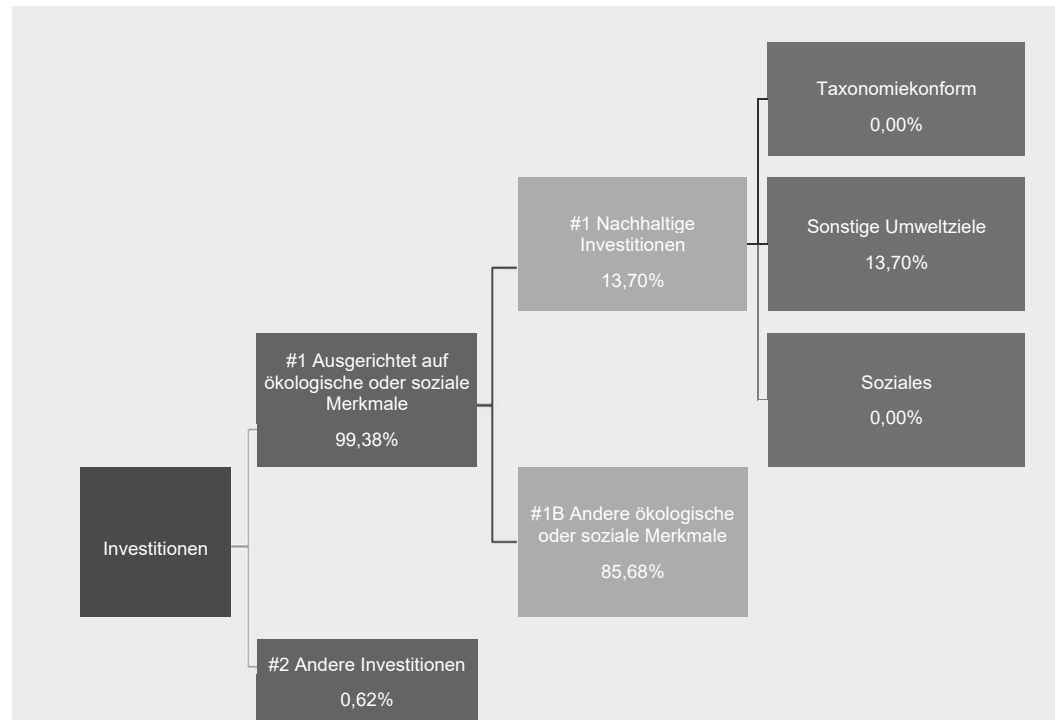
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 13,70 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,38 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,62 %) 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 Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 13,70 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen.



**#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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	26,21%
Finanzsektor	21,86%
Industrie	11,83%
Zyklische Konsumgüter	11,59%
Kommunikationsdienste	8,77%
Basiskonsumgüter	6,12%
Gesundheitssektor	4,72%
Grundstoffe	2,84%
Immobilien	2,74%
Versorgungsunternehmen	2,71%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	13,88%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	13,69%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	5,71%
Elektronische Ausrüstung, Geräte u. Komponenten	5,14%
Allgemeiner Einzelhandel	4,67%
Elektronikgeräte	4,48%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	3,43%
IT-Dienstleistungen	3,32%
Verkehrsinfrastruktur	2,86%
Versicherungen	2,80%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	2,24%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	2,23%
Pharmaindustrie	2,21%
Produkte für den persönlichen Bedarf	2,07%
Raumfahrt und Verteidigung	2,05%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

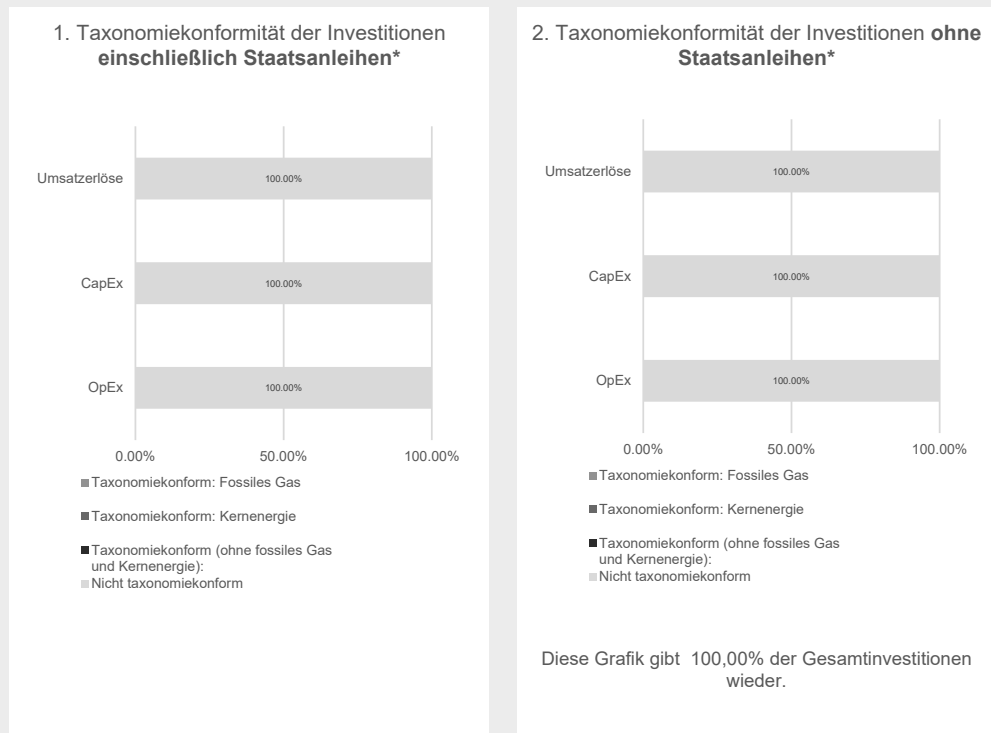
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?

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.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.



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 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 können, enthielt der Fonds 13,70 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

0,0 %. Der Fonds hat keinen Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen festgelegt.



● **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 0,62 % 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, schloss der Referenzindex Aktien von Unternehmen aus, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird halbjährlich im Mai und November überprüft und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwachte das Portfolio regelmäßig und stellte sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtete. Er überprüfte die Investments auf Portfolioebene auf mögliche nachteilige Auswirkungen durch die Indexnachbildung. Der Anlageverwalter stellte sicher, dass die Fondsanlagen den Index stets eng nachbildeten, damit die Ausrichtung auf die ESG-Merkmale des Index gewährleistet war.

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.

Für alle unsere ETF Fondsreihen erfolgt eine Stimmrechtsvertretung, die sich an den Sustainability Voting Guidelines von ISS (Institutional Shareholder Services), unserem Berater für die Stimmrechtsausübung, orientiert. Die letztendliche Entscheidung liegt bei unseren PortfoliomanagerInnen, die auf den Versammlungen nach ihrem eigenen Ermessen abstimmen können und sich an den Abstimmungsleitlinien des Franklin Templeton Stewardship Team orientieren. 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.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 Emerging Markets 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/Mio. USD Umsatz)	490,40	491,20	1 480,60

# Franklin MSCI World Catholic Principles UCITS ETF (der „Fonds“)



FRANKLIN  
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
254900QIW06E1RDG2053

## 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- Es wurden damit **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
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt**: 0,00%

**NEIN**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 22,87 % 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
- Es wurden damit **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 Merkmale durch die Abbildung des MSCI World Select Catholic Principles ESG Universal and Low Carbon NR Index (der Referenzindex), der die Wertentwicklung von Unternehmen darstellt, die geringere CO<sub>2</sub>-Emissionen und eine bessere ESG-Leistung aufweisen als der MSCI World Index (Hauptindex).

Der Index förderte ökologische und soziale Merkmale, indem Unternehmen, die an umstrittenen Geschäften beteiligt waren oder die als negativ für die Umwelt oder die Gesellschaft angesehen wurden, ausgeschlossen wurden. Dazu gehörten Unternehmen, die an Aktivitäten wie Erwachsenenunterhaltung, Öl und Gas aus der Arktis, zivile Schusswaffen, umstrittene und konventionelle Waffen, Glücksspiel, Atomwaffen, Tabak, Energieerzeugung mit Kraftwerkskohle und unkonventionelle Öl- und Gasförderung beteiligt waren. Für eine Aufnahme in den Index mussten Unternehmen ein ESG-Rating von mindestens BB aufweisen, gemessen durch die MSCI ESG Ratings.

Unternehmen im zulässigen Anlageuniversum wurden im Hinblick auf ihre CO<sub>2</sub>-Emissionen bewertet, und die oberen 20 % der Unternehmen im Hauptindex mit den höchsten CO<sub>2</sub>-Emissionen wurden aus dem Index ausgeschlossen. Die Indexbestandteile wurden außerdem nach ihren potenziellen CO<sub>2</sub>-Emissionen aufgelistet, und Titel wurden so lange ausgeschlossen, bis die kumulierten potenziellen Emissionen der ausgeschlossenen Papiere 50 % des Hauptindex erreichten.

Der Index förderte zudem soziale Merkmale durch den Ausschluss von Unternehmen, welche bestimmte römisch-katholische Grundsätze nicht erfüllten oder römisch-katholischen Überzeugungen und Werten entgegenstanden. Dazu gehörten Unternehmen, die mit Aktivitäten wie Abtreibungen und Verhütungsmittel, Tierversuche und Tierschutz und Stammzellforschung oder -entwicklung verbunden waren.

Darüber hinaus wurden alle Unternehmen, die in sehr stark kontroversen Bereichen tätig waren, deren Betrieb bzw. Erzeugnisse und Dienstleistungen Folgen für Umwelt, Gesellschaft oder Governance haben, aus dem Index ausgeschlossen.

22,87 % des Gesamtvermögens des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

1) Am Ende des Berichtszeitraums lag der MSCI ESG Rating Score des Portfolios bei 8,1 gegenüber einem Score von 7,0 für den MSCI World Index. Dies entsprach einer Verbesserung um 15,6 %.

2) Am Ende des Berichtszeitraums war die gewichtete Kohlenstoffintensität des Portfolios um 76,3 % niedriger als die des Hauptindex.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
MSCI ESG Rating Score des Index im Vergleich zum Hauptindex	8,10	6,98
Verringerung der CO2-Emissionsintensität durch den Index, im Vergleich zum Hauptindex	-76,30%	

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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 verantwortungsvollen Unternehmen in Landkreisen in Industrieländern. Die Unternehmen waren Bestandteil des Index. Bei dem Index handelt es sich um eine diversifizierte Aktienbenchmark, die sich aus Unternehmen zusammensetzt, die geringere CO2-Emissionen und eine bessere ESG-Leistung aufweisen als der Hauptindex. Unternehmen durften außerdem nicht an verschiedenen kontroversen Geschäftstätigkeiten oder an Aktivitäten, die im Konflikt zu römisch-katholischen Werten stehen, beteiligt oder mit diesen verbunden sein. Die nachhaltigen Investitionen waren zudem in der Lage, mit einem Umweltziel Umsätze zu generieren, und erfüllten die DNSH-Kriterien („Do No Significant Harm“) gemäß Artikel 2 (17) SFDR.

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, wurden mindestens 10 % des Fonds in Wertpapiere investiert, 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 22,87 % der Wertpapiere 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 darüber hinaus die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen 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. Wie oben dargelegt, sah diese Bewertung vor, dass das einzelne Unternehmen strenge Kriterien erfüllen musste, zum Beispiel durfte es nicht an folgenden Aktivitäten beteiligt sein:

- Konventionelle und umstrittene Waffen
- Zivile Schusswaffen
- Stammzellforschung
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung
- Abtreibungen und Verhütungsmittel
- Tierversuche
- Tabak (≥10 % des Umsatzes oder ein beliebiger Produzent)

Konkrete ökologische Ausschlüsse basierten auf folgenden Kriterien:

- Abbau von Kraftwerkskohle
- Energieerzeugung durch Kraftwerkskohle
- Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle
- Glücksspiel
- Unkonventionelle Öl- und Gasförderung
- Öl und Gas aus der Arktis

Außerdem wurden die Wertpapiere der Unternehmen im Anlageuniversum, die im Hinblick auf die Intensität ihrer CO2-Emissionen und auf die potenziellen CO2-Emissionen am schlechtesten abschnitten, aus dem Index ausgeschlossen.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Index, den der Fonds nachbildete, enthält 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)

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.

## 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, welche 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 Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 24.04.2024 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
NVIDIA Corp COM USD.001	Informationstechnologie	13,19%	USA
Broadcom Inc COM USD 1	Informationstechnologie	2,40%	USA
ASML Holding NV ORD EUR.09	Informationstechnologie	2,25%	Niederlande
Mastercard Inc COM USD.0001 CL A	Finanzsektor	2,00%	USA
Home Depot Inc/The COM USD0.05	Zyklische Konsumgüter	1,85%	USA
Advanced Micro Devices Inc COM USD.01	Informationstechnologie	1,43%	USA
ADOBE INC COM USD 0.0001	Informationstechnologie	1,35%	USA
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE ORD EUR.3	Zyklische Konsumgüter	1,14%	Frankreich
Visa Inc COM USD NPV CL A	Finanzsektor	1,13%	USA
Applied Materials Inc COM USD.01	Informationstechnologie	1,06%	USA
Intuit Inc COM USD.01	Informationstechnologie	0,99%	USA
Verizon Communications Inc COM USD1	Kommunikationsdienste	0,94%	USA
ServiceNow Inc COM USD.001	Informationstechnologie	0,87%	USA
Netflix Inc COM USD.001	Kommunikationsdienste	0,80%	USA
S&P Global Inc COM USD1	Finanzsektor	0,77%	USA



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

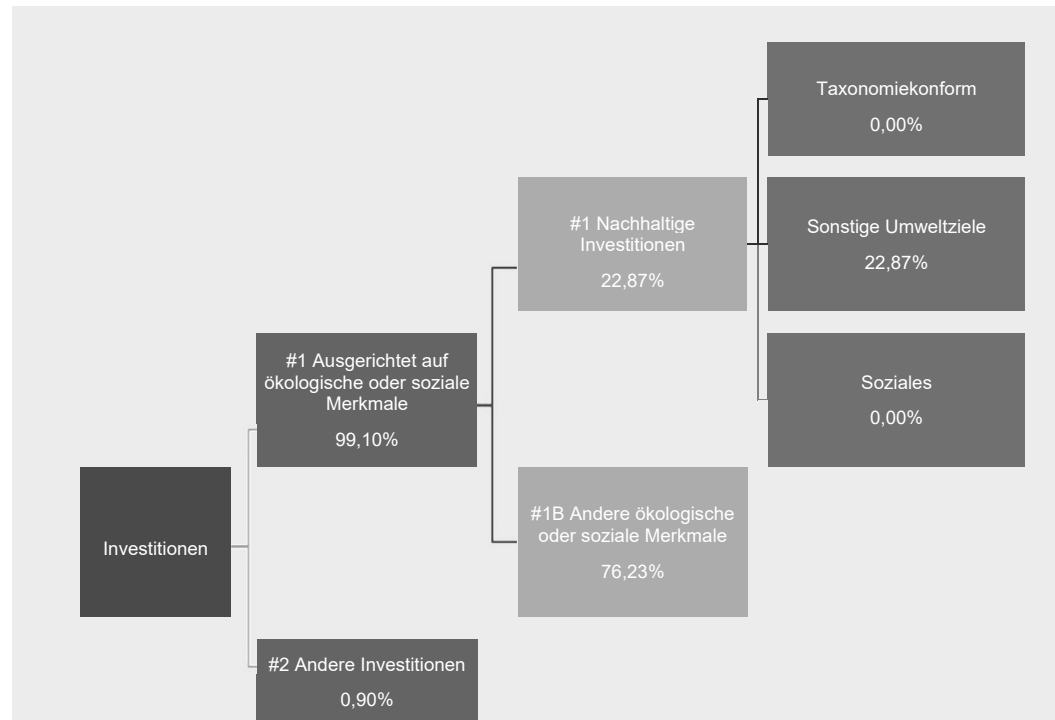
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 22,87 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,10 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,90 %) 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 Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 22,87 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen.



