

FRANKLIN LIBERTYSHARES ICAV

30. Juni 2022



Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

Franklin FTSE China UCITS ETF

Franklin FTSE India UCITS ETF

Franklin FTSE Korea UCITS ETF

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF

Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate
Bond UCITS ETF

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF

Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF

Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate
UCITS ETF

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign
Debt UCITS ETF

INHALT

	Seite
Verzeichnis	2
Allgemeine Informationen	4
Bericht des Verwaltungsrats	8
Bericht des Anlageverwalters	13
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber	41
Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers	42
Bilanz	47
Gesamtergebnisrechnung	53
Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	59
Erläuterungen zum Abschluss	65
Vermögensaufstellung	
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	153
Franklin FTSE China UCITS ETF	156
Franklin FTSE India UCITS ETF	173
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	177
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF	181
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	184
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	187
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	193
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	196
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	203
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	212
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	214
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	218
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	222
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	229
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	235
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	247
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	254
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	259
Offenlegung zu Vergütungen (ungeprüft).....	262
Übersicht über Portfolioveränderungen (ungeprüft)	263
Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft)	298

VERZEICHNIS

VERWALTUNGSRAT

William Jackson (Brite) (Vorsitzender)
Robert Burke (Ire)*
Frank Ennis (Ire)*
Gregory McGowan (US-Amerikaner)
Patrick O'Connor (US-Amerikaner)
Caroline Baron (Französin)

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht geschäftsführend

EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ

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

ANLAGEVERWALTER

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

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

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

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

REGISTRIERUNGSNUMMER

C167746

* Unabhängige Verwaltungsratsmitglieder.

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

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

RECHTSBERATER

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

VERWAHRSTELLE

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

VERWALTER

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

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

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

VERTRETER IN DER SCHWEIZ

Franklin Templeton Switzerland Limited
Stockerstrasse 38
8002 Zürich
Schweiz

AUTORISIERTE TEILNEHMER

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

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

VERZEICHNIS (Fortsetzung)

AUTORISIERTE TEILNEHMER (Fortsetzung)

Commerzbank AG
Kaiserplatz
Frankfurt/Main 60311
Deutschland

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

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

Societe Generale
29, Boulevard Haussmann
Paris 75009
Frankreich

GESELLSCHAFTSSEKRETÄR

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

ZAHLSTELLE IN ÖSTERREICH

Unicredit Bank Austria AG
Schottengasse 6 – 8
1010 Wien
Österreich

FAZILITÄTSSTELLE IM VEREINIGTEN KÖNIGREICH

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

ZAHLSTELLE IN DÄNEMARK

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

ZAHLSTELLE IN DER SCHWEIZ

BNP Paribas Securities Services, Paris
Succursale de Zurich
Selnausstrasse 16
8002 Zürich
Schweiz

INFORMATIONSTELLE IN DEUTSCHLAND

Franklin Templeton Investment Services GmbH
Mainzer Landstraße 16 60325
Frankfurt
Deutschland

ZAHLSTELLE IN SCHWEDEN

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

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Franklin LibertyShares ICAV (der „Fonds“ oder die „ICAV“) ist eine als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtete irische Investmentgesellschaft (Irish Collective Asset-Management Vehicle, ICAV) mit der Registrierungsnummer C167746. Die ICAV wurde am 11. Juli 2017 registriert. Die ICAV ist von der irischen Zentralbank (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß den Bestimmungen der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in ihrer jeweils gültigen Fassung) und der Central Bank (Supervision And Enforcement) Act 2013 (Section 48(1) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities)) Regulations von 2019 (in ihrer jeweils gültigen Fassung) (zusammen die „OGAW-Vorschriften“) zugelassen. In diesem Dokument feststehende, aber nicht definierte Begriffe haben dieselbe Bedeutung, die ihnen im Prospekt der ICAV vom 3. Dezember 2021 (der „Prospekt“) zugeschrieben wird.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Teilfonds und Anteilklassen

Zum 30. Juni 2022 sind neunzehn Teilfonds aktiv. Sechzehn dieser Teilfonds bilden einen Index nach (die „indexnachbildenden Teilfonds“), und drei der Teilfonds werden vom Anlageverwalter aktiv gemanagt, um ein bestimmtes Anlageziel zu erreichen (die „aktiv gemanagten Teilfonds“).

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

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

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

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

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

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 zu einem Auflegungspreis von 25 EUR bzw. 25 USD aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 zu einem Auflegungspreis von 25 EUR bzw. 25 USD aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 zu einem Auflegungspreis von 25 EUR bzw. 25 USD aufgelegt.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Börsennotierungen

Die Teilfonds der ICAV sind zum 30. Juni 2022 an den folgenden Börsen notiert:

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

* Zum Handel zugelassen.

** Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

**** Der Teilfonds wurden am 27. Juni 2022 aufgelegt.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Börsennotierungen (Fortsetzung)

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

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

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

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

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

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

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

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022

Der Verwaltungsrat der ICAV legt hiermit seinen Bericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 vor. Der Abschluss der ICAV wurde gemäß Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), irischem Recht einschließlich des Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 (das „ICAV-Gesetz“) und den OGAW-Vorschriften aufgestellt.

Geschäftsrückblick

Die ICAV wurde am 11. Juli 2017 gegründet. Die Auflegungsdaten der einzelnen Teilfonds der ICAV sind auf Seite 5 angegeben.

Die Ergebnisse für das Geschäftsjahr sind auf den Seiten 53 bis 58 aufgeführt. Eine detaillierte Analyse der Wertentwicklung der ICAV ist jeweils dem Bericht des Anlageverwalters über die einzelnen Teilfonds auf den Seiten 13 bis 40 zu entnehmen. Die ICAV wird weiterhin als Investmentgesellschaft wie im Prospekt beschrieben tätig sein.

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

Die Auswirkungen von COVID-19 wurden von der Verwaltungsgesellschaft und den Dienstleistungsanbietern genau überwacht, die bestätigt haben, dass geeignete Maßnahmen für die Kontinuität des Geschäftsbetriebs ergriffen wurden. Dazu gehört die Unterstützung der Mitarbeiter bei der Arbeit von zu Hause aus und bei einer eventuellen Rückkehr in eine Büroumgebung. Der Betrieb an sich wurde nicht beeinträchtigt, und der Teilfonds wurde innerhalb der etablierten rechtlichen, aufsichtsrechtlichen und operativen Infrastruktur- und Risikoparameter verwaltet. Weitere Einzelheiten zu den Auswirkungen von COVID-19 können dem Bericht des Anlageverwalters auf Seite 13 entnommen werden.

Der Jahresabschluss wurde auf Basis der Unternehmensfortführung erstellt, da der Verwaltungsrat keine Kenntnis von irgendetwas erhalten hat, das darauf hindeutet, dass die Teilfonds nicht für zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Jahresabschlusses (der „Bewertungszeitraum“) ihre operative Tätigkeit fortsetzen können.

Corporate Governance

Entsprechenserklärung zur Corporate Governance

Die ICAV hat den Corporate Governance Code for Collective Investment Management Schemes and Management Companies (der „Kodex“) der Irish Funds Industry Association vollständig übernommen. Der Wortlaut des Kodex ist auf der Website der Irish Funds abrufbar: www.irishfunds.ie. Die ICAV hat dem Kodex im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 voll entsprochen.

Beschreibung der Aufgaben des Verwaltungsrats

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

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

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Beschreibung der Aufgaben des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

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

Ausschüttungen

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 festgesetzte Dividenden sind in Erläuterung 12 angegeben.

Finanzinstrumente

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

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Risikomanagementziele und -politik

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

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

Einzelheiten zu den Auswirkungen von COVID-19 und der Russisch-ukrainischen Krise sind im Abschnitt Geschäftsentwicklung in diesem Bericht des Verwaltungsrats auf Seite 8 enthalten.

Wichtige Kennzahlen (Key Performance Indicators)

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

Transaktionen mit verbundenen Parteien

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

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

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

Geschäftsvorfälle mit nahe stehenden Unternehmen und Personen

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

Getrennte Haftung

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

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

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

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Beschäftigte

Die ICAV hatte im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 keine Beschäftigten.

Diversität

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

Wesentliche Ereignisse im Geschäftsjahr

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

Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

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

Verwaltungsratsmitglieder

Die Namen und Nationalitäten der Personen, die zu irgendeinem Zeitpunkt innerhalb des am 30. Juni 2022 abgelaufenen Geschäftsjahres Verwaltungsratsmitglieder waren, sind nachstehend aufgeführt:

William Jackson (Brite)
Robert Burke (Ire)*
Frank Ennis (Ire)*
Gregory McGowan (US-Amerikaner)
Patrick O'Connor (US-Amerikaner)
Caroline Baron (Französin)

* Unabhängige Verwaltungsratsmitglieder

Sekretär

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

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

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

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

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

Politische Spenden

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

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Prüfungsrelevante Informationen

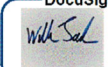
Der Verwaltungsrat hat seiner Auffassung nach alle Maßnahmen ergriffen, die vom Verwaltungsrat ergriffen werden sollten, um Kenntnis von prüfungsrelevanten Informationen zu erlangen und dafür zu sorgen, dass die Abschlussprüfer der Gesellschaft diese Informationen kennen. Soweit den Verwaltungsratsmitgliedern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

Unabhängige Abschlussprüfer

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

Im Namen des Verwaltungsrats:

William Jackson
Verwaltungsratsmitglied

DocuSigned by:

BD0F1D6D795F49E...

Datum: 14. Oktober 2022

Frank Ennis
Verwaltungsratsmitglied

DocuSigned by:

2AF3A12C7C604BA...

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS

Konjunktur- und Marktüberblick für den Bericht des Anlageverwalters

Zwölfmonatiger Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Der zwölfmonatige Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 spiegelte zwei unterschiedliche Hälften wider, da sich die Bedingungen auf den globalen Finanzmärkten von 2021 auf 2022 drastisch veränderten. Ein weltweit weitgehend lockerer geldpolitischer Kurs sowie allgemein gute Unternehmensgewinne in mehreren Regionen der Welt und nachlassende Sorgen über die COVID-19-Pandemie unterstützten die globalen Aktienmärkte in der zweiten Hälfte des Jahres 2021. Nachdem die Aktien Anfang Januar 2022 neue Höchststände erreicht hatten, gerieten sie jedoch angesichts der Inflations Sorgen der Anleger weltweit unter Druck. Der Inflationstrend schien nicht mehr nur vorübergehender Natur zu sein, weil immer mehr Zentralbanken zu einer restriktiveren Geldpolitik griffen und weil sich die geopolitische Instabilität durch den Einmarsch Russlands in die Ukraine Ende Februar noch verschärfte. Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine und die daraus resultierenden Sanktionen sorgten für Handelsstörungen und ließen die Rohöl- und Erdgaspreise in die Höhe schnellen. Im weiteren Verlauf des Jahres erreichte die Inflation in mehreren Ländern aufgrund der Verbrauchernachfrage und von Unterbrechungen der Lieferketten ein Rekordniveau und veranlasste viele Zentralbanken, die Zinssätze zu erhöhen. Im zweiten Quartal 2022 nahmen die Rezessionsängste zu, und die Weltbank senkte im Juni ihre globale Wachstumsprognose von 5,7 % im Jahr 2021 auf 2,9 % für das Jahr 2022.

An den Kreditmärkten war der Zwölfmonatszeitraum durch die Herausforderungen für die Weltwirtschaft in Form der anhaltenden wirtschaftlichen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie, des Beginns des russischen Krieges gegen die Ukraine Ende Februar, der Rohstoffpreisinflation, steigender globaler Zinssätze, des sich abschwächenden globalen Wachstums des Bruttoinlandsprodukts (BIP) und der Lieferkettenunterbrechungen in China im Zuge der Null-COVID-Politik gekennzeichnet. Die Renditen von Staatsanleihen stiegen in den meisten Ländern der Welt, da viele wichtige Zentralbanken die Leitzinsen anhoben, um die Inflation einzudämmen, und Pläne zum Ausstieg aus der vorherigen quantitativen Lockerung bekannt gaben. Die Renditen auf Staatsanleihen aus Industrieländern tendierten nach oben. Die Rendite auf die 10-jährige US Treasury Note erreichte am 14. Juni ein Mehrjahreshoch von 3,48 % und schloss den Berichtszeitraum bei 3,02 %. In Europa erreichte die 10-jährige Bundesanleihe mit 1,77 % am 21. Juni die höchste Rendite seit 2014; am Ende des Berichtszeitraums lag sie bei 1,33 %.

Die US-Aktienmärkte wurden in der zweiten Jahreshälfte 2021 durch anhaltendes Wirtschaftswachstum sowie robuste Unternehmensgewinne und -bilanzen unterstützt. Nachdem die US-Aktien Anfang Januar Rekordhöhen erreicht hatten, fielen sie im ersten Halbjahr 2022. Im Juni ergab sich dann ein Bärenmarkt, da sich die Anleger Sorgen über die steigende Inflation, das Tempo der Zinserhöhungen der US-Notenbank (Fed), einen Konjunkturrückgang im ersten Quartal und die Gefahr einer Rezession machten. Die Fed begann im November mit der Drosselung ihres Anleihekaufprogramms und stellte es im Juni ein. Darüber hinaus erhöhte die Fed den Leitzins im März zum ersten Mal seit Ausbruch der Pandemie um 25 Basispunkte (Bp.), im Mai um 50 Bp. und im Juni um 75 Bp. – die größte Erhöhung seit 1994 – auf eine Spanne von 1,50 % bis 1,75 %.

Die europäischen Aktienmärkte gerieten in der zweiten Jahreshälfte 2021 durch den Anstieg der Coronazahlen, Inflations Sorgen und Bedenken hinsichtlich des Wirtschaftswachstums in Europa und in China unter Druck. Dennoch beendeten sie das Jahr 2021 positiv, begünstigt durch die nachlassenden Ängste betreffend den Coronavirus im Dezember und die Ankündigung der Europäischen Zentralbank (EZB), ihren lockeren Kurs beizubehalten. Die Aktien in Europa fielen im ersten Halbjahr 2022 und im Zwölfmonatszeitraum aufgrund der Besorgnis der Anleger über die anhaltend hohe Inflation, den Russland-Ukraine-Krieg und das Teil-Embargo der Europäischen Union auf russisches Öl. Im Juni kündigte die EZB an, dass sie ihre Nettoanleihenkäufe beenden und ihren Leitzins im Juli zum ersten Mal seit elf Jahren anheben wird, um die rekordhohe Inflation zu bekämpfen. Unterdessen hob die Bank of England ihren Leitzins im Berichtszeitraum fünfmal an, und zwar mit 1,25 % auf den höchsten Stand seit 13 Jahren.

Die japanischen Aktien wurden durch das uneinheitliche Wirtschaftswachstum beeinträchtigt, da das japanische BIP im dritten Quartal 2021 und im ersten Quartal 2022 schrumpfte. Die Bank of Japan beließ ihre Leitzinsen auf den geldpolitischen Sitzungen während des 12-monatigen Berichtszeitraums unverändert. Sie beließ den Tagesgeldsatz bei -0,10 % und das Renditeziel für 10-jährige japanische Staatsanleihen bei 0,0 % innerhalb einer Bandbreite von 25 Basispunkten.

Die Aktien der Schwellenländer wurden durch die Besorgnis der Anleger über eine weltweite Konjunkturabschwächung, anhaltende Unterbrechungen der Lieferketten, hohe Inflation und steigende Zinsen beeinträchtigt. Während die People's Bank of China ihre expansive Geldpolitik beibehielt, erhöhten viele Zentralbanken der Schwellenländer im Zwölfmonatszeitraum die Zinssätze, um die Inflation einzudämmen. So erhöhte die Reserve Bank of India beispielsweise ihren Leitzins im Zwölfmonatszeitraum zweimal auf nunmehr 4,9 %. Andernorts in Asien hob die taiwanesischen Zentralbank ihren Leitzins zweimal an und erhöhte ihn auf 1,5 %, den höchsten Stand seit 2016. In Lateinamerika hob die mexikanische Zentralbank ihren Leitzins mehrmals an; dieser steht nun mit 7,75 % auf dem höchsten Stand seit 2019. Die brasilianische Zentralbank brachte ihren Leitzins nach mehreren Zinserhöhungen mit 13,25 % auf den höchsten Stand seit 2016.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS (Fortsetzung)

Performance-Überblick

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

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Teilfondsrendite basierend auf	
		dem Nettoinventarwert für das Jahr zum 30. Juni 2022 - einjährige Rendite	Rendite des Referenzindex für das Jahr zum 30. Juni 2022 - 1-Jahres-Rendite
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF*	USD	-24,16 %	-24,53 %
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	-31,16 %	-31,13 %
Franklin FTSE India UCITS ETF*	USD	-5,08 %	-5,49 %
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	-38,05 %	-38,06 %
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF**	USD	-18,60 %	-18,68 %
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF*	USD	-12,24 %	-11,79 %
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF*	USD	-20,59 %	-20,19 %
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF*	EUR	2,86 %	2,54 %
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF*	EUR	-7,74 %	-7,78 %
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF*	USD	-6,21 %	-6,02 %
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF*	USD	-15,38 %	-15,22 %
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF*	USD	-4,96 %	-5,05 %
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	EUR	-8,19 %	-8,35 %
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	USD	-13,57 %	-13,65 %
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF**	USD	6,53 %	5,18 %
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF**	USD	-0,48 %	-1,47 %

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

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Teilfondsrendite basierend auf	
		dem Nettoinventarwert für das Jahr zum 30. Juni 2022 - 1-Jahres-Rendite	Rendite des Referenzindex für das Jahr zum 30. Juni 2022 - 1-Jahres-Rendite
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF*	EUR	-15,51 %	-16,44 %
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF*	EUR	-0,17 %	-0,87 %
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF*	USD	-14,40 %	-14,19 %

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

** Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

**** Der Teilfonds wurden am 27. Juni 2022 aufgelegt.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS (Fortsetzung)

Tracking Error (Nachbildungsfehler)

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

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

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

Nachstehende Tabelle stellt den erwarteten Tracking Error der Teilfonds Fonds (wie im Prospekt auf Ex-ante-Basis angegeben) dem tatsächlich realisierten Tracking Error der Teilfonds Fonds zum 30. Juni 2022 gegenüber

Teilfonds	Erwarteter Tracking Error	Annualisierter realisierter Tracking Error
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Bis 2,00 %	1,70 %
Franklin FTSE China UCITS ETF	Bis 0,80 %	0,13 %
Franklin FTSE India UCITS ETF***	Bis 1,00 %	1,66 %
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	Bis 0,50 %	0,14 %
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF**	Bis 1,00 %	0,19 %
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	Bis 0,80 %	0,46 %
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	Bis 0,80 %	0,32 %
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	Bis 0,80 %	0,18 %
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	Bis 0,50 %	0,39 %
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	Bis 0,50 %	0,10 %
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	Bis 0,50 %	0,09 %
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	Bis 0,50 %	0,06 %
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	Bis 0,50 %	0,15 %
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	Bis 0,20 %	0,04 %

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

** Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

*** Der höhere Tracking Error und die Underperformance gegenüber dem Index des Franklin FTSE India UCITS ETF lassen sich auf die Effekte aus der Besteuerung von Kapitalgewinnen in diesem Markt zurückführen.

Der Franklin MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned UCITS ETF und der Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF wurden im Juni 2022 aufgelegt und verfügen daher nicht über eine hinreichende Ertragshistorie, um einen aussagekräftigen realisierten annualisierten Tracking Error zu ermitteln.

Im Berichtszeitraum erzielten die Teilfonds und ihre jeweiligen Referenzindizes die im Bericht des Anlageverwalters angegebene Wertentwicklung. Die Überperformance/Underperformance eines Teilfonds gegenüber seines jeweiligen Referenzindex ist vor allem den zeitlichen Differenzen von Handelsgeschäften, wenn der Index neugewichtet wird, der vom Teilfonds getragenen Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER) und dem für vom Fonds vereinnahmte Dividenden oder Zinsen geltenden Zinssatz gegenüber dem für die Gesamtertragsberechnung des Referenzindex zugrunde gelegten Steuersatz zuzuschreiben.

Franklin Advisers, Inc.
Franklin Templeton Institutional, LLC
Franklin Templeton Investment Management Limited
Franklin Advisory Services LLC
14. Oktober 2022

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin FTSE Brazil UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 für die meisten Abzüge von der absoluten Wertentwicklung des Teilfonds verantwortlich waren, waren Nicht-Basiskonsumgüter, Finanzwerte und Werkstoffe. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Vale, Magazine Luiza and Natura.

Die Sektoren, die im selben Zeitraum den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Energie, Kommunikationsdienstleistungen und Versorger. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Petrobras, Bradespar and Telefonica Brasil.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Vale SA ADR	14,62
Petroleo Brasileiro SA ADR (preferred stock)	7,42
Petroleo Brasileiro SA ADR	5,19
Itau Unibanco Holding SA ADR	5,13
Banco Bradesco SA ADR	4,26
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	3,42
Centrais Eletricas Brasileiras SA	2,95
Ambev SA ADR	2,79
Itausa SA	2,05
WEG SA	2,02

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Finanzwerte	23,71
Grundstoffe	21,05
Energie	17,49
Basiskonsumgüter	12,34
Versorger	10,66
Zyklische Konsumgüter	5,55
Industrie	4,44
Kommunikation	1,72
Technologie	0,52

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Brasilien	97,49

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin FTSE China UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 die für die größten Wertabzüge von der zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds sorgten, waren Nicht-Basiskonsumgüter, Kommunikationsdienstleistungen und das Gesundheitswesen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Alibaba, Tencent and Meituan.

Im selben Zeitraum war die Energie der einzige Sektor, der zur absolute Wertentwicklung des Teilfonds beitrug. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten BYD, Li Auto and Shenhua Energy.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022.

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Tencent Holdings Ltd	11,45
Alibaba Group Holding Ltd	9,07
Meituan	4,29
JD.com Inc	3,22
China Construction Bank Corp 'H' Shares	2,66
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares	1,97
Baidu Inc	1,78
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' Shares	1,70
BYD Co Ltd 'H' Shares	1,41
Wuxi Biologics Cayman Inc	1,37

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Kommunikation	35,27
Finanzwerte	20,07
Basiskonsumgüter	12,63
Zyklische Konsumgüter	12,08
Industrie	6,32
Energie	3,69
Technologie	3,32
Grundstoffe	2,84
Versorger	2,63
Diversifiziert	0,24

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Kaimaninseln	52,80
China	41,98
Hongkong	3,15
Bermuda	1,04
Singapur	0,13

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin FTSE India UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin FTSE India UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 für die meisten Abzüge von der absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Werkstoffe und Finanzen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten HDFC, Infosys and Axis Bank.

Die Sektoren, die im selben Zeitraum den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Energie, Versorger und Kommunikationsdienstleistungen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Reliance Industries, Adani Total Gas und Airtel.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Reliance Industries Ltd	11,75
Infosys Ltd	6,99
Housing Development Finance Corp Ltd	5,12
Tata Consultancy Services Ltd	4,50
Hindustan Unilever Ltd	2,66
Bharti Airtel Ltd	2,12
Axis Bank Ltd	1,96
Bajaj Finance Ltd	1,73
Asian Paints Ltd	1,64
Maruti Suzuki India Ltd	1,51

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Finanzwerte	19,13
Technologie	16,11
Basiskonsumgüter	15,09
Energie	14,34
Zyklische Konsumgüter	10,46
Industrie	8,01
Grundstoffe	6,89
Versorger	6,31
Kommunikation	3,58
Diversifiziert	0,07

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Indien	99,99

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin FTSE Korea UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin FTSE Korea UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Kommunikationsdienstleistungen und Nicht-Basiskonsumgüter. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds mindernden Einzelpositionen gehörten Samsung Electronics, Naver und Kakao.

Im selben Zeitraum leistete kein Sektor einen Wertbeitrag zur absoluten Performance des Teilfonds. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Korea Aerospace Industries, LG Innotek und Hyundai Heavy Industries.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Samsung Electronics Co Ltd	25,54
SK Hynix Inc	5,03
Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock)	4,06
NAVER Corp	3,54
Samsung SDI Co Ltd	2,85
Hyundai Motor Co	2,56
LG Chem Ltd	2,46
Kakao Corp	2,17
Kia Corp	2,04
Celltrion Inc	1,95

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Technologie	36,90
Zyklische Konsumgüter	12,44
Basiskonsumgüter	10,12
Industrie	10,09
Kommunikation	10,01
Finanzwerte	9,82
Grundstoffe	6,78
Energie	2,81
Versorger	0,70

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Südkorea	99,67

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Für den Zeitraum seit Auflegung des Teilfonds vom 21. März 2022 bis zum 30. Juni 2022 leistete kein Sektor einen Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten E Ink, Walsin Lihwa und Far EasTone Telecommunications.

Die Sektoren, die in demselben Zeitraum den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Finanzen und Werkstoffe. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten TSMC, Mediatek and China Steel.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	29,67
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	5,07
MediaTek Inc	3,77
Formosa Plastics Corp	2,06
Delta Electronics Inc	1,86
Nan Ya Plastics Corp	1,82
Chunghwa Telecom Co Ltd	1,80
United Microelectronics Corp	1,79
CTBC Financial Holding Co Ltd	1,78
Fubon Financial Holding Co Ltd	1,64

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Technologie	45,04
Industrie	18,59
Finanzwerte	17,71
Grundstoffe	6,56
Zyklische Konsumgüter	4,76
Kommunikation	3,84
Basiskonsumgüter	1,62
Energie	0,50

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Taiwan	95,67
Kaimaninseln	2,95

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 trugen die Durations- sowie die Renditekurvenpositionierung des Teilfonds zur relativen Wertentwicklung bei. Die Allokation des Teilfonds auf lokalen Märkten steigerte die relativen Ergebnisse zusätzlich, vor allem eine übergewichtete Position auf dem britischen Markt, der sich durch eine Outperformance auszeichnete. Die Währungspositionierung des Teilfonds hatte bedingt durch das Engagement gegenüber dem Pfund Sterling ebenfalls einen leicht positiven Effekt auf die relativen Renditen. Dagegen wurde der relative Wert durch die Sektorallokation und die Wertpapierauswahl des Teilfonds geschmälert, insbesondere durch die Positionierung in staatsnahen Anleihen.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Der Teilfonds Fonds investiert überwiegend in:

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

In geringerem Umfang kann der Teilfonds Fonds auch investieren in:

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

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Netherlands Government Bond	4,77
Bundesobligation	3,72
Ireland Government Bond	3,22
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2,91
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	2,10
Societe Nationale SNCF SA	2,04
Spain Government Bond	1,96
Societe Du Grand Paris EPIC	1,93
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1,92
Orsted AS	1,81

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Staatsanleihen	30,29
Finanzwerte	20,83
Versorger	19,12
Industrie	7,60
Kommunikation	3,95
Energie	2,45
Zyklische Konsumgüter	2,39
Basiskonsumgüter	1,46

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Frankreich	18,31
Niederlande	18,09
Deutschland	16,97
Spanien	6,86
Italien	5,05
Irland	3,22
Belgien	3,05
Schweden	2,66
Luxemburg	2,32
Dänemark	1,82
Sonstige	9,74

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

In dem am 30. Juni 2022 endenden Geschäftsjahr trug die Titelauswahl des Teilfonds in deutschen Bundesanleihen und französischen Staatsanleihen zur relativen Rendite bei, während die Auswahl von Investment-Grade-Papieren bei Finanzwerten und Unternehmensanleihen in der Eurozone den relativen Wert schmälerte. Die Duration und die Positionierung des Teilfonds auf Renditekurve in Eurozone-Anleihen trug ebenfalls zu den relativen Ergebnissen bei. Im Gegensatz dazu beeinträchtigte die Sektorallokation des Teilfonds die relative Performance, insbesondere ein Engagement außerhalb der Benchmark in hochverzinslichen Unternehmensanleihen aus dem Finanzsektor in der Eurozone.

Zusammenfassung der Anlageziele/Anlagepolitik

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

Der Teilfonds Fonds investiert überwiegend in:

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

In geringerem Umfang kann der Teilfonds Fonds auch investieren in:

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

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnettovermögens
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.10% 15/04/2023	4,98
Netherlands Government Bond 2.00% 15/07/2024	3,05
France Treasury Bill BTF 0.00% 30/11/2022	2,97
Spain Letras del Tesoro 0.00% 07/10/2022	2,96
Bundesschatzanweisungen 0.00% 15/03/2024	2,95
Bundesobligation 0.00% 10/10/2025	2,90
France Treasury Bill BTF 0.00% 10/08/2022	2,68
Spain Letras del Tesoro 0.00% 09/12/2022	2,53
French Republic Government Bond OAT 0.25% 25/07/2024	2,50
Spain Government Inflation Linked Bond 1.80% 30/11/2024	2,46

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnettovermögens
Staatsanleihen	45,66
Finanzwerte	33,16
Basiskonsumgüter	4,14
Versorger	1,36
Industrie	1,21
Zyklische Konsumgüter	1,14
Technologie	1,02
Kommunikation	0,93
Hypothekendarlehen	0,10

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Deutschland	15,69
Frankreich	14,75
Spanien	11,37
Niederlande	7,73
Italien	6,85
Belgien	4,94
Vereinigtes Königreich	4,94
Vereinigte Staaten	4,31
Luxemburg	3,79
Schweden	2,12
Sonstige	12,23

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Marktübersicht für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

Im zweiten Halbjahr 2021 waren die Folgen von COVID-19 in der Weltwirtschaft weiterhin spürbar, da die aufeinanderfolgenden Wellen täglicher neuer Fallzahlen, die durch zusätzliche Virusvarianten verursacht wurden, erst im Januar 2022 ihren Höhepunkt erreichten. Obwohl sich die Gesundheitsbehörden davor hüteten, einige der strengeren sozialen Distanzierungsmaßnahmen wieder einzuführen, wirkte sich dies negativ auf das Verbraucherverhalten aus, da die Rückkehr zum Vor-COVID-Niveau ins Stocken geriet. Das Wachstum des US-Bruttoinlandsprodukts (BIP) erreichte im Gesamtjahr 2021 einen Wert von 5,7 %, doch im ersten Quartal 2022 schrumpfte das BIP mit einer Jahresrate von -1,6 %.

Die Inflationssorgen, die in der zweiten Hälfte der Sommermonate 2021 aufkamen, rückten im Laufe des Jahres 2022 in den Mittelpunkt. Die weltweiten Störungen in den Lieferketten führten zu Lieferverzögerungen und Bauteilknappheit, wodurch die Preise von der Angebotsseite her unter Druck gerieten. Diese Entwicklung traf auf eine aufgestaute Verbrauchernachfrage, die durch die historisch hohen Ersparnisse der US-Verbraucher aus den staatlichen Transferzahlungen im Rahmen der COVID-Hilfsmaßnahmen gestärkt wurde. Die Veränderungen des Verbraucherpreisindex (VPI) im Jahresvergleich, die im Juni 2021 bereits bei 5,4 % lagen, wurden durch die russische Invasion in der Ukraine im Februar 2022 noch verschärft. Diese trieb die Rohstoffpreise, vor allem für Energie und Nahrungsmittel, in die Höhe. Auch die chinesische Null-COVID-19-Politik trug zum Preisanstieg bei, da große Teile der chinesischen Wirtschaft langfristig heruntergefahren wurden. Der Verbraucherpreisindex erhöhte sich im Jahresvergleich auf seit Jahrzehnten nicht mehr erreichte Höchststände und lag Ende Juni 2022 bei 9,1 %.

Bis fast zum Ende des Jahres 2021 war die US-Notenbank (Fed) der Ansicht, dass die Inflation „vorübergehender Natur“ sei, d. h. durch Basiseffekte und Lieferkettenunterbrechungen verursacht werde, die sich kurzfristig selbst korrigieren würden. Zum Jahresende hin änderte sie jedoch ihre Haltung und signalisierte ihre Absicht, die außerordentlichen geldpolitischen Anreize während der Pandemie langsam wieder zurückzufahren. Da die Inflation weiterhin ungebremst anstieg, zog die Fed die erwarteten Erhöhungen der Leitzinsen und die Pläne zur

Reduzierung der Bilanzsumme vor. Infolgedessen sind für das Jahr 2022 bereits Zinserhöhungen von insgesamt 150 Basispunkten (Bp.) zu vermelden. Darüber hinaus geht die mittlere Prognose für den Leitzins zum Jahresende 2022 in der Zusammenfassung der Wirtschaftsprognosen der Fed vom Juni von weiteren Anhebungen um insgesamt 175 Basispunkte bis zum Jahresende aus. Die zunehmend aggressive Politik der Fed, die darauf abzielt, die steigende Inflation unter Kontrolle zu bringen, hat die Sorgen der Märkte in Richtung einer Wachstumsverlangsamung und der Gefahr einer mittelfristigen Rezession verschoben.