**#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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	34,68%
Finanzsektor	23,47%
Industrie	10,93%
Zyklische Konsumgüter	8,60%
Grundstoffe	4,40%
Kommunikationsdienste	4,25%
Gesundheitssektor	4,25%
Immobilien	3,27%
Basiskonsumgüter	2,89%
Energie	1,66%
Versorgungsunternehmen	1,50%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	23,83%
Software	7,47%
Versicherungen	6,78%
Kapitalmärkte	6,08%
Banken	4,92%
Finanzdienstleistungen	4,45%
Fachhandel	3,66%
Maschinen	3,55%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,38%
Chemische Erzeugnisse	2,24%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	2,09%
Elektronikgeräte	2,08%
Fachdienstleistungen	1,99%
IT-Dienstleistungen	1,45%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,34%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

**Ermöglichte Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

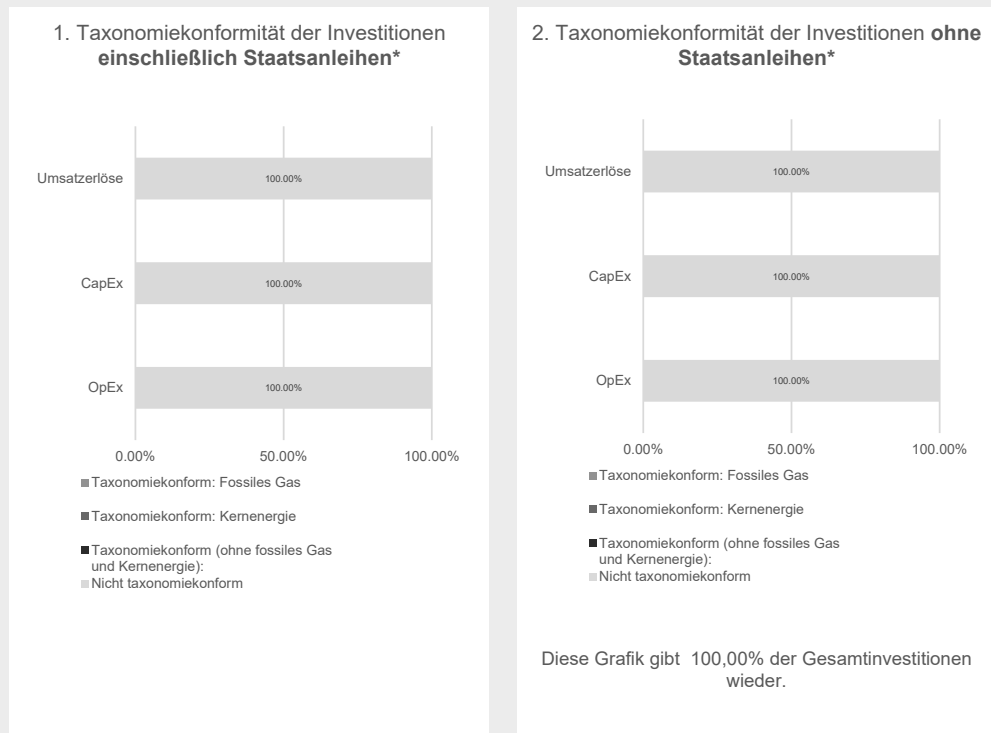
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?

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.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.



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 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 22,87 % „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?**

0,0 %. Der Fonds hat keinen Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen festgelegt.



● **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 0,90 % 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, schloss der Referenzindex Aktien von Unternehmen aus, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird vierteljährlich im Februar, Mai, August und November neu gewichtet und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwachte das Portfolio regelmäßig und stellte sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtete. Er überprüfte 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.

Für alle unsere ETF Fondsreihen erfolgt eine Stimmrechtsvertretung, die sich an den Sustainability Voting Guidelines von ISS (Institutional Shareholder Services), unserem Berater für die Stimmrechtsausübung, orientiert. Die letztendliche Entscheidung liegt bei unseren PortfoliomanagerInnen, die auf den Versammlungen nach ihrem eigenen Ermessen abstimmen können und sich an den Abstimmungsleitlinien des Franklin Templeton Stewardship Team orientieren. 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.

Weitere Informationen zum MSCI World Select Catholic Principles ESG Universal and Low Carbon Index finden Sie unter folgenden Link:

<https://www.msci.com/documents/10199/4f7a4038-ffca-3a77-2e32-8315afadb39b>

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Breite Marktindizes sind nach Marktkapitalisierung gewichtet, außer Größe und Investierbarkeit gibt es keine weiteren Ausschlusskriterien. Der Index soll die Wertentwicklung von Unternehmen abbilden, die im Vergleich zum breiten Markt geringere CO<sub>2</sub>-Emissionen und eine bessere ESG-Leistung aufweisen. Dabei werden Unternehmen ausgeschlossen, die an kontroversen Geschäftstätigkeiten beteiligt sind, wie unter anderem Waffen, Glücksspiel und Erwachsenenunterhaltung. Der Index hält außerdem die Grundsätze römisch-katholischer Unternehmensführung und Sozialnormen ein, indem er Unternehmen ausschließt, die an Abtreibungen, Verhütungsmittel, Stammzellforschung und Tierversuche beteiligt 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 World Catholic Principles UCITS ETF	MSCI World Select Catholic Principles ESG Universal and Low Carbon Index	MSCI World Index
MSCI ESG Rating Score des Index im Vergleich zum Hauptindex	8,10	8,10	6,98
Verringerung der CO <sub>2</sub> -Emissionsintensität durch den Index, im Vergleich zum Hauptindex	-76,30%	-78,80%	0,00%

# 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- Es wurden damit 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
- Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

NEIN

- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 21,50 % 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
- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Ausgeschlossen waren außerdem Aktien von Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen, Tabak, Kleinwaffen, Militärverträgen, Kraftwerkskohle, Ölsand, Energie aus Schieferöl, Glücksspiel und Alkohol in Verbindung stehen.

Der Index schloss zudem Unternehmen aus, die nicht mit den UNGC-Prinzipien, den OECD-Leitsätzen oder den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte konform waren.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
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)	115,53	274,07

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die CO<sub>2</sub>-Intensität des Fonds nahm im Beobachtungszeitraum ab. Die durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope-3-CO<sub>2</sub>-Intensität im Jahr 2024 war um 4,5 % niedriger als 2023.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2024		2023	
	Wert	Referenzwert	Wert	Referenzwert
Treibhausgasintensität der Wertpapiere des Referenzindex im Vergleich zum Hauptindex, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO2e/investierte Mio. USD) (S&P und Trucost)	115,53	274,07	120,90	311,83

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Wenngleich das Anlageziel des Fonds keine nachhaltigen Investitionen vorsah, wurden mindestens 10 % des Fonds in Wertpapiere investiert, die als nachhaltig 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 21,50 % der Wertpapiere 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 darüber hinaus die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen 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.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Index, den der Fonds nachbildete, enthält 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, welche 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?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Microsoft Corp COM USD0.001	Informationstechnologie	6,93%	USA
Apple Inc COM USD.00001	Informationstechnologie	6,42%	USA
NVIDIA Corp COM USD.001	Informationstechnologie	4,84%	USA
Amazon.com Inc COM USD.01	Zyklische Konsumgüter	4,30%	USA
Alphabet Inc COM USD.001 CL A	Kommunikationsdienste	2,81%	USA
Alphabet Inc COM USD.001 CL C	Kommunikationsdienste	2,40%	USA
Visa Inc COM USD NPV CL A	Finanzsektor	2,05%	USA
Meta Platforms Inc COM USD NPV CL A	Kommunikationsdienste	1,93%	USA
TESLA INC COM USD.001	Zyklische Konsumgüter	1,84%	USA
UnitedHealth Group Inc COM USD0.01	Gesundheitssektor	1,64%	USA
Mastercard Inc COM USD.0001 CL A	Finanzsektor	1,59%	USA
Eli Lilly & Co COM NPV	Gesundheitssektor	1,44%	USA
AbbVie Inc COM USD NPV	Gesundheitssektor	1,36%	USA
JPMorgan Chase & Co COM USD1	Finanzsektor	1,18%	USA
ADOBE INC COM USD 0.0001	Informationstechnologie	1,17%	USA



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

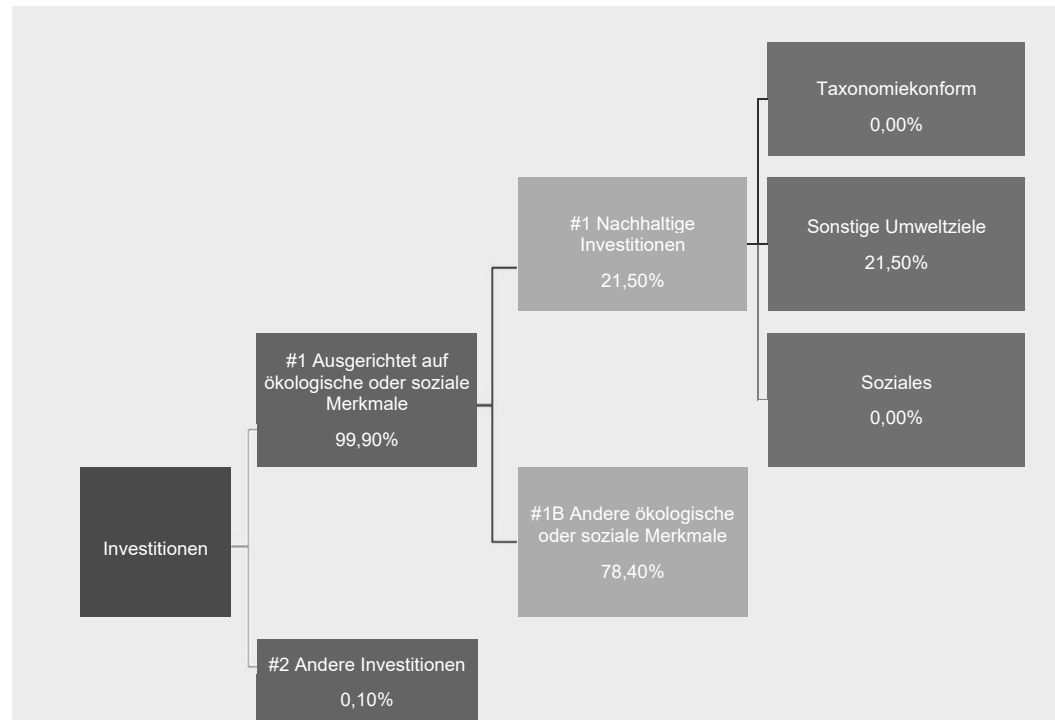
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 21,50 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,90 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,10 %) 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 Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 21,50 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen.



**#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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	31,03%
Gesundheitssektor	13,97%
Finanzsektor	13,88%
Zyklische Konsumgüter	11,04%
Kommunikationsdienste	9,80%
Industrie	8,66%
Basiskonsumgüter	6,54%
Immobilien	2,51%
Grundstoffe	2,16%
Versorgungsunternehmen	0,31%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Software	12,35%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	9,02%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	7,17%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	6,67%
Allgemeiner Einzelhandel	4,49%
Finanzdienstleistungen	4,38%
Kapitalmärkte	4,02%
Pharmaindustrie	3,39%
Banken	3,37%
Biotechnologie	3,29%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,97%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,79%
Überlandtransport	2,57%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	2,06%
Getränke	1,87%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

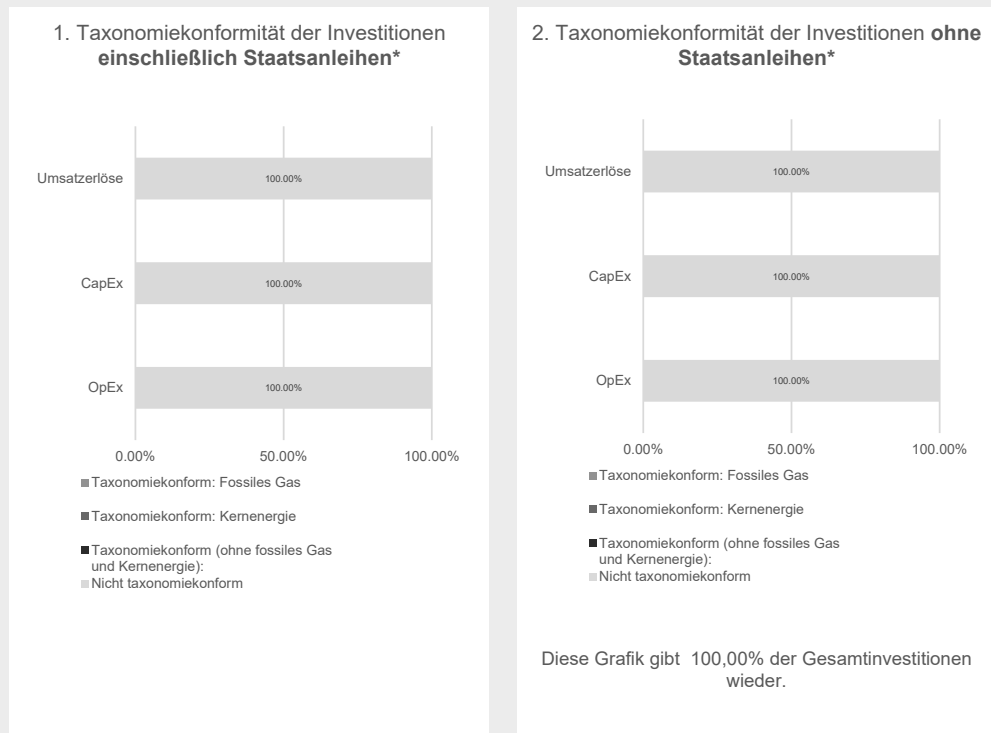
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?

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.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.



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 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 21,50 % „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?**

0,0 %. Der Fonds hat keinen Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen festgelegt.



● **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 0,10 % 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, schloss der Referenzindex Aktien von Unternehmen aus, die an bestimmten Aktivitäten beteiligt waren und/oder Umsätze daraus erzielten, um die ökologischen Merkmale des Fonds zu fördern.

Der Index wird vierteljährlich im März, Juni, September und Dezember neu gewichtet und alle Wertpapiere werden bewertet, um festzustellen, ob sie weiterhin die Voraussetzungen erfüllen und im Index verbleiben können. Der Anlageverwalter überwachte das Portfolio regelmäßig und stellte sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtete. Er überprüfte 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.

Für alle unsere ETF Fondsreihen erfolgt eine Stimmrechtsvertretung, die sich an den Sustainability Voting Guidelines von ISS (Institutional Shareholder Services), unserem Berater für die Stimmrechtsausübung, orientiert. Die letztendliche Entscheidung liegt bei unseren PortfoliomanagerInnen, die auf den Versammlungen nach ihrem eigenen Ermessen abstimmen können und sich an den Abstimmungsleitlinien des Franklin Templeton Stewardship Team orientieren. 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.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		
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)	115,53	116,00	274,07

# 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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

- Es wurden damit **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
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt**: 0,00%

NEIN

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 12,00 % 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
- Es wurden damit **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 Merkmale durch Nachbildung des STOXX Europe 600 Paris-Aligned Index (der Referenzindex). Der Index ist auf die Mindestanforderungen für die EU Paris Aligned Benchmarks (EU-PABs) ausgelegt. Der Fonds investierte in ein Portfolio aus europäischen Beteiligungspapieren, zu denen auch alle oder ein Großteil der im zugrunde liegenden 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.

Der Index förderte zudem ökologische Merkmale durch Reduzierung der Intensität der CO<sub>2</sub>-Emissionen im Vergleich zum STOXX 600 Index (der Hauptindex), reduzierte die Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen und erhöhte sein Engagement in potenziellen klimawandelbezogenen Chancen.

Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, 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 haben.

Darüber hinaus wurden auch Unternehmen ausgeschlossen, die einen Bezug zu anderen Bereichen haben, die von ISS (Institutional Shareholder Services) als schädlich für das UN-SDG (UN Sustainable Development Goal) Nr. 13 Klimaschutz erachtet 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/investierte Mio. USD) des Index war um 32 % niedriger als beim Hauptindex (578,9 gegenüber 840,6). 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 33 % niedriger als beim Hauptindex (756,9 gegenüber 1.133,5). STOXX berechnet die CO<sub>2</sub>-Intensität anhand der Daten von ISS ESG.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Referenzwert
Treibhausgasintensität der Wertpapiere in der Referenz-Benchmark im Vergleich zum Hauptindex, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO2e/investierte Mio. USD)	578,90	840,50
Treibhausgasintensität der Wertpapiere in der Referenz-Benchmark im Vergleich zum Hauptindex, gemessen anhand der absoluten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO2e/investierte Mio. USD)	756,90	1 133,50

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Die CO2-Intensität des Fonds nahm im Beobachtungszeitraum zu. Die durchschnittliche Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-CO2-Intensität im Jahr 2024 war um 8,9 % höher als 2023.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2024		2023	
	Wert	Referenzwert	Wert	Referenzwert
Treibhausgasintensität der Wertpapiere in der Referenz-Benchmark im Vergleich zum Hauptindex, gemessen anhand der kombinierten gewichteten Scope 1-, Scope 2- und Scope 3-Emissionen. (tCO2e/investierte Mio. USD)	578,90	840,50	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. (tCO2e/investierte Mio. USD)	756,90	1 133,50	544,80	1 140,90

### 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 STOXX Europe 600 Paris Aligned Index, einer EU Paris-Aligned Benchmark, sind, umgesetzt. 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, wurden mindestens 10 % des Fonds in Wertpapiere investiert, 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 12,00 % der Wertpapiere 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 darüber hinaus die Investition in viele Unternehmen vermeiden, die ökologischen 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.

### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Index, den der Fonds nachbildete, enthält 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)

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.

## 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, welche 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 Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Novo Nordisk A/S ORD DKK.1 CL B	Gesundheitssektor	4,47%	Dänemark
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE ORD EUR.3	Zyklische Konsumgüter	4,47%	Frankreich
ASML Holding NV ORD EUR.09	Informationstechnologie	4,34%	Niederlande
AstraZeneca PLC ORD GBP.25	Gesundheitssektor	4,20%	Vereinigtes Königreich
Novartis AG ORD CHF 0.49	Gesundheitssektor	3,19%	Schweiz
SAP SE ORD EUR NPV	Informationstechnologie	3,13%	Deutschland
Nestle SA ORD REGD CHF0.1	Basiskonsumgüter	2,67%	USA
L'Oreal SA ORD EUR.2	Basiskonsumgüter	2,54%	Frankreich
Hermes International SCA ORD NPV	Zyklische Konsumgüter	2,36%	Frankreich
Cie Financiere Richemont SA ORD CHF1 CL A	Zyklische Konsumgüter	1,92%	Schweiz
Sanofi SA ORD EUR2	Gesundheitssektor	1,82%	Frankreich
Iberdrola SA ORD EUR.75	Versorgungsunternehmen	1,78%	Spanien
Deutsche Telekom AG ORD REGD NPV	Kommunikationsdienste	1,75%	Deutschland
London Stock Exchange Group PLC ORD GBP.069186	Finanzsektor	1,74%	Vereinigtes Königreich
Air Liquide SA ORD EUR5.5	Grundstoffe	1,62%	Frankreich



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

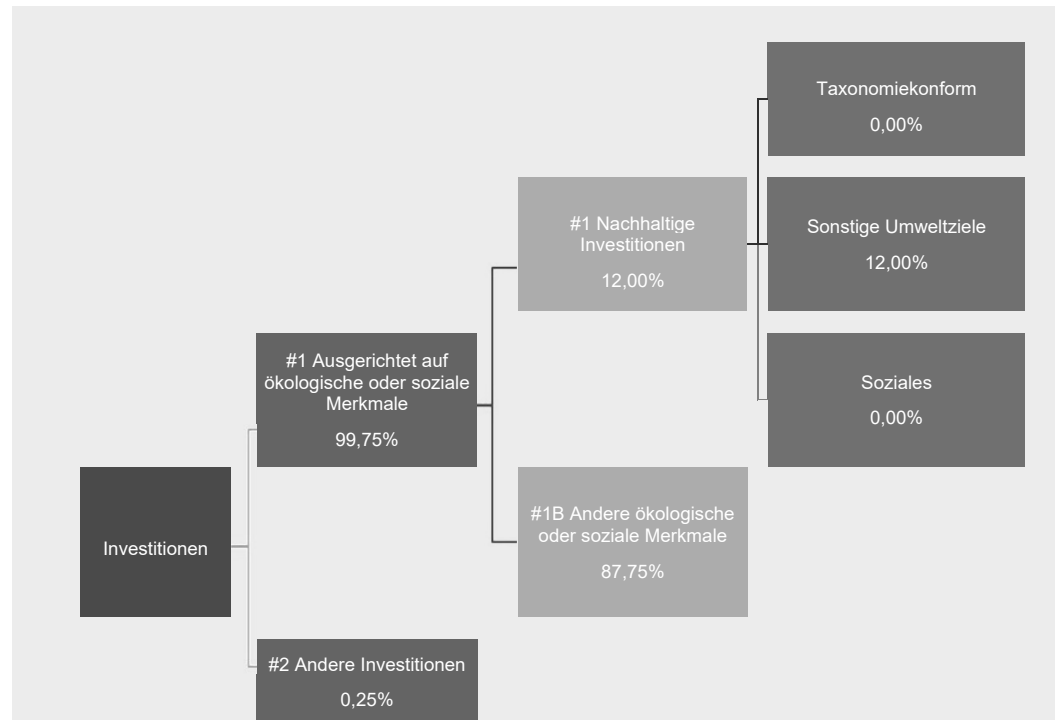
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 12,00 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,75 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,25 %) 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 Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 12,00 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen.



**#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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Gesundheitssektor	19,27%
Zyklische Konsumgüter	15,80%
Finanzsektor	13,89%
Basiskonsumgüter	11,58%
Informationstechnologie	11,50%
Industrie	9,96%
Grundstoffe	7,52%
Kommunikationsdienste	6,64%
Versorgungsunternehmen	2,50%
Immobilien	1,09%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Pharmaindustrie	17,08%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	11,14%
Chemische Erzeugnisse	6,27%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	5,53%
Versicherungen	5,05%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,36%
Banken	4,30%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	4,14%
Software	4,05%
Kapitalmärkte	3,76%
Lebensmittel	3,52%
Getränke	2,82%
Luftfracht u. -logistik	2,15%
Stromversorger	2,03%
Fachdienstleistungen	2,03%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

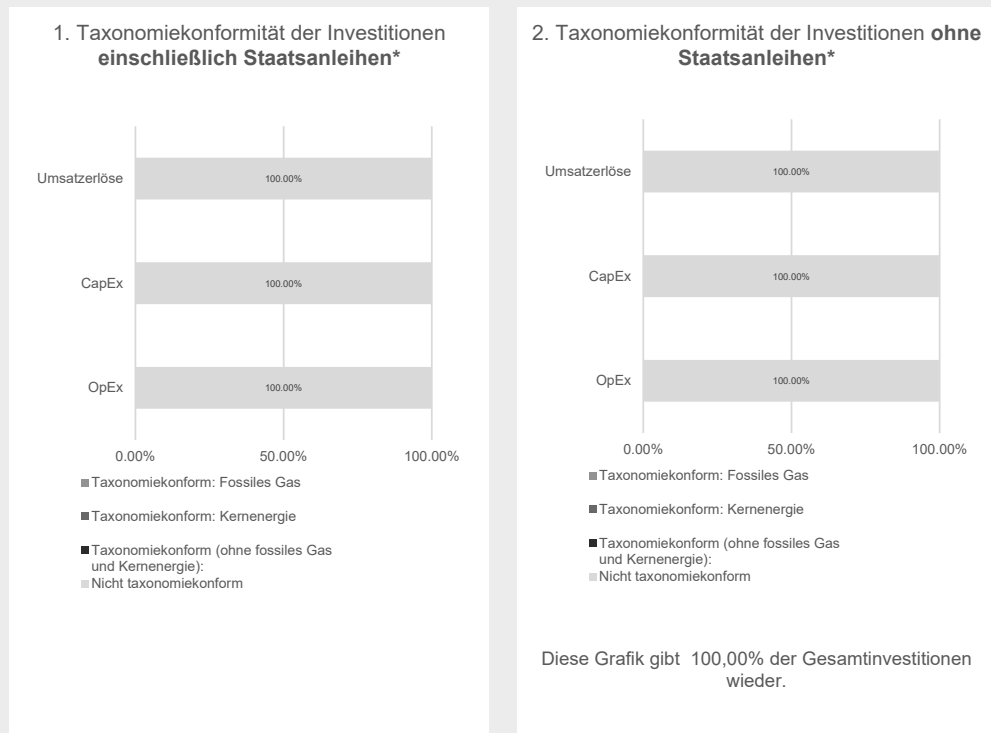
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?

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.



● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.



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 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 12,00 % „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?**

0,0 %. Der Fonds hat keinen Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen festgelegt.



● **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 0,25 % 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, schloss der Referenzindex Aktien von Unternehmen aus, 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 überwachte das Portfolio regelmäßig und stellte sicher, dass der Fonds die Index-Methodik beachtete. Er überprüfte 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.

Für alle unsere ETF Fondsreihen erfolgt eine Stimmrechtsvertretung, die sich an den Sustainability Voting Guidelines von ISS (Institutional Shareholder Services), unserem Berater für die Stimmrechtsausübung, orientiert. Die letztendliche Entscheidung liegt bei unseren PortfoliomanagerInnen, die auf den Versammlungen nach ihrem eigenen Ermessen abstimmen können und sich an den Abstimmungsleitlinien des Franklin Templeton Stewardship Team orientieren. 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 Europe 600 Index
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)	578,90	579,00	840,50

# Franklin Sustainable 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 99,04%

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

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%



**NEIN**

Es wurden damit **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

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt.



### Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das vorrangige ökologische Anlageziel des Fonds ist die Senkung der CO<sub>2</sub>-Emissionen. Dazu investierte der Fonds vorwiegend in grüne Anleihen (99,04 % des NIW), deren Mittel für die Finanzierung in den Ausbau erneuerbarer Energie, die effiziente Energienutzung, CO<sub>2</sub>-effiziente Verkehrsmittel und grüne Gebäude verwendet wurden. Daneben wurden die Mittel auch für die Finanzierung von Projekten in den Bereichen Abfall- und Abwasserbehandlung und nachhaltige Bewirtschaftung lebender natürlicher Ressourcen und Landnutzung verwendet. Der Fonds hat erfolgreich Kapital für die vorgenannten Ausgabenzwecke eingesetzt, was unter anderem dazu führte, dass pro investierter Million Euro ca. 422,6 Tonnen CO<sub>2</sub>e vermieden oder reduziert wurden, ca. 489,5 MWh erneuerbare Energie erzeugt wurden, ca. 73,8 MWh Energie eingespart wurden, ca. 265,3 m<sup>2</sup> klimafreundliche Gebäude gebaut oder renoviert wurden, ca. 30,2 Hektar Flächen wiederhergestellt/aufgeforstet/zertifiziert wurden, ca. 180 Tonnen Abfall behandelt oder vermieden wurden und ca. 2.655.648 Liter Wasser eingespart oder aufbereitet wurden (Stand: 29. Dez. 2023).

Ein Beispiel für eine Investition in eine grüne Anleihe ist die grüne Anleihe von Orsted. 2023 wurden 18,7 Mrd. DKK in die elf Renewables-Projekte gelenkt, darunter Offshore- und Onshore-Windparks sowie in Photovoltaik-Parks. Eines der Schlüsselprojekte ist der Hornsea 2 Offshore-Windpark in Großbritannien, der im August 2022 in Betrieb genommen wurde und eine Kapazität von 1,32 GW hat – genug, um mehr als 1,4 Millionen Haushalte zu versorgen. Die finanzierten Projekte unterstützen das Pariser Klimaabkommen und sollen transformativen Einfluss auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung haben, insbesondere auf diejenigen, deren Schwerpunkt auf bezahlbarer und sauberer Energie sowie auf Maßnahmen zum Klimaschutz liegt. Darüber hinaus hat sich Unternehmen dem Schutz der biologischen Vielfalt verpflichtet (alle Renewables-Projekte, die ab 2030 in Betrieb genommen werden, dürfen eine netto-positive Wirkung auf die Biodiversität haben) und unterstützt das Verbot der Deponierung von Rotorblättern und Photovoltaik-Modulen.

Ein weiteres Beispiel ist eine grüne Anleihe der Bank of Ireland. Damit soll der Übergang zu einer grünen Wirtschaft gefördert werden, indem Projekte in vier Kategorien finanziert werden: Grüne Gebäude und Energieeffizienz (Wohn- und Gewerbeimmobilien), erneuerbare Energie und saubere Mobilität. Das Portfolio zulässiger grüner Anlagen umfasst erstklassige energieeffiziente Wohnimmobilien, Gewerbeimmobilien mit hoher BREEAM- oder LEED-Zertifizierung, Anlagen zur Erzeugung erneuerbarer Energie und saubere Mobilitätslösungen wie Elektrofahrzeuge. Rund 11.000 Projekte wurden mit den Mitteln unterstützt.

Des Weiteren steht die Anlageverwaltung im Dialog mit den Unternehmen, in die der Fonds investiert, um die Reduzierung der Treibhausgasemissionen zu fördern.

Der Fonds unterstützte zudem auch weitere positive ökologische Auswirkungen, darunter Schutz der biologischen Vielfalt, Förderung der Kreislaufwirtschaft und der nachhaltigen Abwasserwirtschaft und effiziente Wassernutzung.

Ein Beispiel für die Förderung des Schutzes der Biodiversität durch Investitionen in Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung ist die grüne Anleihe der Bundesrepublik Deutschland. Mit den durch die Anleihe aufgebrachtten Mitteln finanzierte die Bundesregierung verschiedene Programme für den Erhalt der biologischen Vielfalt und den Schutz gefährdeter Arten. Das Programm GAK (Verbesserung der Agrarstruktur und des Küstenschutzes), das von der Bundesregierung und den Ländern gemeinsam finanziert wird, unterstützt eine an den Markt und lokal angepasste umweltfreundliche Landbewirtschaftung, darunter den Erhalt der Natur und das Landschaftsmanagement, wobei der Fokus auf nachhaltigen Praktiken im Acker-, Pflanzen- und Obstbau liegt. Das Bundesprogramm „Biologische Vielfalt“ ist das primäre Finanzierungsinstrument des Umweltministeriums für die Verbesserung der Biodiversität und konzentriert sich auf die Bekämpfung des Insektensterbens durch Erhaltungsprojekte in städtischen und geschützten Bereichen sowie durch Aufklärung über Insekten. Das Programm „chance.natur“ unterstützt die Schaffung und den Erhalt wichtiger natürlicher Bereiche und trägt so zum Schutz der biologischen Vielfalt und des natürlichen Erbes Deutschlands bei. Der „Wildnisfonds“ fördert den Kauf von Wäldern und Mooren, um das Ziel der Regierung, 2 Prozent der Landfläche Deutschlands als Wildnisbereiche zu erhalten.

Ein weiteres Beispiel dafür ist die grüne Anleihe von Munich Re. Über 40 % der mit der Anleihe aufgebrachtten Mittel flossen in die Finanzierung der Bewirtschaftung von lebenden natürlichen Ressourcen und der Landnutzung nach ökologisch nachhaltigen Grundsätzen, darunter drei spezifische Projekte. Dansk Demetra und Pegasos sind Investitionen, die mit nachhaltigen landwirtschaftlichen Praktiken zusammenhängen, die auf eine Kultivierung mit Integrität abzielen. Das Projekt Dansk Demetra ist ein SMA, das in hochwertiges Ackerland investiert, mit Schwerpunkt auf der Getreideproduktion in Dänemark. Das Projekt Pegasos besteht aus hochwertigem Ackerland mit Schwerpunkt auf einjährigen Pflanzen in Litauen. Und das dritte Projekt, Faunus Silva, ist ein zertifiziertes nachhaltiges Forstwirtschaftsinvestment, das über 91.000 Hektar mit Kiefern bewirtschaftet.

Die Anlageverwalter haben außerdem einen aktiven Dialog mit verschiedenen Emittenten geführt, um die kritische Notwendigkeit des Erhalts und der Schutzes der biologischen Vielfalt zu verdeutlichen.

Im Bereich der nachhaltigen Abwasserwirtschaft und der effizienten Wassernutzung ist die grüne Anleihe von Suez zu erwähnen. Die Unternehmensgruppe konzentriert sich auf ein zirkuläres Geschäftsmodell und ist in allen Aspekten der Wasserwirtschaft und der Abfallverwertung tätig, einschließlich Bau von Anlagen, Infrastrukturbewirtschaftung, Recycling, Erzeugung erneuerbarer Energie und digitale Services. Mit der Anleihe wurden unter anderem Projekte im Bereich Abwasseraufbereitung finanziert, einschließlich Entwicklung, Bau, Betrieb, Ausbau, Erneuerung und Wartung von Abwassersammelsystemen und -infrastruktur für kommunale und industrielle Kunden. Ein weiterer Bereich waren zulässige abfallbezogene Projekte wie die Entwicklung, der Bau, die Installation und/oder die Wartung von Anlagen für Abfallsortierung, Aufbereitung, Recycling und Kompostierung von Bioabfällen sowie die Sammlung, der Transport und die Verbringung von ungefährlichem Abfall und städtische Reinigungsdienste.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- Betrag (in Euro), der vierteljährlich für geeignete Projekte bereitgestellt wird – auf der Grundlage der Allokation in grüne Anleihen:

Q3 2023 – 247.946.104,53

Q4 2023 – 236.687.034,23

Q1 2024 – 232.580.939,41

Q2 2024 – 306.667.590,20

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	97,62%
Prozentualer Anteil der Investitionen in andere zulässige Anleihen, die eine CO2-arme Zukunft fördern oder das Pariser Klimaabkommen unterstützen	1,42%
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?**

Wir weisen darauf hin, dass aufgrund einer Umstellung der Methodik einige Nachhaltigkeitsindikatoren aus diesem Bezugszeitraum (Prozentsatz der Investitionen in soziale und nachhaltige Anleihen) auf dem Durchschnitt zum Quartalsende basieren und der vorherige Bezugszeitraum nur die Werte am letzten Tag des Geschäftsjahres (30. Juni 2023) widerspiegelt.

In beiden Bezugszeiträumen hielt der Fonds eine erhebliche prozentuale Allokation in nachhaltigen Investitionen, wobei die durchschnittliche Allokation am Ende des aktuellen Bezugszeitraums etwas höher war. Am 30. Juni 2023 betrug das Engagement in grünen Anleihen und sonstigen zulässigen Anleihen, die eine CO2-arme Zukunft fördern oder das Pariser Klimaabkommen unterstützen, 97,16 %. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 stieg die durchschnittliche Allokation auf 99,04 %.

Am Ende des aktuellen und des vorherigen Bezugszeitraums wies der Fonds kein Engagement in und keine Verbindung zu den ausgeschlossenen Sektoren und weiteren Ausschlüssen auf.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2024	2023
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	97,62%	95,57%
Prozentualer Anteil der Investitionen in andere zulässige Anleihen, die eine CO2-arme Zukunft fördern oder das Pariser Klimaabkommen unterstützen	1,42%	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%	0,00%

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“) der Anlageverwaltung 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.