Die Renditen von US Treasuries (UST) zogen in der ersten Jahreshälfte 2022 rapide an, wobei die Benchmark-Rendite für 10-jährige USTs um 150 Basispunkte auf 3,01 % stieg. Nachdem die Spreads von US-Investment-Grade-Unternehmensanleihen über weite Strecken des Jahres 2021 auf einem historisch niedrigen Niveau lagen, führte eine restriktive Haltung der Fed in Verbindung mit geopolitischen Unsicherheiten Anfang 2022 zu einer risikoaversen Stimmung, die die Spreads deutlich ausweitete. Infolgedessen verzeichnete der Sektor den schlechtesten Jahresbeginn seit Beginn der Aufzeichnungen. Die Kreditspreads von Investment-Grade-Papieren weiteten sich auf 155 Bp. bis Ende Juni 2022, nachdem sie noch zu Jahresbeginn bei 92 Bp. gelegen hatten.

Überblick über die Wertentwicklung des Teilfonds

Der Teilfonds erzielte in dem am 30. Juni endenden Zwölfmonatszeitraum auf Basis des Nettoinventarwerts eine Rendite von -14,40 % (netto, in US-Dollar) und blieb damit leicht hinter der Rendite der Benchmark von -14,19 % (brutto, ebenfalls in US-Dollar) zurück.

Performancefaktoren

Die Renditekurven- und die Durationspositionierung des Teilfonds wirkten sich im Laufe des Jahres negativ auf die Performance aus. Während der Teilfonds im Vergleich zur Benchmark eine Untergewichtung der Gesamtduration aufwies, wirkte sich die Übergewichtung von Anleihen mit einer Restlaufzeit von fünf bis zehn Jahren negativ auf die Rendite aus, da die UST-Renditen in diesem Teil der Kurve am stärksten anstiegen. Eine Untergewichtung von Anleihen mit einer Restlaufzeit von mehr als 20 Jahren hatte hingegen positive Effekte auf die Rendite.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

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

Unsere Branchenallokation wirkte sich positiv auf die Performance aus, insbesondere die Übergewichtung von USTs und die Untergewichtung des Bankensektors. Dies wurde teilweise durch eine Übergewichtung von Versicherungs- und Kommunikationstiteln sowie eine Untergewichtung von Energiewerten ausgeglichen, was die Rendite belastete.

Insgesamt hat die Titelauswahl die Fondsp performance im Laufe des Jahres leicht verbessert, insbesondere in den Bereichen Banken, Technologie und Basiskonsumgüter. Die Titelauswahl in den Sektoren Versicherungen, zyklische Konsumgüter und Investitionsgüter dämpfte die Ergebnisse. Zu den wichtigsten Einzelpositionen im Berichtszeitraum gehörten der Konsumgüterhersteller Coca-Cola Europacific Partners, die Investmentbank JPMorgan Chase und der Mobilfunknetzbetreiber T-Mobile US. Die Titelauswahl in den Sektoren Versicherungen, zyklische Konsumgüter und Investitionsgüter beeinträchtigte dagegen die Ergebnisse. Negativbeiträge lieferten unter anderem der Finanzdienstleister Credit Suisse, das Wohnungsbauunternehmen MDC Holdings und der Telekommunikationskonzern Comcast Corporation.

Die Rating-Allokationen wirkten sich neutral auf die Fondsp performance aus: Eine Untergewichtung von AA-gerateten Anleihen schadete den Renditen, während eine Übergewichtung von BBB-gerateten Wertpapieren die Ergebnisse verbesserte.

Strategieausblick

Wir sind nach wie vor der Ansicht, dass die Bilanzen von Staaten, Unternehmen und Verbrauchern gesund genug sind, um in den nächsten Quartalen einen drastischen Rückgang des Weltwirtschaftswachstums zu verhindern, prognostizieren aber nun eine erhebliche Verlangsamung des Wachstums bis ins Jahr 2023 hinein, da eine restriktive Politik erforderlich ist, um dem wachsenden Inflationsdruck zu begegnen. Während die Zentralbanken und die Finanzmärkte begonnen haben, die längst überfällige Realitätsprüfung in Bezug auf Inflation und Zinssätze vorzunehmen, und erkannt haben, dass die Risiken wohl zunehmen werden, könnte eine aggressivere Straffung der Politik weiterhin notwendig sein, um die Inflation wieder unter Kontrolle zu bringen. Unseres Erachtens ist das entsprechende Risiko für die Anlagenpreise und das Wirtschaftswachstum größer, als viele zugeben möchten.

Wir haben unseren Ausblick für den Sektor der mit Investment-Grade bewerteten Unternehmensanleihen aufgrund der Erwartung schwierigerer finanzieller Bedingungen, eines langsameren Wachstums und anhaltender Marktvolatilität herabgestuft. Obwohl sich die Spreads seit Jahresbeginn deutlich ausgeweitet haben, wird die auf dem Markt vorherrschende risikoscheue Stimmung die Spreads wahrscheinlich weiter unter Druck setzen. Kurzfristig besteht unseres Erachtens ein größeres Abwärtsrisiko, wenn sich die wirtschaftliche Lage in den USA verschlechtert. Obwohl die Umsätze der Unternehmen weiter gestiegen sind, üben steigende Inputkosten, Störungen der Lieferketten und eine schwächere Verbrauchernachfrage Druck auf die Gewinnspannen aus und beeinträchtigen die Rentabilität der Unternehmen, während geopolitische Risiken und COVID-19-bedingte Lockdowns in China die Unsicherheit erhöhen.

Da sowohl die Zentralbanken als auch die Märkte nun mit mehreren Zinserhöhungen und höheren Zinsen über die gesamte Renditekurve hinweg rechnen, sind wir weiterhin der Auffassung, dass die Renditen für risikofreie Anlagen unter Druck bleiben werden, ebenso wie die Segmente des festverzinslichen Universums mit hoher Duration. Wie wir bereits seit längerem erklären, verfolgen wir einen aktiven, forschungsbasierten und selektiven Investitionsansatz.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Der Teilfonds Fonds investiert überwiegend in:

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

In geringerem Umfang kann der Teilfonds Fonds auch investieren in:

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

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

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

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
United States Treasury Floating Rate Note	3,06
Bank of America Corp 4	2,22
Citigroup Inc	2,09
JPMorgan Chase & Co	1,75
HSBC Holdings Plc	1,75
Cigna Corp	1,71
T-Mobile USA Inc	1,69
Credit Suisse Group AG	1,69
Verizon Communications Inc	1,65
RELX Capital Inc	1,65

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Finanzwerte	29,04
Basiskonsumgüter	20,11
Kommunikation	9,66
Versorger	8,55
Industrie	7,52
Energie	6,70
Technologie	6,01
Zyklische Konsumgüter	3,53
Staatsanleihen	3,06
Grundstoffe	2,20

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Vereinigte Staaten	77,63
Vereinigtes Königreich	4,45
Frankreich	3,60
Niederlande	2,72
Schweiz	1,69
Kanada	1,41
Italien	1,32
Japan	1,14
Norwegen	1,03
Spanien	0,77
Sonstige	0,62

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 für die meisten Abzüge von der absoluten Wertentwicklung des Teilfonds verantwortlich waren, waren Informationstechnologie, Industriewerte und Finanzen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Samsung Electronics, Country Garden und Top Glove.

Die Sektoren, die im selben Zeitraum den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Energie, Versorger und Kommunikationsdienstleistungen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Shenhua Energy, Yanzhou Coal Mining und ITC.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Kweichow Moutai Co Ltd	2,37
Bank of China Ltd 'H' Shares	2,09
Infosys Ltd	2,08
Tata Consultancy Services Ltd	2,03
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares	1,97
China Construction Bank Corp 'H' Shares	1,97
CK Asset Holdings Ltd	1,65
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1,88
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1,55
Chunghwa Telecom Co Ltd	1,52

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Finanzwerte	26,88
Basiskonsumgüter	16,14
Technologie	14,78
Industrie	10,71
Kommunikation	8,00
Energie	7,66
Grundstoffe	5,24
Versorger	5,20
Zyklische Konsumgüter	3,15
Diversifiziert	1,17

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
China	29,90
Indien	15,99
Taiwan	15,79
Südkorea	9,43
Kaimaninseln	8,88
Hongkong	6,78
Singapur	3,36
Indonesien	2,86
Thailand	2,44
Malaysia	2,08
Sonstige	1,42

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF bezieht sich auf den Zeitraum zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Werkstoffe, Informationstechnologie und Energie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Nornickel, Tatneft and Lukoil.

Im selben Zeitraum waren Versorger der einzige Sektor, der die absolute Wertentwicklung des Teilfonds belastete. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Shenhua Energy, ITC und Petrobras.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Kweichow Moutai Co Ltd	1,25
Bank of China Ltd 'H' Shares	1,07
Infosys Ltd	1,08
Tata Consultancy Services Ltd	1,05
Chunghwa Telecom Co Ltd	1,04
Saudi Arabian Oil Co	1,04
ITC Ltd	1,04
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares	1,02
Fubon Financial Holding Co Ltd	1,03
HCL Technologies Ltd	1,02

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Finanzwerte	21,70
Grundstoffe	14,63
Basiskonsumgüter	14,43
Technologie	11,00
Energie	10,55
Kommunikation	8,86
Industrie	8,36
Zyklische Konsumgüter	5,79
Versorger	3,16
Diversifiziert	0,46
Sonstige	0,00

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
China	22,08
Indien	13,43
Taiwan	13,05
Südkorea	8,02
Brasilien	6,80
Südafrika	6,08
Saudi-Arabien	5,35
Kaimaninseln	3,96
Indonesien	2,67
Mexiko	2,44
Sonstige	15,06

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Finanzen, Nicht-Basiskonsumgüter und Informationstechnologie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Nokian Renkaat, Besi und Admiral.

Die Sektoren, die im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Energie, Industrie und das Gesundheitswesen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten BAE, Gaztransport & Technigaz and TotalEnergies.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
BAE Systems Plc	3,39
Telenor ASA	3,22
Admiral Group Plc	3,20
Koninklijke KPN NV	3,20
CaixaBank SA	3,16
Elisa OYJ	3,14
GlaxoSmithKline Plc	3,11
Tryg A/S	3,11
Imperial Brands Plc	3,08
Zurich Insurance Group AG	3,05
Franklin LibertyShares ICAV	

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Finanzwerte	32,44
Kommunikation	17,61
Basiskonsumgüter	16,92
Versorger	11,27
Energie	7,94
Grundstoffe	6,22
Industrie	4,23
Technologie	2,10
Zyklische Konsumgüter	0,79

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Vereinigtes Königreich	21,89
Spanien	15,47
Frankreich	10,66
Finnland	9,41
Schweiz	8,48
Deutschland	7,22
Italien	7,03
Niederlande	5,55
Norwegen	5,05
Dänemark	3,58
Sonstige	5,18

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 für die größten Wertabzüge von der absoluten Wertentwicklung des Teilfonds verantwortlich zeichneten waren Industrie, Nicht-Basiskonsumgüter und Werkstoffe. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Deutsche Post, Partners Group und Logitech.

Im selben Zeitraum leistete kein Sektor einen Wertbeitrag zur absoluten Performance des Teilfonds. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Novo Nordisk, BAT und BHP.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Novo Nordisk A/S	2,25
Unilever Plc	2,21
Nestle SA	2,11
British American Tobacco Plc	2,09
Hermes International	2,09
GlaxoSmithKline Plc	2,09
Roche Holding AG (non-voting rights)	2,07
Koninklijke Ahold Delhaize NV	2,06
Zurich Insurance Group AG	2,05
TotalEnergies SE	2,04

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Basiskonsumgüter	29,92
Zyklische Konsumgüter	13,26
Industrie	12,10
Grundstoffe	10,68
Finanzwerte	10,11
Kommunikation	9,17
Energie	9,08
Versorger	2,62
Technologie	2,62

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Vereinigtes Königreich	22,79
Schweiz	16,33
Niederlande	11,22
Spanien	8,80
Frankreich	8,56
Dänemark	6,64
Deutschland	6,54
Schweden	6,05
Norwegen	3,95
Italien	3,02
Sonstige	5,66

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Industrie, Nicht-Basiskonsumgüter und Informationstechnologie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Target, 3M und Kone.

Die Sektoren, die größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren das Gesundheitswesen, Basiskonsumgüter und Versorger. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Amgen, Merck und Altria.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
United Parcel Service Inc	2,28
Kimberly-Clark Corp	2,19
Coca-Cola Co	2,19
Unilever Plc	2,18
Pfizer Inc	2,16
Cisco Systems Inc	2,13
Johnson & Johnson	2,13
Procter & Gamble Co	2,12
Lockheed Martin Corp	2,10
Amgen Inc	2,08

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Finanzwerte	28,90
Basiskonsumgüter	27,50
Industrie	13,41
Kommunikation	9,29
Technologie	7,98
Grundstoffe	7,61
Zyklische Konsumgüter	4,73
Versorger	0,32
Energie	0,23

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Vereinigte Staaten	40,96
Schweiz	9,03
Japan	8,76
Kanada	7,65
Vereinigtes Königreich	7,57
Australien	6,64
Irland	3,07
Deutschland	2,61
Saudi-Arabien	2,49
Taiwan	2,41
Sonstige	8,78

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 für die meisten Abzüge von der absoluten Wertentwicklung des Teilfonds verantwortlich waren, waren Nicht-Basiskonsumgüter, Finanzwerte und Werkstoffe. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten IDEXX Laboratories, Biogen und T. Rowe Price.

Im selben Zeitraum waren Versorger der einzige Sektor, der die absolute Wertentwicklung des Teilfonds belastete. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Vertex Pharmaceuticals, Nvidia und Novo Nordisk.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
General Mills Inc	1,20
Vertex Pharmaceuticals Inc	1,16
American Tower Corp	1,16
Colgate-Palmolive Co	1,13
Novo Nordisk A/S	1,12
L'Oreal SA	1,12
Biogen Inc	1,11
Unilever Plc	1,10
Coca-Cola Co	1,10
Kimberly-Clark Corp	1,10

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Basiskonsumgüter	35,20
Finanzwerte	17,29
Zyklische Konsumgüter	13,67
Kommunikation	7,67
Grundstoffe	7,21
Technologie	7,01
Industrie	7,12
Versorger	2,66
Energie	1,32
Diversifiziert	0,32

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Vereinigte Staaten	45,63
Japan	8,48
Kanada	7,35
Vereinigtes Königreich	5,27
Australien	4,71
Taiwan	3,59
Schweiz	2,74
Dänemark	2,70
Frankreich	1,80
Indien	1,67
Sonstige	15,53

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Nicht-Basiskonsumgüter und Kommunikationsdienstleistungen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Meta, Target und Applied Materials.

Die Sektoren, die größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren das Gesundheitswesen, Basiskonsumgüter und Versorger. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Eli Lilly, NVIDIA and Pfizer.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
AbbVie Inc	1,12
Eli Lilly & Co	1,12
Dollar General Corp	1,12
UnitedHealth Group Inc	1,11
Costco Wholesale Corp	1,10
Northrop Grumman Corp	1,10
Bristol-Myers Squibb Co	1,10
International Business Machines Corp	1,09
Vertex Pharmaceuticals Inc	1,08
PepsiCo Inc	1,08

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Basiskonsumgüter	29,91
Technologie	16,29
Zyklische Konsumgüter	15,72
Industrie	11,06
Kommunikation	7,93
Finanzwerte	5,92
Energie	4,50
Grundstoffe	4,38
Versorger	4,10

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Vereinigte Staaten	97,41
Irland	1,12
Niederlande	0,55
Bermuda	0,31
Guernsey	0,22
Jersey	0,20

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 den größten Beitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Nicht-Basiskonsumgüter, Industrie und Informationstechnologie. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten SAP, ASML und Philips.

Im selben Zeitraum leistete kein Sektor einen Wertbeitrag zur absoluten Performance des Teilfonds. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten Novo Nordisk, AstraZeneca und HSBC.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Nestle SA	4,41
Novartis AG	3,66
Novo Nordisk A/S	3,64
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	3,45
AstraZeneca Plc	3,39
Unilever Plc	2,34
Linde Plc	2,12
Diageo Plc	2,09
SAP SE	2,08
L'Oreal SA	2,07

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Basiskonsumgüter	37,29
Finanzwerte	15,65
Zyklische Konsumgüter	11,98
Industrie	8,49
Grundstoffe	8,15
Technologie	6,73
Kommunikation	6,33
Versorger	4,08
Energie	1,16

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Vereinigtes Königreich	19,50
Frankreich	19,01
Schweiz	17,50
Deutschland	13,30
Dänemark	6,93
Niederlande	6,36
Spanien	4,74
Irland	3,08
Schweden	2,59
Belgien	1,35
Sonstige	5,50

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - INDEXNACHBILDENDE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Die Sektoren, die im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 den größten Minusbeitrag zur absoluten Wertentwicklung des Teilfonds lieferten, waren Informationstechnologie, Nicht-Basiskonsumgüter und Kommunikationsdienstleistungen. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds beeinträchtigenden Einzelpositionen gehörten Amazon, Meta and Adobe.

Im selben Zeitraum war das Gesundheitswesen der einzige Sektor, der die absolute Wertentwicklung des Teilfonds belastete. Zu den die absolute Rendite des Teilfonds steigernden Einzelpositionen gehörten AbbVie, UnitedHealth und Pfizer.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Microsoft Corp	5,87
Apple Inc	4,94
Amazon.com Inc	4,84
Alphabet Inc 'A' Shares	2,51
NVIDIA Corp	2,46
Alphabet Inc 'C' Shares	2,33
UnitedHealth Group Inc	1,77
Visa Inc	1,77
PepsiCo Inc	1,73
AbbVie Inc	1,72

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Basiskonsumgüter	25,86
Technologie	24,13
Finanzwerte	16,78
Kommunikation	15,93
Industrie	7,33
Zyklische Konsumgüter	6,51
Grundstoffe	2,31
Versorger	0,80
Energie	0,12

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Vereinigte Staaten	96,93
Irland	2,27
Schweiz	0,30
Jersey	0,16
Vereinigtes Königreich	0,07
Bermuda	0,04

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF bezieht sich auf das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Der Teilfond wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnettovermögens
Tencent Holdings Ltd	12,68
Alibaba Group Holding Ltd	10,41
Meituan	4,44
China Construction Bank Corp	3,18
LONGi Green Energy Technology Co Ltd	2,35
BYD Co Ltd	2,30
JD.com Inc	2,24
Baidu Inc	2,23
China Conch Venture Holdings Ltd	1,61
Tongwei Co Ltd	1,42

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnettovermögens
Kommunikation	37,64
Finanzwerte	14,70
Basiskonsumgüter	12,81
Zyklische Konsumgüter	10,44
Energie	8,13
Industrie	7,09
Technologie	4,34
Versorger	3,40
Grundstoffe	0,79
Diversifiziert	0,02

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnettovermögens
Kaimaninseln	52,63
China	41,62
Hongkong	2,24
Bermuda	1,70
Vereinigte Staaten	0,81
Singapur	0,36

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DES ANLAGEVERWALTERS - AKTIV GEMANAGTE TEILFONDS (Fortsetzung)

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF

Dieser Bericht des Anlageverwalters für den Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF bezieht sich auf den Zeitraum zum 30. Juni 2022.

Der Teilfond wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

Zusammenfassung der Anlageziele/ Anlagepolitik

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

Top-10-Positionen

30. Juni 2022

Bezeichnung des Wertpapiers	% des Gesamtnetto- vermögens
Romanian Government International Bond	4,92
Mexico Government International Bond	4,66
Brazilian Government International Bond	4,42
Colombia Government International Bond	4,35
Peruvian Government International Bond	3,86
Romanian Government International Bond	3,51
Israel Government International Bond	3,43
Chile Government International Bond	3,20
Republic of South Africa Government International Bond	3,19
Philippine Government International Bond	2,91

Top-10-Sektoren/-Branchen

30. Juni 2022

Sektor	% des Gesamtnetto- vermögens
Staatsanleihen	95,23

Top-10-Länder*

30. Juni 2022

Land	% des Gesamtnetto- vermögens
Mexiko	9,35
Rumänien	8,43
Philippinen	7,25
Brasilien	6,93
Chile	6,81
Israel	6,26
Polen	5,56
Kolumbien	5,13
Panama	5,04
Peru	5,00
Sonstige	29,47

*Der Indexanbieter kann nach anderen Kriterien klassifizieren.

BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER

In unserer Eigenschaft als Verwahrstelle der ICAV haben wir die Geschäftsführung der Franklin LibertyShares ICAV (die „ICAV“) im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 überprüft. Dieser Bericht einschließlich des Prüfvermerks wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Teilfonds der ICAV erstellt. Dieser Bericht wurde gemäß Vorschrift 34 (1), (3) und (4) in Teil 5 der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2019, in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) und für keinen anderen Zweck erstellt. Wir akzeptieren oder übernehmen durch die Erteilung dieses Prüfvermerks keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht vorgelegt wird.

Obliegenheiten der Verwahrstelle

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

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

Grundlage für den Prüfvermerk der Verwahrstelle

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

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

Prüfvermerk

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

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

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

Datum: 14. Oktober 2022

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Anteilhaber der Teilfonds der Franklin LibertyShares ICAV

Bericht zur Abschlussprüfung

Prüfvermerk

Unserer Auffassung nach vermittelt der Jahresabschluss der Franklin LibertyShares ICAV:

- ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Teilfonds zum 30. Juni 2022 und ihrer Ergebnisse für das an diesem Tag endende Geschäftsjahr;
- und wurde ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen (den vom Financial Reporting Council des Vereinigten Königreichs herausgegebenen Bilanzierungsgrundsätzen einschließlich Financial Reporting Standard 102, „der im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendende Bilanzierungsstandard“ und irischem Recht); und
- gemäß dem Irish Collective Asset-management Vehicles Act von 2015 und den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in ihrer jeweils gültigen Fassung) aufgestellt.

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

- die Bilanz zum 30. Juni 2022;
- die Gesamtergebnisrechnung für das an diesem Tag endende Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens für das an diesem Tag endende Geschäftsjahr;
- die Vermögensaufstellung für die einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2022; und
- die Erläuterungen zum Abschluss der einzelnen Teilfonds, die eine Beschreibung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze enthalten.

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

Grundlage für den Prüfvermerk

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

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

Unabhängigkeit

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

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

Wir haben für die ICAV im Zeitraum vom 1. Juli 2021 bis zum 30. Juni 2022 keine prüfungsfremden Leistungen erbracht.

Unser Prüfungsansatz

Überblick



Wesentlichkeit

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

Prüfungsumfang

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

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte

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

Umfang unserer Prüfung

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

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte

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

Besonders wichtiger Prüfungssachverhalt

Bewertung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte.

Näheres ist Bilanzierungsgrundsatz 1(c) des Abschlusses zu entnehmen. Die in der Bilanz der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2022 ausgewiesenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte werden gemäß dem Financial Reporting Standard 102 mit dem beizulegenden Zeitwert bewertet. Dies gilt als besonders wichtiger Prüfungssachverhalt, da es das zentrale Element im Abschluss darstellt.

Berücksichtigung des besonders wichtigen Prüfungssachverhalts bei der Prüfung

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

Bestand von ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten

Näheres ist Bilanzierungsgrundsatz 1(c) des Abschlusses der ICAV zu entnehmen. Die in der Bilanz der einzelnen Teilfonds ausgewiesenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte werden zum 30. Juni 2022 im Namen des Teilfonds gehalten.

Wir haben von der Verwahrstelle und den Gegenparteien des zum 30. Juni 2022 gehaltenen Anlageportfolios eines jeden Teilfonds unabhängige Bestätigungen eingeholt und die Bestätigungen der Verwahrstelle und der Gegenparteien mit den Geschäftsbüchern abgeglichen. Es wurden keine wesentlichen Sachverhalte im Zusammenhang mit der Durchführung dieser Verfahren festgestellt.

Festlegung des Prüfungsumfangs

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

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

Wesentlichkeit

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

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

Die Wesentlichkeit für den Abschluss als Ganzes und ihre Ermittlung	50 Basispunkte (2021: 50 Basispunkte) des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 30. Juni 2022 für jeden Teilfonds der ICAV.
Grund für den herangezogenen Referenzindex	Wir haben diesen Referenzindex herangezogen, weil das Hauptziel der ICAV darin besteht, den Anlegern eine Gesamtrendite auf Teilfondsebene unter Berücksichtigung der Kapital- und Ertragsrendite zu bieten.

Wir haben mit dem Verwaltungsrat vereinbart, dass wir über etwaige im Zuge unserer Prüfungstätigkeit ermittelte Falschangaben, die hinsichtlich NIW-relevanter Auswirkungen mehr als 5 Basispunkte des NIW des einzelnen Teilfonds ausmachen (2021: 5 Basispunkte des NIW des einzelnen Teilfonds hinsichtlich NIW-relevanter Auswirkungen) sowie über falsche Angaben unterhalb dessen, die jedoch unserer Meinung nach aus qualitativen Gründen mitgeteilt werden sollten, Bericht erstatten würden.

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Fortführung der Geschäfte

Unsere Beurteilung der Einschätzung des Verwaltungsrats bezüglich der Fähigkeit der Teilfonds, weiterhin auf der Grundlage der Fortführung der Geschäfte zu bilanzieren, umfasste:

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

Auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeiten haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten im Zusammenhang mit Ereignissen oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Teilfonds wecken könnten, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum, an dem die Herausgabe des Abschlusses genehmigt wird, auch weiterhin auf der Grundlage der Fortführung der Geschäfte zu bilanzieren.

Bei der Prüfung des Abschlusses sind wir zu dem Schluss gelangt, dass die vom Verwaltungsrat eingesetzte Bilanzierung auf der Grundlage der Fortführung der Geschäfte bei der Aufstellung des Jahresabschlusses angemessen ist.

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

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

Bericht über sonstige Informationen

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

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

Bericht des Verwaltungsrats

- Nach unserer Auffassung auf der Grundlage der im Zuge unserer Prüfung durchgeführten Prüfungshandlungen stimmen die Angaben im Bericht des Verwaltungsrats für das Jahr zum 30. Juni 2022 mit dem Abschluss überein.

Verantwortung für den Jahresabschluss und die Prüfung

Zuständigkeiten des Verwaltungsrats für den Abschluss

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

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

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

Zuständigkeiten der Abschlussprüfer für die Abschlussprüfung

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

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

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

https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf

Diese Beschreibung ist Bestandteil unsere Berichts des Abschlussprüfers.

Verwendung dieses Berichts

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

Sonstige vorgeschriebene Angaben

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

Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder

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

Bestellung

Wir wurden vom Verwaltungsrat am 11. Juli 2017 mit der Prüfung des Abschlusses für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2018 und anschließende Berichtszeiträume beauftragt. Der Zeitraum der gesamten ununterbrochenen Beauftragung beträgt 5 Jahre und umfasst die Jahre bis zum 30. Juni 2018 und 30. Juni 2022.

Andrew O'Callaghan
für und im Namen von PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants & Statutory Audit Firm
Dublin
14. Oktober 2022

BILANZ

Zum 30. Juni 2022

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

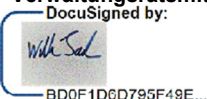
	Erl.	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* USD
Umlaufvermögen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

* Der Fonds wurde nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt, daher werden keine Vergleichsdaten angegeben.

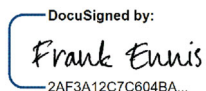
William Jackson

Frank Ennis

Verwaltungsratsmitglied

DocuSigned by:

 BD0F1D6D795F49E...

Verwaltungsratsmitglied

DocuSigned by:

 2AF3A12C7C604BA...

Datum: 14. Oktober 2022n

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021

	Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Umlaufvermögen:								
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:								
Wertpapiere	1(c)	23.297.096	193.605.629	72.855.180	685.606.948	104.759.627	54.587.545	16.792.707
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	1(c)	-	-	-	-	13.153	-	-
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1(d), 7	6.516	264.796	56.118	471.335	2.660.149	4.670.161	171.396
Sonstige Forderungen	8	163.843	794.667	83.864	899.992	418.897	2.308.903	136.739
Gesamtumlaufvermögen		23.467.455	194.665.092	72.995.162	686.978.275	107.851.826	61.566.609	17.100.842
Kurzfristige Verbindlichkeiten								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)								
Sonstige Verbindlichkeiten	1(c) 9	(1.920)	(770)	-	(888)	-	(18.780)	-
Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen		(340.492)	(29.962)	(1.339.788)	(48.230)	(26.087)	(1.744.421)	(4.670)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“)		23.126.963	194.635.130	71.655.374	686.930.045	107.825.739	59.822.188	17.096.172

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD
Umlaufvermögen								
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:								
Wertpapiere	1(c)	5.834.722	39.380.789	22.805.681	9.468.724	37.859.927	22.288.798	105.238.120
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten (Futures)	1(c)	-	1.350	-	-	-	-	2.969
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1(d), 7	15.716	169.326	-	6.158	-	39.118	330.640
Sonstige Forderungen	8	41.633	292.422	2.749.226	22.658	112.395	40.390	96.439
Gesamtumlaufvermögen		5.892.071	39.843.887	25.554.907	9.497.540	37.972.322	22.368.306	105.668.168
Kurzfristige Verbindlichkeiten								
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)								
Überziehungskredit	1(c)	-	-	(485)	-	-	(51)	-
Sonstige Verbindlichkeiten	1(d), 9	(29.934)	(146.355)	(2.570.229)	(1.953)	(68.538)	(13.004)	(106.251)
Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen		(29.934)	(146.355)	(2.598.893)	(1.953)	(83.517)	(13.055)	(106.251)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“)		5.862.137	39.697.532	22.956.014	9.495.587	37.888.805	22.355.251	105.561.917

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BILANZ (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF* EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
Umlaufvermögen			
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:			
Wertpapiere	1(c)	9.297.102	46.064.715
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1(d), 7	4.799	67.362
Sonstige Forderungen	8	7.251	11.469.800
Gesamtumlaufvermögen		9.309.152	57.601.877
Kurzfristige Verbindlichkeiten			
Sonstige Verbindlichkeiten	9	(1.123)	(11.434.334)
Kurzfristige Gesamtverbindlichkeiten ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen		(1.123)	(11.434.334)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen („Nettovermögen“)		9.308.029	46.167.543

* Der Fonds wurde nach dem 30. Juni 2020 aufgelegt.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

GESAMTERGEBNISRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

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

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

* Der Fonds wurde nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt, daher werden keine Vergleichsdaten angegeben.