### **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 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.

### **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 Anlageverwaltung schloss 2023 die obligatorische Einflussnahme auf 5 % der Beteiligungen erfolgreich ab, 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) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.8% 08/15/2053 REG S	Staatsanleihen	5,20%	Deutschland
European Union 2.75% 02/04/2033 REG S	Staatsanleihen	5,02%	Supranational
Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 04/22/2033 REG S	Staatsanleihen	4,27%	Belgien
Netherlands Government Bond .5% 01/15/2040 144A REG S	Staatsanleihen	4,02%	Niederlande
United Kingdom Gilt .875% 07/31/2033 REG S	Staatsanleihen	3,69%	Vereinigtes Königreich
Ireland Government Bond 1.35% 03/18/2031 REG S	Staatsanleihen	3,22%	Irland
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 08/15/2030 REG S	Staatsanleihen	3,13%	Deutschland
Spain Government Bond 1% 07/30/2042 144A REG S	Staatsanleihen	2,71%	Spanien
Region Wallonne Belgium 3.75% 04/22/2039 REG S	Staatsanleihen	2,25%	Belgien
French Republic Government Bond OAT 1.75% 06/25/2039 REG S 144A	Staatsanleihen	1,71%	Frankreich
Austria Treasury Bill 08/29/2024 TBLM	Staatsanleihen	1,56%	Österreich
Societe Nationale SNCF SACA .625% 04/17/2030 REG S	Staatsanleihen	1,45%	Frankreich
Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF ETF EUR 1	Finanzsektor	1,41%	Europäische Union
European Union 02/04/2037 REG S	Staatsanleihen	1,40%	Supranational
Republic of Austria Government Bond 1.85% 05/23/2049 144A REG S	Staatsanleihen	1,36%	Österreich

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.



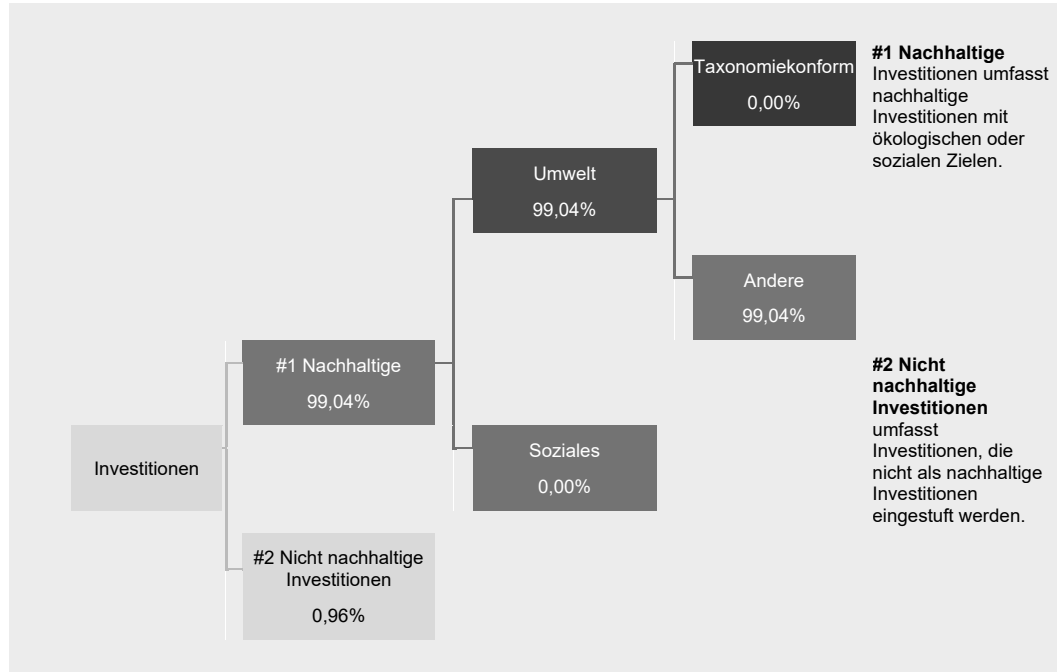
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 99,04 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,04 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,96 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln sowie Derivaten, die zu Absicherungszwecken eingesetzt werden.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

<b>Wichtigster Sektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Staatsanleihen	49,61%
Finanzsektor	23,81%
Versorgungsunternehmen	15,02%
Industrie	3,15%
Immobilien	2,56%
Zyklische Konsumgüter	2,04%
Kommunikationsdienste	1,79%
Basiskonsumgüter	0,77%
Grundstoffe	0,29%
<b>Wichtigster Teilsektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Staatsanleihen	49,61%
Banken	15,02%
Stromversorger	10,76%
Versicherungen	4,60%
Finanzdienstleistungen	4,20%
Multi-Versorger	2,14%
Diversifizierte REITs	1,60%
Überlandtransport	1,50%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,47%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	0,96%
Wasserversorger	0,90%
Automobilindustrie	0,84%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	0,83%
Lebensmittel	0,77%
Luftfracht u. -logistik	0,71%





## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 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

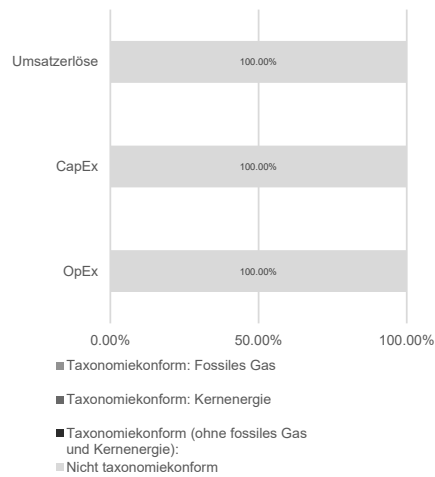
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert? <sup>1</sup>

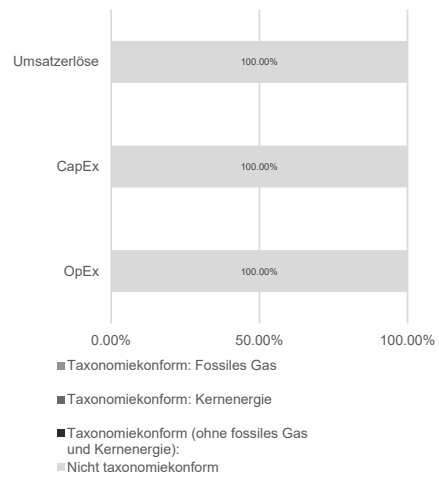
- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen\*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



Diese Grafik gibt 100,00% der Gesamtinvestitionen wieder.

\* 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 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 99,04 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, das auf die SFDR ausgerichtet ist.



## 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 0,96 % 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?

Der Anlageverwalter wendete verschiedene Methoden an, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds zu erreichen und gleichzeitig den verpflichtenden Bestandteilen der Anlagestrategie Rechnung zu tragen. Diese Methoden, die im Folgenden aufgeführt werden, umfassen eine Synthese qualitativer und quantitativer Analysen von Investitionen, mit denen der positive Beitrag zu Umweltzielen ermittelt und sichergestellt wird, dass die Investitionen die DNSH-Grundsätze erfüllen und die Promoter Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden, geeignete IT-Anwendungen einsetzen und Interaktionen mit den verschiedenen Stakeholdern unterhalten. Durch die Umsetzung dieser Methoden hat der Fonds seine zugesagten Umweltziele erreicht.

1. Der Fonds wies den Großteil seines Nettovermögens nachhaltigen Investitionen zu. Diese Verpflichtung wurde erfüllt, indem entweder in Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung (dies sind Finanzinstrumente zur Finanzierung von Projekten mit positiven ökologischen Auswirkungen) oder in konventionelle Anleihen, die sich auf nachhaltige Aktivitäten konzentrieren, investiert wurde. Um die Eignung jedes Wertpapiers als nachhaltige Anlage gemäß der Definition der Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) (siehe Abschnitt 2.17) festzustellen, führte die Anlageverwaltung eine gründliche Bewertung durch. Dabei wurde unter anderem geprüft, ob die Erlöse aus grünen oder Nachhaltigkeitsanleihen für Investitionsausgaben verwendet wurden, die ökologische Ziele fördern. Bei nachhaltigen Anlagen in konventionelle Anleihen hat die Anlageverwaltung durch ihre Recherchen festgestellt, ob ein Emittent den Großteil seiner Einnahmen aus wirtschaftlichen Aktivitäten bezieht (bei Unternehmensemittenten) oder ausschließlich Projekte finanziert (bei staatsnahen Einrichtungen), die einen positiven Beitrag zu ökologischen Zielen leisten. Ferner untersuchte die Anlageverwaltung die Indikatoren für wesentliche negative Auswirkungen (PAII) in Bezug auf den Emittenten sowie die möglichen Auswirkungen der Finanzierung von Investitionsausgaben auf diese PAII. Bei der Bewertung wurde auch geprüft, ob die gesamten wirtschaftlichen Aktivitäten des Emittenten und die finanzierten Investitionsausgaben potenziell erheblichen Schaden anrichten könnten; es wurden auch die Governance-Praktiken des Emittenten auf ihre Nachhaltigkeit hin untersucht. Dank diesem strengen Überprüfungsprozess wurde sichergestellt, dass nur grüne, nachhaltige oder konventionelle Anleihen, die von qualifizierten Emittenten ausgegeben wurden, als nachhaltige Investitionen klassifiziert wurden.

2. Die Anlageverwaltung bediente sich einer Suite von IT-Lösungen, die nahtlos in die Compliance- und Handelsstrukturen integriert ist. Diese Systeme wurden bei der Überwachung und dem Ausschluss von Emittenten eingesetzt, die gegen zwingende Vorschriften in Bezug auf schädliche wirtschaftliche Aktivitäten oder umstrittene Geschäftspraktiken verstießen (dazu gehören auch demokratische Standards für staatliche Emittenten). Die Anlageverwaltung nutzte sowohl interne als auch externe Informationen, wie z. B. MSCI-Daten, um zu untersuchen, ob die Emittenten in kontroverse Geschäftspraktiken verwickelt sind oder ihre Umsatzerlöse aus schädlichen Aktivitäten stammen, wie z. B. der Rüstung, dem Kohlebergbau oder der Tabakerzeugung. Eine umfassende Liste der Ausschlüsse ist in den vorvertraglichen Informationen enthalten. Dieses strenge Verfahren stellte den Ausschluss aller unzulässigen Emittenten vor der Transaktion sicher. Nach einer Transaktion

(Post-Trade) überprüfen die IT-Systeme weiterhin diese Beschränkungen und melden Emittenten, deren nachhaltige Merkmale eine Verschlechterung aufwiesen, um so die Notwendigkeit einer zeitnahen Veräußerung zu signalisieren.

3. Die Anlageverwaltung stand im ständigen Dialog mit den Emittenten, durch persönliche Treffen, Online-Meetings und Schriftverkehr, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds sicherzustellen. Diese Kommunikation erfolgte mit Portfoliounternehmen, die an dieser und anderen von der Anlageverwaltung gemanagten Strategien beteiligt sind.

- Internetmeetings sind nach wie vor die kosteneffizienteste Lösung, denn sie ermöglichen der Anlageverwaltung den Dialog mit der Geschäftsleitung, Investor Relations und Nachhaltigkeitsfachleuten zur Diskussion über Themen mit Nachhaltigkeitsbezug. Bei diesen Gesprächen wurden die Emittenten unter anderem zu bestimmten Kontroversen befragt, um ihre Positionen besser zu verstehen. Bei Bedarf wurden sie aufgefordert, zur Abhilfe gegenüber betroffenen Bevölkerungsgruppen und Ökosystemen eine proaktivere Haltung einzunehmen. Zudem besprach die Anlageverwaltung bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken oder -chancen, die für einzelne Emittenten wesentlich oder Teil eines thematischen Dialogs zu vorab ausgewählten Themen waren, wie zum Beispiel Sicherheit der künstlichen Intelligenz und Reduzierung von Methan-Emissionen.
- Die schriftliche Kommunikation umfasste Briefe an Emittenten, in denen die Anlageverwaltung ihre Meinung zu Themen äußerte, die sie für den Emittenten oder dessen Wirtschaftszweig als wichtig erachtete. Die Anlageverwaltung bat Portfoliounternehmen aus bestimmten Sektoren auch darum, Fragebogen zur Informationsbeschaffung auszufüllen, um bessere Investitionsentscheidungen zu ermöglichen. So wurden zum Beispiel Umfragen an Finanzinstitute verschickt, in denen deren Beteiligung an Krediten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen erfragt wurde, um Investitionen in diejenigen zu fördern, bei denen eine strategische Verpflichtung besteht, nicht in Öl-, Gas- und Kohleprojekte zu investieren.
- Schließlich hatte die Anlageverwaltung bei Branchenveranstaltungen wie der EuroMoney Conference in Wien im Januar 2024, der Erste Group ESG CEE Konferenz in Wien im Mai 2024 und dem Investor Relations Forum 2024 in Breslau die Gelegenheit, eine größere Gruppe von Stakeholdern persönlich zu treffen. Bei diesen Konferenzen leitete die Anlageverwaltung Workshops und nahm an Panels teil und konnte so über die Best Practices des nachhaltigen Investierens informieren.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

**Bei den Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

# Franklin Sustainable Euro Green Corp 1-5 Year UCITS ETF (der „Fonds“)



FRANKLIN  
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
25490008AGZTC1BZY545

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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält**. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

## Nachhaltiges Investitionsziel

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <b>JA</b>	<input type="radio"/> <b>NEIN</b>
<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt</b> : 97,99%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt</b> : 0,00%	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b> .



### Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das vorrangige ökologische Anlageziel des Fonds ist die Senkung der THG-Emissionen. Um dieses Ziel zu erreichen, investierte der Fonds vorwiegend in grüne Anleihen (99,22 % des NIW), deren Mittel für die Finanzierung in den Ausbau erneuerbarer Energie, die effiziente Energienutzung, CO<sub>2</sub>-effiziente Verkehrsmittel und gegebenenfalls anderer Projekte verwendet wurden. Der Fonds hat erfolgreich Kapital für die vorgenannten Ausgabenzwecke eingesetzt, was unter anderem dazu führte, dass pro investierter Million Euro ca. 420,40 Tonnen CO<sub>2</sub>e vermieden oder reduziert wurden, ca. 1002,05 MWh erneuerbare Energie erzeugt wurden, ca. 53,68 MWh Energie eingespart wurden, ca. 95,25 m<sup>2</sup> klimafreundliche Gebäude gebaut oder renoviert wurden und ca. 11.090.234 Millionen Liter Wasser eingespart oder aufbereitet wurden (Stand: 29. Dez. 2023).

Ein Beispiel für eine Anlage in eine grüne Mittelverwendung ist eine grüne Anleihe der Bank of Ireland. Damit soll der Übergang zu einer grünen Wirtschaft gefördert werden, indem Projekte in vier Kategorien finanziert werden: Grüne Gebäude und Energieeffizienz (Wohn- und Gewerbeimmobilien), erneuerbare Energie und saubere Mobilität. Das Portfolio zulässiger grüner Anlagen umfasst erstklassige energieeffiziente Wohnimmobilien, Gewerbeimmobilien mit hoher BREEAM- oder LEED-Zertifizierung, Anlagen zur Erzeugung erneuerbarer Energie und saubere Mobilitätslösungen wie Elektrofahrzeuge. Rund 11.000 Projekte wurden mit den Mitteln unterstützt.

Des Weiteren steht die Anlageverwaltung im Dialog mit den Unternehmen, in die der Fonds investiert, um die Reduzierung der Treibhausgasemissionen zu fördern.

Der Fonds unterstützte auch weitere positive ökologische Auswirkungen: Schutz der biologischen Vielfalt, Förderung der Kreislaufwirtschaft und der nachhaltigen Abwasserwirtschaft, effiziente Wassernutzung, Stärkung der Klimaresilienz durch Anpassungen.

Ein Beispiel für die Investition des Fonds in Biodiversitätsanleihen ist der von dem italienischen Finanzunternehmen Intesa Sanpaolo ausgegebene Green Bond Framework 2021. Im Rahmen des Framework erklärt der Emittent seine Bereitschaft, Projekte zu finanzieren, die in die folgende Kategorie fallen: Bewirtschaftung von lebenden natürlichen Ressourcen und Landnutzung nach ökologisch nachhaltigen Grundsätzen, biodiversitätserhaltende Landwirtschaft, nachhaltige Forstwirtschaft und Stadtbegrünung. Für die Finanzierung vorgeschlagene Projekte umfassen: nachhaltige Lebensmittelproduktionssysteme, resiliente Landwirtschaftspraktiken, die zur Erhaltung von Ökosystemen beitragen, sowie nachhaltige Forstwirtschaft, die die Voraussetzungen

für die Anpassung an den Klimawandel, extreme Wetterbedingungen, Dürren, Überschwemmungen und andere Katastrophen verbessert.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- Betrag (in Euro), der vierteljährlich für geeignete Projekte bereitgestellt wird – auf der Grundlage der Allokation in grüne Anleihen:

Q4 2023 – 26.639.454,47

Q1 2024 – 26.594.384,48

Q2 2024 – 28.418.624,20

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	97,99%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in nachhaltige Anleihen	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in sonstige zulässige Anleihen, die die Reduzierung und Vermeidung von CO <sub>2</sub> -Emissionen und andere ökologische Ziele unterstützen	2,01%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die in bestimmten Sektoren tätig sind oder mit ihnen in Verbindung stehen, und der zusätzlichen Ausschlüsse	0,00%
Die Liste der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter zusammenarbeitet	60,00

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

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“) der Anlageverwaltung überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten eines Drittanbieters, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche Wirtschaftstätigkeiten und/oder Kontroversen involviert sind, und schloss solche Emittenten aus dem Anlageuniversum aus.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft. Des Weiteren nahm die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder einer externen Zweitmeinung) der DNSH-Konformität des Emittenten und des Projekts vor.

--- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Bei der Beurteilung dessen, ob die Anlagen des Fonds den „Do No Significant Harm“-Grundsätzen entsprechen, berücksichtigte die Anlageverwaltung alle verpflichtenden PAI-Indikatoren von Tabelle 1 in Anhang I der in der SFDR vorgesehenen Regulatory Technical Standards („RTS“), sofern diese für die vom Fonds beabsichtigten Anlagen relevant waren. Die Anlageverwaltung führte diese Analyse auf der Ebene jeder einzelnen nachhaltigen Investition durch, sodass die Relevanz und Wesentlichkeit der PAI-Faktoren bei den Anlagen jeweils unterschiedlich sein kann. Emittenten, die nach Einschätzung des Anlageverwalters gegen diese Indikatoren verstießen, wurden nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft. Bei der Bewertung der in Frage kommenden Anleihen prüfte und dokumentierte die Anlageverwaltung 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 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:**

Die Ausrichtung der nachhaltigen Investitionen an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte wurde anhand von MSCI-Daten und internen

Prüfungen der Anlageverwaltung bewertet. Diese Ausrichtung wurde sichergestellt, indem der MSCI der Anlageverwaltung jegliche mögliche Nichteinhaltung dieser Standards durch Emittenten zur Überprüfung vorlegte. Sollte die Überprüfung ergeben, dass ein Emittent sich nicht an diese Standards hält, so wurde nicht in die Wertpapiere des Emittenten investiert und/oder die Anlage wurde veräußert.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

- Durchführung der DNSH-bezogenen Überprüfung,
- Hilfestellung für thematisches Engagement und
- Anwendung von Ausschlüssen.

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 nutzt Daten eines Drittanbieters, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen involviert sind (basierend auf allen verpflichtenden PAIs), und schließt solche Emittenten aus dem Anlageuniversum aus. Darüber hinaus werden staatliche Emittenten auf ihre Treibhausgasemissionen, politische Freiheiten und/oder Korruption hin überprüft und entsprechend bewertet.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwaltung schloss 2023 die obligatorische Einflussnahme auf 5 % der Beteiligungen erfolgreich ab, 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, Aktivitäten, die die Biodiversität negativ beeinflussen (#PAI 7) und die Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI #14) bei der Anwendung spezifischer ESG-Ausschlüsse, wie in der Anlagestrategie beschrieben.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 31.10.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Bank of Ireland Group PLC 4.875% 07/16/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,98%	Irland
EDP - Energias De Portugal SA 3.875% 06/26/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,97%	Portugal
Telia Co AB FRN 05/11/2081 REG S *fixed to float*	Kommunikationsdienste	1,97%	Schweden
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4% 11/09/2026 REG S	Finanzsektor	1,92%	Schweden
DNB Bank ASA 4.5% 07/19/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,91%	Norwegen
BNP Paribas SA 4.375% 01/13/2029 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,85%	Frankreich
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU 1.661% 12/04/2026 REG S	Industrie	1,82%	Spanien
Engie SA 1.75% 03/27/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,82%	Frankreich
ASR Nederland NV 3.625% 12/12/2028 REG S	Finanzsektor	1,81%	Niederlande
Citigroup Inc 3.713% 09/22/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,80%	USA
Vesteda Finance BV 1.5% 05/24/2027 REG S	Immobilien	1,80%	Niederlande
Nordea Bank Abp 1.125% 02/16/2027 REG S	Finanzsektor	1,80%	Finnland
Svenska Handelsbanken AB .01% 12/02/2027 REG S	Finanzsektor	1,79%	Schweden
Deutsche Bank AG 3.25% 05/24/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,77%	Deutschland
Amprion Gmbh 3.875% 09/07/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,73%	Deutschland



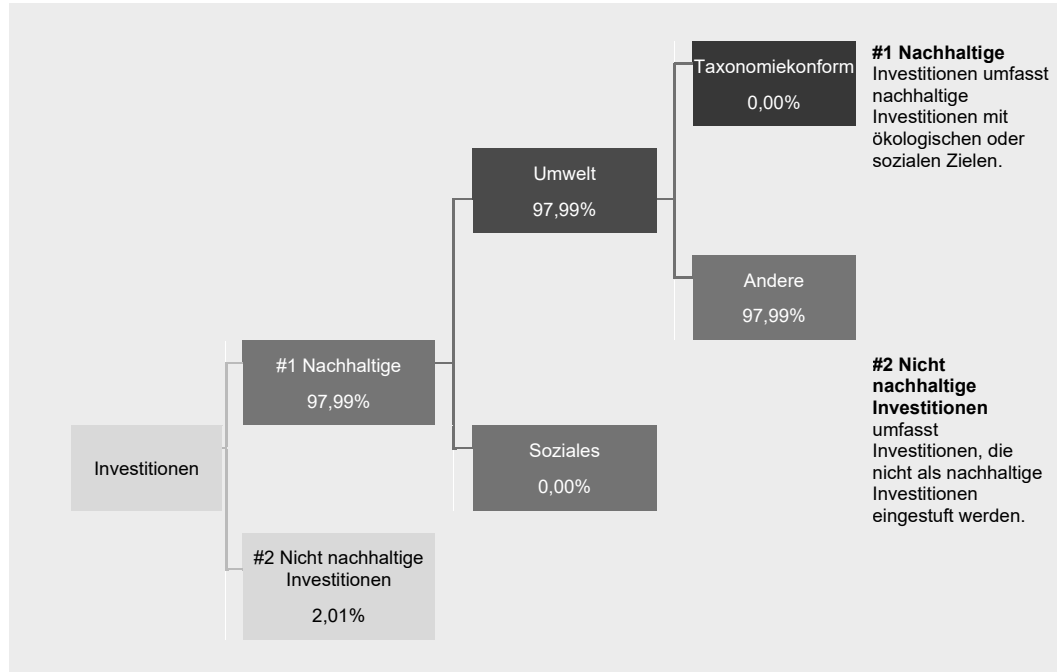
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 97,99 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,99 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,01 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln sowie Derivaten, die zu Absicherungszwecken eingesetzt werden.





**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

<b>Wichtigster Sektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Finanzsektor	61,36%
Versorgungsunternehmen	17,86%
Zyklische Konsumgüter	4,26%
Industrie	4,10%
Immobilien	2,59%
Staatsanleihen	2,53%
Kommunikationsdienste	2,41%
Grundstoffe	1,67%
Basiskonsumgüter	0,77%
Informationstechnologie	0,41%
<b>Wichtigster Teilsektor</b>	<b>% der Vermögenswerte</b>
Banken	54,64%
Stromversorger	10,36%
Versicherungen	4,68%
Multi-Versorger	3,09%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	2,69%
Staatsanleihen	2,53%
Automobilindustrie	2,32%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,97%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	1,82%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	1,80%
Kapitalmärkte	1,77%
Wasserversorger	1,72%
Chemische Erzeugnisse	1,67%
Fahrzeugkomponenten	1,39%
Luftfracht u. -logistik	1,15%



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 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

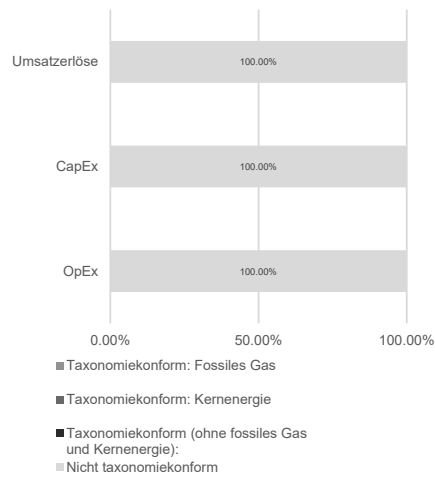
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert? <sup>1</sup>

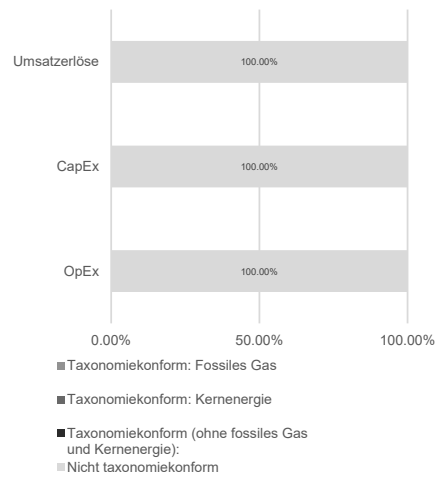
- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen\*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



Diese Grafik gibt 100,00% der Gesamtinvestitionen wieder.

\* 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 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 97,99 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, das auf die SFDR ausgerichtet ist.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds verpflichtete sich nicht dazu, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen mit ökologischen Zielen zu investieren. Dennoch investierte der Fonds in nachhaltige Anlagen mit einem ökologischen Ziel als Teil der Investition von mindestens 90 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Anlagen gemäß der SFDR.



## 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 2,01 % 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 ausschließlich zu Absicherungszwecken gehalten werden. Zur Verdeutlichung: Dies schließt gewisse Geldmarktinstrumente wie Staatsanleihen nicht ein, für die die Anlageverwaltung bestätigt hat, dass sie mit vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen in Einklang stünden. Der Anlageverwalter wendete einen ökologischen und sozialen Mindestschutz an, indem er überprüfte, ob die für Derivatgeschäfte und die Platzierung von Einlagen verwendeten Gegenparteien die EU Taxonomy Safeguards, wie von MSCI bewertet, erfüllten. Mit Gegenparteien, die diese Kriterien nicht erfüllten, schloss der Fonds keine Transaktionen ab.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Anlageverwalter wendete verschiedene Methoden an, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds zu erreichen und gleichzeitig den verpflichtenden Bestandteilen der Anlagestrategie Rechnung zu tragen. Diese Methoden, die im Folgenden aufgeführt werden, umfassen eine Synthese qualitativer und quantitativer Analysen von Investitionen, mit denen der positive Beitrag zu ökologischen und/oder sozialen Zielen ermittelt und sichergestellt wird, dass die Investitionen die DNSH-Grundsätze erfüllen und die Promoter Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden, geeignete IT-Anwendungen einsetzen und Interaktionen mit den verschiedenen Stakeholdern unterhalten. Durch die Umsetzung dieser Methoden hat der Fonds seine zugesagten ökologischen und sozialen Ziele erreicht.

1. Der Fonds wies den Großteil seines Nettovermögens nachhaltigen Investitionen zu. Diese Verpflichtung wurde erfüllt, indem entweder in Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung (dies sind Finanzinstrumente zur Finanzierung von Projekten mit positiven ökologischen oder sozialen Auswirkungen) oder in konventionelle Anleihen, die sich auf nachhaltige Aktivitäten konzentrieren, investiert wurde. Um die Eignung jedes Wertpapiers als nachhaltige Anlage gemäß der Definition der Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) (siehe Abschnitt 2.17) festzustellen, führte die Anlageverwaltung eine gründliche Bewertung durch. Dabei wurde unter anderem geprüft, ob die Erlöse aus grünen, sozialen oder Nachhaltigkeitsanleihen für Investitionsausgaben verwendet wurden, die ökologische oder soziale Ziele fördern. Bei nachhaltigen Anlagen in konventionelle Anleihen hat die Anlageverwaltung durch ihre Recherchen festgestellt, ob ein Emittent den Großteil seiner Einnahmen aus wirtschaftlichen Aktivitäten bezieht (bei Unternehmensemittenten) oder ausschließlich Projekte finanziert (bei staatsnahen Einrichtungen), die einen positiven Beitrag zu ökologischen und/oder sozialen Zielen leisten. Ferner untersuchte die Anlageverwaltung die Indikatoren für wesentliche negative Auswirkungen (PAII) in Bezug auf den Emittenten sowie die möglichen Auswirkungen der Finanzierung von Investitionsausgaben auf diese PAII. Bei der Bewertung wurde auch geprüft, ob die gesamten wirtschaftlichen Aktivitäten des Emittenten und die finanzierten Investitionsausgaben potenziell erheblichen Schaden anrichten könnten; es wurden auch die Governance-Praktiken des Emittenten auf ihre Nachhaltigkeit hin untersucht. Dank diesem strengen Überprüfungsprozess wurde sichergestellt, dass nur grüne, soziale, nachhaltige oder konventionelle Anleihen, die von qualifizierten Emittenten ausgegeben wurden, als nachhaltige Investitionen klassifiziert wurden.

2. Die Anlageverwaltung bediente sich einer Suite von IT-Lösungen, die nahtlos in die Compliance- und Handelsstrukturen integriert ist. Diese Systeme wurden bei der Überwachung und dem Ausschluss von Emittenten eingesetzt, die gegen zwingende Vorschriften in Bezug auf schädliche wirtschaftliche Aktivitäten oder umstrittene Geschäftspraktiken verstießen (dazu gehören auch demokratische Standards für staatliche Emittenten). Die Anlageverwaltung nutzte sowohl interne als auch externe Informationen, wie z. B. MSCI-Daten, um zu untersuchen, ob die Emittenten in kontroverse Geschäftspraktiken verwickelt sind oder ihre Umsatzerlöse aus schädlichen Aktivitäten stammen, wie z. B. der Rüstung, dem Abbau von Kraftwerkskohle oder der Tabakerzeugung. Eine umfassende Liste der Ausschlüsse ist in den vorvertraglichen Informationen enthalten. Dieses strenge Verfahren stellte sicher, dass alle unzulässigen Emittenten vor dem Handel (Pre-Trade) ausgeschlossen wurden. Nach einer Transaktion (Post-Trade) überprüften die IT-Systeme weiterhin diese Beschränkungen und meldeten Emittenten, deren nachhaltige Merkmale eine Verschlechterung aufwiesen, um so die Notwendigkeit einer zeitnahen Veräußerung zu signalisieren.

3. Die Anlageverwaltung stand im ständigen Dialog mit den Emittenten, durch persönliche Treffen, Online-Meetings und Schriftverkehr, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds sicherzustellen. Diese Kommunikation erfolgte mit Portfoliounternehmen, die an dieser und anderen von der Anlageverwaltung gemanagten Strategien beteiligt sind.

- Internetmeetings sind nach wie vor die kosteneffizienteste Lösung, denn sie ermöglichen der Anlageverwaltung den Dialog mit der Geschäftsleitung, Investor Relations und Nachhaltigkeitsfachleuten zur Diskussion über Themen mit Nachhaltigkeitsbezug. Bei diesen Gesprächen wurden unter anderem die Äußerungen der Emittenten zu bestimmten Kontroversen erfragt, um deren Positionen besser zu verstehen. Bei Bedarf wurden sie aufgefordert, zur Abhilfe gegenüber betroffenen Bevölkerungsgruppen und Ökosystemen eine proaktivere Haltung einzunehmen. Zudem besprach die Anlageverwaltung bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken oder -chancen, die für einzelne Emittenten wesentlich oder Teil eines thematischen Dialogs zu vorab ausgewählten Themen waren, wie zum Beispiel Sicherheit der künstlichen Intelligenz und Reduzierung von Methan-Emissionen.
- Die schriftliche Kommunikation umfasste Briefe an Emittenten, in denen die Anlageverwaltung ihre Meinung zu

Themen äußerte, die sie für den Emittenten oder dessen Wirtschaftszweig als wichtig erachtete. Die Anlageverwaltung bat Portfoliounternehmen aus bestimmten Sektoren auch darum, Fragebogen zur Informationsbeschaffung auszufüllen, um bessere Investitionsentscheidungen zu ermöglichen. So wurden zum Beispiel Umfragen an Finanzinstitute verschickt, in denen deren Beteiligung an Krediten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen erfragt wurde, um Investitionen in diejenigen zu fördern, bei denen eine strategische Verpflichtung besteht, nicht in Öl-, Gas- und Kohleprojekte zu investieren.

- Schließlich hatte die Anlageverwaltung bei Branchenveranstaltungen wie der EuroMoney Conference in Wien im Januar 2024, der Erste Group ESG CEE Konferenz in Wien im Mai 2024 und dem Investor Relations Forum 2024 in Breslau die Gelegenheit, eine größere Gruppe von Stakeholdern persönlich zu treffen. Bei diesen Konferenzen hielt die Anlageverwaltung Workshops und nahm an Panels teil und konnte so über die Best Practices des nachhaltigen Investierens informieren.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Nicht zutreffend.

# Franklin Sustainable Euro Green Sovereign UCITS ETF (der „Fonds“)



FRANKLIN  
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
254900UNO4UQ4IFVZ469

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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält**. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

## Nachhaltiges Investitionsziel

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <b>JA</b>	<input type="radio"/> <b>NEIN</b>
<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 99,20%</b>	<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%</b>	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b> .



### Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das vorrangige ökologische Anlageziel des Fonds ist die Senkung der THG-Emissionen. Um dieses Ziel zu erreichen, investierte der Fonds vorwiegend in grüne Anleihen (99,22 % des NIW), deren Mittel für die Finanzierung in den Ausbau erneuerbarer Energie, die effiziente Energienutzung, CO<sub>2</sub>-effiziente Verkehrsmittel und gegebenenfalls anderer Projekte verwendet wurden. Der Fonds hat erfolgreich Kapital für die vorgenannten Ausgabenzwecke eingesetzt, was unter anderem dazu führte, dass pro investierter Million Euro ca. 346,72 Tonnen CO<sub>2</sub>e vermieden oder reduziert wurden, ca. 727,65 MWh erneuerbare Energie erzeugt wurden, ca. 92,57 MWh Energie eingespart wurden, ca. 1.745,75 m<sup>2</sup> klimafreundliche Gebäude gebaut oder renoviert wurden und ca. 758,9 Millionen Liter Wasser eingespart oder aufbereitet wurden (Stand: 29. Dez. 2023).

Ein Beispiel für die Förderung der Reduzierung von THG-Emissionen durch Investitionen in Anleihen mit festgelegter Mittelverwendung ist die grüne Anleihe der Republik Irland. Die Allokationen unterstützen die Verpflichtung Irlands zu nachhaltiger Entwicklung und Erreichung der CO<sub>2</sub>-Neutralität bis 2050. Zu den verschiedenen Kategorien zulässiger grüner Projekte gehörten Energieeffizienz und saubere Mobilität. Zu diesen Programmen zählt das Energy Efficiency Retrofit Programme zur Sanierung von Sozialwohnungen und Nichtwohngebäuden im öffentlichen und gewerblichen Sektor. Ein großer Teil der Ausgaben wurde in saubere Mobilität gelenkt, darunter die staatlichen Investition in Initiativen für öffentliche Verkehrsmittel. Finanziert wurden auch Initiativen für Radfahrer und Fußgänger sowie nachhaltige städtische Verkehrsinfrastrukturen. Darüber hinaus wurde die Dekarbonisierung des Schwerlastverkehrs gefördert, indem die Anschaffung neuer Lkw, Busse und Reisebusse unterstützt wurde. Mit den aufgebrachten Mitteln unterstützte die Regierung auch den Climate Action Plan, der die stärkere Nutzung von Elektrofahrzeugen fördern soll.

Des Weiteren steht die Anlageverwaltung im Dialog mit den Unternehmen, in die der Fonds investiert, um die Reduzierung der Treibhausgasemissionen zu fördern.

Der Fonds unterstützte auch weitere positive ökologische Auswirkungen: Schutz der biologischen Vielfalt, Förderung der Kreislaufwirtschaft und der nachhaltigen Abwasserwirtschaft, effiziente Wassernutzung, Stärkung der Klimaresilienz durch Anpassungen.

Die Anlageverwaltung hat einen aktiven Dialog mit verschiedenen Emittenten geführt, um die kritische Notwendigkeit des Erhalts und der Schutzes der biologischen Vielfalt zu verdeutlichen. Dieser Dialog wurde auch mit staatlichen Emittenten geführt.

Ein Beispiel für die Förderung des Schutzes der Biodiversität durch Investitionen in Anleihen mit festgelegter Mittelverwendung ist die grüne Anleihe der Bundesrepublik Deutschland. Mit den durch die Anleihe aufgebrachtten Mitteln finanzierte die Bundesregierung verschiedene Programme für den Erhalt der biologischen Vielfalt und den Schutz gefährdeter Arten. Das Programm GAK (Verbesserung der Agrarstruktur und des Küstenschutzes), das von der Bundesregierung und den Ländern gemeinsam finanziert wird, unterstützt eine an den Markt und lokal angepasste umweltfreundliche Landbewirtschaftung, darunter den Erhalt der Natur und das Landschaftsmanagement, wobei der Fokus auf nachhaltigen Praktiken im Acker-, Pflanzen- und Obstbau liegt. Das Bundesprogramm „Biologische Vielfalt“ ist das primäre Finanzierungsinstrument des Umweltministeriums für die Verbesserung der Biodiversität und konzentriert sich auf die Bekämpfung des Insektensterbens durch Erhaltungsprojekte in städtischen und geschützten Bereichen sowie durch Aufklärung über Insekten. Das Programm „chance.natur“ unterstützt die Schaffung und den Erhalt wichtiger natürlicher Bereiche und trägt so zum Schutz der biologischen Vielfalt und des natürlichen Erbes Deutschlands bei. Der „Wildnisfonds“ fördert den Kauf von Wäldern und Mooren, um das Ziel der Regierung, 2 Prozent der Landfläche Deutschlands als Wildnisbereiche zu erhalten.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- Betrag (in Euro), der vierteljährlich für geeignete Projekte bereitgestellt wird – auf der Grundlage der Allokation in grüne Anleihen:

Q4 2023 – 27.898.058,23

Q1 2024 – 53.337.959,81

Q2 2024 – 55.321.454,06

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	99,20%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in nachhaltige Anleihen,	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in sonstige zulässige Anleihen, die die Reduzierung und Vermeidung von CO <sub>2</sub> -Emissionen und andere ökologische Ziele unterstützen	0,80%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die in bestimmten Sektoren tätig sind oder mit ihnen in Verbindung stehen, und der zusätzlichen Ausschlüsse	0,00%
Die Liste der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter zusammenarbeitet	14,00

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

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.

Staatliche Emittenten wurden auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption hin überprüft. Des Weiteren nahm die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder einer externen Zweitmeinung) der DNSH-Konformität des Emittenten und des Projekts vor.

### --- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Bei der Beurteilung dessen, ob die Anlagen des Fonds den „Do No Significant Harm“-Grundsätzen entsprechen, berücksichtigte die Anlageverwaltung alle verpflichtenden PAI-Indikatoren von Tabelle 1 in Anhang I der in der SFDR vorgesehenen technischen Regulierungsstandards („RTS“), sofern diese für die vom Fonds beabsichtigten Anlagen relevant waren. Die Anlageverwaltung führte diese Analyse auf der Ebene jeder einzelnen nachhaltigen Investition durch, sodass die Relevanz und Wesentlichkeit der PAI-Faktoren bei den Anlagen jeweils unterschiedlich sein kann. Emittenten, die nach Einschätzung des Anlageverwalters gegen diese Indikatoren verstießen, wurden nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft. Bei der Bewertung der in Frage kommenden Anleihen prüfte und dokumentierte die Anlageverwaltung 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-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:**

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte waren nur auf Unternehmensemittenten, nicht aber auf staatliche und staatsnahe Emittenten, anwendbar.



## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

- Durchführung der DNSH-bezogenen Überprüfung,
- Hilfestellung für thematisches Engagement und
- Anwendung von Ausschlüssen.

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. Darüber hinaus werden staatliche Emittenten auf ihre Treibhausgasemissionen, politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft und entsprechend bewertet.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwaltung schloss 2023 die obligatorische Einflussnahme auf 5 % der Beteiligungen erfolgreich ab, 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 sozialen Ziele (#PAI 16) und wendete spezielle ESG-Ausschlüsse an, wie in der Anlagestrategie beschrieben.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) gestalteten sich im Referenzzeitraum wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 31.10.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Netherlands Government Bond .5% 01/15/2040 144A REG S	Staatsanleihen	10,74%	Niederlande
European Union 2.75% 02/04/2033 REG S	Staatsanleihen	9,49%	Supranational
Kreditanstalt Fuer Wiederaufbau 2.75% 05/15/2030 REG S	Staatsanleihen	8,95%	Deutschland
Ireland Government Bond 1.35% 03/18/2031 REG S	Staatsanleihen	6,46%	Irland
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.8% 08/15/2053 REG S	Staatsanleihen	6,06%	Deutschland
Spain Government Bond 1% 07/30/2042 144A REG S	Staatsanleihen	5,49%	Spanien
Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 04/22/2033 REG S	Staatsanleihen	5,38%	Belgien
European Union 02/04/2037 REG S	Staatsanleihen	5,34%	Supranational
United Kingdom Gilt .875% 07/31/2033 REG S	Staatsanleihen	4,77%	Vereinigtes Königreich
Republic of Austria Government Bond 1.85% 05/23/2049 144A REG S	Staatsanleihen	4,68%	Österreich
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 08/15/2030 REG S	Staatsanleihen	4,34%	Deutschland
Societe Des Grands Projets EPIC 11/25/2030 REG S	Staatsanleihen	2,98%	Frankreich
French Republic Government Bond OAT 1.75% 06/25/2039 REG S 144A	Staatsanleihen	2,66%	Frankreich
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.3% 02/15/2033 REG S	Staatsanleihen	2,41%	Deutschland
Societe Nationale SNCF SACA .625% 04/17/2030 REG S	Staatsanleihen	2,41%	Frankreich





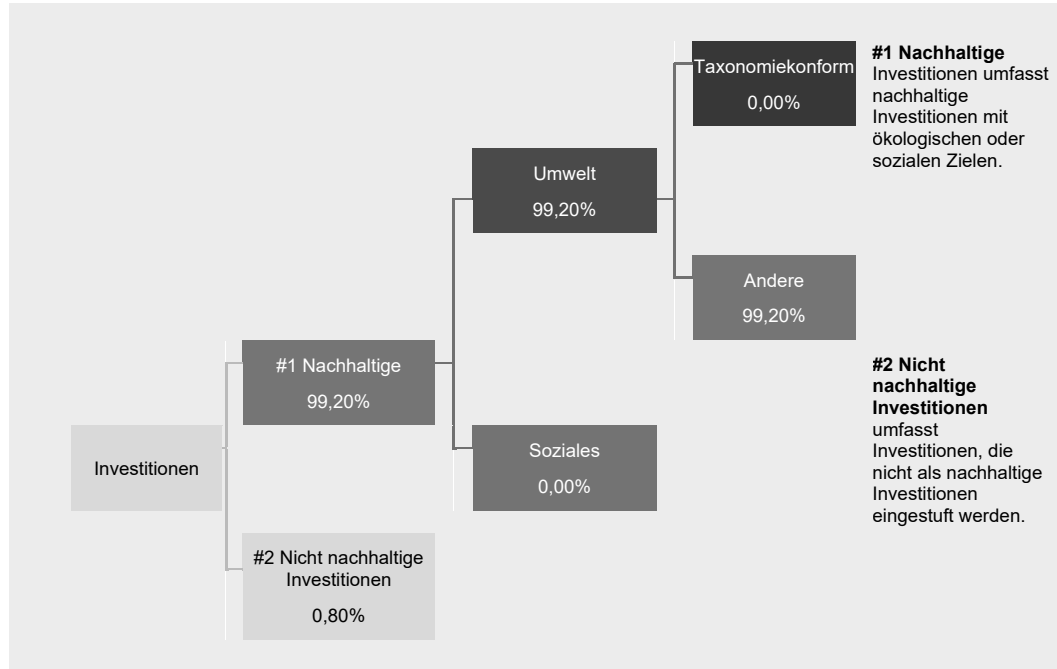
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen lag bei 99,20 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,20 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,80 %) 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?

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	95,76%
Finanzsektor	1,83%
Versorgungsunternehmen	1,60%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	95,76%
Stromversorger	1,60%
Finanzdienstleistungen	1,19%
Banken	0,64%



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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.

**Ermöglichte 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 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

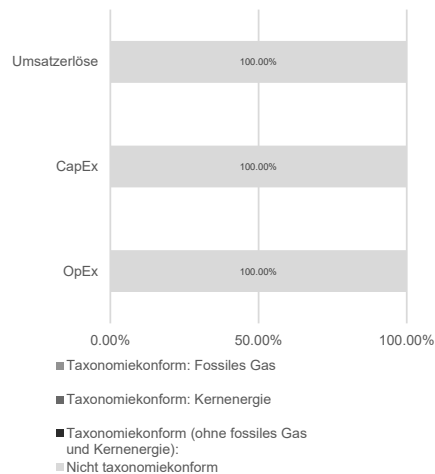
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert? <sup>1</sup>

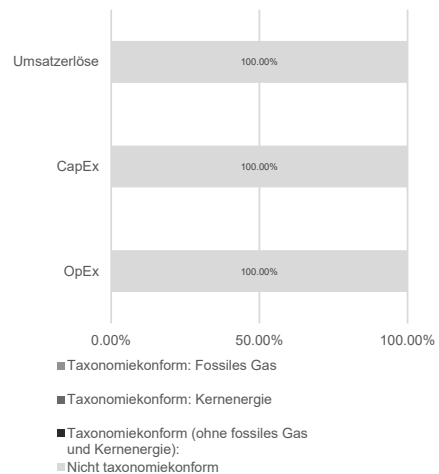
- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen\*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



Diese Grafik gibt 100,00% der Gesamtinvestitionen wieder.

\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.


<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.

- **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.

 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 99,20 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, das auf die SFDR ausgerichtet ist.

- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht dazu, einen Mindestanteil seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Investitionen mit ökologischen Zielen zu investieren. Dennoch investierte der Fonds in nachhaltige Anlagen mit einem ökologischen Ziel als Teil der Investition von mindestens 90 % seines Nettoinventarwerts in nachhaltige Anlagen gemäß der SFDR.

- **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 0,80 % 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 ausschließlich zu Absicherungszwecken gehalten werden. Zur Verdeutlichung: Dies schließt gewisse Geldmarktinstrumente wie Staatsanleihen nicht ein, für die die Anlageverwaltung bestätigt hat, dass sie mit vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen im Einklang stünden. Der Anlageverwalter wendete einen ökologischen und sozialen Mindestschutz an, indem er überprüfte, ob die für Derivatgeschäfte und die Platzierung von Einlagen verwendeten Gegenparteien die EU Taxonomy Safeguards, wie von MSCI bewertet, erfüllten. Mit Gegenparteien, die diese Kriterien nicht erfüllten, schloss der Fonds keine Transaktionen ab.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?**

Der Anlageverwalter wendete verschiedene Methoden an, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds zu erreichen und gleichzeitig den verpflichtenden Bestandteilen der Anlagestrategie Rechnung zu tragen. Diese Methoden, die im Folgenden aufgeführt werden, umfassen eine Synthese qualitativer und quantitativer Analysen von Investitionen, mit denen der positive Beitrag zu ökologischen und/oder sozialen Zielen ermittelt und sichergestellt wird, dass die Investitionen die DNSH-Grundsätze erfüllen und die Promoter Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden, geeignete IT-Anwendungen einsetzen und Interaktionen mit den verschiedenen Stakeholdern unterhalten. Durch die Umsetzung dieser Methoden hat der Fonds seine zugesagten ökologischen und sozialen Ziele erreicht.

1. Der Fonds wies den Großteil seines Nettovermögens nachhaltigen Investitionen zu. Diese Verpflichtung wurde erfüllt, indem entweder in Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung (dies sind Finanzinstrumente zur Finanzierung von Projekten mit positiven ökologischen oder sozialen Auswirkungen) oder in konventionelle Anleihen, die sich auf nachhaltige Aktivitäten konzentrieren, investiert wurde. Um die Eignung jedes Wertpapiers als nachhaltige Anlage gemäß der Definition der Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) (siehe Abschnitt 2.17) festzustellen, führte die Anlageverwaltung eine gründliche Bewertung durch. Dabei wurde unter anderem geprüft, ob die Erlöse aus grünen, sozialen oder Nachhaltigkeitsanleihen für Investitionsausgaben verwendet wurden, die ökologische oder soziale Ziele fördern. Bei nachhaltigen Anlagen in konventionelle Anleihen hat die Anlageverwaltung durch ihre Recherchen festgestellt, ob ein Emittent ausschließlich Projekte finanzierte, die einen positiven Beitrag zu ökologischen und/oder sozialen Zielen leisteten. Ferner untersuchte die Anlageverwaltung die Indikatoren für wesentliche negative Auswirkungen (PAII) in Bezug auf den Emittenten sowie die möglichen Auswirkungen der Finanzierung von Investitionsausgaben auf diese PAII. Bei der Bewertung wurde auch geprüft, ob die gesamten wirtschaftlichen Aktivitäten des Emittenten und die finanzierten Investitionsausgaben potenziell erheblichen Schaden anrichten könnten; es wurden auch die Governance-Praktiken des Emittenten auf ihre Nachhaltigkeit hin untersucht. Dank diesem strengen Überprüfungsprozess wurde sichergestellt, dass nur grüne, soziale, nachhaltige oder konventionelle Anleihen, die von qualifizierten Emittenten ausgegeben wurden, als nachhaltige Investitionen klassifiziert wurden.

2. Die Anlageverwaltung bediente sich einer Suite von IT-Lösungen, die nahtlos in die Compliance- und Handelsstrukturen integriert ist. Diese Systeme wurden bei der Überwachung und dem Ausschluss von Emittenten eingesetzt, die gegen zwingende Vorschriften in Bezug auf schädliche wirtschaftliche Aktivitäten oder umstrittene Geschäftspraktiken verstießen (dazu gehören auch demokratische Standards für staatliche Emittenten).