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Erträge:								
Dividendenerträge	1(f)	671.901	1.878.749	453.259	14.725.689	-	-	-
Zinserträge	1(f)	629	12	488	863	438.632	126.488	472.122
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	1(b), 1(c), 4	5.871.122	932.977	9.835.792	218.150.798	(381.164)	309.112	28.550
Gesamtanlageerträge		6.543.652	2.811.738	10.289.539	232.877.350	57.468	435.600	500.672
Aufwendungen:								
Betriebliche Aufwendungen	5	(30.285)	(174.235)	(53.508)	(484.596)	(215.507)	(55.844)	(65.161)
Nettoertrag/(-verlust)		6.513.367	2.637.503	10.236.031	232.392.754	(158.039)	379.756	435.511
Finanzierungskosten:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile	12	-	-	-	-	-	-	(379.415)
Zinsaufwendungen	1(f)	-	(258)	(806)	(1.016)	(11.068)	(36.385)	-
Besteuerung:								
Quellensteuer	1(j), 2	(36.122)	(129.946)	(92.483)	(2.945.868)	-	-	-
Kapitalertragsteuer	2	(265.305)	-	(1.360.922)	-	-	-	-
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit		6.211.940	2.507.299	8.781.820	229.445.870	(169.107)	343.371	56.096

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD
Erträge:								
Dividendenerträge	1(f)	220.896	1.801.956	1.337.828	269.120	1.092.003	488.214	1.580.213
Zinserträge	1(f)	142	1.114	-	-	-	-	50
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	1(b), 1(c), 4	1.108.176	10.044.451	4.025.604	1.900.183	8.203.063	4.619.764	21.241.977
Gesamtanlageerträge		1.329.214	11.847.521	5.363.432	2.169.303	9.295.066	5.107.978	22.822.240
Aufwendungen:								
Betriebliche Aufwendungen	5	(21.691)	(191.217)	(54.648)	(20.540)	(134.378)	(76.394)	(190.863)
Nettoertrag		1.307.523	11.656.304	5.308.784	2.148.763	9.160.688	5.031.584	22.631.377
Finanzierungskosten:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile	12	-	-	(1.171.060)	-	(798.580)	-	-
Zinsaufwendungen	1(f)	(86)	(976)	(1.313)	(8)	(811)	(342)	-
Besteuerung:								
Quellensteuer	1(j), 2	(26.491)	(213.498)	(75.998)	(25.641)	(140.695)	(61.799)	(234.204)
Kapitalertragsteuer	2	(27.095)	(131.437)	-	-	-	(5.889)	-
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit		1.253.851	11.310.393	4.060.413	2.123.114	8.220.602	4.963.554	22.397.173

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

	Erl.	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF* EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
Erträge:			
Dividenerträge	1(f)	135.286	211.475
Zinserträge	1(f)	46	456
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	1(b), 1(c), 4	1.112.381	5.901.283
Gesamtanlageerträge		1.247.713	6.113.214
Aufwendungen:			
Betriebliche Aufwendungen	5	(7.907)	(22.586)
Nettoertrag		1.239.806	6.090.628
Finanzierungskosten:			
Zinsaufwendungen	1(f)	(1)	-
Besteuerung:			
Quellensteuer	1(j), 2	(15.449)	(32.446)
Kapitalertragsteuer	2	-	-
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Anlagetätigkeit		1.224.356	6.058.182

* Der Fonds wurde nach dem 30. Juni 2020 aufgelegt.

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 (Fortsetzung)

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

* Der Fonds wurde nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt, daher werden keine Vergleichsdaten angegeben.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

Erl.	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	10.642.572	24.414.681	9.431.488	155.387.818	25.055.354	33.194.289	18.516.316
Anstieg/(Rückgang) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	6.211.940	2.507.299	8.781.820	229.445.870	(169.107)	343.371	56.096
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	3 6.272.451	167.713.150	53.442.066	508.809.729	84.797.541	28.532.972	5.751.510
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	3 -	-	-	(206.713.372)	(1.858.049)	(2.248.444)	(7.227.750)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen	6.272.451	167.713.150	53.442.066	302.096.357	82.939.492	26.284.528	(1.476.240)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	23.126.963	194.635.130	71.655.374	686.930.045	107.825.739	59.822.188	17.096.172

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	4.608.286	39.233.342	10.646.513	7.372.473	23.745.588	16.981.039	46.908.719
Anstieg des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	1.253.851	11.310.393	4.060.413	2.123.114	8.220.602	4.963.554	22.397.173
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	3	-	23.233.545	-	17.405.696	6.517.769	60.895.919
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	3	(10.846.203)	(14.984.457)	-	(11.483.081)	(6.107.111)	(24.639.894)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen	-	(10.846.203)	8.249.088	-	5.922.615	410.658	36.256.025
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	5.862.137	39.697.532	22.956.014	9.495.587	37.888.805	22.355.251	105.561.917

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

		Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF* EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS* ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		-	-
Anstieg des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		1.224.356	6.058.182
Erlöse aus der Ausgabe von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	3	8.083.673	61.250.388
Zahlungen für die Rücknahme von rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen	3	-	(21.141.027)
Zunahme des Nettovermögens aus Anteilstransaktionen		8.083.673	40.109.361
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		9.308.029	46.167.543

* Der Fonds wurde nach dem 30. Juni 2020 aufgelegt.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

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

Dieser geprüfte Abschluss für die ICAV wurde für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 erstellt.

a) Grundlage der Aufstellung

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

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

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

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

Der Jahresabschluss wurde auf Basis der Unternehmensfortführung erstellt, da der Verwaltungsrat davon ausgeht, dass die ICAV für zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Jahresabschlusses (der „Bewertungszeitraum“) ihre operative Tätigkeit fortsetzen kann.

Die ICAV hat von der für offene Investmentfonds nach FRS 104 geltenden Befreiung Gebrauch gemacht und legt keine Kapitalflussrechnung vor.

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten

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

b) Funktionale Währung und Darstellungswährung

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

b) Funktionale Währung und Darstellungswährung (Fortsetzung)

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

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

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

Einstufung

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

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

Ansatz und Ausbuchung

Ansatz und Erstbewertung

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

Ausbuchung

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

Erwartete Kreditverluste

Zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 werden sämtliche Forderungen/Zahlungsmittel bei gut kapitalisierten Gegenparteien gehalten und sind zur Abwicklung innerhalb eines Jahres fällig. Das Management erachtete die Ausfallwahrscheinlichkeit als nahe Null. Demzufolge wurden keine Wertberichtigungen basierend auf den im Zwölfmonatszeitraum erwarteten Kreditverlusten ausgewiesen, da eine derartige Wertminderung für die ICAV gänzlich unbedeutend wäre.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert (Fortsetzung)

i) Wertpapiere

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

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

ii) Devisenterminkontrakte

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

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

iii) Terminkontrakte (Futures)

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

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

d) Fortgeführte Anschaffungskosten

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

d) Fortgeführte Anschaffungskosten (Fortsetzung)

i) Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, Überziehungskredite und Bareinschüsse

Zu den Zahlungsmitteln gehören alle Kontokorrentguthaben bei Banken und Überziehungskredite. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente sind kurzfristige, hoch liquide Anlagen mit einer Laufzeit von höchstens drei Monaten, die leicht in bekannte Barbeträge konvertierbar sind, einem unwesentlichen Wertänderungsrisiko unterliegen und nicht zu Anlagezwecken oder anderen Zwecken, sondern zur Begleichung kurzfristiger Barverpflichtungen gehalten werden. Die Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente werden bei der State Street Custodial Services (Ireland) Limited gehalten und zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Zum 30. Juni 2022 werden Bareinschusssalden bei J.P. Morgan gehalten (zum 30. Juni 2021: Bareinschusssalden wurden bei J.P. Morgan gehalten) und sind in Erläuterung 7 enthalten. Überziehungskredite werden bei der State Street Custodial Services (Ireland) Limited gehalten und mit ihrem Nennwert bewertet, zusammen mit gegebenenfalls aufgelaufenen Zinsen.

ii) Forderungen und Verbindlichkeiten

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

e) Saldierungsrecht

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

f) Anlageerträge

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

i) Dividendenerträge

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

ii) Zinserträge/Zinsaufwendungen

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

g) Aufwendungen

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

h) Realisierte Gewinne und Verluste

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

i) Nicht realisierte Gewinne und Verluste

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

j) Besteuerung

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

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

k) Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile

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

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

l) Transaktionskosten

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze (Fortsetzung)

m) Ausschüttungspolitik

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

n) Wesentliche rechnungslegungsrelevante Schätzungen und Beurteilungen

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

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

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

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

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

o) Ertragsausgleich

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

2. Besteuerung

Nach der geltenden irischen Rechtslage und Rechtspraxis erfüllt die ICAV die Voraussetzungen eines Anlageorganismus gemäß der Definition in Section 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 (in der jeweils gültigen Fassung; „TCA“). Auf dieser Grundlage unterliegt sie keiner irischen Steuer auf ihre Erträge oder Kapitalgewinne.

Eine irische Steuer kann jedoch bei Eintritt eines „steuerpflichtigen Ereignisses“ anfallen. Zu den steuerpflichtigen Ereignissen zählen alle Ausschüttungen an Anteilinhaber oder Einlösungen, Rücknahmen, Annullierungen, Übertragungen oder fiktive Veräußerungen von Anteilen im Sinne des irischen Steuerrechts sowie der Besitz von Anteilen am Ende jedes achtjährigen Zeitraums, beginnend mit dem Erwerb dieser Anteile. Bei steuerpflichtigen Ereignissen werden für die ICAV keine irischen Steuern fällig im Falle von:

- einem Anteilinhaber, der zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses weder in Irland ansässig ist noch seinen gewöhnlichem Aufenthalt in Irland hat, vorausgesetzt, dass der ICAV die entsprechenden gültigen Erklärungen gemäß Schedule 2B des TCA vorliegen und sich die ICAV nicht im Besitz von Informationen befindet, die nach billigem Ermessen vermuten lassen, dass die darin enthaltenen Angaben im Wesentlichen nicht mehr zutreffen, oder wenn die ICAV von den irischen Steuerbehörden autorisiert wurde, bei Nichtvorliegen der entsprechenden Erklärungen Bruttoauszahlungen vorzunehmen; oder
- einem Anteilinhaber, bei dem es sich zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses um einen steuerbefreiten irischen Anleger (wie in Section 739D definiert) handelt, vorausgesetzt, dass der ICAV die entsprechende gültige Erklärung gemäß Schedule 2B des TCA vorliegt und sich die ICAV nicht im Besitz von Informationen befindet, die nach billigem Ermessen vermuten lassen, dass die darin enthaltenen Angaben im Wesentlichen nicht mehr zutreffen, oder wenn das Unternehmen den irischen Steuerbehörden autorisiert wurde, bei Nichtvorliegen der entsprechenden Erklärungen Bruttoauszahlungen vorzunehmen; oder

(Gegebenenfalls) erzielte Dividenden, Zinsen und Veräußerungsgewinne aus Anlagen der ICAV können in dem Land, in dem die Anlageerträge/Gewinne erzielt werden, Steuern unterliegen. Die Gesellschaft und ihre Anteilinhaber haben möglicherweise keinen Anspruch auf Erstattung dieser Steuern.

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

Die ICAV kann Steuern unterliegen, die von bestimmten anderen Ländern, in denen die ICAV investiert, auf realisierte und nicht realisierte Gewinne aus Wertpapieren erhoben werden. Anlageerträge/Gewinne werden vereinnahmt, und die ICAV oder ihre Anteilinhaber haben möglicherweise keinen Anspruch auf Erstattung dieser Steuern. Viele dieser Länder haben Steuergesetze, nach denen Kapitalertragsteuern auf Nichtansässige, wie z. B. die ICAV, anwendbar sein können. Typischerweise sind diese Kapitalertragsteuern auf der Grundlage der Selbstveranlagung zu ermitteln. Aus diesem Grund dürfen diese Steuern vom Makler der ICAV nicht auf der Grundlage der „Einbehaltung“ abgezogen werden.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

2. Besteuerung (Fortsetzung)

Der ausländische Steueraufwand wird gegebenenfalls periodengerecht ausgewiesen und unter „Kapitalertragsteuern“ in der Gesamtergebnisrechnung erfasst. Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 fielen Kapitalertragssteuern für den Franklin FTSE Brazil UCITS ETF, den Franklin FTSE India UCITS ETF, den Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF, den Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF und den Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF an. Der im Ausland geschuldete Steuerbetrag wird gegebenenfalls unter „Verbindlichkeiten aus Kapitalertragsteuern“ in der Bilanz erfasst. Veräußerungsgewinne, Dividenden und Zinsen, die vereinnahmt werden, können im Ursprungsland Quellensteuern unterliegen. Die ICAV oder ihre Anteilhaber haben möglicherweise keinen Anspruch auf Erstattung dieser Steuern. Die Quellensteuerbelastung auf Dividenden für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 ist in der Gesamtergebnisrechnung angegeben. Die für das Jahr zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 zu zahlende Kapitalertragssteuer auf nicht realisierte Gewinne ist in der Bilanz dargestellt.

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

Für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 hat die ICAV ungewisse Steuerverbindlichkeiten und damit verbundene Zinsen und Strafen in Bezug auf ausländische Kapitalertragsteuern mit null bewertet. Dies stellt die bestmögliche Schätzung des Managements dar, doch kann der geschätzte Wert erheblich von dem letztlich zu zahlenden Betrag abweichen.

Status als meldepflichtiger Fonds

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

3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil

Genehmigt

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

Zeichneranteile

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

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

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

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE China UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE India UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD Thesaurierende Anteile	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	900.000	5.000.000	2.250.000	14.900.000	-	4.060.000	2.390.000
Ausgegebene Anteile	900.000	5.200.000	1.800.000	700.000	100.000	1.720.000	24.530.000
Zurückgenommene Anteile	(400.000)	(1.200.000)	-	(5.400.000)	-	(2.040.000)	-
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	1.400.000	9.000.000	4.050.000	10.200.000	100.000	3.740.000	26.920.000
Nettoinventarwert	27.282.986	241.165.019	122.416.418	291.261.525	2.082.954	83.936.003	672.845.051
Nettoinventarwert pro Anteil	19,49	26,80	30,23	28,56	20,83	22,44	24,99
Kreationen während des Geschäftsjahres	18.922.112	158.463.210	58.959.850	28.153.790	2.559.376	43.005.516	616.091.440
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.576.144)	(33.146.387)	-	(212.249.826)	-	(51.604.984)	-
	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	600.000	250.000	1.400.000	900.000	300.000	1.200.000	600.000
Ausgegebene Anteile	200.000	-	-	550.000	-	2.200.000	200.000
Zurückgenommene Anteile	(250.000)	-	-	(200.000)	(100.000)	(2.000.000)	-
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	550.000	250.000	1.400.000	1.250.000	200.000	1.400.000	800.000
Nettoinventarwert	13.105.918	5.144.978	31.528.323	31.034.287	5.839.568	40.334.173	25.222.243
Nettoinventarwert pro Anteil	23,83	20,58	22,52	24,83	29,20	28,81	31,53
Kreationen während des Geschäftsjahres	5.636.533	-	-	14.325.318	-	74.124.771	7.062.064
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.104.476)	-	-	(5.195.223)	(3.070.358)	(63.453.318)	-

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

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

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

* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

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

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE China UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE India UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	600.000	800.000	450.000	5.700.000	960.000	1.340.000	650.000
Ausgegebene Anteile	300.000	4.200.000	1.800.000	13.800.000	3.170.000	1.140.000	200.000
Zurückgenommene Anteile	-	-	-	(4.600.000)	(70.000)	(90.000)	(250.000)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	900.000	5.000.000	2.250.000	14.900.000	4.060.000	2.390.000	600.000
Nettoinventarwert	23.126.963	194.635.130	71.655.374	686.930.045	107.825.739	59.822.188	17.096.172
Nettoinventarwert pro Anteil	25,70	38,93	31,85	46,10	26,56	25,03	28,49
Kreationen während des Geschäftsjahres	6.272.451	167.713.150	53.442.066	508.809.729	84.797.541	28.532.972	5.751.510
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	-	-	-	(206.713.372)	(1.858.049)	(2.248.444)	(7.227.750)
	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	250.000	1.800.000	500.000	300.000	1.000.000	600.000	1.450.000
Ausgegebene Anteile	-	-	1.000.000	-	600.000	200.000	1.600.000
Zurückgenommene Anteile	-	(400.000)	(600.000)	-	(400.000)	(200.000)	(650.000)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	250.000	1.400.000	900.000	300.000	1.200.000	600.000	2.400.000
Nettoinventarwert	5.862.137	39.697.532	22.956.014	9.495.587	37.888.805	22.355.251	105.561.917
Nettoinventarwert pro Anteil	23,45	28,36	25,51	31,65	31,57	37,26	43,98
Kreationen während des Geschäftsjahres	-	-	23.233.545	-	17.405.696	6.517.769	60.895.919
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	-	(10.846.203)	(14.984.457)	-	(11.483.081)	(6.107.111)	(24.639.894)

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

3. Anteilskapital und Nettoinventarwert pro Anteil (Fortsetzung)

Das ausgegebene Anteilskapital, der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil stellen sich zum 30. Juni 2020 wie folgt dar:

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE China UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE India UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	100.000	200.000	100.000	100.000	450.000	1.290.000	250.000
Ausgegebene Anteile	500.000	800.000	350.000	5.700.000	620.000	240.000	650.000
Zurückgenommene Anteile	-	(200.000)	-	(100.000)	(110.000)	(190.000)	(250.000)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	600.000	800.000	450.000	5.700.000	960.000	1.340.000	650.000
Nettoinventarwert	10.642.572	24.414.681	9.431.488	155.387.818	25.055.354	33.194.289	18.516.316
Nettoinventarwert pro Anteil	17,74	30,52	20,96	27,26	26,10	24,77	28,49
Kreationen während des Geschäftsjahres	8.510.999	22.450.351	6.964.742	144.253.158	16.099.086	5.993.082	17.779.552
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	-	(5.441.348)	-	(2.788.758)	(2.851.087)	(4.639.649)	(6.715.187)
	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR Thesaurierende Anteile	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD Ausschüttende Anteile	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD Thesaurierende Anteile
Zu Beginn des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	250.000	2.200.000	300.000	200.000	200.000	200.000	550.000
Ausgegebene Anteile	250.000	800.000	400.000	100.000	800.000	1.400.000	1.350.000
Zurückgenommene Anteile	(250.000)	(1.200.000)	(200.000)	-	-	(1.000.000)	(450.000)
Am Ende des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile	250.000	1.800.000	500.000	300.000	1.000.000	600.000	1.450.000
Nettoinventarwert	4.608.286	39.233.342	10.646.513	7.372.473	23.745.588	16.981.039	46.908.719
Nettoinventarwert pro Anteil	18,43	21,80	21,29	24,57	23,75	28,30	32,35
Kreationen während des Geschäftsjahres	4.126.877	17.018.617	9.121.582	2.649.352	20.710.482	37.020.801	43.315.677
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.173.364)	(23.098.763)	(5.173.916)	-	-	(26.424.908)	(13.806.101)

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

4. Nettogewinn/(-verlust) aus der Anlagetätigkeit

	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 Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022							
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter (Verlust)/Gewinn aus Anlagen und Fremdwährungen	(206.293)	(20.002.620)	804.475	22.399.606	(1.501)	(2.824.359)	2.932.504
Entwicklung der nicht realisierten (Wertminderung)/-steigerung aus Anlagen und Fremdwährungen	(8.838.815)	(62.563.606)	(10.871.038)	(241.392.060)	(498.144)	(12.856.007)	(7.531.508)
Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(9.045.108)	(82.566.226)	(10.066.563)	(218.992.454)	(499.645)	(15.680.366)	(4.599.004)
	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD
Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022							
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter Gewinn aus Anlagen und Fremdwährungen	111.048	53.518	933.784	1.096.943	696.385	1.499.622	177.861
Entwicklung der nicht realisierten Wertminderungen aus Anlagen und Fremdwährungen	(2.622.654)	(982.763)	(10.858.829)	(2.106.021)	(1.543.125)	(9.866.208)	(4.878.885)
Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(2.511.606)	(929.245)	(9.925.045)	(1.009.078)	(846.740)	(8.366.586)	(4.701.024)

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

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

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

* Der Teilfonds wurde nach dem 30. Juni 2021 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten angegeben werden.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

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

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021							
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen und Fremdwährungen	315.023	(237.408)	541.765	60.836.047	(335.472)	218.843	249.770
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung) aus Anlagen und Fremdwährungen	5.556.099	1.170.385	9.294.027	157.314.751	(45.692)	90.269	(221.220)
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	5.871.122	932.977	9.835.792	218.150.798	(381.164)	309.112	28.550
	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD
Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021							
Gewinn/(Verlust) aus:							
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen und Fremdwährungen	141.654	1.455.467	1.886.431	(38.984)	1.787.527	1.465.904	6.577.904
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung aus Anlagen und Fremdwährungen	966.522	8.588.984	2.139.173	1.939.167	6.415.536	3.153.860	14.664.073
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	1.108.176	10.044.451	4.025.604	1.900.183	8.203.063	4.619.764	21.241.977

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

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

Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF* EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
Gewinn/(Verlust) aus:		
Realisierter Gewinn aus Anlagen und Fremdwährungen	168.465	1.957.373
Entwicklung der nicht realisierten Wertsteigerung aus Anlagen und Fremdwährungen	943.916	3.943.910
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	1.112.381	5.901.283

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

5. Betriebliche Aufwendungen

Gesamtkostenquote („TER“)

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

- die Gebühren und Aufwendungen der Verwaltungsgesellschaft, des Abschlussprüfers, des Anlageverwalters (einschließlich der Kosten und Aufwendungen für einen vom Anlageverwalter bestellten Anlageberater), der Rechtsberater, des Gesellschaftssekretärs, der Verwaltungsratsmitglieder (siehe Seite 83 für Einzelheiten zu den gezahlten Honoraren), des Verwalters und der Verwahrstelle;
- die Kosten für die Registrierung eines Teilfonds zum Vertrieb in einer Rechtsordnung sowie der Zulassung und der Aufrechterhaltung der Zulassung von Anteilen zur Notierung an einer Börse;
- Kosten für das Einberufen und Abhalten von Versammlungen des Verwaltungsrats und der Anteilinhaber;
- Honorare und Ausgaben für Rechtsberatung und anderweitige Beratungsdienste;
- die Kosten und Aufwendungen für die Erstellung, den Druck, die Veröffentlichung und das Verteilen der Prospekte, Prospektnachträge, Jahres- und Halbjahresberichte und aller anderen Dokumente an aktuelle und potenzielle Anleger;
- die Kosten und Aufwendungen für die Lizenzierung oder andere zahlbare Gebühren an einen Indexanbieter oder anderen Lizenzgeber von geistigem Eigentum, Handels- oder Dienstleistungsmarken zur Nutzung durch die ICAV;
- die Gebühren lokaler Zahl-, Zentralisierungs-, Register- oder sonstiger Stellen (die handelsüblichen Sätzen entsprechen müssen);
- sämtliche Gründungskosten des Fonds und der Teilfonds sowie
- die sonstigen Kosten und Aufwendungen (ohne einmalige und außerordentliche Kosten und Aufwendungen), die von Zeit zu Zeit anfallen können und die durch den Verwaltungsrat als für den fortgesetzten Betrieb der ICAV oder eines Teilfonds als notwendig oder angemessen genehmigt wurden.

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

5. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

Die für die einzelnen Teilfonds zahlbare TER ist nachstehend aufgeführt.

Teilfonds	Gesamtkostenquote (TER)	Gesamtkostenquote (TER)
	(% des NIW) 30. Juni 2022	(% des NIW) 30. Juni 2021
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	0,19 %	0,19 %
Franklin FTSE China UCITS ETF	0,19 %	0,19 %
Franklin FTSE India UCITS ETF	0,19 %	0,19 %
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	0,09 %	0,09 %
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*	0,19 %	-
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	0,30 %	0,30 %
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	0,05 %**	0,15 %**
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	0,35 %	0,35 %
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	0,40 %	0,40 %
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	0,45 %	0,45 %
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	0,25 %	0,25 %
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	0,25 %	0,25 %
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	0,45 %	0,45 %
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	0,40 %	0,40 %
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	0,25 %	0,25 %
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	0,15 %	0,15 %
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	0,07 %***	0,07 %***
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF****	0,22 %	-
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*****	0,35 %	-

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Die TER wurde am 1. Juli 2021 von 0,15 % auf 0,05 % gesenkt.

*** Die TER wurde am 1. Juni 2021 von 0,15 % auf 0,07 % gesenkt.

**** Der Teilfonds wurden am 14. Juni 2022 aufgelegt.

***** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 sind für die Verwaltungsratsmitglieder Robert Burke, Frank Ennis und Gregory McGowan Honorare in Höhe von jeweils 25.000 EUR angefallen (30. Juni 2021: jeweils 25.000 EUR) Dies sind die einzigen Verwaltungsratsmitglieder, die ein Honorar erhalten. Diese Honorare wurden gezahlt. Die Franklin Templeton Gruppe stellt Mitarbeitende zur Verfügung, die als Verwaltungsratsmitglieder der ICAV tätig sind (diese Verwaltungsratsmitglieder erhalten kein Honorar). Die Gesamtvergütung der Verwaltungsratsmitglieder übersteigt nicht 100.000 EUR pro Jahr und Verwaltungsratsmitglied (oder einen entsprechenden Betrag) (oder eine andere Summe, die der Verwaltungsrat bisweilen festlegen und den Anteilhabern mitteilen kann).

Vergütung des unabhängigen Abschlussprüfers

Die Vergütung für alle seitens der Wirtschaftsprüfungsgesellschaft für die Geschäftsjahre zum 30. Juni 2022 bzw. 30. Juni 2021 durchgeführten Arbeiten beträgt:

	30. Juni 2022 EUR	30. Juni 2021 EUR
Gesetzlich vorgeschriebene Abschlussprüfung	163.600	138.850
Insgesamt	163.600	138.850

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

5. Betriebliche Aufwendungen (Fortsetzung)

Vergütung des unabhängigen Abschlussprüfers (Fortsetzung)

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

Transaktionskosten

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

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

Den Teilfonds sind im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 insgesamt die folgenden Transaktionskosten angefallen:

Teilfonds	Währung	30. Juni 2022	30. Juni 2021
		Kosten	Kosten
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	10.496	4.308
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	61.662	63.090
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	16.200	16.617
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	71.186	182.045
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*	USD	652	-
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	1.161	-
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	9.829	395
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	-	90
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	USD	789	1.315
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	USD	8.252	13.676
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	EUR	2.518	4.704
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	EUR	738	806
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	USD	27.611	9.058
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	USD	2.107	4.733
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	USD	4.470	6.547
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	1.862	799
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	10.613	9.069
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF**	USD	677	-
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF***	USD	-	-

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement

Einleitung und Überblick

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

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

Für Teilfonds mit aktiv gemanagten Anlagen (gemäß Angabe im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ auf Seite 4) setzt der Anlageverwalter einen Investmentansatz ein, der in aller Regel Research wie fundamentale Analysen, mikro- und makroökonomische Analysen und/oder technische Analysen beinhaltet und nicht auf das Erzielen der Wertentwicklung eines Index ausgerichtet ist, weil er davon ausgeht, dass mit der aktiven Auswahl von Anlagen bessere Ergebnisse zu erzielen sind als durch ein marktbreites Engagement. Solche Teilfonds können Verluste erleiden, wenn sich das Urteil des Anlageverwalters über Märkte, künftige Volatilität, Zinsen, Branchen, Sektoren und Regionen oder die Attraktivität, die relativen Werte, die Liquidität, die Effektivität oder die potenzielle Wertsteigerung bestimmter Anlagen, die für einen Teilfonds vorgenommen werden, als falsch erweist. Infolge der COVID-19-Pandemie und ihrer Auswirkungen auf die Weltwirtschaft wurden diese Analysen um spezifische Marktstresstests und die Überwachung des Kreditrisikos erweitert.

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

a) Marktpreisrisiko

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

a) Marktpreisrisiko (Fortsetzung)

Das maximale Risiko, das aus einer Anlage in einem Finanzinstrument entstehen kann, richtet sich nach dem beizulegenden Zeitwert der Finanzinstrumente. Dies gilt nicht für Short-Positionen in Derivaten und Wertpapieren, deren Verluste potenziell unbegrenzt sind. Das Marktpreisrisiko, dem die Teilfonds zum 30. Juni 2022 und 2021 ausgesetzt sind, beläuft sich auf den beizulegenden Zeitwert der Anlagen, wie in der Vermögensaufstellung des betreffenden Teilfonds angegeben.

Preissensitivitätsanalyse

Eine Erhöhung des Preises aller von den Teilfonds zum 30. Juni 2022 gehaltenen Aktien um jeweils 5 % (30. Juni 2021: 5 %), hätte, wenn alle übrigen Variablen konstant bleiben, eine Zunahme des Nettovermögens der Teilfonds zur Folge gehabt wie in nachstehender Tabelle angegeben. Ein Rückgang um 5 % hätte einen gegenläufigen Effekt in gleicher Höhe auf den Wert der Teilfonds.

Teilfonds	Währung	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	1.329.786	1.164.855
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	11.948.813	9.680.281
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	6.120.225	3.642.759
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	14.515.246	34.280.347
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*	USD	102.714	-
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	3.697.053	5.237.981
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	29.845.907	2.729.377
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	631.596	839.635
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	USD	254.493	291.736
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	USD	1.559.654	1.969.039
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	EUR	1.544.264	1.140.284
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	EUR	290.681	473.436
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	USD	2.016.089	1.892.996
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	USD	1.254.417	1.114.440
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	USD	4.693.395	5.261.906
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	711.156	464.855
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	5.455.961	2.303.236
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF**	USD	128.072	-
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF***	USD	1.421.328	-

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

b) Währungsrisiko

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

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

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

Die Währungsrisikoexposition und Währungssensitivitätsanalyse, die den ungefähren Anstieg oder Rückgang des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens jedes relevanten Teilfonds angeben, wenn der Wechselkurs der Basiswährung zum 30. Juni 2022 und 2021 für jeden Teilfonds um 5 % gegenüber der Nicht-Basiswährung gestiegen oder gesunken ist, sind in den nachstehenden Tabellen für diejenigen Teilfonds mit einem wesentlichen Risiko aufgeführt.