3. Die Anlageverwaltung stand im ständigen Dialog mit den Emittenten, durch persönliche Treffen, Online-Meetings und Schriftverkehr, um das nachhaltige Anlageziel des Fonds sicherzustellen. Diese Kommunikation erfolgte mit Portfoliounternehmen, die an dieser und anderen von der Anlageverwaltung gemanagten Strategien beteiligt sind.

- Internetmeetings sind nach wie vor die kosteneffizienteste Lösung, denn sie ermöglichen der Anlageverwaltung den Dialog mit der Geschäftsleitung, Investor Relations und Nachhaltigkeitsfachleuten zur Diskussion über Themen mit Nachhaltigkeitsbezug. Bei diesen Gesprächen wurden unter anderem die Äußerungen der Emittenten zu bestimmten Kontroversen erfragt, um deren Positionen besser zu verstehen. Bei Bedarf wurden sie aufgefordert, zur Abhilfe gegenüber betroffenen Bevölkerungsgruppen und Ökosystemen eine proaktivere Haltung einzunehmen. Zudem besprach die Anlageverwaltung bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken oder -chancen, die für einzelne Emittenten wesentlich oder Teil eines thematischen Dialogs zu vorab ausgewählten Themen waren, wie zum Beispiel Sicherheit der künstlichen Intelligenz und Reduzierung von Methan-Emissionen.
- Die schriftliche Kommunikation umfasste Briefe an Emittenten, in denen die Anlageverwaltung ihre Meinung zu Themen äußerte, die sie für den Emittenten oder dessen Wirtschaftszweig als wichtig erachtete. Die Anlageverwaltung bat Portfoliounternehmen aus bestimmten Sektoren auch darum, Fragebogen zur Informationsbeschaffung auszufüllen, um bessere Investitionsentscheidungen zu ermöglichen. So wurden zum Beispiel Umfragen an Finanzinstitute verschickt, in denen deren Beteiligung an Krediten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen erfragt wurde, um Investitionen in diejenigen zu fördern, bei denen eine strategische Verpflichtung besteht, nicht in Öl-, Gas- und Kohleprojekte zu investieren.
- Schließlich hatte die Anlageverwaltung bei Branchenveranstaltungen wie der EuroMoney Conference in Wien im Januar 2024, der Erste Group ESG CEE Konferenz in Wien im Mai 2024 und dem Investor Relations Forum 2024 in Breslau die Gelegenheit, eine größere Gruppe von Stakeholdern persönlich zu treffen. Bei diesen Konferenzen hielt die Anlageverwaltung Workshops und nahm an Panels teil und konnte so über die Best Practices des nachhaltigen Investierens informieren.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

**Bei den Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

# 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- Es wurden damit **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
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt**: 0,00%

**NEIN**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 14,95 % 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
- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds hat alle festgelegten ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich beworben. Im Folgenden ist für jedes der folgenden Merkmale die Erfolgsquote angegeben:

- Förderung des Übergangs zu einer CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaft durch Vermeidung von Investitionen in Emittenten, die beim Übergang zurückliegen:

Um die Energieeinsparung und die Reduzierung von Treibhausgasemissionen (THG) zu fördern, war die Anlageverwaltung bestrebt, in sogenannte 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 35,86 % seines Nettoinventarwerts (NIW). Um den Übergang bestmöglich zu fördern, wurden die unteren 20 %, die sogenannten Umweltnachzügler, aus dem investierbaren Universum ausgeschlossen. Zudem investierte die Anlageverwaltung nicht in Emittenten, deren Beteiligung an der Förderung fossiler Brennstoffe oder an der Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen über das von der Anlageverwaltung für akzeptabel erachtete Niveau hinausging (siehe dazu die Schwellenwerte in den vorvertraglichen Informationen).

Im Referenzzeitraum betrug die durchschnittliche THG-Intensität der Portfoliounternehmen (Scope 1, 2 und 3) beim Fonds 600,29 und bei der Benchmark 1.117,18. Die Scope 1- und 2-THG-Intensität betrug beim Fonds 89,91 und bei der Benchmark 282,31. Die THG-Intensität des Fonds ist niedriger als die der Benchmark, was die strategische Portfolioauswahl zur Verringerung der Treibhausgasintensität reflektiert. Die Ausrichtung des Fonds auf Unternehmen mit geringerer Kohlenstoffintensität erlaubt es dem Fonds zum einen, seine ökologischen Ziele zu erfüllen, und zum anderen, die potenziellen Risiken im Zusammenhang mit Klimaschutzvorschriften und den Veränderungen des Marktumfelds in Richtung nachhaltigerer Praktiken zu reduzieren.

Die Anlageverwaltung hat auch mehrere idiosynkratische Engagements geführt.

Darüber hinaus investierte der Fonds in Anleihen, bei denen die Mittelverwendung einem grünen Zweck diente und die ausdrücklich für die Finanzierung geeigneter Projekte begeben wurden. Ein Beispiel dafür ist die Investition des Fonds in eine von dem US-Energieunternehmen Public Service Enterprise Group, Inc. (PSEG) begebene Nachhaltigkeitsanleihe. Das Unternehmen hat aktive Schritte unternommen, um die Emissionen zu senken, die staatlichen Bemühungen um saubere Energie zu unterstützen und die Infrastruktur zu erneuern, um die Methanemissionen zu reduzieren und die Infrastruktur für Elektrofahrzeuge zu fördern. Das Unternehmen hat einen bedeutenden Beitrag zu Bildungsprogrammen, zur Entwicklung von Arbeitskräften und zu gemeinnützigen Aktivitäten geleistet und damit sein Engagement für soziale Belange unterstrichen. Die Finanzlage von PSEG ist robust; das Unternehmen führt ein diszipliniertes Investitionsprogramm mit einem strategischen Fokus auf einem überzeugenden Anlageangebot in einem überwiegend regulierten Sektor.

- Einführung von Negativscreens als Teil seines Anlageprozesses:

Im Rahmen des Portfolioverwaltungsprozesses wurden Negativscreen erfolgreich eingeführt. Durch den Ausschluss von Unternehmen, die an bestimmten, in vorvertraglichen Informationen festgelegten Praktiken beteiligt sind (z. B. wiederholte und schwerwiegende Verstöße gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen, die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen), haben sie ihre Ausrichtung auf die Beschränkungen des Fonds und ihre Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen bewiesen. Die Bewertung des Unternehmens Energy Transfer LP stellt ein Beispiel für die Einführung von Negativscreens im Rahmen des Portfolioverwaltungsprozesses dar. Der Emittent ist in mehrere Praktiken verwickelt, die gegen die Umweltgesetze und Menschenrechte verstoßen und die nicht gelöst wurden. Es wurden mehrere Leckagen aus den durch Energy Transfer betriebenen Rohölleitungen gemeldet, die zu großen Umweltverschmutzungen führten. Darüber hinaus ist der Emittent in einen ungelösten Fall verwickelt, bei dem es um die Verletzung der Menschenrechte des Stammes der Standing Rock Sioux und die Beschädigung ihrer Grabstätten und kulturellen Stätten in North Dakota geht. Nach der Ermittlung der beschriebenen Verstöße haben wir im Rahmen unserer Negativscreens eingehende Überprüfungen durchgeführt und das Unternehmen Energy Transfer LP veräußert.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- 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 während des Referenzzeitraums ab.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	13,63%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	1,32%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden	35,86%
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	82,00

## ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Im aktuellen Referenzzeitraum, der am 30. Juni 2024 endete, reduzierte der Fonds seine durchschnittliche Allokation in nachhaltige Anlagen gegenüber dem vorherigen Referenzzeitraum. Am 30. Juni 2023 betrug das Engagement in grünen Anleihen 16,09 % und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 fiel die durchschnittliche Allokation auf 13,63 %.

Am 30. Juni 2023 betrug das Engagement in sozialen Anleihen 1,50 % und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 fiel die durchschnittliche Allokation auf 1,32 %.

Im aktuellen Referenzzeitraum, der am 30. Juni 2024 endete, erhöhte der Fonds seine durchschnittliche Allokation in Umweltchampions deutlich gegenüber dem vorherigen Referenzzeitraum. Am 30. Juni 2023 betrug das Engagement in Umweltchampions 33,24 % und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2024 stieg die durchschnittliche Allokation auf 35,86 %.

Am Ende des aktuellen und des vorherigen Bezugszeitraums wies der Fonds kein Engagement in und keine Verbindung zu den ausgeschlossenen Sektoren und weiteren Ausschlüssen auf.

In beiden Bezugszeiträumen war die Anlageverwaltung aktiv im Bereich Nachhaltigkeitsengagement. Unterstrichen wird dies durch die Tatsache, dass im vorherigen Referenzzeitraum mit 38 Emittenten ein Dialog geführt wurde und die Anlageverwaltung ihre Bemühungen in diesem Bereich ausgeweitet hat, sodass es im aktuellen Referenzzeitraum 82 Emittenten waren.

Hinweis: Benchmark PAI 1 bzw. finanzierte Emissionen ist für die Benchmark-Analyse nicht vergleichbar. Bei der Berechnung der Kennzahl „Investor Stake“ (Marktwert der Anlage/EVIC) gibt es eine Verzerrung, da die Inputs aus verschiedenen Datenquellen stammen (Factset BDF und MSCI ESG). Dies hat eine Inkongruenz beim Bewertungsdatum sowie bei der Maßeinheit zur Folge. Benchmark PAI 1 Kennzahlen zum 30. Juni 2023 wurden gegenüber der vorherigen Berichterstattung des Fonds angepasst.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in grüne Anleihen	13,63%	16,09%
Prozentualer Anteil der Investitionen in soziale Anleihen	1,32%	1,50%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%	0,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden	35,86%	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%	0,00%

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2024	2023
	Wert	Wert
Anzahl der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter im Rahmen eines Engagements zusammenarbeitete	82,00	38,00

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	259,76	89,67%	300,50	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	299,16	91,64%	288,56	91,74%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	67,10	89,67%	71,56	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	55,87	91,64%	54,90	91,74%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	2 058,32	89,67%	2 335,23	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	2 154,19	91,50%	2 376,13	91,65%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	326,85	89,67%	372,05	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	355,03	91,64%	343,47	91,74%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	2 385,17	89,67%	2 707,28	89,12%
Benchmark – THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	2 509,22	91,64%	2 719,59	91,74%
CO2-Bilanz 1&2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	38,17	89,67%	45,15	89,12%
Benchmark – CO2-Bilanz 1 & 2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	59,42	91,64%	59,29	91,74%
Geschätzte CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	280,08	89,67%	328,57	89,12%
Benchmark – Geschätzte CO2-Bilanz (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	420,60	91,64%	469,47	91,74%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	89,91	94,70%	95,03	94,55%
Benchmark – THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	282,31	99,16%	301,23	99,01%
Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	600,29	94,70%	708,01	94,55%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Benchmark – Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	1 117,18	99,16%	1 131,27	99,01%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	13,30%	94,01%	15,75%	93,05%
Benchmark-Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	16,57%	97,51%	16,26%	96,92%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	71,99%	69,81%	72,75%	82,30%
Benchmark – Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	70,92%	71,59%	71,95%	85,22%
Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	50,11%	0,00	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	72,77%	0,00	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,07	50,61%	1,69	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,32	72,77%	1,97	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs : Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,46	55,17%	0,83	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,41	72,77%	0,76	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs : Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	2,15	51,17%	2,60	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	8,81	72,77%	9,11	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs : Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	50,11%	0,00	77,14%
Benchmark – Intensität des	GWh pro Mio. € Umsatz	0,67	72,77%	0,71	77,80%



		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Energieverbrauchs : Wasser (EUR)					
Intensität des Energieverbrauchs : Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	50,11%	0,00	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,24	72,77%	0,20	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,06	50,83%	0,06	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,18	72,77%	0,06	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	5,53	51,10%	11,17	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,44	72,77%	4,65	77,80%
Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,38	50,58%	0,40	77,14%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs : Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,52	72,77%	0,56	77,80%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,01%	0,00%	93,05%
Benchmark – Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	4,52%	97,35%	0,11%	96,92%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
Benchmark – Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,22	0,04%	1 830,61	0,16%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	1,34	40,03%	0,31	33,64%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Benchmark – Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,61	40,78%	0,65	27,28%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,01%	0,00%	93,05%
Benchmark – Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,33%	98,25%	0,32%	98,03%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	27,30%	94,01%	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	31,61%	97,49%	62,27%	96,92%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	17,19%	35,34%	15,55%	26,61%
Benchmark – Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	18,44%	33,11%	20,02%	22,80%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	34,42%	94,01%	33,79%	93,05%
Benchmark – Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher	34,09%	97,51%	33,50%	96,90%

		PAI im historischen Vergleich			
		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang
	Vorstandsmitglied er				
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,01%	0,00%	93,05%
Benchmark – Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,94%	97,51%	0,95%	96,92%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	275,73	3,23%	k. A.	k. A.
Benchmark – THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	k. A.	k. A.
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	3,23%	k. A.	k. A.
Benchmark – Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	0,00%	k. A.	k. A.

● **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,
- sozialer Integration,
- guten Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten eine Allokation 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:

- die Mittel 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 Fonds, mindestens 1 % seines Portfolios in nachhaltige soziale Aktivitäten zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- die Mittel für geeignete soziale Projekte genutzt wurden,
- der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang stand (u. a. den Social Bond Principles der ICMA), und
- 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?**

Die Anlageverwalter verwendeten eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen. Alle Emittenten wurden mit Hilfe der Principal Adverse Impact Risk App (die „PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten verschiedener externer Anbieter, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche Wirtschaftstätigkeiten und/oder Kontroversen involviert sind, und solche Emittenten aus dem Anlageuniversum auszuschließen. Ein zweites proprietäres Instrument, der Energy and Environmental Transition Index („EETI“), stufte die verbleibenden staatlichen Emittenten im Universum nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer Treibhausgasintensität ein. Staatliche Emittenten, die basierend auf dem EETI zu den untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppe zählten, wurden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Ein weiteres Instrument, die ESG Credit App, ordnete die Unternehmensemittenten nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer Treibhausgasintensität ein und verwendete dazu verschiedene Daten, wie z.B. Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen und die historische Entwicklung der Emittenten. Unternehmensemittenten, die zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehören (d. h. Klima-Nachzügler), wurden auf der Grundlage der ESG Credit App ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen. Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten (PAI Nr. 16) und/oder Korruption überprüft. Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den 11 % des Fondsportfolios, die für ökologische und soziale Ziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Erfüllung des DNSH-Kriteriums („Do Not Significant Harm“) für das Projekt durch.

## **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Bei der Beurteilung dessen, ob die Anlagen des Fonds den „Do No Significant Harm“-Grundsätzen entsprechen, berücksichtigte die Anlageverwaltung alle verpflichtenden PAI-Indikatoren von Tabelle 1 in Anhang I der in der SFDR vorgesehenen Regulatory Technical Standards („RTS“), sofern diese für die vom Fonds beabsichtigten Anlagen relevant waren, sowie weitere Quellenangaben, die die Anlageverwaltung als Indikatoren für nachteilige Auswirkungen ansah. Die Anlageverwaltung führte diese Analyse auf der Ebene der einzelnen nachhaltigen Investitionen durch, sodass die Relevanz und die Wesentlichkeit der PAI-Indikatoren in den Anlagen jeweils unterschiedlich sein kann. Emittenten, die nach Einschätzung der Anlageverwaltung gegen diese Indikatoren verstießen, wurden nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft. Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüften und dokumentierten die Anlageverwalter die Wesentlichkeit der relevanten PAIs für das Projekt und die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten. Wenn die Anlageverwaltung beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte sie sich, dass die finanzierten Projekte das Risiko von PAIs im Zusammenhang mit Treibhausgasemissionen verringerten.

## **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 die Anlageverwaltung 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, welche 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:

- Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten,
- Einschränkung des Fonds-Anlageuniversums und
- Hilfestellung für thematisches Engagement.

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die von der Anlageverwaltung als „Umweltchampions“ eingestuft wurden. „Umweltchampions“ wurden anhand eines proprietären ESG-Rankings identifiziert:

- Die ESG Credit App ordnete die Unternehmensemittenten nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer Treibhausgasintensität ein und verwendete dazu verschiedene Datenreferenzen, wie z. B. Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen, die historische Entwicklung der Emissionen bei den Emittenten.

- Der Energy and Environment Transition Index (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).

Beschränkung 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 Anlageverwaltung schloss 2023 die obligatorische Einflussnahme auf 5 % der Beteiligungen erfolgreich ab, 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.

PAI-Kennzahlen entsprechen den Durchschnittswerten am 29. September 2023, 29. Dezember 2023, 29. März 2024 und 30. Juni 2024.