	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF				
Brasilianischer Real	299.549	15.154.373	15.453.922	772.696
	299.549	15.154.373	15.453.922	772.696

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

	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Franklin FTSE India UCITS ETF				
Indische Rupie	(117.158)	122.404.499	122.287.341	6.114.367
	(117.158)	122.404.499	122.287.341	6.114.367

	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Franklin FTSE Korea UCITS ETF				
Koreanischer Won	882.379	290.304.928	291.187.307	14.559.365
	882.379	290.304.928	291.187.307	14.559.365

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*				
Neuer Taiwan-Dollar	28.738	2.054.278	2.083.016	104.151
	28.738	2.054.278	2.083.016	104.151

	Monetär EUR	Nicht monetär EUR	Devisen- termin- kontrakte	Insgesamt EUR	Währungs- sensitivität EUR
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF					
Britisches Pfund	5.434.386	-	(6.289.663)	(855.277)	(42.764)
	5.434.386	-	(6.289.663)	(855.277)	(42.764)

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6 Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Die Teilfonds mit einer wesentlichen Währungsrisikoexposition zum 30. Juni 2021 sind in den nachstehenden Tabellen aufgeführt:

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Brasilianischer Real	(250.117)	13.218.943	12.968.826	648.441
	(250.117)	13.218.943	12.968.826	648.441

Franklin FTSE China UCITS ETF	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Chinesischer Yuan Renminbi	76.623	34.547.134	34.623.757	1.731.188
Hongkong-Dollar	873.202	131.082.311	131.955.513	6.597.776
Singapur-Dollar	1	174.583	174.584	8.729
	949.826	165.804.028	166.753.854	8.337.693

Franklin FTSE India UCITS ETF	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Indische Rupie	(1.238.252)	72.852.125	71.613.873	3.580.694
	(1.238.252)	72.852.125	71.613.873	3.580.694

Franklin FTSE Korea UCITS ETF	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Koreanischer Won	1.186.351	685.606.948	686.793.299	34.339.665
	1.186.351	685.606.948	686.793.299	34.339.665

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	Monetär EUR	Nicht monetär EUR	Devisen- termin- kontrakte	Insgesamt EUR	Währungs- sensitivität EUR
Britisches Pfund	5.930.138	-	(5.846.705)	83.433	4.172
	5.930.138	-	(5.846.705)	83.433	4.172

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF				
Chinesischer Yuan Renminbi	8.069	630.814	638.883	31.944
Euro	(1)	-	(1)	-
Hongkong-Dollar	39.626	1.884.710	1.924.336	96.217
Indische Rupie	(25.173)	1.007.132	981.959	49.098
Indonesische Rupiah	3.357	124.947	128.304	6.415
Koreanischer Won	1.349	546.995	548.344	27.417
Malaysischer Ringgit	2.343	152.204	154.547	7.727
Neuer Taiwan-Dollar	4.106	1.079.779	1.083.885	54.194
Pakistanische Rupie	108	2.626	2.734	137
Philippinischer Peso	51	28.606	28.657	1.433
Singapur-Dollar	19	168.075	168.094	8.405
Thailändischer Baht	56	161.126	161.182	8.059
	33.910	5.787.014	5.820.924	291.046

	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF				
Brasilianischer Real	19.669	638.747	658.416	32.921
Chilenischer Peso	-	261.541	261.541	13.077
Chinesischer Yuan Renminbi	47.943	3.250.906	3.298.849	164.942
Tschechische Krone	726	73.712	74.438	3.722
Ägyptisches Pfund	-	48.173	48.173	2.409
Euro	5.116	147.065	152.181	7.609
Hongkong-Dollar	210.408	7.001.111	7.211.519	360.576
Ungarische Forint	996	57.655	58.651	2.933
Indische Rupie	(103.385)	5.167.117	5.063.732	253.187
Indonesische Rupiah	18.043	743.938	761.981	38.099
Koreanischer Won	5.585	3.059.042	3.064.627	153.231
Kuwaitischer Dinar	888	102.056	102.944	5.147
Malaysischer Ringgit	18.760	846.819	865.579	43.279
Mexikanischer Peso	2.152	1.010.679	1.012.831	50.642
Neuer Russischer Rubel	11.140	3.921.743	3.932.883	196.644
Neuer Taiwan-Dollar	19.817	5.200.229	5.220.046	261.002
Neue Türkische Lira	76	469.566	469.642	23.482
Pakistanische Rupie	719	16.179	16.898	845
Philippinischer Peso	1.202	178.471	179.673	8.984
Polnischer Złoty	2.872	225.611	228.483	11.424
Katar-Riyal	9.675	486.106	495.781	24.789
Saudi-Riyal	3.977	1.629.857	1.633.834	81.692
Südafrikanischer Rand	10.933	1.952.841	1.963.774	98.189
Thailändischer Baht	93	578.136	578.229	28.911
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	8.791	499.560	508.351	25.418
	296.196	37.566.860	37.863.056	1.893.154

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

	Monetär	Nicht monetär	Insgesamt	Währungs- sensitivität
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone	2.512	633.225	635.737	31.787
Norwegische Krone	10.141	1.513.495	1.523.636	76.182
Britisches Pfund	34.083	7.016.418	7.050.501	352.525
Schwedische Krone	7.120	832.504	839.624	41.981
Schweizer Franken	-	1.694.323	1.694.323	84.716
US-Dollar	12.656	-	12.656	633
	66.512	11.689.965	11.756.477	587.824

	Monetär	Nicht monetär	Insgesamt	Währungs- sensitivität
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	EUR	EUR	EUR	EUR
Dänische Krone	5	717.872	717.877	35.894
Norwegische Krone	3.203	156.428	159.631	7.982
Britisches Pfund	6.223	2.192.103	2.198.326	109.916
Schwedische Krone	7	725.716	725.723	36.286
Schweizer Franken	4	1.644.845	1.644.849	82.242
US-Dollar	858	-	858	43
	10.300	5.436.964	5.447.264	272.363

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Australischer Dollar	14.857	2.002.235	2.017.092	100.855
Brasilianischer Real	2.804	-	2.804	140
Kanadischer Dollar	5.190	3.348.763	3.353.953	167.698
Chinesischer Yuan Renminbi	5.789	123.752	129.541	6.477
Dänische Krone	-	123.297	123.297	6.165
Euro	13.586	2.027.551	2.041.137	102.057
Hongkong-Dollar	1.916	520.656	522.572	26.129
Indonesische Rupiah	-	163.361	163.361	8.168
Japanischer Yen	5.641	3.126.510	3.132.151	156.608
Kuwaitischer Dinar	13	-	13	1
Malaysischer Ringgit	-	42.563	42.563	2.128
Mexikanischer Peso	-	-	-	-
Neuer Russischer Rubel	-	299.148	299.148	14.957
Neuer Taiwan-Dollar	2.807	1.077.093	1.079.900	53.995
Neue Türkische Lira	51	33.736	33.787	1.689
Neuseeländischer Dollar	1	166.707	166.708	8.335
Norwegische Krone	807	105.238	106.045	5.302
Philippinischer Peso	-	14.700	14.700	735
Britisches Pfund	9.596	2.273.828	2.283.424	114.171
Katar-Riyal	-	589.795	589.795	29.490
Saudi-Riyal	-	1.348.356	1.348.356	67.418
Singapur-Dollar	-	333.736	333.736	16.687
Südafrikanischer Rand	1.774	89.700	91.474	4.574
Schweizer Franken	-	2.983.707	2.983.707	149.185
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	-	143.063	143.063	7.153
	64.832	20.937.495	21.002.327	1.050.117

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	Monetär USD	Nicht monetär USD	Insgesamt USD	Währungs- sensitivität USD
Australischer Dollar	1.708	970.615	972.323	48.616
Brasilianischer Real	5.467	159.653	165.120	8.256
Kanadischer Dollar	1.627	1.210.549	1.212.176	60.609
Chilenischer Peso	-	32.642	32.642	1.632
Chinesischer Yuan Renminbi	178	26.222	26.400	1.320
Dänische Krone	742	746.442	747.184	37.359
Euro	10.657	2.213.370	2.224.027	111.201
Hongkong-Dollar	1.062	872.428	873.490	43.675
Ungarische Forint	-	-	-	-
Indische Rupie	(4.636)	388.024	383.388	19.169
Indonesische Rupiah	2.637	13.498	16.135	807
Japanischer Yen	12.307	2.578.040	2.590.347	129.517
Koreanischer Won	1.109	273.865	274.974	13.749
Kuwaitischer Dinar	13	-	13	1
Malaysischer Ringgit	1.508	151.394	152.902	7.645
Neuer Russischer Rubel	-	115.503	115.503	5.775
Neuer Taiwan-Dollar	1.789	651.941	653.730	32.687
Neue Türkische Lira	-	18.125	18.125	906
Neuseeländischer Dollar	803	143.761	144.564	7.228
Norwegische Krone	1.387	144.018	145.405	7.270
Pakistanische Rupie	-	1.771	1.771	89
Philippinischer Peso	-	3.958	3.958	198
Britisches Pfund	4.903	1.360.086	1.364.989	68.249
Katar-Riyal	38	17.029	17.067	853
Saudi-Riyal	34	8.496	8.530	427
Singapur-Dollar	1	60.308	60.309	3.015
Südafrikanischer Rand	1.638	132.215	133.853	6.693
Schwedische Krone	5	160.194	160.199	8.010
Schweizer Franken	-	570.534	570.534	28.527
Thailändischer Baht	916	227.883	228.799	11.440
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	982	-	982	49
	46.875	13.252.564	13.299.439	664.972

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

b) Währungsrisiko (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	Monetär EUR	Nicht monetär EUR	Insgesamt EUR	Währungs- sensitivität EUR
Dänische Krone	111	539.630	539.741	26.987
Norwegische Krone	239	88.195	88.434	4.422
Polnischer Złoty	49	7.499	7.548	377
Britisches Pfund	2.788	1.766.287	1.769.075	88.454
Schwedische Krone	1.612	505.600	507.212	25.361
Schweizer Franken	1	1.423.489	1.423.490	71.175
US-Dollar	432	-	432	22
	5.232	4.330.700	4.335.932	216.798

*Die Teilfonds wurden am 29. Juli 2020 aufgelegt.

Der Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF, der Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF, und der Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF und der Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF weisen zum 30. Juni 2021 kein Währungsrisiko auf. Aus diesem Grund erfolgen für diese Teilfonds keine Angaben.

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

Zum 30. Juni 2022

Weniger als 1 Monat
EUR

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF

Zuflüsse	7.873.901
Abflüsse	(7.668.790)

Zum 30. Juni 2021

Weniger als 1 Monat
EUR

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF

Zuflüsse	5.873.011
Abflüsse	(5.859.858)

c) Zinsrisiko

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

** Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	40.321.780	40.321.780
Sonstige Forderungen	-	-	94.734	94.734
Gesamtvermögen	-	-	40.416.514	40.416.514
Verbindlichkeiten				
Überziehungskredit	-	(65.886)	-	(65.886)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(16.455)	(16.455)
Gesamtverbindlichkeiten	-	(65.886)	(16.455)	(82.341)
Gesamtnettvermögen				40.334.173
5 % Zinssensitivitätslücke				-

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

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

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

** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

Das Zinsrisiko stellt sich für jeden Teilfonds zum 30. Juni 2021 wie folgt dar:

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	23.297.096	23.297.096
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	6.516	-	6.516
Sonstige Forderungen	-	-	163.843	163.843
Gesamtvermögen	-	6.516	23.460.939	23.467.455
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente	-	-	(1.920)	(1.920)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(338.572)	(338.572)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(340.492)	(340.492)
Gesamtnettvermögen				23.126.963
5 % Zinssensitivitätslücke				326

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE China UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	193.605.629	193.605.629
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	264.796	-	264.796
Sonstige Forderungen	-	-	794.667	794.667
Gesamtvermögen	-	264.796	194.400.296	194.665.092
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente	-	-	(770)	(770)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(29.192)	(29.192)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(29.962)	(29.962)
Gesamtnettovermögen				194.635.130
5 % Zinssensitivitätslücke				13.240

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

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE India UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	3.055	-	72.852.125	72.855.180
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	56.118	-	56.118
Sonstige Forderungen	-	-	83.864	83.864
Gesamtvermögen	3.055	56.118	72.935.989	72.995.162
Verbindlichkeiten				
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(1.339.788)	(1.339.788)
Gesamtnettovermögen				71.655.374
5 % Zinssensitivitätslücke				2.959

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin FTSE Korea UCITS ETF	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	685.606.948	685.606.948
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	471.335	-	471.335
Sonstige Forderungen	-	-	899.992	899.992
Gesamtvermögen	-	471.335	686.506.940	686.978.275
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente	-	-	(888)	(888)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(47.342)	(47.342)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(48.230)	(48.230)
Gesamtnettvermögen				686.930.045
5 % Zinssensitivitätslücke				23.567

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

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Unverzinslich EUR	Gesamtwert EUR
Vermögenswerte				
Wertpapiere	104.759.627	-	-	104.759.627
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	2.660.149	-	2.660.149
Derivative Finanzinstrumente	-	-	13.153	13.153
Sonstige Forderungen	-	-	418.897	418.897
Gesamtvermögen	104.759.627	2.660.149	432.050	107.851.826
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(26.087)	(26.087)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(26.087)	(26.087)
Gesamtnettvermögen				107.825.739
5 % Zinssensitivitätslücke				5.370.989

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Unverzinslich EUR	Gesamtwert EUR
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	44.820.375	9.767.170	-	54.587.545
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	4.670.161	-	4.670.161
Sonstige Forderungen	-	-	2.308.903	2.308.903
Gesamtvermögen	44.820.375	14.437.331	2.308.903	61.566.609
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente	-	-	(18.780)	(18.780)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(1.725.641)	(1.725.641)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(1.744.421)	(1.744.421)
Gesamtnettovermögen				59.822.188
5 % Zinssensitivitätslücke				2.962.885

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

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	16.792.707	-	-	16.792.707
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	171.396	-	171.396
Sonstige Forderungen	-	-	136.739	136.739
Gesamtvermögen	16.792.707	171.396	136.739	17.100.842
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(4.670)	(4.670)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(4.670)	(4.670)
Gesamtnettovermögen				17.096.172
5 % Zinssensitivitätslücke				848.205

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	205	-	5.834.517	5.834.722
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	15.716	-	15.716
Sonstige Forderungen	-	-	41.633	41.633
Gesamtvermögen	205	15.716	5.876.150	5.892.071
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(29.934)	(29.934)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(29.934)	(29.934)
Gesamtnettvermögen				5.862.137
5 % Zinssensitivitätslücke				796

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

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	1.209	-	39.379.580	39.380.789
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	169.326	-	169.326
Derivative Finanzinstrumente	-	-	1.350	1.350
Sonstige Forderungen	-	-	292.422	292.422
Gesamtvermögen	1.209	169.326	39.673.352	39.843.887
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(146.355)	(146.355)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(146.355)	(146.355)
Gesamtnettvermögen				39.697.532
5 % Zinssensitivitätslücke				8.527

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Unverzinslich EUR	Gesamtwert EUR
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	22.805.681	22.805.681
Sonstige Forderungen	-	-	2.749.226	2.749.226
Gesamtvermögen	-	-	25.554.907	25.554.907
Verbindlichkeiten				
Überziehungskredit	-	(28.179)	-	(28.179)
Derivative Finanzinstrumente	-	-	(485)	(485)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(2.570.229)	(2.570.229)
Gesamtverbindlichkeiten	-	(28.179)	(2.570.714)	(2.598.893)
Gesamtnettovermögen				22.956.014
5 % Zinssensitivitätslücke				-

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

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Unverzinslich EUR	Gesamtwert EUR
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	9.468.724	9.468.724
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	6.158	-	6.158
Sonstige Forderungen	-	-	22.658	22.658
Gesamtvermögen	-	6.158	9.491.382	9.497.540
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(1.953)	(1.953)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(1.953)	(1.953)
Gesamtnettovermögen				9.495.587
5 % Zinssensitivitätslücke				308

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	37.859.927	37.859.927
Sonstige Forderungen	-	-	112.395	112.395
Gesamtvermögen	-	-	37.972.322	37.972.322
Verbindlichkeiten				
Überziehungskredit	-	(68.538)	-	(68.538)
Derivative Finanzinstrumente	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(14.979)	(14.979)
Gesamtverbindlichkeiten	-	(68.538)	(14.979)	(83.517)
Gesamtnettovermögen				37.888.805
5 % Zinssensitivitätslücke				-

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

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	22.288.798	22.288.798
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	39.118	-	39.118
Sonstige Forderungen	-	-	40.390	40.390
Gesamtvermögen	-	39.118	22.329.188	22.368.306
Verbindlichkeiten				
Derivative Finanzinstrumente	-	-	(51)	(51)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(13.004)	(13.004)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(13.055)	(13.055)
Gesamtnettovermögen				22.355.251
5 % Zinssensitivitätslücke				1.956

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	105.238.120	105.238.120
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	330.640	-	330.640
Derivative Finanzinstrumente	-	-	2.969	2.969
Sonstige Forderungen	-	-	96.439	96.439
Gesamtvermögen	-	330.640	105.337.528	105.668.168
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(106.251)	(106.251)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(106.251)	(106.251)
Gesamtnettovermögen				105.561.917
5 % Zinssensitivitätslücke				16.532

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

	Fester Zinssatz EUR	Variabler Zinssatz EUR	Unverzinslich EUR	Gesamtwert EUR
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF*				
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	9.297.102	9.297.102
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	4.799	-	4.799
Sonstige Forderungen	-	-	7.251	7.251
Gesamtvermögen	-	4.799	9.304.353	9.309.152
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(1.123)	(1.123)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(1.123)	(1.123)
Gesamtnettovermögen				9.308.029
5 % Zinssensitivitätslücke				240

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	Fester Zinssatz USD	Variabler Zinssatz USD	Unverzinslich USD	Gesamtwert USD
Vermögenswerte				
Wertpapiere	-	-	46.064.715	46.064.715
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	67.362	-	67.362
Sonstige Forderungen	-	-	11.469.800	11.469.800
Gesamtvermögen	-	67.362	57.534.515	57.601.877
Verbindlichkeiten				
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(11.434.334)	(11.434.334)
Gesamtverbindlichkeiten	-	-	(11.434.334)	(11.434.334)
Gesamtnettvermögen				46.167.543
5 % Zinssensitivitätslücke				3.368

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

*Die Teilfonds wurden am 29. Juli 2020 aufgelegt.

d) Kreditrisiko und Gegenparteirisiko

Das Kreditrisiko ist das wahrscheinliche Risiko eines Verlustes, der entsteht, wenn ein Kreditnehmer einen Kredit nicht zurückzahlt oder seine vertraglichen Verpflichtungen nicht erfüllt. Anlagen in Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren unterliegen keinem Kreditrisiko. Die Teilfonds sind durch gehaltene Schuldtitel einem Kreditrisiko ausgesetzt. Das Kreditrisiko umfasst in aller Regel das Ausfallrisiko, das Spreadrisiko, das Gegenparteirisiko und das Erfüllungsrisiko. Das Kreditrisiko der Schuldtitel der ICAV zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 wird vom Anlageverwalter überwacht.

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

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

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

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

Zum 30. Juni 2022 betrug das Kreditrating für Citibank NA A+ (30. Juni 2021: A+) und für JPMorgan Securities Inc betrug es A+ (30. Juni 2021: A+).

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

d) Kreditrisiko und Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Die Verwahrstelle der ICAV ist die State Street Custodial Services (Ireland) Limited. Im Wesentlichen alle Vermögenswerte und Zahlungsmittel der Teilfonds werden im Depotbanknetz der Verwahrstelle gehalten. Ein Konkurs oder eine Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle oder ihrer Muttergesellschaft, State Street Corporation, kann dazu führen, dass die Rechte der Teilfonds in Bezug auf ihre bei der Verwahrstelle gehaltenen Anlagen verzögert oder eingeschränkt werden. Das Kreditrating der State Street Corporation zum 30. Juni 2022 betrug A (30. Juni 2021: A).

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Rating*	%	%
Investment Grade	70,94	80,48
Unter Investment Grade	7,41	6,77
Ohne Rating	21,65	12,75
Insgesamt	100,00	100,00

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

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Rating*	%	%
Investment Grade	65,61	67,29
Unter Investment Grade	1,91	4,54
Ohne Rating	32,48	28,17
Insgesamt	100,00	100,00

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

d) Kreditrisiko und Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond ETF zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Rating*	%	%
Investment Grade	90,81	99,79
Ohne Rating	9,19	0,21
Insgesamt	100,00	100,00

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

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Rating*	%	%
Ohne Rating	-	100,00
Insgesamt	-	100,00

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

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Rating*	%	%
Ohne Rating	-	100,00
Insgesamt	-	100,00

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

Die Kreditrisiken in Bezug auf die Schuldtitel des Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 gestalteten sich wie folgt:

Portfolio nach Rating-Kategorie	30. Juni 2022**	30. Juni 2021
Rating*	%	%
Investment Grade	66,48	-
Unter Investment Grade	31,20	-
Ohne Rating	2,32	-
Insgesamt	100,00	-

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

** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten vorliegen.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

e) Liquiditätsrisiko

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

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

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

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

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

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE China UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	63.633	-	-	63.633
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	241.165.019	-	-	241.165.019
Gesamtverbindlichkeiten	241.228.652	-	-	241.228.652

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE India UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	897.372	-	-	897.372
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	122.416.418	-	-	122.416.418
Gesamtverbindlichkeiten	123.313.790	-	-	123.313.790

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE Korea UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)	32.781	-	-	32.781
Sonstige Verbindlichkeiten	25.258	-	-	25.258
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	291.261.525	-	-	291.261.525
Gesamtverbindlichkeiten	291.319.564	-	-	291.319.564
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*				
Sonstige Verbindlichkeiten	351	-	-	351
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	2.082.954	-	-	2.082.954
Gesamtverbindlichkeiten	2.083.305	-	-	2.083.305
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	6.783	-	-	6.783
Sonstige Verbindlichkeiten	18.580	-	-	18.580
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	83.936.003	-	-	83.936.003
Gesamtverbindlichkeiten	83.961.366	-	-	83.961.366
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	26.670	-	-	26.670
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	672.845.051	-	-	672.845.051
Gesamtverbindlichkeiten	672.871.721	-	-	672.871.721
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	3.801	-	-	3.801
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	13.105.918	-	-	13.105.918
Gesamtverbindlichkeiten	13.109.719	-	-	13.109.719
LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)	1.055	-	-	1.055
Sonstige Verbindlichkeiten	37.710	-	-	37.710
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	5.144.978	-	-	5.144.978
Gesamtverbindlichkeiten	5.183.743	-	-	5.183.743

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

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

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

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

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF**				
Sonstige Verbindlichkeiten	242	-	-	242
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	2.578.067	-	-	2.578.067
Gesamtverbindlichkeiten	2.578.309	-	-	2.578.309

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF***				
Sonstige Verbindlichkeiten	8.462.155	-	-	8.462.155
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	29.851.589	-	-	29.851.589
Gesamtverbindlichkeiten	38.313.744	-	-	38.313.744

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Das Liquiditätsprofil der finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds stellt sich zum 30. Juni 2021 wie folgt dar:

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)	1.920	-	-	1.920
Sonstige Verbindlichkeiten	338.572	-	-	338.572
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	23.126.963	-	-	23.126.963
Gesamtverbindlichkeiten	23.467.455	-	-	23.467.455

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE China UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)	770	-	-	770
Sonstige Verbindlichkeiten	29.192	-	-	29.192
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	194.635.130	-	-	194.635.130
Gesamtverbindlichkeiten	194.665.092	-	-	194.665.092

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE India UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	1.339.788	-	-	1.339.788
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	71.655.374	-	-	71.655.374
Gesamtverbindlichkeiten	72.995.162	-	-	72.995.162

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin FTSE Korea UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)	888	-	-	888
Sonstige Verbindlichkeiten	47.342	-	-	47.342
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	686.930.045	-	-	686.930.045
Gesamtverbindlichkeiten	686.978.275	-	-	686.978.275

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	26.087	-	-	26.087
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	107.825.739	-	-	107.825.739
Gesamtverbindlichkeiten	107.851.826	-	-	107.851.826

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)	18.780	-	-	18.780
Sonstige Verbindlichkeiten	1.725.641	-	-	1.725.641
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	59.822.188	-	-	59.822.188
Gesamtverbindlichkeiten	61.566.609	-	-	61.566.609

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	4.670	-	-	4.670
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	17.096.172	-	-	17.096.172
Gesamtverbindlichkeiten	17.100.842	-	-	17.100.842

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	29.934	-	-	29.934
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	5.862.137	-	-	5.862.137
Gesamtverbindlichkeiten	5.892.071	-	-	5.892.071

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	146.355	-	-	146.355
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	39.697.532	-	-	39.697.532
Gesamtverbindlichkeiten	39.843.887	-	-	39.843.887

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)	485	-	-	485
Überziehungskredit	28.179	-	-	28.179
Sonstige Verbindlichkeiten	2.570.229	-	-	2.570.229
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	22.956.014	-	-	22.956.014
Gesamtverbindlichkeiten	25.554.907	-	-	25.554.907

	Weniger als 1 Monat EUR	1 Monat bis 1 Jahr EUR	> 1 Jahr EUR	Gesamtwert EUR
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	1.953	-	-	1.953
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	9.495.587	-	-	9.495.587
Gesamtverbindlichkeiten	9.497.540	-	-	9.497.540

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF				
Überziehungskredit	68.538	-	-	68.538
Sonstige Verbindlichkeiten	14.979	-	-	14.979
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	37.888.805	-	-	37.888.805
Gesamtverbindlichkeiten	37.972.322	-	-	37.972.322

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF				
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten (Futures)	51	-	-	51
Sonstige Verbindlichkeiten	13.004	-	-	13.004
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	22.355.251	-	-	22.355.251
Gesamtverbindlichkeiten	22.368.306	-	-	22.368.306

	Weniger als 1 Monat USD	1 Monat bis 1 Jahr USD	> 1 Jahr USD	Gesamtwert USD
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF				
Sonstige Verbindlichkeiten	106.251	-	-	106.251
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	105.561.917	-	-	105.561.917
Gesamtverbindlichkeiten	105.668.168	-	-	105.668.168

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

e) Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	Weniger als 1	1 Monat bis	> 1 Jahr	Gesamtwert
	Monat	1 Jahr		
	EUR	EUR	EUR	EUR
Sonstige Verbindlichkeiten	1.123	-	-	1.123
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	9.308.029	-	-	9.308.029
Gesamtverbindlichkeiten	9.309.152	-	-	9.309.152

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	Weniger als 1	1 Monat bis	> 1 Jahr	Gesamtwert
	Monat	1 Jahr		
	USD	USD	USD	USD
Sonstige Verbindlichkeiten	11.434.334	-	-	11.434.334
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	46.167.543	-	-	46.167.543
Gesamtverbindlichkeiten	57.601.877	-	-	57.601.877

*Die Teilfonds wurden am 29. Juli 2020 aufgelegt.

f) Zeitwerthierarchie

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

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

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

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

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

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

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

In den folgenden Tabellen wird die Zeitwerthierarchie der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. Juni 2022 analysiert.

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	26.595.719	-	-	26.595.719
Terminkontrakte (Futures)*	(56.076)	-	-	(56.076)
	<u>26.539.643</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>26.539.643</u>

Franklin FTSE China UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	238.677.645	-	298.623	238.976.268
Terminkontrakte (Futures)*	33.190	-	-	33.190
	<u>238.710.835</u>	<u>-</u>	<u>298.623</u>	<u>239.009.458</u>

Franklin FTSE India UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	122.404.499	-	-	122.404.499
	<u>122.404.499</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>122.404.499</u>

Franklin FTSE Korea UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	290.304.928	-	-	290.304.928
Terminkontrakte (Futures)*	(32.781)	-	-	(32.781)
	<u>290.272.147</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>290.272.147</u>

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF**	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	2.054.278	-	-	2.054.278
	<u>2.054.278</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>2.054.278</u>

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	73.941.052	-	73.941.052
Terminkontrakte*	-	205.111	-	205.111
Terminkontrakte (Futures)*	63.407	-	-	63.407
	<u>63.407</u>	<u>74.146.163</u>	<u>-</u>	<u>74.209.570</u>

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	596.918.148	-	596.918.148
Terminkontrakte (Futures)*	434.546	-	-	434.546
	<u>434.546</u>	<u>596.918.148</u>	<u>-</u>	<u>597.352.694</u>

Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	12.631.912	-	12.631.912
	<u>-</u>	<u>12.631.912</u>	<u>-</u>	<u>12.631.912</u>

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	5.089.860	-	-	5.089.860
Aktien	(1.055)	-	-	(1.055)
	<u>5.088.805</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>5.088.805</u>

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	31.175.128	-	17.960	31.193.088
Terminkontrakte (Futures)*	(3.280)	-	-	(3.280)
	<u>31.171.848</u>	<u>-</u>	<u>17.960</u>	<u>31.189.808</u>

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	EUR	EUR	EUR	EUR
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	30.885.281	-	-	30.885.281
Terminkontrakte (Futures)*	(1.890)	-	-	(1.890)
	<u>30.883.391</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>30.883.391</u>

	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	EUR	EUR	EUR	EUR
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	5.813.624	-	-	5.813.624
Terminkontrakte (Futures)*	(435)	-	-	(435)
	<u>5.813.189</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>5.813.189</u>

	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	USD	USD	USD	USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	40.317.613	-	4.167	40.321.780
	<u>40.317.613</u>	<u>-</u>	<u>4.167</u>	<u>40.321.780</u>

	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	USD	USD	USD	USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	25.088.331	-	-	25.088.331
Terminkontrakte (Futures)*	(1.053)	-	-	(1.053)
	<u>25.087.278</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>25.087.278</u>

	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	USD	USD	USD	USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	93.867.900	-	-	93.867.900
Terminkontrakte (Futures)*	(9.126)	-	-	(9.126)
	<u>93.858.774</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>93.858.774</u>

	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Insgesamt
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	EUR	EUR	EUR
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	14.223.125	-	-	14.223.125
Terminkontrakte (Futures)*	235	-	-	235
	<u>14.223.360</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>14.223.360</u>

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	109.119.212	-	-	109.119.212
Terminkontrakte (Futures)*	(8.751)	-	-	(8.751)
	109.110.461	-	-	109.110.461
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF***				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	2.561.446	-	-	2.561.446
	2.561.446	-	-	2.561.446
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF****				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	-	28.426.550	-	28.426.550
	-	28.426.550	-	28.426.550

* Repräsentiert den nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust).

** Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

**** Der Teilfonds wurden am 27. Juni 2022 aufgelegt.

Anlagen, deren Werte auf notierten Marktpreisen in aktiven Märkten basieren, werden in die Ebene 1 eingeordnet. Für die ICAV gehören dazu aktive börsennotierte Aktien und börsengehandelte Derivate.

Finanzinstrumente, die nicht börsennotiert sind, aber auf der Grundlage von notierten Marktpreisen, Händlernoteierungen oder alternativen Preisquellen bewertet werden, die durch beobachtbare Parameter gestützt werden, werden der Ebene 2 zugeordnet. Darunter fallen Anleihen.

Übertragungen zwischen den Ebenen der Zeitwerthierarchie gelten als am Ende des Berichtszeitraums erfolgt. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 oder im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 gab es keine Übertragungen zwischen der Ebene 1 und der Ebene 2 der Zeitwerthierarchie. Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 gab es keine Übertragungen aus der Ebene 1 in die Ebene 3.

Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Im Franklin FTSE China UCITS ETF gab es sechs Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 298.623 USD, die zum 30. Juni 2022 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die Evergrande Property Services Group Ltd wurde am 4. Oktober 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Shimao Group Holdings Ltd wurde am 1. April 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Sunac China Holdings Ltd wurde am 1. April 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die China Evergrande Group wurde am 4. Oktober 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Guosheng Financial Holding Inc wurde am 1. Juni 2022 vom Handel an der Börse Shenzhen ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Logan Group Co Ltd wurde am 12. Mai 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

Im Franklin FTSE Korea UCITS ETF gab es eine mit 0 USD bewertete Anlage, die zum 30. Juni 2022 in die Ebene 3 eingestuft war. Die Sillajen Inc wurde am 5. Mai 2022 vom Handel an der Korean Securities Dealers Automated Quotations ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

Im Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF gab es eine mit 0 USD bewertete Anlage, die zum 30. Juni 2022 in die Ebene 3 eingestuft war. Die Taishin Financial Holding (voting rights) wurde am 28. Juni 2022 vom Handel an der Börse Taiwan ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Im Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF gab es 19 Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 17.960 USD, die zum 30. Juni 2021 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die Alrosa PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Phosagro PJSC GDR ist ein im Freiverkehr gehandeltes Wertpapier, das zum 28. Februar 2022 mit dem beizulegenden Zeitwert bewertet wird. PhosAgro PJSC GDR (Reg S) ist ein im Freiverkehr gehandeltes Wertpapier, das zum 28. Februar 2022 mit dem beizulegenden Zeitwert bewertet wird. Die Shimao Group Holdings Ltd wurde am 1. April 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Sunac China Holdings Ltd wurde am 1. April 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polyus PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Tatneft PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Novolipetsk Steel PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Gazprom PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die LUKOIL PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Rosneft Oil Co PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die MMC Norilsk Nickel PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Inter RAO UES PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Severstal PAO wurde am 28. Februar 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Surgutneftegas PJSC wurde am 28. Februar 2022 vom Handel im russischen Handelssystem Moskau ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Surgutneftegas PJSC (preferred stock) wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polymetal International Plc wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die TCS Group Holding Plc GDR wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der Micex Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

Im Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF gab es drei Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 4.167 USD, die zum 30. Juni 2022 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die Tatneft Pjsc wurde am 28. Februar 2022 vom Handel im Russian Trading System (RTS) Index ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polymetal International Plc wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Das Wertpapier wird weiterhin zum zuletzt gehandelten Marktkurs für dieses Wertpapier an diesem Datum bewertet. Die Logan Group Co Ltd wurde am 12. Mai 2022 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

Im Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF gab es vier Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 0 USD, die zum 30. Juni 2022 in die Ebene 3 eingestuft waren. Phosagro Pjsc ist ein im Freiverkehr gehandeltes Wertpapier, das zum 28. Februar 2022 mit dem beizulegenden Zeitwert bewertet wird, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. PhosAgro PJSC GDR ist ein im Freiverkehr gehandeltes Wertpapier, das zum 28. Februar 2022 mit dem beizulegenden Zeitwert bewertet wird, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polyus Pjsc wurde am 28. Februar 2022 vom Handel im Russian Trading System (RTS) Index ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Polymetal International Plc wurde am 28. Februar 2022 vom Handel an der MICEX Stock Exchange ausgesetzt, und zum 30. Juni 2022 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Das Wertpapier wird weiterhin zum zuletzt gehandelten Marktkurs für dieses Wertpapier an diesem Datum bewertet.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

Nachstehende Tabellen geben Aufschluss über Veränderungen bezogen auf die Ebene 3 der Zeitwerthierarchie für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022:

	30. Juni 2022
	USD
Franklin FTSE China UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	146.252
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(153.760)
Nicht realisierter Verlust im Periodenergebnis	(80.811)
Verkäufe	(117.164)
Käufe	275.828
Übertragungen auf Ebene 3	228.278
Am Ende des Geschäftsjahres	298.623

	30. Juni 2022
	USD
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	1.123.019
Nicht realisierter Verlust im Periodenergebnis	(585.806)
Käufe	465.604
Verkäufe	(808.712)
Übertragungen aus Ebene 3	(216.243)
Realisierte Gewinne im Periodenergebnis	22.138
Am Ende des Geschäftsjahres	--

	30. Juni 2022
	USD
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	11.280
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(9.771)
Nicht realisierter Gewinn im Periodenergebnis	6.168
Verkäufe	(7.677)
Am Ende des Geschäftsjahres	-

	30. Juni 2022
	USD
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	63.169
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(55.586)
Nicht realisierter Verlust im Periodenergebnis	(125.975)
Verkäufe	(42.990)
Käufe	179.342
Am Ende des Geschäftsjahres	17.960

	30. Juni 2022
	USD
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	-
Übertragungen auf Ebene 3	4.167
Am Ende des Geschäftsjahres	4.167

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

In den folgenden Tabellen wird die Zeitwerthierarchie der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. Juni 2021 analysiert.