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	259,76	89,67%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	299,16	91,64%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	67,10	89,67%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	55,87	91,64%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	2 058,32	89,67%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	2 154,19	91,50%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	326,85	89,67%
Benchmark – THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	355,03	91,64%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	2 385,17	89,67%
Benchmark – THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO <sub>2</sub> e	2 509,22	91,64%
CO <sub>2</sub> -Bilanz 1&2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	38,17	89,67%
Benchmark – CO <sub>2</sub> -Bilanz 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	59,42	91,64%
Geschätzte CO <sub>2</sub> -Bilanz (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	280,08	89,67%
Benchmark – Geschätzte CO <sub>2</sub> -Bilanz (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/investierte Mio. €	420,60	91,64%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	89,91	94,70%
Benchmark – THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	282,31	99,16%
Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	600,29	94,70%
Benchmark – Geschätzte THG-Intensität (EUR)	tCO <sub>2</sub> e/Mio. € Umsatz	1 117,18	99,16%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	13,30%	94,01%
Benchmark– Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	16,57%	97,51%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	71,99%	69,81%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Benchmark – Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	70,92%	71,59%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	50,11%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	72,77%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,07	50,61%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,32	72,77%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,46	55,17%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,41	72,77%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	2,15	51,17%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	8,81	72,77%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	50,11%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,67	72,77%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	50,11%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,24	72,77%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,06	50,83%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,18	72,77%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	5,53	51,10%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,44	72,77%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,38	50,58%
Benchmark – Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,52	72,77%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,01%
Benchmark – Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	4,52%	97,35%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%
Benchmark – Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,22	0,04%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	1,34	40,03%
Benchmark – Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,61	40,78%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,01%
Benchmark – Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,33%	98,25%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	27,30%	94,01%
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	31,61%	97,49%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	17,19%	35,34%
Benchmark – Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	18,44%	33,11%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	34,42%	94,01%
Benchmark – Geschlechtervielfalt im Vorstand	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Vorstandsmitglieder	34,09%	97,51%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,01%
Benchmark – Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,94%	97,51%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	275,73	3,23%
Benchmark – THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	0,00	0,00%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	3,23%
Benchmark – Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	0,00%



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 - 30.06.2024.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Morgan Stanley 3.591% 07/22/2028 FIXED TO FLOAT	Finanzsektor	2,12%	USA
Citigroup Inc 3.668% 07/24/2028 FIXED TO FLOAT	Finanzsektor	2,06%	USA
BNP Paribas SA 3.375% 01/09/2025 REG S	Finanzsektor	1,91%	Frankreich
Verizon Communications Inc 2.85% 09/03/2041	Kommunikationsdienste	1,90%	USA
Enel Finance International NV 3.5% 04/06/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,81%	Italien
UBS Group AG 2.095% 02/11/2032 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,72%	Schweiz
EDP Finance BV 1.71% 01/24/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,70%	Portugal
United States Treasury Floating Rate Note FRN 01/31/2024	Staatsanleihen	1,67%	USA
Toronto-Dominion Bank/The 1.15% 06/12/2025	Finanzsektor	1,59%	Kanada
T-Mobile USA Inc 3.375% 04/15/2029	Kommunikationsdienste	1,48%	USA
Toyota Motor Credit Corp 2.15% 02/13/2030	Zyklische Konsumgüter	1,47%	USA
American Express Co 3.3% 05/03/2027	Finanzsektor	1,38%	USA
Aercap Ireland Capital DAC / Aercap Global Aviation Trust 2.45% 10/29/2026	Finanzsektor	1,35%	Irland
Ford Foundation/The 2.815% 06/01/2070	Industrie	1,32%	USA
Fiserv Inc 3.2% 07/01/2026	Finanzsektor	1,32%	USA





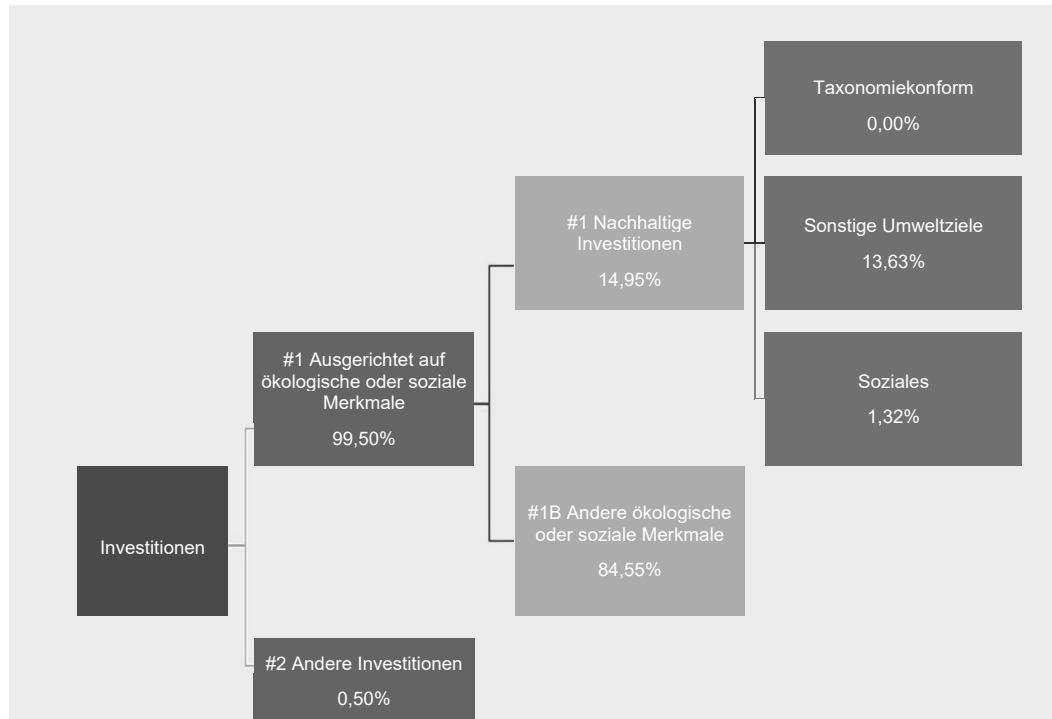
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 14,95 %.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,50 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,5 %) 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/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 14,95 % 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?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	30,96%
Gesundheitssektor	13,78%
Kommunikationsdienste	12,03%
Versorgungsunternehmen	8,23%
Energie	7,04%
Basiskonsumgüter	5,96%
Industrie	5,12%
Informationstechnologie	4,90%
Zyklische Konsumgüter	3,43%
Staatsanleihen	3,23%
Grundstoffe	2,80%
Immobilien	2,01%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	12,15%
Kapitalmärkte	11,10%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	6,12%
Stromversorger	5,31%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	4,87%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	4,81%
Pharmaindustrie	3,84%
Finanzdienstleistungen	3,28%
Medien	3,26%
Staatsanleihen	3,23%
Versicherungen	3,06%
Biotechnologie	2,70%
Getränke	2,20%
Software	2,10%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	2,05%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften. Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

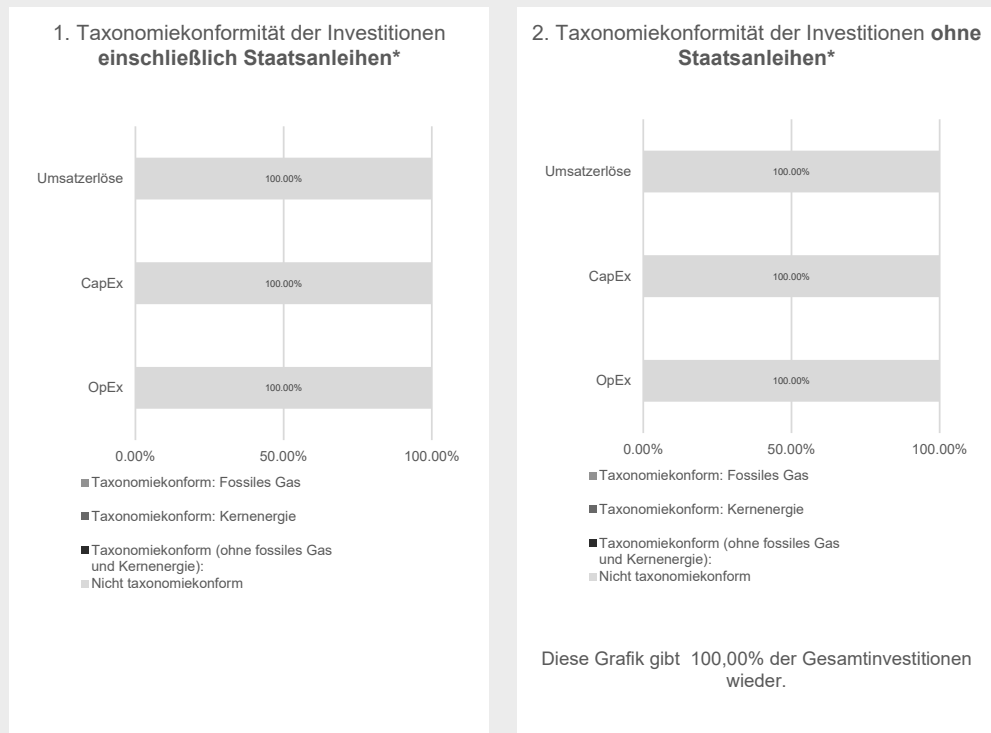
Nicht zutreffend.

### 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

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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.


<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.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermögliche Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.

 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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Gemäß der Verpflichtung des Fonds bestand das Portfolio zu 13,63 % aus „nachhaltigen Anlagen“ laut EU-Taxonomie, deren ökologische Zielsetzung nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 1,32 %.



### **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 0,5 % 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 Anlageverwaltung wandte verschiedene Methoden an, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale einzubeziehen und gleichzeitig die obligatorischen Bestandteile der Anlagestrategie einzuhalten. Diese Methoden, die im Folgenden aufgeführt werden, umfassen eine Synthese von IT-Anwendungen, qualitativen und quantitativen Analysen und Interaktionen mit den verschiedenen Stakeholdern (unter anderem). Durch die Umsetzung dieser Methoden hat der Fonds seine zugesagten ökologischen und sozialen Merkmale erreicht.

1. Der Fonds weist einen Teil seines Nettovermögens nachhaltigen Investitionen zu. Das Erreichen dieser Verpflichtung wurde durch Investitionen in Instrumente mit fester Mittelverwendung erfüllt. Diese Finanzinstrumente werden für die Finanzierung von Projekten mit positiven ökologischen oder sozialen Auswirkungen konzipiert. Um die Eignung jedes Wertpapiers als nachhaltige Anlage gemäß der Definition der Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) (siehe Abschnitt 2.17) festzustellen, führt die Anlageverwaltung eine gründliche Bewertung durch. Dabei wird unter anderem geprüft, ob die Erlöse aus grünen, sozialen oder Nachhaltigkeitsanleihen für Investitionsausgaben verwendet werden, die ökologische oder soziale Ziele fördern. Ferner untersucht die Anlageverwaltung die Indikatoren für wesentliche negative Auswirkungen (PAII) in Bezug auf den Emittenten sowie die möglichen Auswirkungen der Finanzierung von Investitionsausgaben auf diese PAII. Bei der Bewertung wird auch geprüft, ob die gesamten wirtschaftlichen Aktivitäten des Emittenten und die finanzierten Investitionsausgaben potenziell erheblichen Schaden anrichten könnten und die Governance-Praktiken des Emittenten werden auf ihre Nachhaltigkeit hin untersucht. Dieser strenge Überprüfungsprozess gewährleistet, dass nur geprüfte grüne, soziale und nachhaltige Anleihen als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

2. Die Anlageverwaltung bediente sich einer Suite von IT-Lösungen, die nahtlos in die Compliance- und Handelsstrukturen integriert ist. Diese Systeme wurden bei der Überwachung und dem Ausschluss von Emittenten eingesetzt, die gegen zwingende Vorschriften in Bezug auf schädliche wirtschaftliche Aktivitäten oder umstrittene Geschäftspraktiken verstießen (dazu gehören auch demokratische Standards für staatliche Emittenten). Zu dieser Suite von IT-Lösungen zählten zwei zentrale Anwendungen – die ESG Credit Application und der Energy and Environmental Transition Index (EETI). Die Letztere gliedert die THG-Emissionen von Emittenten mit einer sektorspezifischen Gruppe ab und identifizierte so die schlechtesten 20 % der Emittenten – die als „Nachzügler“ gelten – als nicht-investierbare Unternehmen. Das Anlageteam nutzte außerdem sowohl interne als auch externe Informationen, wie z. B. MSCI-Daten, um zu untersuchen, ob die Emittenten in kontroverse Geschäftspraktiken verwickelt sind oder ihre Umsatzerlöse aus schädlichen Aktivitäten stammen, wie z. B. der Rüstung, dem Abbau von Kraftwerkskohle oder der Tabakerzeugung. Eine umfassende Liste der Ausschlüsse ist in den vorvertraglichen Informationen enthalten. Dieses strenge Verfahren stellte sicher, dass alle unzulässigen Emittenten vor dem Handel (Pre-Trade) ausgeschlossen wurden. Nach der Transaktion (Post-Trade) überprüften die IT-Systeme weiterhin diese Beschränkungen und meldeten Emittenten, deren nachhaltige Merkmale eine Verschlechterung aufwiesen, um so die Notwendigkeit einer zeitnahen Veräußerung zu signalisieren.

3. Um die in den vorvertraglichen Offenlegungen beschriebene Einhaltung der ökologischen und sozialen Merkmale zu gewährleisten, nutzte die Anlageverwaltung die „PAII App“. Diese Anwendung lieferte Informationen zu den Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAII) jedes Emittenten in Bezug auf das Anlageuniversum. Da die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds mit bestimmten PAIIs korrelieren, können Portfoliomanager im Entscheidungsfindungsprozess bei der Investition mit diesem Instrument neben anderen finanziellen und nicht-finanziellen Eigenschaften Risiken einer Exponierung in bestimmten PAII gewichten. Darüber hinaus bemühte sich das Anlageteam, die Exposition auf Fondsebene mit dem Referenzindex zu vergleichen, obwohl der Fonds nicht verpflichtet ist, seine durchschnittliche PAII-Exposition unter der Benchmark zu halten. Durch diese Überwachung konnte die Effizienz des Fonds beim Erreichen der gewünschten Merkmale beurteilt und bei Bedarf die Umsetzung korrigierender Maßnahmen gesteuert werden.

4. Um ökologische und soziale Merkmale zu fördern und das obligatorische Einwirken auf Emittenten zu gewährleisten, die am stärksten in die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen involviert sind, kommunizierte die Anlageverwaltung bei persönlichen Treffen, Internetmeetings und schriftlich mit den Emittenten. Diese Kommunikation erfolgte mit Portfoliounternehmen, die an dieser und anderen vom Anlageteam gemanagten Strategien beteiligt sind.

- Internetmeetings sind nach wie vor die kosteneffizienteste Lösung, denn sie ermöglichen der Anlageverwaltung den Dialog mit der Geschäftsleitung, Investor Relations und Nachhaltigkeitsfachleuten zur Diskussion über Themen mit Nachhaltigkeitsbezug. Bei diesen Gesprächen wurden die Emittenten unter anderem zu bestimmten Kontroversen befragt, um ihre Positionen besser zu verstehen. Bei Bedarf wurden sie aufgefordert, zur Abhilfe gegenüber betroffenen Bevölkerungsgruppen und Ökosystemen eine proaktivere Haltung einzunehmen. Zudem besprach das Team bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken oder -chancen, die für einzelne Emittenten wesentlich oder Teil eines thematischen Dialogs zu vorab ausgewählten Themen waren, wie zum Beispiel Sicherheit der künstlichen Intelligenz und Reduzierung von Methan-Emissionen.
- Die schriftliche Kommunikation umfasste Briefe an Emittenten, in denen die Anlageverwaltung ihre Meinung zu Themen äußerte, die sie für den Emittenten oder dessen Wirtschaftszweig als wichtig erachtete. Die Anlageverwaltung bat Portfoliounternehmen aus bestimmten Sektoren auch darum, Fragebogen zur Informationsbeschaffung auszufüllen, um bessere Investitionsentscheidung zu ermöglichen. So wurden zum Beispiel Umfragen an Finanzinstitute verschickt, in denen deren Beteiligung an Krediten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen erfragt wurde, um Investitionen in diejenigen zu fördern, bei denen eine strategische Verpflichtung besteht, nicht in Öl-, Gas- und Kohleprojekte zu investieren.
- Schließlich hatten die VertreterInnen der Anlageverwaltung bei Branchenveranstaltungen wie der EuroMoney Conference in Wien im Januar 2024, der Erste Group ESG CEE Konferenz in Wien im Mai 2024 und dem Investor Relations Forum 2024 in Breslau die Gelegenheit, eine größere Gruppe von Stakeholdern persönlich zu treffen. Bei diesen Konferenzen hielt die Anlageverwaltung Workshops und nahm an Panels teil und konnte so über die Best Practices des nachhaltigen Investierens informieren.



## 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.

Nur zum Vertrieb zugelassen, wenn ein verkürzter Verkaufsprospekt und/oder Verkaufsprospekt beiliegt oder zuvor übermittelt wurde. Anleger sollten die Anlageziele, Risiken, Gebühren und Aufwendungen eines Fonds sorgfältig abwägen, bevor sie eine Anlage tätigen. Ein Verkaufsprospekt enthält diese und weitere Informationen; bitte lesen Sie diesen vor der Anlage sorgfältig.

Damit wir Qualitätsservice bestmöglich gewährleisten können, werden alle Anrufe an und von unserem Service mitgehört und/oder aufgezeichnet.



**Jahresbericht**  
**Franklin Templeton ICAV**