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	23.297.096	-	-	23.297.096
Terminkontrakte (Futures)*	(1.920)	-	-	(1.920)
	<u>23.295.176</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>23.295.176</u>

Franklin FTSE China UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	193.459.377	-	146.252	193.605.629
Terminkontrakte (Futures)*	(770)	-	-	(770)
	<u>193.458.607</u>	<u>-</u>	<u>146.252</u>	<u>193.604.859</u>

Franklin FTSE India UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	3.055	-	3.055
Aktien	72.852.125	-	-	72.852.125
	<u>72.852.125</u>	<u>3.055</u>	<u>-</u>	<u>72.855.180</u>

Franklin FTSE Korea UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	684.483.929	-	1.123.019	685.606.948
Terminkontrakte (Futures)*	(888)	-	-	(888)
	<u>684.483.041</u>	<u>-</u>	<u>1.123.019</u>	<u>685.606.060</u>

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	104.759.627	-	104.759.627
Terminkontrakte*	-	13.153	-	13.153
	<u>-</u>	<u>104.772.780</u>	<u>-</u>	<u>104.772.780</u>

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	54.587.545	-	54.587.545
Terminkontrakte (Futures)*	(18.780)	-	-	(18.780)
	<u>(18.780)</u>	<u>54.587.545</u>	<u>-</u>	<u>54.568.765</u>

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	16.792.707	-	16.792.707
	-	16.792.707	-	16.792.707
	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	205	-	205
Aktien	5.823.237	-	11.280	5.834.517
	5.823.237	205	11.280	5.834.722
	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	-	1.209	-	1.209
Aktien	39.316.411	-	63.169	39.379.580
Terminkontrakte (Futures)*	1.350	-	-	1.350
	39.317.761	1.209	63.169	39.382.139
	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Insgesamt EUR
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	22.805.681	-	-	22.805.681
Terminkontrakte (Futures)*	(485)	-	-	(485)
	22.805.196	-	-	22.805.196
	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Insgesamt EUR
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	9.468.724	-	-	9.468.724
	9.468.724	-	-	9.468.724
	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	37.859.927	-	-	37.859.927
	37.859.927	-	-	37.859.927
	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	22.288.798	-	-	22.288.798
Terminkontrakte (Futures)*	(51)	-	-	(51)
	22.288.747	-	-	22.288.747

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF				
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	105.238.120	-	-	105.238.120
Terminkontrakte (Futures)*	2.969	-	-	2.969
	105.241.089	-	-	105.241.089
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF				
	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	9.297.102	-	-	9.297.102
	9.297.102	-	-	9.297.102
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF				
	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Insgesamt USD
Finanzielle Vermögenswerte:				
Aktien	46.064.715	-	-	46.064.715
	46.064.715	-	-	46.064.715

* Repräsentiert den nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust).

Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Im Franklin FTSE China UCITS ETF gab es vier Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 146.252 USD, die zum 30. Juni 2021 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die Brilliance China Automotive Holdings Ltd wurde am 23. Juni 2021 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2021 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die Easysight Supply Chain Management Co Ltd wurde am 30. April 2021 vom Handel an der Börse Schanghai ausgesetzt, und zum 30. Juni 2021 gab es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Das Wertpapier wird weiterhin zum zuletzt gehandelten Marktkurs für dieses Wertpapier an diesem Datum bewertet. Die Suning.com Co Ltd wurde am 16. Juni 2021 vom Handel an der Börse Shenzhen ausgesetzt, und zum 30. Juni 2021 gab es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Die China Huarong Asset Management Co Ltd hat zum 30. Juni 2021 keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Das Wertpapier wird weiterhin zum zuletzt gehandelten Marktkurs für dieses Wertpapier an diesem Datum bewertet.

Im Franklin FTSE Korea UCITS ETF gab es zwei Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von 1.123.019 USD, die zum 30. Juni 2021 in die Ebene 3 eingestuft waren. Die Doosan Infracore Co Ltd wurde am 19. März 2021 vom Handel an der Börse ausgesetzt, und zum 30. Juni 2021 gab es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Das Wertpapier wird weiterhin zum zuletzt gehandelten Marktkurs für dieses Wertpapier an diesem Datum bewertet. SillaJen Inc, ein vom Franklin FTSE Korea UCITS ETF gehaltenes Wertpapier, wurde am 6. Mai 2020 vom Handel an der Korean Stock Exchange ausgesetzt. Seit diesem Datum gab es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier. Der letzte notierte Kurs an diesem Datum war 12.100 KRW. Zum 30. Juni 2021 hatte der Anlageverwalter einen Abschlag von 50 % auf diese Anlage angesetzt und das Wertpapier mit 2.665 USD bewertet. In der folgenden Tabelle ist der Effekt einer Veränderung der wesentlichen Annahmen bei diesen Finanzinstrumenten der Ebene 3 aufgeführt

Abschlag %	Aktualisierter Zeitwert USD	Veränderung des rückkaufbarer, zuzurechnenden USD	den gewinnberechtigter Anteile Nettoinventarwerts
0 %	5.330	2.665	
25 %	3.998	(1.332)	
75 %	1.332	(3.998)	

Im Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF gab es eine mit 11.280 USD bewertete Anlage, die zum 30. Juni 2021 in die Ebene 3 eingestuft war. Die Brilliance China Automotive Holdings Ltd wurde am 23. Juni 2021 vom Handel an der Börse Hongkong ausgesetzt, und zum 30. Juni 2021 gibt es keinen aktiven Markt für dieses Wertpapier.

Im Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF gab es eine mit 63.169 USD bewertete Anlage, die zum 30. Juni 2021 in die Ebene 3 eingestuft war. Brilliance China Automotive Holdings Ltd setzte den Handel aus.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

6. Richtlinien und Angaben zum Risikomanagement (Fortsetzung)

f) Zeitwerthierarchie (Fortsetzung)

Nachstehende Tabelle gibt Aufschluss über Veränderungen bezogen auf die Ebene 3 der Zeitwerthierarchie für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021:

	30. Juni 2021
	USD
Franklin FTSE China UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	-
Übertragungen auf Ebene 3	146.252
Am Ende des Geschäftsjahres	146.252

	30. Juni 2021
	USD
Franklin FTSE India UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	689
Realisierter Verlust im Periodenergebnis	(520)
Nicht realisierter Gewinn im Periodenergebnis	165
Verkäufe	(334)
Am Ende des Geschäftsjahres	-

	30. Juni 2021
	USD
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	4.989
Nicht realisierter Verlust im Periodenergebnis	(2.324)
Übertragungen auf Ebene 3	1.120.354
Am Ende des Geschäftsjahres	1.123.019

	30. Juni 2021
	USD
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	-
Übertragungen auf Ebene 3	11.280
Am Ende des Geschäftsjahres	11.280

	30. Juni 2021
	USD
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	-
Übertragungen auf Ebene 3	63.169
Am Ende des Geschäftsjahres	63.169

g) Gesamtrisiko und Hebelwirkung

Das Gesamtrisiko und die Hebelwirkung der Teilfonds werden anhand des Commitment-Ansatzes berechnet und betragen höchstens 100 % des Nettoinventarwerts. Der Commitment-Ansatz rechnet die Positionen der einzelnen Teilfonds in derivativen Finanzinstrumenten („DFI“) in entsprechende Positionen in den Basiswerten um und stellt möglichst sicher, dass das DFI-Risiko hinsichtlich künftiger Verpflichtungen, die für einen Teilfonds entstehen oder entstehen könnten, überwacht wird.

Eine aus dem Einsatz von DFI und Techniken des effizienten Portfoliomanagements entstehende Hebelwirkung muss den Anforderungen der Zentralbank entsprechen und darf 100 % des Nettoinventarwerts des betreffenden Teilfonds nicht überschreiten.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

7. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Zum 30. Juni 2022 werden sämtliche Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente bei der State Street Custodial Services (Ireland) Limited gehalten. Ausgenommen sind nachstehende Bareinschüsse. Das langfristige Kreditrating von State Street Corporation, der ultimativen Muttergesellschaft der Verwahrstelle, betrug zum 30. Juni 2022 A (30. Juni 2021: AA-). Sämtliche Bareinschusssalden wurden bei J.P. Morgan gehalten, deren Kreditrating zum 30. Juni 2022 bei A+ lag (30. Juni 2021: A+).

Die folgenden zum 30. Juni 2022 Dezember und 30. Juni 2021 bei Brokern gehaltenen Bareinschusssalden sind in der verkürzten Bilanz unter Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente erfasst:

Teilfonds	Währung	30. Juni 2022	30. Juni 2021
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	USD	187.207	17.336
Franklin FTSE China UCITS ETF	USD	218.505	68.608
Franklin FTSE India UCITS ETF	USD	-	-
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	USD	89.394	78.844
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*	USD	-	-
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	EUR	105.974	-
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	EUR	910.641	65.235
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	USD	-	-
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	USD	3.500	-
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	USD	15.985	13.850
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	EUR	12.046	3.015
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	EUR	2.163	41
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	USD	21	21
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	USD	6.833	2.210
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	USD	16.266	12.901
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	EUR	1.468	-
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	USD	57.803	-
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF**	USD	-	-
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF***	USD	-	-

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

8. Sonstige Forderungen

	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 Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Zum 30. Juni 2022							
Dividendenforderungen	422.721	1.477.686	304.233	765.609	23.919	-	-
Zinsforderungen	-	-	-	-	-	362.874	2.616.922
Sonstige Forderungen	611	-	15.155	-	-	-	-
Forderungen für ausgegebene Aktien	-	1.053	-	-	-	2.694.437	750.202
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe	-	35.710	486.197	-	4.792	-	-
	423.332	1.514.449	805.585	765.609	28.711	3.057.311	3.367.124
	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD
Zum 30. Juni 2022							
Dividendenforderungen	-	65.803	396.211	194.780	23.300	94.734	76.925
Zinsforderungen	113.923	-	-	-	-	-	-
Sonstige Forderungen	-	-	2.610	-	-	-	65
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe	-	20.123	108.148	-	15.580	-	-
	113.923	85.926	506.969	194.780	38.880	94.734	76.990
	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF** USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*** USD		
Zum 30. Juni 2022							
Dividendenforderungen	112.209	19.748	76.174	12.403	-		
Zinsforderungen	-	-	-	-	407.567		
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe	-	9	13.301.033	136	-		
	112.209	19.757	13.377.207	12.539	407.567		

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

8. Sonstige Forderungen (Fortsetzung)

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Zum 30. Juni 2021							
Dividendenforderungen	162.432	784.786	83.551	899.201	-	-	-
Zinsforderungen	-	-	13	-	418.897	234.792	136.739
Sonstige Forderungen	1.411	-	300	791	-	-	-
Forderungen für ausgegebene Aktien	-	-	-	-	-	1.752.965	-
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe	-	9.881	-	-	-	321.146	-
	163.843	794.667	83.864	899.992	418.897	2.308.903	136.739

	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD
Zum 30. Juni 2021							
Dividendenforderungen	41.124	287.894	196.913	22.658	112.395	40.390	96.145
Sonstige Forderungen	-	963	-	-	-	-	294
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe	509	3.565	2.552.313	-	-	-	-
	41.633	292.422	2.749.226	22.658	112.395	40.390	96.439

	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF* EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
Zum 30. Juni 2021		
Dividendenforderungen	7.251	17.873
Forderungen für ausgegebene Aktien	-	3.419.976
Noch abzurechnende Wertpapierverkäufe	-	8.031.951
	7.251	11.469.800

*Die Teilfonds wurden am 29. Juli 2020 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

9. Sonstige Verbindlichkeiten

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* USD	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR
Zum 30. Juni 2022							
Zahlbare Kapitalertragsteuer	(81)	-	(392.333)	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren.....	(4.842)	(35.687)	(18.842)	(25.258)	(351)	(18.580)	(26.670)
Noch nicht abgerechnete Käufe	(48.122)	(26.996)	(486.197)	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten	-	(950)	-	-	-	-	-
	(53.045)	(63.633)	(897.372)	(25.258)	(351)	(18.580)	(26.670)

	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD
Zum 30. Juni 2022							
Zahlbare Kapitalertragsteuer	-	(20.885)	(95.756)	-	-	(187)	(892)
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren.....	(3.801)	(1.741)	(12.207)	(6.370)	(1.235)	(15.438)	(8.532)
Noch nicht abgerechnete Käufe	-	(15.084)	(162.280)	-	(17.631)	-	(5.835)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	(490)	-	-	(830)	-
	(3.801)	(37.710)	(270.733)	(6.370)	(18.866)	(16.455)	(15.259)

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2022	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF USD	Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF** USD	Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*** USD
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren.....	(19.803)	(2.082)	(6.461)	(242)	(1.152)
Noch nicht abgerechnete Käufe	-	-	(13.734.414)	-	(8.461.003)
	(19.803)	(2.082)	(13.740.875)	(242)	(8.462.155)

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Franklin FTSE Brazil UCITS ETF USD	Franklin FTSE China UCITS ETF USD	Franklin FTSE India UCITS ETF USD	Franklin FTSE Korea UCITS ETF USD	Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF EUR	Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF EUR	Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF USD
Zum 30. Juni 2021							
Zahlbare Kapitalertragsteuer	(334.948)	-	(1.328.766)	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren.....	(3.624)	(29.192)	(11.022)	(47.342)	(26.087)	(6.818)	(4.670)
Noch nicht abgerechnete Käufe	-	-	-	-	-	(1.718.823)	-
	(338.572)	(29.192)	(1.339.788)	(47.342)	(26.087)	(1.725.641)	(4.670)

	Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF EUR	Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF USD	Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF USD
Zum 30. Juni 2021							
Zahlbare Kapitalertragsteuer	(27.722)	(131.437)	-	-	-	(5.652)	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren.....	(1.951)	(14.918)	(6.239)	(1.953)	(14.149)	(7.352)	(21.391)
Noch nicht abgerechnete Käufe	(261)	-	-	-	-	-	(84.860)
Sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	(830)	-	-
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen	-	-	(2.563.990)	-	-	-	-
	(29.934)	(146.355)	(2.570.229)	(1.953)	(14.979)	(13.004)	(106.251)

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

9. Sonstige Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021	Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF* EUR	Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF* USD
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren.....	(1.123)	(2.391)
Noch nicht abgerechnete Käufe	-	(11.431.943)
	(1.123)	(11.434.334)

*Die Teilfonds wurden am 29. Juli 2020 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

10. Angaben zu nahe stehenden Unternehmen und Personen

Die auf Seite 2 aufgeführten Verwaltungsratsmitglieder, die Anlageverwalter, Franklin Advisers, Inc., Franklin Templeton Investment Management Limited, Franklin Templeton Institutional, LLC und Franklin Advisory Services LLC, die Verwaltungsgesellschaft, Franklin Templeton International Services S.à r.l., der Vertreter in der Schweiz, Franklin Templeton Switzerland Limited und die Informationsstelle in Deutschland, Franklin Templeton International Services S.à r.l., Niederlassung Deutschland, gelten als nahe stehende Personen im Sinne der Rechnungslegungsstandards, denen die ICAV unterliegt.

Vom Anlageverwalter im Geschäftsjahr vereinnahmte und zahlbare Beträge am Ende des Geschäftsjahres zum 30. Juni 2022 sind in der TER für die einzelnen Teilfonds enthalten und in Erläuterung 5 angegeben. Im Geschäftsjahr fielen bei der ICAV Gebühren von insgesamt 2.288.232 EUR an (30. Juni 2021: 1.562.847 EUR). Zum Ende des Geschäftsjahres waren Gebühren in Höhe von 202.583 EUR (30. Juni 2021: 175.313 EUR) noch nicht bezahlt und in den sonstigen Verbindlichkeiten enthalten.

Geschäfte mit Führungskräften in Schlüsselpositionen

Die Beteiligungen von Verwaltungsratsmitgliedern an nahe stehenden Unternehmen oder Personen stellen sich wie folgt dar:

William Jackson ist Chief Administration Officer for Technology & Operations bei Franklin Templeton. Außerdem ist er Verwaltungsratsmitglied bei mehreren Franklin-Templeton-Unternehmen, unter anderem bei der Verwaltungsgesellschaft, sowie bei im Vereinigten Königreich und in Luxemburg ansässigen Fondsgesellschaften. Er ist britischer Staatsbürger.

Gregory E. McGowan war von 1986 bis zu seinem Ausscheiden 2016 bei Franklin Templeton tätig und bekleidete mehrere leitende Posten, unter anderem als Executive Vice President, Director und General Counsel von Templeton International Inc. und Templeton Worldwide Inc. Er ist US-amerikanischer Staatsbürger.

Patrick O'Connor ist Head of Global Exchange Traded Funds bei Franklin Templeton Investments. Er ist US-amerikanischer Staatsbürger.

Caroline Baron ist Head of Exchange Traded Fund Sales - EMEA. Sie unterstützt die Markteinführung von Franklin Templetons Global Exchange Traded Funds in ganz Europa und bewirbt die Franklin LibertyShares ICAV-Palette in der Region. Sie ist französische Staatsbürgerin.

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 war abgesehen von den vorstehenden Angaben kein Verwaltungsratsmitglied beziehungsweise keine verbundene Person eines Verwaltungsratsmitglieds als wirtschaftlicher Eigentümer oder anderweitig am Anteilskapital der ICAV oder maßgeblich an der ICAV selbst oder an einem Vertrag oder einer Vereinbarung mit der ICAV beteiligt.

Einzelheiten zu den gezahlten Verwaltungsrats honoraren sind Seite 83 zu entnehmen.

Alle vorstehend genannten Geschäfte mit nahe stehenden Parteien hielten dem Fremdvergleichsgrundsatz stand und erfolgten im normalen Geschäftsgang.

Bedeutende Anteilinhaber

Den folgenden Tabellen sind die Zahl der Anteilinhaber mit wesentlichen Anteilbeständen (von mindestens 20 %) der einzelnen Teilfonds sowie der prozentuale Anteil des betreffenden Bestands zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 zu entnehmen. Die bedeutenden Anteilinhaber sind die autorisierten Teilnehmer, die zum Bilanzstichtag 100 % der Teilfonds im Register der Primäranteile halten, von denen die Mehrzahl auf dem Sekundärmarkt weiterverkauft wird. Das wirtschaftliche Eigentum dieser Anteile wird dann von den autorisierten Teilnehmern über den Handel der Anteil auf dem Sekundärmarkt weitergegeben.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

10. Angaben zu nahe stehenden Unternehmen und Personen (Fortsetzung)

Wesentliche Anteilinhaber (Fortsetzung)

Teilfonds	Anzahl der bedeutenden Anteilinhaber	Gesamtbestand zum 30. Juni 2022	Gesamtbestand in % des Teilfonds zum 30. Juni 2022
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	3	1.200.000	85,71
Franklin FTSE China UCITS ETF	2	6.200.000	68,89
Franklin FTSE India UCITS ETF	3	3.200.000	79,01
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	3	9.300.000	91,18
Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF**	1	100.000	100,00
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	1	2.800.000	74,87
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	2	25.090.000	93,20
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	2	500.000	90,91
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	1	250.000	100,00
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	2	1.600.000	114,29
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	2	950.000	76,00
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	2	300.000	150,00
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	3	1.500.000	107,14
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	2	1.400.000	175,00
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	2	2.250.000	100,00
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	1	500.000	100,00
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	3	3.700.000	100,00
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF**	1	100.000	100,00
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF***	1	1.200.000	100,00

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

** Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

*** Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

Teilfonds	Anzahl der bedeutenden Anteilinhaber	Gesamtbestand zum 30. Juni 2021	Gesamtbestand in % des Teilfonds zum 30. Juni 2021
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	2	700.000	77,78
Franklin FTSE China UCITS ETF	1	3.200.000	64,00
Franklin FTSE India UCITS ETF	2	1.400.000	62,22
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	2	10.900.000	73,15
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	1	3.340.000	82,27
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	3	2.430.000	101,67
Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	3	650.000	108,33
Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF	1	250.000	100,00
Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF	2	1.600.000	114,29
Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	2	800.000	88,89
Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF	2	300.000	100,00
Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	2	1.200.000	100,00
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	2	1.200.000	200,00
Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF	2	2.400.000	100,00
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	1	300.000	100,00
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF*	1	1.250.000	92,59

* Die Teilfonds wurden am 29. Juli 2020 aufgelegt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

11. Effizientes Portfoliomanagement

Die ICAV kann im Auftrag der einzelnen Teilfonds zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements – also zur Minderung von Risiken, unter anderem dem Risiko eines Tracking Error (Nachbildungsfehler) zwischen der Wertentwicklung eines Teilfonds und der Wertentwicklung des vom betreffenden passiven Teilfonds nachgebildeten Index, zur Verringerung der Kosten der Teilfonds, zur Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Teilfonds sowie zur Absicherung gegen Marktbewegungen, Währungs- oder Zinsrisiken – unter Berücksichtigung des Risikoprofils der einzelnen Teilfonds und der allgemeinen Bestimmungen der OGAW-Vorschriften Techniken und Instrumente wie derivative Finanzinstrumente, Pensions-/umgekehrte Pensionsgeschäfte und Aktienleihgeschäfte einsetzen. Solche Transaktionen können Devisengeschäfte umfassen, welche die Währungsmerkmale der von den einzelnen Teilfonds gehaltenen Wertpapiere verändern. In den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 erfolgten keine Wertpapierleihgeschäfte.

12. Ausschüttungen

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 wurden von den Teilfonds die folgenden Ausschüttungen festgesetzt:

Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Wert USD	Pro Anteil USD	Ex-Tag
Anteile USD Distributing	176.580	0,29	10. Dez. 2021
Anteile USD Distributing	168.465	0,31	10. Juni 2022
Insgesamt	345.045		

Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	Wert EUR	Pro Anteil EUR	Ex-Tag
Anteile EUR Distributing	196.420	0,28	10. Sept. 2021
Anteile EUR Distributing	218.610	0,24	10. Dez. 2021
Anteile EUR Distributing	129.700	0,13	10. Mrz. 2022
Anteile EUR Distributing	912.000	0,76	10. Juni 2022
Insgesamt	1.456.730		

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	Wert USD	Pro Anteil USD	Ex-Tag
Anteile USD Distributing	205.080	0,17	10. Sept. 2021
Anteile USD Distributing	209.640	0,17	10. Dez. 2021
Anteile USD Distributing	351.120	0,13	10. Mrz. 2022
Anteile USD Distributing	536.760	0,38	10. Juni 2022
Insgesamt	1.302.600		

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

12. Ausschüttungen (Fortsetzung)

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 wurden von den Teilfonds die folgenden Ausschüttungen festgesetzt:

Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF	Wert USD	Pro Anteil USD	Ex-Tag
Anteile USD Distributing	206.437	0,32	11. Dez. 2020
Anteile USD Distributing	172.978	0,31	11. Juni 2021
Insgesamt	379.415		

Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF	Wert EUR	Pro Anteil EUR	Ex-Tag
			11. Sept. 2020
Anteile EUR Distributing	93.800	0,19	
Anteile EUR Distributing	164.790	0,18	11. Dez. 2020
Anteile EUR Distributing	209.300	0,15	11. Mrz. 2021
Anteile EUR Distributing	703.170	0,54	11. Juni 2021
Insgesamt	1.171.060		

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF	Wert USD	Pro Anteil USD	Ex-Tag
			11. Sept. 2020
Anteile USD Distributing	109.120	0,14	
Anteile USD Distributing	159.900	0,16	11. Dez. 2020
Anteile USD Distributing	146.400	0,12	11. Mrz. 2021
Anteile USD Distributing	383.160	0,32	11. Juni 2021
Insgesamt	798.580		

13. Soft Commissions und Directed-Brokerage-Dienste

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 und im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 traf der Anlageverwalter für die Teilfonds keine Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions) oder Directed-Brokerage-Dienste.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

14. Wechselkurse

Zum 30. Juni 2022 galten die folgenden Wechselkurse:

1 USD =	Währung	Wechselkurs	1 EUR =	Währung	Wechselkurs
	AED	3,6731		CHF	1,0009
	AUD	1,4542		DKK	7,4367
	BRL	5,2295		GBP	0,8608
	CAD	1,2900		NOK	10,3288
	CHF	0,9574		PLN	4,7002
	CLP	936,8650		SEK	10,7131
	CNH	6,7042		USD	1,0454
	CNY	6,6943			
	COP	4.161,1000			
	CZK	23,6602			
	DKK	7,1134			
	EGP	18,8000			
	EUR	0,9565			
	GBP	0,8234			
	HKD	7,8470			
	HUF	379,5400			
	IDR	14.897,5000			
	ILS	3,5022			
	INR	78,9725			
	JPY	135,8550			
	KRW	1.298,4000			
	KWD	0,3069			
	MXN	20,1758			
	MYR	4,4075			
	NOK	9,8798			
	NZD	1,6084			
	PHP	54,9850			
	PLN	4,4959			
	QAR	3,6418			
	RUB	54,7500			
	SAR	3,7521			
	SEK	10,2474			
	SGD	1,3917			
	THB	35,3550			
	TRY	16,6965			
	TWD	29,7335			
	ZAR	16,3825			

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

14. Wechselkurse (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021 galten die folgenden Wechselkurse:

1 USD =	Währung	Wechselkurs	1 EUR =	Währung	Wechselkurs
	AED	3,6732		CHF	1,0962
	AUD	1,3320		DKK	7,4362
	BRL	4,9568		GBP	0,8584
	CAD	1,2383		NOK	10,2049
	CHF	0,9244		PLN	4,5147
	CLP	728,1100		SEK	10,1420
	CNY	6,4615		USD	1,1859
	CZK	21,5086			
	DKK	6,2706			
	EGP	15,6950			
	EUR	0,8432			
	GBP	0,7239			
	HKD	7,7659			
	HUF	296,0031			
	IDR	14.500,0000			
	ILS	3,2585			
	INR	74,3300			
	JPY	110,9900			
	KRW	1.126,1500			
	KWD	0,3013			
	MXN	19,9105			
	MYR	4,1515			
	NOK	8,6052			
	NZD	1,4311			
	PHP	48,8150			
	PKR	157,6000			
	PLN	3,8070			
	QAR	3,6410			
	RUB	73,0538			
	SAR	3,7504			
	SEK	8,5522			
	SGD	1,3442			
	THB	32,0500			
	TRY	8,6875			
	TWD	27,8625			

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

15. Wesentliche Ereignisse im Geschäftsjahr

COVID-19-Pandemie

Zum Zeitpunkt der Genehmigung dieses Jahresabschlusses wird die anhaltende COVID-19-Pandemie voraussichtlich keine wesentlichen Auswirkungen auf die Zukunft des Teilfonds haben.

Änderungen der TER

Die Gesamtkostenquote (TER) änderte sich mit Wirkung vom 1. Juli 2021 für den Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF von 0,15 % auf 0,05 %.

Prospektaktualisierungen

Der Prospekt wurde am 3. Dezember 2021 aktualisiert.

Für die folgenden vier Teilfonds wurde die Anlagepolitik aktualisiert, um der ESG-Doktrin „Zentraler Kommunikationsansatz“ der AMF im Rahmen unserer Registrierung von OGAW-ETF in Frankreich Rechnung zu tragen:

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Länderregistrierung und Notierung an der Euronext Amsterdam:

Nach dem zur Kenntnis genommenen Prospekt und den Prospektnachträgen wurden alle 17 Teilfonds in Frankreich und den Niederlanden registriert. Im Zusammenhang mit diesen Registrierungen wurden 8 der 17 Teilfonds am 15. September 2021 an der Euronext Amsterdam zugelassen. Einzelheiten zu den 8 Teilfonds sind nachstehend aufgeführt:

Teilfonds	ISIN	Handels- währung	Bloomberg Ticker – Euronext Amsterdam - EUR	Reuters RIC – Euronext Amsterdam - EUR	SEDOL - Euronext Amsterdam - EUR	Euronext Amsterdam Stock Exchange Ticker - EUR
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	IE00BF2B0N83	EUR	FLXG NA	FLXG1.AS	BKY8CQ9	FLXG
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	IE00BHZZRR253	EUR	FLRG NA	FLR1.AS	BKY8CR0	FLRG
Franklin FTSE Brazil UCITS ETF	IE00BHZRQY00	EUR	FLXB NA	FLX3.AS	BKY8CS1	FLXB
Franklin FTSE China UCITS ETF	IE00BHZRRL147	EUR	FLXC NA	FLX4.AS	BKY8CT2	FLXC
Franklin FTSE India UCITS ETF	IE00BHZRQZ17	EUR	FLXI NA	FLXIG.AS	BKY8CV4	FLXI
Franklin FTSE Korea UCITS ETF	IE00BHZRR030	EUR	FLXK NA	FLXK.AS	BKY8CW5	FLXK
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	IE00BMDPBZ72	EUR	USPA NA	FLX5.AS	BKY8CX6	USPA
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	IE00BMDPBY65	EUR	PARI NA	FLXP.AS	BKY8CY7	PARI

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

15. Wesentliche Ereignisse im Geschäftsjahr (Fortsetzung)

Militärischer Konflikt zwischen Russland und der Ukraine

Am 24. Februar 2022 startete Russland eine militärische Operation im Hoheitsgebiet der Ukraine. Die derzeitige politische und finanzielle Unsicherheit im Zusammenhang mit Russland und der Ukraine kann die Marktvolatilität und das wirtschaftliche Risiko einer Anlage in Wertpapieren in diesen und anderen betroffenen Ländern in der Region erhöhen. Gegebenenfalls betroffene Wertpapiere sind in der Vermögensaufstellung des jeweiligen Fonds aufgeführt. Aufgrund der Sanktionen, der Maßnahmen der Regierungen, der Entwicklungen in der Ukraine selbst und anderer Umstände wird die Verwaltungsgesellschaft weiterhin die Auswirkungen auf die Bewertung prüfen und gegebenenfalls Maßnahmen ergreifen, da sich die Fakten und Umstände ändern können.

Im Geschäftsjahr gab es keine weiteren wesentlichen Ereignisse, die eine Offenlegung im Abschluss der ICAV erfordern.

16. Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

Es gab keine wesentlichen Ereignisse nach dem Ende des Geschäftsjahres, die eine Offenlegung im Abschluss der ICAV erfordern würden.

17. Genehmigung des Abschlusses

Der Abschluss wurde am 14. Oktober 2022 vom Verwaltungsrat genehmigt.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 97,49 % (30. Juni 2021: 100,74 %)		
	Aktien: 97,49 % (30. Juni 2021: 100,74 %)		
	Brasilien: 97,49 % (30. Juni 2021: 100,74 %)		
16.800	Alpargatas SA	61.489	0,23
16.800	Ambev SA	43.049	0,16
302.946	Ambev SA ADR	760.394	2,79
48.900	Americanas SA	125.582	0,46
5.600	Armac Locacao Logistica E Servicos SA	13.000	0,05
19.600	Atacadao SA	62.479	0,23
26.600	Auren Energia SA	69.279	0,25
21.000	Azul SA	49.715	0,18
445.200	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	933.060	3,42
110.600	Banco Bradesco SA	304.129	1,11
25.200	Banco Bradesco SA (preferred stock)	82.884	0,30
356.454	Banco Bradesco SA ADR	1.162.040	4,26
85.400	Banco BTG Pactual SA	364.335	1,34
63.000	Banco do Brasil SA	402.134	1,47
28.000	Banco Pan SA	32.715	0,12
26.600	Banco Santander Brasil SA	146.544	0,54
49.000	BB Seguridade Participacoes SA	243.245	0,89
61.600	BR Malls Participacoes SA	88.581	0,32
2.800	Bradespar SA	12.208	0,04
18.200	Bradespar SA (preferred stock)	87.843	0,32
14.000	Braskem SA	99.697	0,37
58.800	BRF SA	152.806	0,56
32.200	Caixa Seguridade Participacoes S/A	42.671	0,16
81.200	CCR SA	194.559	0,71
91.000	Centrais Eletricas Brasileiras SA	803.947	2,95
21.000	Centrais Eletricas Brasileiras SA (preferred stock)	187.534	0,69
11.200	Cia Brasileira de Distribuicao	34.996	0,13
25.200	Cia de Locacao das Americas	114.255	0,42
25.200	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	203.211	0,74
14.000	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista	61.494	0,23
23.751	Cia Energetica de Minas Gerais	68.853	0,25
93.800	Cia Energetica de Minas Gerais (preferred stock)	186.185	0,68
23.800	Cia Paranaense de Energia	28.991	0,11
96.600	Cia Paranaense de Energia (preferred stock)	126.166	0,46
47.600	Cia Siderurgica Nacional SA	140.539	0,52
82.600	Cielo SA	59.232	0,22
88.200	Cosan SA	306.962	1,13
14.000	CPFL Energia SA	82.670	0,30
39.200	CSN Mineracao SA	28.935	0,11
19.600	Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	44.301	0,16
22.400	Dexco SA	42.277	0,15
18.200	EDP - Energias do Brasil SA	71.381	0,26
53.200	Embraer SA	116.381	0,43
18.200	Energisa SA	140.430	0,51
88.200	Eneva SA	249.111	0,91
12.600	Engie Brasil Energia SA	99.510	0,36
67.200	Equatorial Energia SA	293.501	1,08
78.400	Gerdau SA	335.072	1,23
30.800	GPS Participacoes e Empreendimentos SA	62.137	0,23
25.200	Grendene SA	33.877	0,12
32.200	GRUPO DE MODA SOMA SA	56.648	0,21
29.400	Grupo Mateus SA	19.002	0,07
295.400	Hapvida Participacoes e Investimentos SA	308.988	1,13
29.400	Hypera SA	213.861	0,78
33.600	Itau Unibanco Holding SA	125.483	0,46

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 97,49 % (30. Juni 2021: 100,74 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 97,49 % (30. Juni 2021: 100,74 %) (Fortsetzung)		
	Brasilien: 97,49 % (30. Juni 2021: 100,74 %) (Fortsetzung)		
26.600	Itau Unibanco Holding SA (preferred stock)	115.313	0,42
327.250	Itau Unibanco Holding SA ADR	1.400.630	5,13
350.000	Itausa SA	558.185	2,05
29.400	JBS SA	177.599	0,65
35.448	JBS SA ADR	428.921	1,57
57.400	Klabin SA	221.721	0,81
43.400	Localiza Rent a Car SA	434.959	1,59
30.800	Locaweb Servicos de Internet SA	33.100	0,12
71.400	Lojas Renner SA	308.841	1,13
9.800	M Dias Branco SA	48.911	0,18
221.200	Magazine Luiza SA	98.979	0,36
25.200	Marfrig Global Foods SA	58.356	0,21
51.800	Metalurgica Gerdau SA	94.597	0,35
19.600	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	82.269	0,30
70.000	Natura & Co Holding SA	179.636	0,66
16.800	Neoenergia SA	47.932	0,18
21.600	Odontoprev SA	38.620	0,14
49.000	Petro Rio SA	206.047	0,76
29.400	Petroleo Brasileiro SA	171.696	0,63
30.800	Petroleo Brasileiro SA (preferred stock)	164.500	0,60
121.142	Petroleo Brasileiro SA ADR	1.414.939	5,19
190.162	Petroleo Brasileiro SA ADR (preferred stock)	2.021.422	7,42
12.600	Porto Seguro SA	42.792	0,16
78.400	Raia Drogasil SA	287.847	1,06
88.200	Raizen SA	77.415	0,28
33.600	Rede D'Or Sao Luiz SA	186.201	0,68
92.400	Rumo SA	282.177	1,03
11.200	Sao Martinho SA	77.809	0,29
58.800	Sendas Distribuidora SA	160.452	0,59
21.000	SIMPAR SA	37.266	0,14
8.400	Smartfit Escola de Ginastica e Danca SA	16.207	0,06
29.400	Sul America SA	124.246	0,46
53.200	Suzano SA	505.504	1,85
2.800	Telefonica Brasil SA	25.197	0,09
29.470	Telefonica Brasil SA ADR	266.998	0,98
58.800	TIM SA	143.474	0,53
32.200	TOTVS SA	143.222	0,52
15.400	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	113.731	0,42
58.800	Ultrapar Participacoes SA	138.414	0,51
3.600	Unipar Carbocloro SA	62.714	0,23
12.600	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas	19.781	0,07
33.600	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas (preferred stock)	55.578	0,20
28.000	Vale SA	409.925	1,50
272.454	Vale SA ADR	3.986.001	14,62
14.000	Vamos Locacao de Caminhoes Maquinas e Equipamentos SA	31.349	0,11
113.400	Via S/A	41.635	0,15
82.600	Vibra Energia SA	263.937	0,97
109.200	WEG SA	552.322	2,02
22.400	YDUQS Participacoes	55.984	0,21
		<u>26.595.719</u>	<u>97,49</u>
	Aktien insgesamt	<u>26.595.719</u>	<u>97,49</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>26.595.719</u>	<u>97,49</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,21) % (30. Juni 2021: (0,01) %)

Terminkontrakte (Futures): (0,21) % (30. Juni 2021: (0,01) %)*

Nominal- betrag USD	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermö- gens
762.238	20.602	185 of Mini Bovespa Long Futures Contracts Expiring August 2022	(56.096)	(0,21)
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	(56.096)	(0,21)
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	(56.096)	(0,21)
			Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
		Anlageportfolio	26.539.623	97,28
		Sonstiges Nettovermögen	743.363	2,72
		Nettovermögen	27.282.986	100,00
				% des Gesamt- vermö- gens
		Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		97,09
		Sonstiges Umlaufvermögen		2,91
		Gesamtvermögen		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 187.207 USD.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin FTSE China UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %)		
	Bermuda: 1,04 % (30. Juni 2021: 1,40 %)		
450.000	Alibaba Health Information Technology Ltd	309.674	0,13
1.350.000	Alibaba Pictures Group Ltd	132.472	0,05
450.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd	135.913	0,06
306.000	China Gas Holdings Ltd	472.632	0,20
93.000	China Resources Gas Group Ltd	433.181	0,18
180.000	COSCO SHIPPING Ports Ltd	127.081	0,05
1.440.000	GOME Retail Holdings Ltd	69.734	0,03
220.000	HengTen Networks Group Ltd	80.745	0,03
74.250	Hopson Development Holdings Ltd	113.358	0,05
360.000	Kunlun Energy Co Ltd	294.994	0,12
202.500	Luye Pharma Group Ltd	66.580	0,03
180.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	152.314	0,06
112.500	Shenzhen International Holdings Ltd	110.680	0,05
		2.499.358	1,04
	Kaimaninseln: 52,80 % (30. Juni 2021: 59,85 %)		
12.285	360 DigiTech Inc ADR	212.531	0,09
135.000	3SBio Inc	107.354	0,04
180.000	Agile Group Holdings Ltd	72.028	0,03
45.000	Akeso Inc	132.185	0,05
1.534.500	Alibaba Group Holding Ltd	21.882.459	9,07
1.800	Angelalign Technology Inc	36.060	0,01
117.000	ANTA Sports Products Ltd	1.437.348	0,60
6.480	Autohome Inc ADR	254.858	0,11
227.250	Baidu Inc	4.300.604	1,78
67.500	BeiGene Ltd	847.304	0,35
26.100	Bilibili Inc	668.553	0,28
90.000	Blue Moon Group Holdings Ltd	76.845	0,03
270.000	Bosideng International Holdings Ltd	167.568	0,07
135.000	China Conch Environment Protection Holdings Ltd	93.935	0,04
157.500	China Conch Venture Holdings Ltd	343.223	0,14
45.000	China East Education Holdings Ltd	23.856	0,01
336.000	China Evergrande Group	35.326	0,01
405.000	China Feihe Ltd	465.544	0,19
226.000	China Hongqiao Group Ltd	255.465	0,11
90.000	China Lesso Group Holdings Ltd	135.798	0,06
45.400	China Literature Ltd	219.278	0,09
135.000	China Medical System Holdings Ltd	210.579	0,09
44.000	China Meidong Auto Holdings Ltd	138.500	0,06
315.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	1.571.598	0,65
270.000	China Resources Cement Holdings Ltd	181.332	0,08
270.000	China Resources Land Ltd	1.259.343	0,52
6.751	China Resources Microelectronics Ltd	59.482	0,02
63.000	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	312.312	0,13
180.000	China State Construction International Holdings Ltd	199.109	0,08
374.080	CIFI Holdings Group Co Ltd	187.828	0,08
810.000	Country Garden Holdings Co Ltd	501.673	0,21
180.000	Country Garden Services Holdings Co Ltd	801.713	0,33
6.975	Dada Nexus Ltd ADR	56.567	0,02
202.500	Dali Foods Group Co Ltd	107.612	0,04
76.500	ENN Energy Holdings Ltd	1.256.647	0,52
480.000	Evergrande Property Services Group Ltd	70.346	0,03
61.830	Full Truck Alliance Co Ltd ADR	560.180	0,23
90.000	GDS Holdings Ltd	379.064	0,16
540.000	Geely Automobile Holdings Ltd	1.227.687	0,51
90.000	Genscript Biotech Corp	326.305	0,14

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Kaimaninseln: 52,80 % (30. Juni 2021: 59,85 %) (Fortsetzung)		
90.000	Greentown China Holdings Ltd	186.493	0,08
90.000	Haidilao International Holding Ltd	209.890	0,09
58.000	Haitian International Holdings Ltd	148.198	0,06
94.200	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	190.154	0,08
12.825	Hello Group Inc ADR	64.766	0,03
67.500	Hengan International Group Co Ltd	316.986	0,13
30.400	Huaxin Cement Co Ltd	43.932	0,02
22.005	Huazhu Group Ltd ADR	838.391	0,35
36.000	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	239.252	0,10
5.580	I-Mab ADR	63.054	0,03
135.000	Innovent Biologics Inc	600.424	0,25
32.805	iQIYI Inc ADR	137.781	0,06
74.250	JD Health International Inc	582.403	0,24
180.000	JD Logistics Inc	392.713	0,16
240.750	JD.com Inc	7.756.084	3,22
90.000	Jiayuan International Group Ltd	4.989	0,00
157.500	Jinxin Fertility Group Ltd	145.117	0,06
45.000	Jiumaojiu International Holdings Ltd	119.569	0,05
4.860	JOYY Inc ADR	145.120	0,06
13.635	Kanzhun Ltd ADR	358.328	0,15
62.235	KE Holdings Inc ADR	1.117.118	0,46
67.500	Kingboard Holdings Ltd	255.481	0,11
112.500	Kingboard Laminates Holdings Ltd	138.780	0,06
272.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	637.802	0,26
9.585	Kingsoft Cloud Holdings Ltd ADR	42.653	0,02
90.400	Kingsoft Corp Ltd	352.524	0,15
198.000	Kuaishou Technology	2.205.341	0,91
135.000	KWG Group Holdings Ltd	43.010	0,02
53.280	Li Auto Inc ADR	2.041.157	0,85
225.000	Li Ning Co Ltd	2.084.568	0,86
132.000	Logan Group Co Ltd	36.672	0,02
180.000	Longfor Group Holdings Ltd	849.884	0,35
70.380	Lufax Holding Ltd ADR	422.280	0,18
418.500	Meituan	10.357.234	4,29
45.000	Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd	72.028	0,03
7.605	MINISO Group Holding Ltd ADR	59.699	0,02
153.000	NetEase Inc	2.809.665	1,17
13.725	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	279.441	0,12
134.955	NIO Inc ADR	2.931.223	1,22
38.160	Pinduoduo Inc ADR	2.358.288	0,98
40.500	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	119.999	0,05
72.000	Pop Mart International Group Ltd	347.753	0,14
76.877	RLX Technology Inc ADR	163.748	0,07
186.285	Seazen Group Ltd	92.110	0,04
76.500	Shenzhou International Group Holdings Ltd	926.643	0,38
168.000	Shimao Group Holdings Ltd	47.103	0,02
87.000	Shimao Services Holdings Ltd	41.909	0,02
990.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	627.033	0,26
180.000	Smooere International Holdings Ltd	555.120	0,23
336.000	Sunac China Holdings Ltd	96.576	0,04
90.000	Sunac Services Holdings Ltd	54.709	0,02
67.500	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	1.100.205	0,46
46.935	TAL Education Group ADR	228.573	0,09
612.000	Tencent Holdings Ltd	27.640.395	11,45
63.675	Tencent Music Entertainment Group ADR	319.649	0,13
90.000	Tongcheng-Elong Holdings Ltd	193.604	0,08
180.000	Topsports International Holdings Ltd	163.554	0,07
55.170	Trip.com Group Ltd ADR	1.514.417	0,63

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Kaimaninseln: 52,80 % (30. Juni 2021: 59,85 %) (Fortsetzung)		
17.280	Tuya Inc ADR	45.274	0,02
42.345	Vipshop Holdings Ltd ADR	418.792	0,17
7.425	Weibo Corp ADR	171.740	0,07
360.000	Wuxi Biologics Cayman Inc	3.294.019	1,37
1.503.000	Xiaomi Corp	2.612.597	1,08
435.681	Xinyi Solar Holdings Ltd	672.931	0,28
53.415	XPeng Inc ADR	1.695.392	0,70
90.000	Yadea Group Holdings Ltd	176.170	0,07
45.000	Yihai International Holding Ltd	162.292	0,07
6.030	Zai Lab Ltd ADR	209.120	0,09
2.295	Zhihu Inc ADR	4.108	0,00
67.500	Zhongsheng Group Holdings Ltd	476.124	0,20
13.500	ZTO Express Cayman Inc	349.588	0,14
		<u>127.335.738</u>	<u>52,80</u>
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %)		
49.500	360 Security Technology Inc	62.907	0,03
13.500	ADAMA Ltd	24.385	0,01
27.000	Addsino Co Ltd	48.086	0,02
4.300	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China	74.882	0,03
18.000	AECC Aviation Power Co Ltd	122.189	0,05
643.500	Agricultural Bank of China Ltd 'A' Shares	289.874	0,12
3.195.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H' Shares	1.205.207	0,49
36.000	Aier Eye Hospital Group Co Ltd	240.405	0,10
40.500	Air China Ltd 'A' Shares	70.136	0,03
180.000	Air China Ltd 'H' Shares	156.443	0,06
56.250	A-Living Smart City Services Co Ltd	90.465	0,04
22.500	Alpha Group	15.740	0,01
90.000	Aluminum Corp of China Ltd 'A' Shares	63.766	0,03
360.000	Aluminum Corp of China Ltd 'H' Shares	136.257	0,06
2.881	Amlogic Shanghai Co Ltd	43.403	0,02
45.000	Angang Steel Co Ltd 'A' Shares	21.613	0,01
180.000	Angang Steel Co Ltd 'H' Shares	67.211	0,03
9.000	Angel Yeast Co Ltd	65.444	0,03
1.254	Anhui Anke Biotechnology Group Co Ltd (Shenzhen Stock Exchange traded) ..	1.891	0,00
13.500	Anhui Anke Biotechnology Group Co Ltd (Shenzhen-Hong Kong Stock Connect traded)	20.358	0,01
27.000	Anhui Conch Cement Co Ltd 'A' Shares	142.084	0,06
112.500	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H' Shares	487.451	0,20
90.000	Anhui Expressway Co Ltd	72.716	0,03
4.500	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'A' Shares	167.577	0,07
13.500	Anhui Gujing Distillery Co Ltd 'B' Shares	210.579	0,09
4.500	Anhui Yingjia Distillery Co Ltd	43.723	0,02
4.500	Anker Innovations Technology Co Ltd	44.515	0,02
9.000	Apeloa Pharmaceutical Co Ltd	27.708	0,01
600	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	25.864	0,01
4.500	Avary Holding Shenzhen Co Ltd	20.278	0,01
27.000	AVIC Electromechanical Systems Co Ltd	49.737	0,02
67.500	AVIC Industry-Finance Holdings Co Ltd	34.836	0,01
13.500	Avic Sunda Holding Co Ltd	36.186	0,02
270.000	AviChina Industry & Technology Co Ltd	154.493	0,06
4.500	AVICOPTER Plc	30.339	0,01
247.500	BAIC Motor Corp Ltd	82.322	0,03
135.000	Bank of Beijing Co Ltd	91.420	0,04
22.500	Bank of Changsha Co Ltd	26.614	0,01
301.500	Bank of China Ltd 'A' Shares	146.608	0,06
7.785.000	Bank of China Ltd 'H' Shares	3.105.290	1,28
265.500	Bank of Communications Co Ltd 'A' Shares	197.218	0,08

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
765.000	Bank of Communications Co Ltd 'H' Shares	528.396	0,22
40.500	Bank of Hangzhou Co Ltd	90.494	0,04
31.500	Bank of Jiangsu Co Ltd	33.454	0,01
81.000	Bank of Nanjing Co Ltd	125.894	0,05
45.000	Bank of Ningbo Co Ltd	240.364	0,10
103.500	Bank of Shanghai Co Ltd	101.119	0,04
39.520	Bank of Suzhou Co Ltd	35.958	0,01
29.244	Bank of Zhengzhou Co Ltd	11.734	0,00
144.000	Baoshan Iron & Steel Co Ltd	129.304	0,05
225.000	BBMG Corp 'H' Shares	32.688	0,01
94.500	BBMG Corp 'A' Shares	39.045	0,02
31.600	Beijing Capital Development Co Ltd	23.143	0,01
67.500	Beijing Capital Eco-Environment Protection Group Co Ltd	29.198	0,01
180.000	Beijing Capital International Airport Co Ltd	122.723	0,05
27.000	Beijing Dabeinong Technology Group Co Ltd	31.453	0,01
4.500	Beijing Easpring Material Technology Co Ltd	60.638	0,03
9.000	Beijing E-Hualu Information Technology Co Ltd	23.358	0,01
27.000	Beijing Enlight Media Co Ltd	38.139	0,02
36.000	Beijing Jetsen Technology Co Ltd	29.534	0,01
180.000	Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd	41.290	0,02
3.225	Beijing Kingsoft Office Software Inc	94.823	0,04
13.500	Beijing New Building Materials Plc	69.713	0,03
13.500	Beijing Orient National Communication Science & Technology Co Ltd	18.566	0,01
36.000	Beijing Originwater Technology Co Ltd	27.976	0,01
396	Beijing Roborock Technology Co Ltd	36.427	0,02
27.000	Beijing Sanju Environmental Protection and New Material Co Ltd	20.378	0,01
15.420	Beijing Shiji Information Technology Co Ltd	36.502	0,02
49.500	Beijing Shougang Co Ltd	35.145	0,01
4.500	Beijing Shunxin Agriculture Co Ltd	18.002	0,01
13.500	Beijing Sinnet Technology Co Ltd	20.982	0,01
13.500	Beijing SL Pharmaceutical Co Ltd	19.553	0,01
9.000	Beijing Tiantan Biological Products Corp Ltd	32.594	0,01
4.500	Beijing United Information Technology Co Ltd	59.470	0,02
18.000	Beijing Yanjing Brewery Co Ltd	25.936	0,01
15.435	Beijing Zhong Ke San Huan High-Tech Co Ltd	43.237	0,02
243.000	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd	181.955	0,08
2.322	Bloomage Biotechnology Corp Ltd	49.244	0,02
18.000	Bluefocus Intelligent Communications Group Co Ltd	17.532	0,01
13.500	Bluestar Adisseo Co	19.291	0,01
9.000	BOC International China Co Ltd	17.854	0,01
243.000	BOE Technology Group Co Ltd 'A' Shares	142.809	0,06
85.500	BOE Technology Group Co Ltd 'B' Shares	43.366	0,02
4.500	Boya Bio-pharmaceutical Group Co Ltd	24.130	0,01
9.000	Bright Dairy & Food Co Ltd	16.955	0,01
9.000	BTG Hotels Group Co Ltd	33.293	0,01
13.500	BYD Co Ltd 'A' Shares	671.537	0,28
85.397	BYD Co Ltd 'H' Shares	3.417.209	1,41
13.500	By-health Co Ltd	43.596	0,02
13.500	C&S Paper Co Ltd	25.211	0,01
34.540	Caitong Securities Co Ltd	40.546	0,02
13.500	Camel Group Co Ltd	22.412	0,01
559	CanSino Biologics Inc 'A' Shares	16.599	0,01
9.000	CanSino Biologics Inc 'H' Shares	92.157	0,04
45.000	CECEP Wind-Power Corp	32.219	0,01
40.500	Central China Securities Co Ltd 'A' Shares	25.191	0,01
135.000	Central China Securities Co Ltd 'H' Shares	22.882	0,01
90.000	CGN Power Co Ltd 'A' Shares	37.588	0,02
1.215.000	CGN Power Co Ltd 'H' Shares	294.191	0,12

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
4.500	Changchun High & New Technology Industry Group Inc	156.676	0,06
36.000	Changjiang Securities Co Ltd	31.843	0,01
13.500	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	60.611	0,03
4.530	Chengdu Kanghong Pharmaceutical Group Co Ltd	10.095	0,00
4.500	Chengxin Lithium Group Co Ltd	40.515	0,02
22.500	China Baoan Group Co Ltd	45.274	0,02
900.000	China Cinda Asset Management Co Ltd	141.074	0,06
67.500	China CITIC Bank Corp Ltd 'A' Shares	47.825	0,02
945.000	China CITIC Bank Corp Ltd 'H' Shares	422.706	0,18
31.500	China Coal Energy Co Ltd 'A' Shares	48.771	0,02
225.000	China Coal Energy Co Ltd 'H' Shares	190.679	0,08
270.000	China Communications Services Corp Ltd	118.709	0,05
63.000	China Construction Bank Corp 'A' Shares	56.946	0,02
9.540.000	China Construction Bank Corp 'H' Shares	6.407.051	2,66
27.000	China CSSC Holdings Ltd	76.439	0,03
94.500	China Eastern Airlines Corp Ltd 'A' Shares	77.385	0,03
180.000	China Eastern Airlines Corp Ltd 'H' Shares	69.046	0,03
333.000	China Energy Engineering Corp Ltd	117.719	0,05
292.500	China Everbright Bank Co Ltd 'A' Shares	131.324	0,05
315.000	China Everbright Bank Co Ltd 'H' Shares	101.963	0,04
13.500	China Galaxy Securities Co Ltd 'A' Shares	19.472	0,01
382.500	China Galaxy Securities Co Ltd 'H' Shares	220.815	0,09
22.500	China Great Wall Securities Co Ltd	34.098	0,01
22.500	China Greatwall Technology Group Co Ltd	36.313	0,02
9.000	China International Capital Corp Ltd 'A' Shares	59.725	0,02
144.000	China International Capital Corp Ltd 'H' Shares	306.830	0,13
13.500	China International Marine Containers Group Co Ltd 'A' Shares	27.889	0,01
45.000	China International Marine Containers Group Co Ltd 'H' Shares	72.946	0,03
27.000	China Jushi Co Ltd	70.116	0,03
765.000	China Life Insurance Co Ltd	1.331.715	0,54
360.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd	695.506	0,29
12.520	China Meheco Co Ltd	27.676	0,01
153.000	China Merchants Bank Co Ltd 'A' Shares	963.068	0,40
382.500	China Merchants Bank Co Ltd 'H' Shares	2.559.116	1,05
31.500	China Merchants Expressway Network & Technology Holdings Co Ltd	35.850	0,01
49.500	China Merchants Securities Co Ltd 'A' Shares	106.395	0,04
45.000	China Merchants Securities Co Ltd 'H' Shares	48.860	0,02
49.500	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	99.159	0,04
9.000	China Minmetals Rare Earth Co Ltd	41.951	0,02
265.500	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A' Shares	147.320	0,06
675.500	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' Shares	241.036	0,10
72.000	China Molybdenum Co Ltd 'A' Shares	61.538	0,03
405.000	China Molybdenum Co Ltd 'H' Shares	226.062	0,09
4.500	China National Accord Medicines Corp Ltd 'A' Shares	19.996	0,01
4.500	China National Accord Medicines Corp Ltd 'B' Shares	9.869	0,00
450.000	China National Building Material Co Ltd	480.569	0,20
27.000	China National Chemical Engineering Co Ltd	37.897	0,02
135.000	China National Nuclear Power Co Ltd	138.137	0,06
27.000	China Nonferrous Metal Industry's Foreign Engineering and Construction Co Ltd	19.452	0,01
22.500	China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd	118.001	0,05
18.000	China Oilfield Services Ltd 'A' Shares	37.454	0,02
182.000	China Oilfield Services Ltd 'H' Shares	178.360	0,07
45.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A' Shares	157.938	0,07
270.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' Shares	659.951	0,27
247.500	China Petroleum & Chemical Corp 'A' Shares	150.622	0,06
2.610.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H' Shares	1.174.125	0,48
189.000	China Railway Group Ltd 'A' Shares	173.094	0,07
405.000	China Railway Group Ltd 'H' Shares	250.320	0,10

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
47.385	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'A' Shares	32.018	0,01
135.000	China Railway Signal & Communication Corp Ltd 'H' Shares	45.075	0,02
810.000	China Reinsurance Group Corp	67.096	0,03
4.500	China Resources Double Crane Pharmaceutical Co Ltd	17.224	0,01
9.000	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd	60.410	0,03
49.500	China Shenhua Energy Co Ltd 'A' Shares	245.868	0,10
337.500	China Shenhua Energy Co Ltd 'H' Shares	967.733	0,40
13.500	China South Publishing & Media Group Co Ltd	19.009	0,01
85.500	China Southern Airlines Co Ltd 'A' Shares	93.226	0,04
180.000	China Southern Airlines Co Ltd 'H' Shares	104.142	0,04
40.500	China Southern Power Grid Energy Efficiency&Clean Energy Co Ltd	38.360	0,02
292.500	China State Construction Engineering Corp Ltd	232.108	0,10
180.000	China Suntien Green Energy Corp Ltd	91.755	0,04
220.500	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd	206.877	0,09
13.500	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	469.043	0,19
4.860.000	China Tower Corp Ltd	625.542	0,26
9.000	China TransInfo Technology Co Ltd	14.928	0,01
207.000	China United Network Communications Ltd	106.832	0,04
63.000	China Vanke Co Ltd 'A' Shares	192.640	0,08
198.000	China Vanke Co Ltd 'H' Shares	497.590	0,21
13.500	China West Construction Group Co Ltd	15.626	0,01
162.000	China Yangtze Power Co Ltd	558.671	0,23
4.500	China Zhenhua Group Science & Technology Co Ltd	91.266	0,04
54.000	China Zheshang Bank Co Ltd	26.741	0,01
9.000	Chinalin Securities Co Ltd	20.472	0,01
18.000	Chinese Universe Publishing and Media Group Co Ltd	26.822	0,01
4.500	Chongqing Brewery Co Ltd	98.401	0,04
64.320	Chongqing Changan Automobile Co Ltd 'A' Shares	166.168	0,07
181.320	Chongqing Changan Automobile Co Ltd 'B' Shares	89.886	0,04
4.500	Chongqing Department Store Co Ltd	14.478	0,01
9.000	Chongqing Fuling Zhacai Group Co Ltd	46.341	0,02
36.000	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'A' Shares	19.868	0,01
272.000	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd 'H' Shares	97.750	0,04
13.500	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	223.537	0,09
31.500	Citic Pacific Special Steel Group Co Ltd	94.676	0,04
90.000	CITIC Securities Co Ltd 'A' Shares	290.773	0,12
225.000	CITIC Securities Co Ltd 'H' Shares	502.934	0,21
49.500	CNOOC Energy Technology & Services Ltd	19.049	0,01
16.800	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	1.338.146	0,54
67.500	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'A' Shares	30.205	0,01
405.000	COSCO SHIPPING Development Co Ltd 'H' Shares	81.031	0,03
31.500	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'A' Shares	48.536	0,02
180.000	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd 'H' Shares	114.694	0,05
86.800	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A' Shares	179.965	0,07
337.500	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' Shares	471.393	0,20
184.500	CRRC Corp Ltd 'A' Shares	143.104	0,06
452.000	CRRC Corp Ltd 'H' Shares	168.198	0,07
31.500	CSC Financial Co Ltd 'A' Shares	135.835	0,06
90.000	CSC Financial Co Ltd 'H' Shares	95.426	0,04
121.500	CSG Holding Co Ltd	45.212	0,02
4.500	Da An Gene Co Ltd of Sun Yat-Sen University	11.538	0,00
103.500	Daqin Railway Co Ltd	101.737	0,04
452.000	Datang International Power Generation Co Ltd	74.883	0,03
27.000	DHC Software Co Ltd	25.453	0,01
4.500	Dian Diagnostics Group Co Ltd	20.875	0,01
4.500	Digital China Information Service Co Ltd	7.571	0,00
4.500	Do-Fluoride Chemicals Co Ltd	32.829	0,01
4.500	Dong-E-E-Jiao Co Ltd	24.802	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
27.000	Dongfang Electric Corp Ltd 'A' Shares	66.250	0,03
45.000	Dongfang Electric Corp Ltd 'H' Shares	53.906	0,02
270.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd	205.073	0,09
18.000	Dongxing Securities Co Ltd	23.895	0,01
13.500	East Group Co Ltd	16.351	0,01
94.560	East Money Information Co Ltd	358.257	0,15
54.000	Easyhome New Retail Group Co Ltd	35.843	0,01
4.500	Ecovacs Robotics Co Ltd	81.815	0,03
22.500	ENN Natural Gas Co Ltd	62.390	0,03
13.500	Eve Energy Co Ltd	196.332	0,08
27.000	Everbright Securities Co Ltd 'A' Shares	63.471	0,03
27.000	Everbright Securities Co Ltd 'H' Shares	18.753	0,01
31.500	Fangda Carbon New Material Co Ltd	35.709	0,01
22.500	FAW Jiefang Group Co Ltd	31.346	0,01
9.000	Fiberhome Telecommunication Technologies Co Ltd	19.439	0,01
27.000	Financial Street Holdings Co Ltd	23.963	0,01
22.500	First Capital Securities Co Ltd	21.513	0,01
4.500	Flat Glass Group Co Ltd 'A' Shares	25.574	0,01
45.000	Flat Glass Group Co Ltd 'H' Shares	158.278	0,07
112.500	Focus Media Information Technology Co Ltd	112.933	0,05
29.619	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	399.208	0,17
58.500	Founder Securities Co Ltd	58.551	0,02
72.000	Foxconn Industrial Internet Co Ltd	105.677	0,04
2.300	Fu Jian Anjoy Foods Co Ltd	57.591	0,02
9.000	Fujian Sunner Development Co Ltd	25.748	0,01
13.500	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'A' Shares	84.191	0,03
54.000	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd 'H' Shares	273.890	0,11
9.000	Ganfeng Lithium Co Ltd 'A' Shares	199.621	0,08
25.040	Ganfeng Lithium Co Ltd 'H' Shares	275.547	0,11
49.500	GCL System Integration Technology Co Ltd	27.466	0,01
144.000	GD Power Development Co Ltd	83.983	0,03
31.500	GEM Co Ltd	42.757	0,02
31.500	Gemdale Corp	63.148	0,03
36.000	GF Securities Co Ltd 'A' Shares	100.415	0,04
108.000	GF Securities Co Ltd 'H' Shares	142.863	0,06
4.500	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	95.454	0,04
2.700	Ginlong Technologies Co Ltd	85.782	0,04
13.500	Glarun Technology Co Ltd	29.903	0,01
22.500	GoerTek Inc	112.765	0,05
9.000	Gotion High-tech Co Ltd	61.215	0,03
31.500	Grandjoy Holdings Group Co Ltd	18.794	0,01
22.700	Great Wall Motor Co Ltd 'A' Shares	125.415	0,05
315.000	Great Wall Motor Co Ltd 'H' Shares	647.908	0,27
22.500	GRG Banking Equipment Co Ltd	31.111	0,01
90.000	Guangdong Electric Power Development Co Ltd	24.200	0,01
9.000	Guangdong Golden Dragon Development Inc	20.257	0,01
13.500	Guangdong Haid Group Co Ltd	120.840	0,05
31.500	Guangdong HEC Technology Holding Co Ltd	42.240	0,02
4.500	Guangdong South New Media Co Ltd	25.392	0,01
4.500	Guangdong Xinbao Electrical Appliances Holdings Co Ltd	14.760	0,01
49.500	Guanghui Energy Co Ltd	77.821	0,03
180.000	Guangshen Railway Co Ltd	33.720	0,01
22.500	Guangxi Liugong Machinery Co Ltd	21.848	0,01
31.500	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'A' Shares	71.606	0,03
360.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H' Shares	348.212	0,14
9.000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'A' Shares	42.408	0,02
22.500	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd 'H' Shares	65.949	0,03
4.500	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd	55.409	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
180.000	Guangzhou R&F Properties Co Ltd	47.483	0,02
12.080	Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd	111.823	0,05
4.500	Guangzhou Wondfo Biotech Co Ltd	27.325	0,01
12.080	Guangzhou Yuexiu Financial Holdings Group Co Ltd	12.667	0,01
9.000	Guangzhou Zhujiang Brewery Co Ltd	11.384	0,00
27.000	Guizhou Xinbang Pharmaceutical Co Ltd	27.829	0,01
13.500	Guolian Securities Co Ltd	24.708	0,01
45.000	Guosen Securities Co Ltd	64.236	0,03
8.800	Guosheng Financial Holding Inc	12.601	0,01
49.500	Guotai Junan Securities Co Ltd 'A' Shares	112.228	0,05
72.000	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H' Shares	89.645	0,04
31.500	Guoyuan Securities Co Ltd	29.225	0,01
45.000	Haier Smart Home Co Ltd 'A' Shares	184.317	0,08
243.000	Haier Smart Home Co Ltd 'H' Shares	899.604	0,37
4.500	Haisco Pharmaceutical Group Co Ltd	10.813	0,00
72.000	Haitong Securities Co Ltd 'A' Shares	105.355	0,04
360.000	Haitong Securities Co Ltd 'H' Shares	264.256	0,11
9.000	Hang Zhou Great Star Industrial Co Ltd	25.292	0,01
4.500	Hangzhou Chang Chuan Technology Co Ltd	30.306	0,01
6.260	Hangzhou First Applied Material Co Ltd	61.179	0,03
9.000	Hangzhou Oxygen Plant Group Co Ltd	41.965	0,02
9.000	Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	48.368	0,02
9.000	Hangzhou Shunwang Technology Co Ltd	19.425	0,01
9.000	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd	69.807	0,03
4.500	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'A' Shares	76.821	0,03
13.500	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' Shares	156.042	0,06
4.500	Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd	22.238	0,01
4.500	Haohua Chemical Science & Technology Co Ltd	25.855	0,01
5.820	Hefei Meiya Optoelectronic Technology Inc	18.821	0,01
18.100	Heilongjiang Agriculture Co Ltd	39.849	0,02
22.500	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	98.334	0,04
13.500	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd	53.604	0,02
22.500	Hengli Petrochemical Co Ltd	74.640	0,03
22.500	Hengyi Petrochemical Co Ltd	35.273	0,01
72.000	Hesteel Co Ltd	24.271	0,01
4.500	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	64.538	0,03
31.500	Holitech Technology Co Ltd	14.706	0,01
6.300	Hongfa Technology Co Ltd	39.327	0,02
4.500	Hoshine Silicon Industry Co Ltd	79.177	0,03
49.500	Huadian Power International Corp Ltd 'A' Shares	29.017	0,01
180.000	Huadian Power International Corp Ltd 'H' Shares	65.605	0,03
13.500	Huadong Medicine Co Ltd	90.937	0,04
22.500	Huafa Industrial Co Ltd Zhuhai	25.406	0,01
9.000	Huagong Tech Co Ltd	31.104	0,01
18.000	Huaibei Mining Holdings Co Ltd	39.092	0,02
13.500	Hualan Biological Engineering Inc	45.912	0,02
49.500	Huaneng Power International Inc 'A' Shares	51.979	0,02
450.000	Huaneng Power International Inc 'H' Shares	224.227	0,09
49.500	Huatai Securities Co Ltd 'A' Shares	104.845	0,04
171.000	Huatai Securities Co Ltd 'H' Shares	253.658	0,11
18.000	Huaxi Securities Co Ltd	21.049	0,01
117.000	Huaxia Bank Co Ltd	90.924	0,04
9.000	Huaxin Cement Co Ltd	26.191	0,01
22.500	Huayu Automotive Systems Co Ltd	77.190	0,03
45.000	Hubei Biocause Pharmaceutical Co Ltd	22.889	0,01
63.000	Hubei Energy Group Co Ltd	48.019	0,02
4.500	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co Ltd	18.230	0,01
9.000	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd	59.054	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
4.500	Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd	99.341	0,04
13.500	Humanwell Healthcare Group Co Ltd	32.219	0,01
18.000	Hunan Gold Corp Ltd	32.594	0,01
36.040	Hunan Valin Steel Co Ltd	27.362	0,01
9.000	Hundsun Technologies Inc	58.450	0,02
9.000	Huolinhe Opencut Coal Industry Corp Ltd of Inner Mongolia	19.224	0,01
22.500	Hytera Communications Corp Ltd	16.244	0,01
18.000	Iflytek Co Ltd	110.671	0,05
1.600	Imeik Technology Development Co Ltd	143.196	0,06
558.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A' Shares	397.014	0,16
8.055.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares	4.783.554	1,97
153.000	Industrial Bank Co Ltd	454.148	0,19
49.500	Industrial Securities Co Ltd	52.053	0,02
4.500	Ingenic Semiconductor Co Ltd	71.317	0,03
9.000	Inmyshow Digital Technology Group Co Ltd	11.048	0,00
306.000	Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd	107.261	0,04
54.000	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	39.307	0,02
49.500	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	287.585	0,12
99.000	Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd	162.261	0,07
13.700	Inspur Electronic Information Industry Co Ltd	54.112	0,02
5.380	Intco Medical Technology Co Ltd	20.351	0,01
17.820	JA Solar Technology Co Ltd	209.719	0,09
4.500	Jafron Biomedical Co Ltd	34.158	0,01
5.850	Jason Furniture Hangzhou Co Ltd	49.415	0,02
9.000	JCET Group Co Ltd	36.246	0,02
4.500	Jiajiayue Group Co Ltd	9.558	0,00
31.500	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd	79.452	0,03
122.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' Shares	122.825	0,05
18.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'A' Shares	23.009	0,01
662	Jiangsu GoodWe Power Supply Technology Co Ltd	30.908	0,01
9.000	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	82.856	0,03
45.000	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	248.956	0,10
9.000	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd	68.465	0,03
9.000	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	245.868	0,10
4.500	Jiangsu Yoke Technology Co Ltd	37.259	0,02
9.000	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd	34.447	0,01
36.000	Jiangsu Zhongnan Construction Group Co Ltd	16.378	0,01
22.500	Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd	77.526	0,03
18.000	Jiangxi Copper Co Ltd 'A' Shares	47.871	0,02
135.000	Jiangxi Copper Co Ltd 'H' Shares	184.772	0,08
13.500	Jiangxi Special Electric Motor Co Ltd	50.422	0,02
22.500	Jiangxi Zhengbang Technology Co Ltd	20.338	0,01
9.000	Jilin Aodong Pharmaceutical Group Co Ltd	19.814	0,01
40.500	Jinke Properties Group Co Ltd	17.277	0,01
27.000	Jinke Smart Services Group Co Ltd	69.505	0,03
13.500	Joincare Pharmaceutical Group Industry Co Ltd	24.869	0,01
4.500	Joinn Laboratories China Co Ltd 'A' Shares	76.385	0,03
4.500	Joinn Laboratories China Co Ltd 'H' Shares	37.906	0,02
9.000	Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd	15.988	0,01
4.500	Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co Ltd	23.231	0,01
4.500	Joyoung Co Ltd	12.324	0,01
13.600	Juneyao Airlines Co Ltd	36.494	0,02
4.500	Kaishan Group Co Ltd	10.041	0,00
4.500	Keboda Technology Co Ltd	41.327	0,02
9.000	Keda Industrial Group Co Ltd	27.708	0,01
18.000	Kingfa Sci & Tech Co Ltd	25.560	0,01
18.000	Kuang-Chi Technologies Co Ltd	46.368	0,02
9.000	Kunlun Tech Co Ltd	21.479	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
9.000	Kweichow Moutai Co Ltd	2.745.295	1,13
22.500	Lao Feng Xiang Co Ltd	73.485	0,03
49.500	Legend Holdings Corp	64.974	0,03
31.500	Lens Technology Co Ltd	52.013	0,02
58.500	Leo Group Co Ltd	16.928	0,01
18.000	Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd	49.858	0,02
4.500	Levima Advanced Materials Corp	22.305	0,01
27.000	Leyard Optoelectronic Co Ltd	29.399	0,01
9.180	LianChuang Electronic Technology Co Ltd	21.032	0,01
4.500	Lianhe Chemical Technology Co Ltd	10.988	0,00
153.000	Liaoning Port Co Ltd	38.797	0,02
54.000	Lingyi iTech Guangdong Co	40.434	0,02
4.500	Livzon Pharmaceutical Group Inc 'A' Shares	24.305	0,01
18.000	Livzon Pharmaceutical Group Inc 'H' Shares	62.279	0,03
13.500	Lomon Billions Group Co Ltd	40.374	0,02
56.640	LONGi Green Energy Technology Co Ltd	562.919	0,23
9.000	Longshine Technology Group Co Ltd	33.816	0,01
13.500	Luxi Chemical Group Co Ltd	34.816	0,01
49.500	Luxshare Precision Industry Co Ltd	249.486	0,10
9.000	Luzhou Laojiao Co Ltd	330.966	0,14
90.000	Maanshan Iron & Steel Co Ltd	27.297	0,01
4.500	Maccura Biotechnology Co Ltd	13.753	0,01
13.500	Mango Excellent Media Co Ltd	67.176	0,03
2.560	Maxscend Microelectronics Co Ltd	51.550	0,02
36.040	Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd	29.943	0,01
90.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'A' Shares	46.985	0,02
270.000	Metallurgical Corp of China Ltd 'H' Shares	64.688	0,03
13.500	Ming Yang Smart Energy Group Ltd	68.062	0,03
7.912	Montage Technology Co Ltd	71.494	0,03
9.000	Montnets Rongxin Technology Group Co Ltd	15.626	0,01
40.500	Muyuan Foodstuff Co Ltd	333.885	0,14
22.500	NanJi E-Commerce Co Ltd	17.922	0,01
40.500	Nanjing Iron & Steel Co Ltd	19.029	0,01
4.500	Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co Ltd	18.928	0,01
27.000	Nanjing Securities Co Ltd	33.588	0,01
43.140	NARI Technology Co Ltd	173.739	0,07
12.465	National Silicon Industry Group Co Ltd	42.726	0,02
4.500	NAURA Technology Group Co Ltd	186.009	0,08
18.000	NavInfo Co Ltd	40.461	0,02
13.500	New China Life Insurance Co Ltd 'A' Shares	64.820	0,03
94.500	New China Life Insurance Co Ltd 'H' Shares	265.546	0,11
31.500	New Hope Liuhe Co Ltd	71.888	0,03
13.600	Newland Digital Technology Co Ltd	26.798	0,01
9.000	Ninestar Corp	67.954	0,03
9.000	Ningbo Joyson Electronic Corp	21.090	0,01
4.500	Ningbo Orient Wires & Cables Co Ltd	51.416	0,02
4.945	Ningbo Ronbay New Energy Technology Co Ltd	95.475	0,04
13.500	Ningbo Shanshan Co Ltd	59.846	0,02
4.500	Ningbo Tuopu Group Co Ltd	45.932	0,02
63.000	Ningbo Zhoushan Port Co Ltd	36.649	0,02
22.500	Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd	49.167	0,02
180.000	Nongfu Spring Co Ltd	1.033.395	0,42
4.500	North Industries Group Red Arrow Co Ltd	19.566	0,01
13.500	Northeast Securities Co Ltd	14.076	0,01
4.500	NSFOCUS Technologies Group Co Ltd	7.061	0,00
40.500	Oceanwide Holdings Co Ltd	9.182	0,00
54.000	Offcn Education Technology Co Ltd	46.636	0,02
45.000	Offshore Oil Engineering Co Ltd	27.856	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
27.000	OFILM Group Co Ltd	27.023	0,01
4.500	Oppl Lighting Co Ltd	11.713	0,00
13.500	ORG Technology Co Ltd	10.471	0,00
57.440	Orient Securities Co Ltd 'A' Shares	87.477	0,04
90.000	Orient Securities Co Ltd 'H' Shares	50.580	0,02
27.000	Oriental Energy Co Ltd	37.494	0,02
27.000	Ourpalm Co Ltd	13.451	0,01
9.000	Ovctek China Inc	76.774	0,03
63.000	Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co Ltd	35.709	0,01
18.000	People.cn Co Ltd	30.071	0,01
810.000	People's Insurance Co Group of China Ltd	247.740	0,10
9.000	Perfect World Co Ltd	19.291	0,01
2.070.000	PetroChina Co Ltd	986.600	0,40
20.200	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' Shares	202.207	0,08
720.000	PICC Property & Casualty Co Ltd	748.724	0,31
135.000	Ping An Bank Co Ltd	301.647	0,13
76.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A' Shares	532.768	0,22
607.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' Shares	4.130.284	1,70
18.000	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co Ltd	36.488	0,02
81.000	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	210.951	0,09
18.000	Poly Property Services Co Ltd	114.694	0,05
148.500	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'A' Shares	119.390	0,05
990.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd 'H' Shares	786.000	0,33
76.500	Power Construction Corp of China Ltd	89.803	0,04
9.000	Qingdao TGOOD Electric Co Ltd	23.238	0,01
3.096	Raytron Technology Co Ltd	18.343	0,01
18.000	Red Star Macalline Group Corp Ltd 'A' Shares	16.270	0,01
63.000	Red Star Macalline Group Corp Ltd 'H' Shares	25.772	0,01
22.500	Remegen Co Ltd	126.020	0,05
40.500	RiseSun Real Estate Development Co Ltd	18.304	0,01
27.100	Rongsheng Petro Chemical Co Ltd	62.210	0,03
63.000	SAIC Motor Corp Ltd	167.362	0,07
22.500	Sailun Group Co Ltd	37.823	0,02
22.500	Sansteel Minguang Co Ltd Fujian	20.439	0,01
63.000	Sany Heavy Industry Co Ltd	179.109	0,07
18.869	Satellite Chemical Co Ltd	72.755	0,03
58.500	SDIC Power Holdings Co Ltd	91.622	0,04
58.500	Sealand Securities Co Ltd	31.675	0,01
18.000	Seazen Holdings Co Ltd	68.277	0,03
36.000	SF Holding Co Ltd	299.687	0,12
1.575	SG Micro Corp	42.761	0,02
54.000	Shaanxi Coal Industry Co Ltd	170.598	0,07
40.500	Shaanxi International Trust Co Ltd	18.848	0,01
18.000	Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co Ltd	41.508	0,02
103.500	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'B' Shares	38.119	0,02
67.500	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd 'H' Shares	25.720	0,01
4.500	Shandong Denghai Seeds Co Ltd	14.156	0,01
27.000	Shandong Gold Mining Co Ltd 'A' Shares	74.747	0,03
67.500	Shandong Gold Mining Co Ltd 'H' Shares	118.192	0,05
9.000	Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co Ltd	29.990	0,01
13.500	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	58.799	0,02
4.500	Shandong Linglong Tyre Co Ltd	17.029	0,01
99.000	Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd	54.490	0,02
4.500	Shandong Pharmaceutical Glass Co Ltd	18.761	0,01
18.000	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd	33.051	0,01
234.000	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	271.963	0,11
36.000	Shanghai 2345 Network Holding Group Co Ltd	12.082	0,01
18.000	Shanghai Bailian Group Co Ltd	14.886	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
6.260	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd	28.050	0,01
4.500	Shanghai Baosight Software Co Ltd 'A' Shares	36.649	0,02
40.500	Shanghai Baosight Software Co Ltd 'B' Shares	170.829	0,07
58.500	Shanghai Construction Group Co Ltd	26.439	0,01
27.000	Shanghai Dazhong Public Utilities Group Co Ltd	13.290	0,01
85.500	Shanghai Electric Group Co Ltd 'A' Shares	52.416	0,02
270.000	Shanghai Electric Group Co Ltd 'H' Shares	66.408	0,03
18.000	Shanghai Electric Power Co Ltd	27.520	0,01
13.500	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'A' Shares	88.782	0,04
45.000	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd 'H' Shares	166.593	0,07
903	Shanghai Friendess Electronic Technology Corp Ltd	29.638	0,01
31.500	Shanghai Huayi Group Co Ltd	23.499	0,01
13.500	Shanghai International Airport Co Ltd	114.175	0,05
72.000	Shanghai International Port Group Co Ltd	62.612	0,03
4.500	Shanghai Jinjiang International Hotels Co Ltd 'A' Shares	42.220	0,02
22.500	Shanghai Jinjiang International Hotels Co Ltd 'B' Shares	43.965	0,02
1.720	Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'A' Shares	19.329	0,01
18.000	Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd 'H' Shares	96.917	0,04
36.000	Shanghai Lingang Holdings Corp Ltd	72.814	0,03
18.000	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd 'A' Shares	27.815	0,01
108.000	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd 'B' Shares	94.932	0,04
4.500	Shanghai M&G Stationery Inc	37.642	0,02
18.000	Shanghai Mechanical and Electrical Industry Co Ltd	21.564	0,01
13.500	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'A' Shares	36.407	0,02
81.000	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd 'H' Shares	134.192	0,06
198.000	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	236.565	0,10
9.000	Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd	113.302	0,05
45.000	Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd	39.803	0,02
63.000	Shanghai Shibe Hi-Tech Co Ltd	18.144	0,01
27.000	Shanghai Shimao Co Ltd	12.001	0,00
27.000	Shanghai Tunnel Engineering Co Ltd	24.647	0,01
9.000	Shanghai Waigaoqiao Free Trade Zone Group Co Ltd 'A' Shares	18.257	0,01
27.000	Shanghai Waigaoqiao Free Trade Zone Group Co Ltd 'B' Shares	24.813	0,01
27.000	Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd	38.018	0,02
13.500	Shanghai Zhangjiang High-Tech Park Development Co Ltd	25.070	0,01
112.500	Shanghai Zhenhua Heavy Industries Co Ltd	28.913	0,01
31.500	Shanxi Coking Coal Energy Group Co Ltd	62.914	0,03
22.500	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd	49.066	0,02
31.500	Shanxi Meijin Energy Co Ltd	57.322	0,02
40.540	Shanxi Securities Co Ltd	34.710	0,01
40.500	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd	32.923	0,01
9.000	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	436.025	0,18
67.500	Shanying International Holding Co Ltd	27.889	0,01
18.000	Shenghe Resources Holding Co Ltd	60.678	0,03
22.600	Shengyi Technology Co Ltd	57.274	0,02
153.000	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd 'A' Shares	97.904	0,04
144.000	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd 'H' Shares	28.995	0,01
27.000	Shenzhen Airport Co Ltd	31.091	0,01
8.020	Shenzhen Capchem Technology Co Ltd	62.876	0,03
1.080	Shenzhen Dynanonic Co Ltd	65.836	0,03
54.000	Shenzhen Energy Group Co Ltd	51.630	0,02
4.960	Shenzhen Everwin Precision Technology Co Ltd	7.628	0,00
90.000	Shenzhen Expressway Corp Ltd	93.476	0,04
18.000	Shenzhen Gas Corp Ltd	18.633	0,01
22.500	Shenzhen Hepalink Pharmaceutical Group Co Ltd	20.702	0,01
4.500	Shenzhen Infogem Technologies Co Ltd	7.377	0,00
19.150	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	188.152	0,08
13.500	Shenzhen Jinjia Group Co Ltd	21.586	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
18.000	Shenzhen Kaifa Technology Co Ltd	31.252	0,01
7.140	Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd	48.117	0,02
9.000	Shenzhen Kingdom Sci-Tech Co Ltd	13.935	0,01
9.000	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	420.453	0,17
45.000	Shenzhen MTC Co Ltd	25.775	0,01
40.500	Shenzhen Neptunus Bioengineering Co Ltd	21.989	0,01
63.000	Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd	60.987	0,03
9.000	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd	37.723	0,02
9.000	Shenzhen Sunway Communication Co Ltd	22.620	0,01
6.556	Shenzhen Transsion Holdings Co Ltd	87.258	0,04
9.000	Shenzhen YUTO Packaging Technology Co Ltd	39.669	0,02
22.500	Shenzhen Zhongjin Lingnan Nonfemet Co Ltd	14.968	0,01
18.000	Shijiazhuang Changshan BeiMing Technology Co Ltd	16.109	0,01
18.000	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co Ltd	65.243	0,03
22.500	Siasun Robot & Automation Co Ltd	33.830	0,01
31.500	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd	56.007	0,02
63.000	Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd	40.032	0,02
13.500	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd	37.656	0,02
9.000	Sichuan New Energy Power Co Ltd	29.735	0,01
36.000	Sichuan Road & Bridge Co Ltd	56.544	0,02
4.500	Sichuan Swellfun Co Ltd	62.115	0,03
4.500	Sichuan Teway Food Group Co Ltd	19.110	0,01
9.000	Sichuan Yahua Industrial Group Co Ltd	43.831	0,02
4.500	Sieyuan Electric Co Ltd	23.936	0,01
22.500	Sinolink Securities Co Ltd	30.205	0,01
13.500	Sinoma International Engineering Co	19.512	0,01
13.500	Sinoma Science & Technology Co Ltd	55.376	0,02
180.000	Sinopec Engineering Group Co Ltd	82.580	0,03
270.000	Sinopec Oilfield Service Corp	20.989	0,01
360.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd	61.476	0,03
126.000	Sinopharm Group Co Ltd	305.408	0,13
45.000	Sinotrans Ltd 'A' Shares	26.043	0,01
180.000	Sinotrans Ltd 'H' Shares	51.612	0,02
4.500	Skshu Paint Co Ltd	86.876	0,04
22.500	Songcheng Performance Development Co Ltd	51.516	0,02
34.140	SooChow Securities Co Ltd	35.290	0,01
54.000	Southwest Securities Co Ltd	31.977	0,01
1.000	StarPower Semiconductor Ltd	57.561	0,02
13.500	STO Express Co Ltd	24.003	0,01
9.000	Sungrow Power Supply Co Ltd	131.895	0,05
27.000	Suning Universal Co Ltd	14.821	0,01
13.500	Sunwoda Electronic Co Ltd	63.632	0,03
13.500	Suzhou Anjie Technology Co Ltd	32.964	0,01
13.500	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd	46.173	0,02
31.500	Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co Ltd	23.869	0,01
1.300	Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd	95.190	0,04
4.500	Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co Ltd	58.665	0,02
4.500	Taiji Computer Corp Ltd	12.894	0,01
13.500	Tangshan Jidong Cement Co Ltd	21.184	0,01
45.000	TangShan Port Group Co Ltd	17.318	0,01
27.000	TBEA Co Ltd	110.308	0,05
103.500	TCL Technology Group Corp	73.948	0,03
4.500	Three Squirrels Inc	16.814	0,01
4.500	Thunder Software Technology Co Ltd	87.581	0,04
4.500	Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co Ltd	21.143	0,01
27.000	Tianjin Chase Sun Pharmaceutical Co Ltd	31.010	0,01
36.000	Tianjin Guangyu Development Co Ltd	69.753	0,03
22.500	Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co Ltd	197.641	0,08

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
22.500	Tianma Microelectronics Co Ltd	33.460	0,01
13.500	Tianshan Aluminum Group Co Ltd	13.149	0,01
22.500	Tianshui Huatian Technology Co Ltd	31.480	0,01
4.500	Tibet Summit Resources Co Ltd	19.264	0,01
18.000	Titan Wind Energy Suzhou Co Ltd	44.274	0,02
18.000	TongFu Microelectronics Co Ltd	41.347	0,02
18.000	Tongkun Group Co Ltd	42.636	0,02
76.500	Tongling Nonferrous Metals Group Co Ltd	37.199	0,02
31.500	Tongwei Co Ltd	281.255	0,12
9.000	Topsec Technologies Group Inc	13.626	0,01
18.000	Transfar Zhilian Co Ltd	17.264	0,01
90.000	TravelSky Technology Ltd	174.794	0,07
15.570	Trina Solar Co Ltd	151.538	0,06
4.500	Tsingtao Brewery Co Ltd 'A' Shares	69.753	0,03
60.545	Tsingtao Brewery Co Ltd 'H' Shares	629.604	0,26
4.500	Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd	127.344	0,05
9.000	Unisplendour Corp Ltd	26.043	0,01
13.600	Universal Scientific Industrial Shanghai Co Ltd	29.130	0,01
4.500	Valiant Co Ltd	14.002	0,01
9.000	Visual China Group Co Ltd	19.184	0,01
13.500	Walvax Biotechnology Co Ltd	97.441	0,04
27.000	Wangsu Science & Technology Co Ltd	21.586	0,01
22.500	Wanhua Chemical Group Co Ltd	325.509	0,13
22.500	Wanxiang Qianchao Co Ltd	19.935	0,01
45.000	Weichai Power Co Ltd 'A' Shares	83.701	0,03
180.000	Weichai Power Co Ltd 'H' Shares	285.818	0,12
9.000	Weifu High-Technology Group Co Ltd 'A' Shares	25.842	0,01
18.000	Weifu High-Technology Group Co Ltd 'B' Shares	34.064	0,01
4.500	Weihai Guangwei Composites Co Ltd	39.515	0,02
13.500	Wens Foodstuffs Group Co Ltd	42.871	0,02
18.000	Western Mining Co Ltd	31.762	0,01
36.000	Western Securities Co Ltd	35.118	0,01
3.268	Western Superconducting Technologies Co Ltd	44.943	0,02
9.000	Westone Information Industry Inc	57.604	0,02
4.500	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai	116.141	0,05
9.000	Wingtech Technology Co Ltd	114.255	0,05
13.500	Winning Health Technology Group Co Ltd	17.680	0,01
13.500	Wolong Electric Group Co Ltd	29.037	0,01
45.000	Wuchan Zhongda Group Co Ltd	34.434	0,01
25.140	Wuhan Guide Infrared Co Ltd	48.261	0,02
9.000	Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	28.500	0,01
27.000	Wuliangye Yibin Co Ltd	813.238	0,34
18.000	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd	39.629	0,02
18.000	WuXi AppTec Co Ltd 'A' Shares	279.201	0,12
36.000	WuXi AppTec Co Ltd 'H' Shares	479.422	0,20
58.500	XCMG Construction Machinery Co Ltd	47.032	0,02
31.500	Xiamen C & D Inc	61.410	0,03
27.000	Xiamen ITG Group Corp Ltd	30.205	0,01
9.000	Xiamen Tungsten Co Ltd	29.024	0,01
31.500	Xiangcai Co Ltd	36.132	0,01
4.500	Xinfengming Group Co Ltd	7.746	0,00
45.000	Xinhua Winshare Publishing and Media Co Ltd	32.000	0,01
27.000	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'A' Shares	59.604	0,02
72.000	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H' Shares	134.697	0,06
13.500	Xinjiang Tianshan Cement Co Ltd	24.768	0,01
27.000	Xinjiang Zhongtai Chemical Co Ltd	31.252	0,01
9.000	Xuji Electric Co Ltd	25.775	0,01
40.500	Yango Group Co Ltd	13.230	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
4.500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'A' Shares	20.754	0,01
22.500	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co 'H' Shares	38.595	0,02
4.500	Yangzhou Yangjie Electronic Technology Co Ltd	47.825	0,02
9.000	Yankuang Energy Group Co Ltd 'A' Shares	53.000	0,02
188.000	Yankuang Energy Group Co Ltd 'H' Shares	589.375	0,24
22.500	Yantai Changyu Pioneer Wine Co Ltd	36.071	0,01
9.000	Yantai Eddie Precision Machinery Co Ltd	27.520	0,01
4.500	Yantai Jereh Oilfield Services Group Co Ltd	27.050	0,01
4.500	Yealink Network Technology Corp Ltd	51.113	0,02
4.500	Yifan Pharmaceutical Co Ltd	9.384	0,00
4.500	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd	35.461	0,01
13.500	Yihai Kerry Arawana Holdings Co Ltd	108.778	0,05
18.100	Yintai Gold Co Ltd	26.296	0,01
4.500	Yixintang Pharmaceutical Group Co Ltd	15.391	0,01
4.500	YongXing Special Materials Technology Co Ltd	102.167	0,04
27.200	Yonyou Network Technology Co Ltd	88.081	0,04
22.500	Youngor Group Co Ltd	22.251	0,01
4.500	Youngy Co Ltd	103.167	0,04
18.000	YTO Express Group Co Ltd	54.745	0,02
13.500	Yuan Longping High-tech Agriculture Co Ltd	33.548	0,01
9.318	Yunda Holding Co Ltd	23.711	0,01
22.500	Yunnan Aluminium Co Ltd	33.158	0,01
12.440	Yunnan Baiyao Group Co Ltd	112.057	0,05
9.000	Yunnan Copper Co Ltd	15.290	0,01
4.570	Yunnan Energy New Material Co Ltd	170.722	0,07
13.500	Yunnan Tin Co Ltd	33.769	0,01
4.500	Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co Ltd	239.445	0,10
112.500	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	98.350	0,04
36.000	Zhefu Holding Group Co Ltd	25.721	0,01
81.000	Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	58.235	0,02
40.500	Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd	33.648	0,01
9.000	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	48.033	0,02
13.500	Zhejiang Crystal-Optech Co Ltd	24.385	0,01
18.000	Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	44.086	0,02
4.500	Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	34.031	0,01
180.000	Zhejiang Expressway Co Ltd	166.077	0,07
18.000	Zhejiang Hailiang Co Ltd	31.010	0,01
2.365	Zhejiang HangKe Technology Inc Co	24.715	0,01
22.500	Zhejiang Hisoar Pharmaceutical Co Ltd	23.258	0,01
18.000	Zhejiang Huace Film & Television Co Ltd	13.371	0,01
27.000	Zhejiang Huafeng Spandex Co Ltd	33.991	0,01
9.000	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd	30.473	0,01
11.640	Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	166.018	0,07
9.000	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	90.736	0,04
9.000	Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co Ltd	69.404	0,03
18.000	Zhejiang Juhua Co Ltd	35.306	0,01
4.500	Zhejiang Medicine Co Ltd	9.162	0,00
21.520	Zhejiang NHU Co Ltd	73.218	0,03
13.500	Zhejiang Runtu Co Ltd	16.230	0,01
18.000	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd	73.781	0,03
13.500	Zhejiang Semir Garment Co Ltd	11.921	0,00
4.500	Zhejiang Supor Co Ltd	37.817	0,02
27.000	Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Co Ltd	21.627	0,01
9.000	Zhejiang Wanliyang Co Ltd	11.478	0,00
13.560	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	48.624	0,02
4.500	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd	34.924	0,01
9.000	Zhejiang Yasha Decoration Co Ltd	6.726	0,00
4.500	Zhejiang Yongtai Technology Co Ltd	22.103	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,10 % (30. Juni 2021: 99,47 %) (Fortsetzung)		
	China: 41,98 % (30. Juni 2021: 35,58 %) (Fortsetzung)		
9.000	Zheshang Securities Co Ltd	15.277	0,01
81.000	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	263.739	0,11
4.500	Zhongji Innolight Co Ltd	20.841	0,01
31.500	Zhongshan Broad Ocean Motor Co Ltd	28.849	0,01
18.000	Zhongtai Securities Co Ltd	20.539	0,01
3.956	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'A' Shares	38.349	0,02
54.000	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H' Shares	266.320	0,11
4.500	Zhuzhou Hongda Electronics Corp Ltd	41.059	0,02
13.500	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd	25.674	0,01
139.500	Zijin Mining Group Co Ltd 'A' Shares	194.137	0,08
578.000	Zijin Mining Group Co Ltd 'H' Shares	707.865	0,29
45.000	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'A' Shares	41.347	0,02
153.000	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' Shares	81.697	0,03
27.000	ZTE Corp 'A' Shares	102.818	0,04
72.000	ZTE Corp 'H' Shares	167.729	0,07
		<u>101.225.762</u>	<u>41,98</u>
	Hongkong: 3,15 % (30. Juni 2021: 2,55 %)		
45.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	159.998	0,07
67.500	BYD Electronic International Co Ltd	212.901	0,09
360.000	China Everbright Environment Group Ltd	212.414	0,09
90.000	China Everbright Ltd	84.644	0,04
630.000	China Jinmao Holdings Group Ltd	169.403	0,07
154.880	China Merchants Port Holdings Co Ltd	263.300	0,11
382.500	China Overseas Land & Investment Ltd	1.208.877	0,50
585.000	China Power International Development Ltd	371.265	0,15
165.272	China Resources Beer Holdings Co Ltd	1.232.124	0,51
157.500	China Resources Pharmaceutical Group Ltd	106.981	0,04
180.000	China Resources Power Holdings Co Ltd	371.609	0,15
144.000	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	177.638	0,07
270.000	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	166.880	0,07
495.000	CITIC Ltd	501.501	0,21
810.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	804.121	0,33
225.000	Far East Horizon Ltd	188.672	0,08
248.500	Fosun International Ltd	229.596	0,10
311.800	Guangdong Investment Ltd	329.802	0,14
45.000	Hua Hong Semiconductor Ltd	162.866	0,07
10.392	Jinmao Property Services Co Ltd	6.357	0,00
45.000	Shanghai Industrial Holdings Ltd	65.032	0,03
270.000	Shenzhen Investment Ltd	53.677	0,02
360.000	Shougang Fushan Resources Group Ltd	149.561	0,06
292.500	Sino-Ocean Group Holding Ltd	49.577	0,02
67.500	Sinotruk Hong Kong Ltd	94.623	0,04
180.000	Sun Art Retail Group Ltd	58.494	0,02
135.000	Yuexiu Property Co Ltd	173.074	0,07
		<u>7.604.987</u>	<u>3,15</u>
	Singapur: 0,13 % (30. Juni 2021: 0,09 %)		
252.000	Yangzijiang Financial Holding Ltd	74.240	0,03
261.000	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	174.412	0,07
81.100	Yanlord Land Group Ltd	61.771	0,03
		<u>310.423</u>	<u>0,13</u>
	Aktien insgesamt	<u>238.976.268</u>	<u>99,10</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>238.976.268</u>	<u>99,10</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: 0,01 % (30. Juni 2021: (0,00) %)

Terminkontrakte (Futures): 0,01 % (30. Juni 2021: (0,00) %)*

Nominal- betrag USD	Durchschnittlicher Anschaffungskurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermö- gens
2.016.935	538	75 of MSCI China Long Futures Contracts Expiring September 2022	33.190	0,01
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	33.190	0,01
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	33.190	0,01
			Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
		Anlageportfolio	239.009.458	99,11
		Sonstiges Nettovermögen	2.155.561	0,89
		Nettovermögen	241.165.019	100,00
				% des Gesamt- vermö- gens
		Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,07
		Börsengehandelte derivative Instrumente		0,01
		Sonstiges Umlaufvermögen		0,92
		Gesamtvermögen		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 218.505 USD.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin FTSE India UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %)		
	Aktien: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %)		
	Indien: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %)		
324	3M India Ltd	89.660	0,07
24.543	Aarti Industries Ltd	217.141	0,18
6.885	ABB India Ltd	200.598	0,16
11.097	ACC Ltd	298.171	0,24
34.263	Adani Enterprises Ltd	950.544	0,78
36.045	Adani Gas Ltd	1.092.179	0,89
51.030	Adani Green Energy Ltd	1.246.858	1,02
103.437	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd	880.241	0,72
122.310	Adani Power Ltd	407.093	0,33
32.481	Adani Transmission Ltd	1.017.400	0,83
20.493	Adani Wilmar Ltd	148.989	0,12
63.990	Aditya Birla Capital Ltd	72.439	0,06
3.240	Alkem Laboratories Ltd	123.021	0,10
90.315	Ambuja Cements Ltd	415.136	0,34
12.879	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	600.713	0,49
186.381	Ashok Leyland Ltd	348.819	0,28
58.806	Asian Paints Ltd	2.006.951	1,64
11.583	Astral Ltd	242.814	0,20
40.338	AU Small Finance Bank Ltd	302.232	0,25
34.425	Aurobindo Pharma Ltd	223.666	0,18
19.359	Avenue Supermarts Ltd	834.958	0,68
295.812	Axis Bank Ltd	2.385.300	1,96
9.153	Bajaj Auto Ltd	429.599	0,35
30.780	Bajaj Finance Ltd	2.104.877	1,73
5.022	Bajaj Finserv Ltd	695.169	0,57
3.483	Bajaj Holdings & Investment Ltd	202.225	0,17
10.530	Balkrishna Industries Ltd	286.562	0,23
103.842	Bandhan Bank Ltd	346.480	0,28
135.675	Bank of Baroda	167.334	0,14
64.719	Bank of India	36.345	0,03
7.776	Bata India Ltd	164.308	0,13
1.539	Bayer CropScience Ltd	97.578	0,08
30.213	Berger Paints India Ltd	217.418	0,18
140.859	Bharat Electronics Ltd	417.552	0,34
32.805	Bharat Forge Ltd	270.756	0,22
162.810	Bharat Heavy Electricals Ltd	92.669	0,08
129.519	Bharat Petroleum Corp Ltd	505.792	0,41
297.270	Bharti Airtel Ltd	2.578.304	2,12
58.644	Biocon Ltd	229.014	0,19
1.134	Bosch Ltd	218.688	0,18
15.471	Britannia Industries Ltd	679.080	0,55
32.724	Cadila Healthcare Ltd	147.931	0,12
46.980	Canara Bank	107.824	0,09
65.124	Castrol India Ltd	85.185	0,07
52.812	Cholamandalam Investment and Finance Co Ltd	414.284	0,34
66.501	Cipla Ltd	772.354	0,63
245.835	Coal India Ltd	577.758	0,47
4.698	Coforge Ltd	210.550	0,17
17.334	Colgate-Palmolive India Ltd	326.355	0,27
35.640	Container Corp Of India Ltd	268.205	0,22
14.175	Coromandel International Ltd	171.084	0,14
17.334	Cummins India Ltd	224.806	0,18
75.087	Dabur India Ltd	471.549	0,39
10.611	Dalmia Bharat Ltd	172.475	0,14
9.882	Deepak Nitrite Ltd	217.279	0,18
16.524	Divi's Laboratories Ltd	759.615	0,62
4.698	Dixon Technologies India Ltd	212.673	0,17
79.623	DLF Ltd	315.276	0,26

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
	Indien: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
4.536	Dr Lal PathLabs Ltd	124.088	0,10
15.714	Dr Reddy's Laboratories Ltd	874.281	0,71
18.063	Eicher Motors Ltd	639.138	0,52
27.378	Emami Ltd	145.691	0,12
69.984	Embassy Office Parks REIT	331.618	0,27
58.725	Exide Industries Ltd	102.470	0,08
204.687	Federal Bank Ltd	233.787	0,19
7.857	FSN E-Commerce Ventures Ltd	139.978	0,11
229.651	GAIL India Ltd	393.160	0,32
9.153	General Insurance Corp of India	13.352	0,01
972	Gillette India Ltd	61.515	0,05
5.265	GlaxoSmithKline Pharmaceuticals Ltd	99.977	0,08
19.764	Glenmark Pharmaceuticals Ltd	96.690	0,08
322.623	GMR Infrastructure Ltd	139.307	0,11
47.142	Godrej Consumer Products Ltd	452.213	0,37
11.340	Godrej Industries Ltd	62.298	0,05
11.259	Godrej Properties Ltd	168.652	0,14
49.896	Grasim Industries Ltd	834.469	0,68
25.839	Gujarat Gas Ltd	137.043	0,11
31.023	Havells India Ltd	431.409	0,35
141.264	HCL Technologies Ltd	1.740.925	1,42
6.966	HDFC Asset Management Co Ltd	158.099	0,13
126.117	HDFC Life Insurance Co Ltd	878.336	0,72
16.929	Hero MotoCorp Ltd	583.011	0,48
183.465	Hindalco Industries Ltd	786.735	0,64
10.854	Hindustan Aeronautics Ltd	243.242	0,20
91.125	Hindustan Petroleum Corp Ltd	250.623	0,20
115.425	Hindustan Unilever Ltd	3.260.211	2,66
31.266	Hindustan Zinc Ltd	98.720	0,08
324	Honeywell Automation India Ltd	138.621	0,11
228.177	Housing Development Finance Corp Ltd	6.272.285	5,12
203.553	ICICI Bank Ltd	1.822.820	1,49
31.671	ICICI Lombard General Insurance Co Ltd	449.544	0,37
48.357	ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd	299.428	0,24
400.950	IDFC First Bank Ltd	159.674	0,13
47.385	Indiabulls Housing Finance Ltd	56.852	0,05
357.696	Indian Oil Corp Ltd INR	336.306	0,27
178.848	Indian Oil Corp Ltd	168.153	0,14
33.939	Indian Railway Catering & Tourism Corp Ltd	247.626	0,20
247.698	Indian Railway Finance Corp Ltd	61.632	0,05
45.279	Indraprastha Gas Ltd	204.056	0,17
113.724	Indus Towers Ltd	301.114	0,25
9.963	Info Edge India Ltd	474.202	0,39
462.186	Infosys Ltd	8.555.759	6,99
12.474	InterGlobe Aviation Ltd	253.705	0,21
18.306	Ipca Laboratories Ltd	208.042	0,17
384.993	ITC Ltd	1.333.320	1,09
51.111	Jindal Steel & Power Ltd	213.091	0,17
50.868	JSW Energy Ltd	133.945	0,11
130.248	JSW Steel Ltd	931.020	0,76
47.385	Jubilant Foodworks Ltd	307.360	0,25
17.010	Kansai Nerolac Paints Ltd	79.803	0,07
113.562	L&T Finance Holdings Ltd	97.208	0,08
3.402	L&T Technology Services Ltd	130.562	0,11
5.832	Larsen & Toubro Infotech Ltd	293.581	0,24
89.586	Larsen & Toubro Ltd	1.767.671	1,44
47.547	Laurus Labs Ltd	279.782	0,23
42.120	LIC Housing Finance Ltd	174.592	0,14

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
	Indien: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
31.266	Lupin Ltd	241.881	0,20
10.125	Macrotech Developers Ltd	137.056	0,11
75.654	Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd	168.030	0,14
119.718	Mahindra & Mahindra Ltd	1.657.156	1,35
22.923	Mangalore Refinery & Petrochemicals Ltd	26.298	0,02
66.825	Marico Ltd	404.390	0,33
17.253	Maruti Suzuki India Ltd	1.850.592	1,51
31.347	Max Financial Services Ltd	310.543	0,25
61.722	Max Healthcare Institute Ltd	286.795	0,23
11.097	Minda Industries Ltd	129.719	0,11
5.670	Mindtree Ltd	207.282	0,17
185.976	Motherson Sumi Systems Ltd	278.237	0,23
11.745	Mphasis Ltd	341.177	0,28
351	MRF Ltd	314.681	0,26
14.013	Muthoot Finance Ltd	173.236	0,14
4.698	Nestle India Ltd	1.039.274	0,85
304.560	NHPC Ltd	118.588	0,10
18.468	Nippon Life India Asset Management Ltd	63.433	0,05
97.200	NMDC Ltd	133.173	0,11
576.720	NTPC Ltd	1.043.569	0,85
15.228	Oberoi Realty Ltd	142.239	0,12
479.682	Oil & Natural Gas Corp Ltd	920.521	0,75
42.930	Oil India Ltd	136.717	0,11
12.069	One 97 Communications Ltd	103.264	0,08
2.835	Oracle Financial Services Software Ltd	111.225	0,09
729	Page Industries Ltd	370.779	0,30
20.655	PB Fintech Ltd	149.853	0,12
6.318	Persistent Systems Ltd	272.153	0,22
97.767	Petronet LNG Ltd	269.015	0,22
9.477	PI Industries Ltd	307.150	0,25
19.845	Pidilite Industries Ltd	525.171	0,43
16.524	Piramal Enterprises Ltd	346.434	0,28
3.402	Polycab India Ltd	94.824	0,08
150.093	Power Finance Corp Ltd	198.515	0,16
408.888	Power Grid Corp of India Ltd	1.097.133	0,90
149.121	Punjab National Bank	54.760	0,04
17.901	Rajesh Exports Ltd	141.762	0,12
60.588	RBL Bank Ltd	64.023	0,05
120.366	REC Ltd	188.614	0,15
9.558	Relaxo Footwears Ltd	116.654	0,10
437.319	Reliance Industries Ltd	14.373.702	11,75
37.827	SBI Cards & Payment Services Ltd	367.984	0,30
54.675	SBI Life Insurance Co Ltd	748.824	0,61
1.782	Shree Cement Ltd	428.950	0,35
25.839	Shriram Transport Finance Co Ltd	419.245	0,34
11.664	Siemens Ltd	354.539	0,29
23.004	Sona Blw Precision Forgings Ltd	161.317	0,13
18.306	SRF Ltd	522.065	0,43
10.692	Star Health & Allied Insurance Co Ltd	66.165	0,05
232.308	State Bank of India	1.370.506	1,12
189.054	Steel Authority of India Ltd	164.103	0,13
141.669	Sun Pharmaceutical Industries Ltd	1.490.016	1,22
13.446	Sun TV Network Ltd	70.242	0,06
15.147	Tata Communications Ltd	175.354	0,14
132.840	Tata Consultancy Services Ltd	5.495.604	4,50
78.651	Tata Consumer Products Ltd	703.474	0,57
4.455	Tata Elxsi Ltd	460.917	0,38
239.679	Tata Motors Ltd	1.249.800	1,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE India UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
	Indien: 99,99 % (30. Juni 2021: 101,67 %) (Fortsetzung)		
48.924	Tata Motors Ltd 'A' Shares	122.538	0,10
263.979	Tata Power Co Ltd	675.888	0,55
105.786	Tata Steel Ltd	1.161.439	0,95
66.663	Tata Teleservices Maharashtra Ltd	102.224	0,08
78.894	Tech Mahindra Ltd	999.006	0,82
54.189	Titan Co Ltd	1.332.038	1,09
6.399	Torrent Pharmaceuticals Ltd	231.761	0,19
28.593	Torrent Power Ltd	163.526	0,13
23.652	Trent Ltd	321.704	0,26
12.960	Tube Investments of India Ltd	302.172	0,25
26.001	TVS Motor Co Ltd	277.205	0,23
14.904	UltraTech Cement Ltd	1.058.232	0,86
147.501	Union Bank of India Ltd	63.970	0,05
8.829	United Breweries Ltd	162.421	0,13
37.989	United Spirits Ltd	365.471	0,30
69.822	UPL Ltd	559.124	0,46
26.363	Varun Beverages Ltd	263.905	0,22
159.489	Vedanta Ltd	450.360	0,37
1.021.734	Vodafone Idea Ltd	108.678	0,09
30.213	Voltas Ltd	372.017	0,30
4.131	Whirlpool of India Ltd	81.647	0,07
164.268	Wipro Ltd	865.411	0,71
1.607.040	Yes Bank Ltd	257.419	0,21
107.973	Zee Entertainment Enterprises Ltd	292.722	0,24
179.253	Zomato Ltd	122.230	0,10
		<u>122.404.499</u>	<u>99,99</u>
	Aktien insgesamt	<u>122.404.499</u>	<u>99,99</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>122.404.499</u>	<u>99,99</u>
		Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Anlageportfolio	122.404.499	99,99
	Sonstige Nettverbindlichkeiten	11.919	0,01
	Nettovermögen	<u>122.416.418</u>	<u>100,00</u>
			% des Gesamt- vermö- gens
	Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,26
	Sonstiges Umlaufvermögen		0,74
	Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin FTSE Korea UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %)		
	Aktien: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %)		
	Südkorea: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %)		
10.710	Alteogen Inc	503.990	0,17
11.322	Amorepacific Corp	1.133.595	0,39
4.182	Amorepacific Corp (preferred stock)	163.621	0,06
11.016	AMOREPACIFIC Group	316.464	0,11
2.448	BGF retail Co Ltd	356.340	0,12
112.200	BNK Financial Group Inc	579.838	0,20
36.924	Celltrion Healthcare Co Ltd	1.950.852	0,67
41.616	Celltrion Inc	5.721.239	1,95
7.344	Celltrion Pharm Inc	445.142	0,15
26.520	Cheil Worldwide Inc	485.097	0,17
3.060	CJ CheilJedang Corp	893.207	0,31
612	CJ CheilJedang Corp (preferred stock)	76.359	0,03
4.794	CJ Corp	286.887	0,10
3.978	CJ ENM Co Ltd	287.075	0,10
3.264	CJ Logistics Corp	286.580	0,10
21.624	Coway Co Ltd	1.064.213	0,37
70.584	Daewoo Engineering & Construction Co Ltd	317.476	0,11
18.972	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd	350.684	0,12
17.238	DB Insurance Co Ltd	813.840	0,28
58.650	DGB Financial Group Inc	343.751	0,12
12.036	DL E&C Co Ltd	384.236	0,13
4.590	DL Holdings Co Ltd	250.640	0,09
11.526	Dongsuh Co Inc	232.579	0,08
9.180	Doosan Bobcat Inc	204.330	0,07
151.368	Doosan Heavy Industries & Construction Co Ltd	2.261.660	0,78
4.896	Doosan Solus Co Ltd	170.063	0,06
15.120	Ecopro BM Co Ltd	1.321.719	0,45
7.752	E-MART Inc	629.880	0,22
6.120	F&F Co Ltd	633.965	0,22
19.584	Fila Holdings Corp	423.837	0,15
2.040	Green Cross Corp	264.741	0,09
24.276	GS Engineering & Construction Corp	589.886	0,20
19.584	GS Holdings Corp	631.231	0,22
14.790	GS Retail Co Ltd	292.178	0,10
111.690	Hana Financial Group Inc	3.384.936	1,15
8.160	Hanjin Kal Corp	388.392	0,13
28.560	Hankook Tire & Technology Co Ltd	724.778	0,25
2.856	Hanmi Pharm Co Ltd	677.486	0,23
5.304	Hanmi Science Co Ltd	163.605	0,06
61.710	Hanon Systems	477.654	0,16
3.570	Hanssem Co Ltd	177.345	0,06
13.362	Hanwha Aerospace Co Ltd	501.178	0,17
16.728	Hanwha Corp	333.040	0,11
9.384	Hanwha Corp (preferred stock)	103.713	0,04
103.632	Hanwha Life Insurance Co Ltd	177.589	0,06
44.472	Hanwha Solutions Corp	1.298.128	0,45
16.626	HDC Hyundai Development Co-Engineering & Construction	142.776	0,05
12.036	Helixmith Co Ltd	192.813	0,07
11.526	Hite Jinro Co Ltd	273.414	0,09
34.476	HLB Inc	939.965	0,32
163.608	HMM Co Ltd	3.099.782	1,06
12.036	Hotel Shilla Co Ltd	660.015	0,23
7.140	HYBE Co Ltd	800.116	0,27
5.814	Hyundai Department Store Co Ltd	313.895	0,11
51.612	Hyundai Doosan Infracore Co Ltd	216.243	0,07
28.152	Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	896.554	0,31
7.140	Hyundai Glovis Co Ltd	987.084	0,34
5.610	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	617.860	0,21

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %) (Fortsetzung)		
	Südkorea: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %) (Fortsetzung)		
19.482	Hyundai Heavy Industries Holdings Co Ltd	891.274	0,31
23.052	Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	549.491	0,19
7.752	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	543.906	0,19
23.868	Hyundai Mobis Co Ltd	3.658.142	1,26
53.754	Hyundai Motor Co	7.472.734	2,56
8.466	Hyundai Motor Co (preferred stock)	567.269	0,19
13.668	Hyundai Motor Co (second preferred stock)	922.148	0,32
29.172	Hyundai Steel Co	721.212	0,25
5.916	Hyundai Wia Corp	254.246	0,09
6.528	Iljin Materials Co Ltd	350.935	0,12
98.532	Industrial Bank of Korea	730.035	0,25
117.300	Kakao Corp	6.314.904	2,17
11.118	Kakao Games Corp	420.864	0,14
59.976	KakaoBank Corp	1.397.315	0,48
8.262	Kakaopay Corp	383.066	0,13
40.494	Kangwon Land Inc	792.165	0,27
149.940	KB Financial Group Inc	5.560.390	1,91
1.632	KCC Corp	361.368	0,12
8.568	KEPCO Plant Service & Engineering Co Ltd	253.397	0,09
99.858	Kia Corp	5.945.027	2,04
27.234	Korea Aerospace Industries Ltd	1.128.457	0,39
98.940	Korea Electric Power Corp	1.718.343	0,59
10.200	Korea Gas Corp	310.698	0,11
14.790	Korea Investment Holdings Co Ltd	702.821	0,24
16.728	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	1.209.765	0,42
3.774	Korea Zinc Co Ltd	1.416.994	0,49
67.728	Korean Air Lines Co Ltd	1.314.499	0,45
11.322	Krafton Inc	1.909.672	0,66
41.616	KT&G Cor	2.634.654	0,90
6.834	Kumho Petrochemical Co Ltd	731.613	0,25
8.772	L&F Co Ltd	1.418.762	0,49
18.054	LG Chem Ltd	7.174.880	2,46
2.958	LG Chem Ltd (preferred stock)	547.904	0,19
34.374	LG Corp	2.062.334	0,71
86.598	LG Display Co Ltd	970.426	0,33
41.820	LG Electronics Inc	2.844.043	0,98
6.936	LG Electronics Inc (preferred stock)	226.766	0,08
9.282	LG Energy Solution Ltd	2.652.204	0,91
3.366	LG Household & Health Care Ltd	1.762.847	0,61
816	LG Household & Health Care Ltd (preferred stock)	205.194	0,07
5.406	LG Innotek Co Ltd	1.426.028	0,49
82.110	LG Uplus Corp	806.302	0,28
5.712	Lotte Chemical Corp	791.867	0,27
1.224	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd	164.972	0,06
10.710	Lotte Corp	307.673	0,11
6.732	LOTTE Fine Chemical Co Ltd	339.607	0,12
4.488	Lotte Shopping Co Ltd	359.482	0,12
6.630	LS Corp	324.760	0,11
13.056	Mando Corp	478.137	0,16
1.828	Medytox Inc	155.008	0,05
9.690	Meritz Financial Group Inc	192.919	0,07
56.610	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	165.243	0,06
103.632	Mirae Asset Securities Co Ltd	528.376	0,18
55.794	NAVER Corp	10.313.124	3,54
6.120	NCSOFT Corp	1.647.366	0,57
6.528	Netmarble Corp	346.410	0,12
52.122	NH Investment & Securities Co Ltd	363.296	0,12
6.528	NHN Corp	140.525	0,05

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %) (Fortsetzung)		
	Südkorea: 99,67 % (30. Juni 2021: 99,81 %) (Fortsetzung)		
1.122	NongShim Co Ltd	231.158	0,08
6.936	OCI Co Ltd	766.571	0,26
8.364	Orion Corp	669.945	0,23
510	Ottogi Corp	166.543	0,06
71.400	Pan Ocean Co Ltd	326.645	0,11
17.136	Paradise Co Ltd	178.170	0,06
11.934	Pearl Abyss Corp	469.676	0,16
28.968	POSCO	5.142.579	1,77
10.608	POSCO Chemical Co Ltd	874.196	0,30
18.870	Posco International Corp	279.765	0,10
7.344	S-1 Corp	363.128	0,12
7.140	Samsung Biologics Co Ltd	4.344.270	1,48
32.538	Samsung C&T Corp	3.082.389	1,06
11.832	Samsung Card Co Ltd	277.939	0,10
21.624	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	2.173.392	0,75
1.694.934	Samsung Electronics Co Ltd	74.407.917	25,54
294.984	Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock)	11.813.900	4,06
61.098	Samsung Engineering Co Ltd	1.014.065	0,35
12.750	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	1.973.775	0,68
1.122	Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd (preferred stock)	136.102	0,05
239.088	Samsung Heavy Industries Co Ltd	1.117.733	0,38
24.684	Samsung Life Insurance Co Ltd	1.190.094	0,41
20.298	Samsung SDI Co Ltd	8.316.802	2,85
612	Samsung SDI Co Ltd (preferred stock)	127.264	0,04
13.872	Samsung SDS Co Ltd	1.388.909	0,48
24.480	Samsung Securities Co Ltd	630.665	0,22
12.852	SD Biosensor Inc	384.550	0,13
10.914	Seegene Inc	303.867	0,10
13.260	Shin Poong Pharmaceutical Co Ltd	223.145	0,08
192.372	Shinhan Financial Group Co Ltd	5.489.359	1,87
2.652	Shinsegae Inc	445.268	0,15
496	SillaJen Inc	0	0,00
9.384	SK Biopharmaceuticals Co Ltd	541.329	0,19
7.650	SK Bioscience Co Ltd	592.133	0,20
5.202	SK Chemicals Co Ltd	368.996	0,13
209.304	SK Hynix Inc	14.669.335	5,03
9.894	SK IE Technology Co Ltd	747.537	0,26
13.974	SK Inc	2.313.933	0,79
20.094	SK Innovation Co Ltd	2.971.386	1,01
53.448	SK Networks Co Ltd	172.891	0,06
38.250	SK Square Co Ltd	1.150.387	0,39
17.646	SK Telecom Co Ltd	706.710	0,24
7.344	SKC Co Ltd	752.274	0,26
15.912	S-Oil Corp	1.274.529	0,44
41.310	SSANGYONG C&E Co Ltd	219.531	0,08
6.426	Wemade Co Ltd	285.567	0,10
245.616	Woori Financial Group Inc	2.288.935	0,79
19.482	Yuhan Corp	840.259	0,29
		<u>290.304.928</u>	<u>99,67</u>
	Aktien insgesamt	<u>290.304.928</u>	<u>99,67</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>290.304.928</u>	<u>99,67</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2021: (0,00) %)

Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2021: (0,00) %)*

Nominal- betrag USD	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermö- gens
920.747	0,25	15 of Kospi2 Inx Long Futures Contracts Expiring September 2022	(32.781)	(0,01)
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures).....	(32.781)	(0,01)
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt.....	(32.781)	(0,01)
			Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
		Anlageportfolio	290.272.147	99,66
		Sonstiges Nettovermögen	989.378	0,34
		Nettovermögen	291.261.525	100,00
				% des Gesamt- vermö- gens
		Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,65
		Sonstiges Umlaufvermögen		0,35
		Gesamtvermögen		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 89.394 USD.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,62 %		
	Aktien: 98,62 %		
	Kaimaninseln: 2,95 %		
60	Advanced Energy Solution Holding Co Ltd	1.955	0,09
374	Airtac International Group	12.466	0,60
3.307	Chailease Holding Co Ltd	23.190	1,11
170	Parade Technologies Ltd	6.575	0,32
150	Silergy Corp	12.082	0,58
1.500	Zhen Ding Technology Holding Ltd	5.196	0,25
		61.464	2,95
	Taiwan: 95,67 %		
1.270	Accton Technology Corp	10.187	0,49
7.000	Acer Inc	5.109	0,25
1.000	Advantech Co Ltd	11.637	0,56
8.200	ASE Technology Holding Co Ltd	21.070	1,01
6.000	Asia Cement Corp	8.839	0,42
90	ASMedia Technology Inc	3.375	0,16
77	ASPEED Technology Inc	4.920	0,24
1.700	Asustek Computer Inc	17.753	0,85
21.000	AU Optronics Corp	11.512	0,55
5.000	Capital Securities Corp	2.354	0,11
1.750	Catcher Technology Co Ltd	9.741	0,47
19.800	Cathay Financial Holding Co Ltd	33.895	1,63
16.000	Chang Hwa Commercial Bank Ltd	9.336	0,45
4.300	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	5.119	0,25
1.480	Chicony Electronics Co Ltd	3.688	0,18
7.000	China Airlines Ltd	5.532	0,27
39.000	China Development Financial Holding Corp	19.281	0,93
630	China Motor Corp	1.316	0,06
30.000	China Steel Corp	28.705	1,38
9.150	Chunghwa Telecom Co Ltd	37.544	1,80
10.000	Compal Electronics Inc	7.651	0,37
44.000	CTBC Financial Holding Co Ltd	37.143	1,78
5.210	Delta Electronics Inc	38.812	1,86
2.150	E Ink Holdings Inc	13.630	0,65
31.000	E.Sun Financial Holding Co Ltd	30.235	1,45
480	Eclat Textile Co Ltd	6.708	0,32
166	eMemory Technology Inc	5.778	0,28
1.570	ENNOSTAR Inc	2.677	0,13
2.300	Eternal Materials Co Ltd	2.502	0,12
6.000	Eva Airways Corp	6.387	0,31
6.070	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	17.271	0,83
5.000	Far Eastern International Bank	1.892	0,09
9.469	Far Eastern New Century Corp	10.127	0,49
4.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	11.247	0,54
1.050	Feng TAY Enterprise Co Ltd	6.198	0,30
25.000	First Financial Holding Co Ltd	22.029	1,06
8.300	Formosa Chemicals & Fibre Corp	20.852	1,00
3.280	Formosa Petrochemical Corp	10.347	0,50
11.750	Formosa Plastics Corp	42.877	2,06
150	Formosa Sumco Technology Corp	890	0,04
2.000	Formosa Taffeta Co Ltd	1.793	0,09
2.700	Foxconn Technology Co Ltd	4.477	0,21
17.000	Fubon Financial Holding Co Ltd	34.190	1,64
200	Genius Electronic Optical Co Ltd	2.465	0,12
730	Giant Manufacturing Co Ltd	5.892	0,28
510	Globalwafers Co Ltd	7.770	0,37
670	Hiwin Technologies Corp	5.374	0,26
28.800	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	105.578	5,07
770	Hotai Motor Co Ltd	15.693	0,75
2.000	HTC Corp	3.289	0,16
24.000	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	18.242	0,88

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,62 % (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,62 % (Fortsetzung)		
	Taiwan: 95,67 % (Fortsetzung)		
22.000	Innolux Corp	8.953	0,43
7.000	Inventec Corp	5.921	0,28
250	Largan Precision Co Ltd	14.504	0,70
5.100	Lite-On Technology Corp	9.931	0,48
3.590	MediaTek Inc	78.601	3,77
26.000	Mega Financial Holding Co Ltd	30.868	1,48
1.600	Micro-Star International Co Ltd	6.108	0,29
132	momo.com Inc	2.832	0,14
13.600	Nan Ya Plastics Corp	37.964	1,82
510	Nan Ya Printed Circuit Board Corp	4.468	0,21
2.000	Nanya Technology Corp	3.323	0,16
330	Nien Made Enterprise Co Ltd	3.252	0,16
1.380	Novatek Microelectronics Corp	14.017	0,67
380	OBI Pharma Inc	1.246	0,06
700	Oneness Biotech Co Ltd	4.132	0,20
5.000	Pegatron Corp	9.585	0,46
6.000	Pou Chen Corp	5.953	0,29
1.700	Powertech Technology Inc	5.020	0,24
1.350	President Chain Store Corp	12.372	0,59
6.450	Quanta Computer Inc	17.311	0,83
1.147	Realtek Semiconductor Corp	14.003	0,67
3.800	Ruentex Development Co Ltd	9.381	0,45
8.000	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	14.287	0,69
32.000	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	9.428	0,45
1.260	Sino-American Silicon Products Inc	5.975	0,29
25.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	14.125	0,68
3.300	Synnex Technology International Corp	5.904	0,28
511	Taishin Financial Holding (voting rights)	0	0,00
26.000	Taishin Financial Holding Co Ltd	14.253	0,68
12.000	Taiwan Business Bank	4.661	0,22
13.000	Taiwan Cement Corp	17.270	0,83
24.000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	21.673	1,04
1.780	Taiwan Fertilizer Co Ltd	3.825	0,18
4.000	Taiwan Glass Industry Corp	2.401	0,12
5.000	Taiwan High Speed Rail Corp	4.717	0,23
4.100	Taiwan Mobile Co Ltd	14.892	0,71
690	Taiwan Secom Co Ltd	2.355	0,11
38.600	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	617.944	29,67
5.000	Teco Electric and Machinery Co Ltd	5.020	0,24
690	Transcend Information Inc	1.604	0,08
1.000	U-Ming Marine Transport Corp	1.381	0,07
3.030	Unimicron Technology Corp	16.152	0,78
11.600	Uni-President Enterprises Corp	26.139	1,25
28.260	United Microelectronics Corp	37.210	1,79
2.150	Vanguard International Semiconductor Corp	5.553	0,27
160	Voltronic Power Technology Corp	7.776	0,37
532	Walsin Lihwa Corp (voting rights)	55	0,00
7.610	Walsin Lihwa Corp	9.227	0,44
1.190	Walsin Technology Corp	3.590	0,17
2.000	Wan Hai Lines Ltd	8.004	0,38
1.000	Win Semiconductors Corp	6.474	0,31
7.000	Winbond Electronics Corp	5.109	0,25
7.000	Wistron Corp	6.286	0,30
210	Wiwynn Corp	4.923	0,24
1.110	Yageo Corp	11.498	0,55
4.100	Yang Ming Marine Transport Corp	11.348	0,54

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,62 % (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,62 % (Fortsetzung)		
	Taiwan: 95,67 % (Fortsetzung)		
28.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	18.551	0,89
1.353	Yulon Motor Co Ltd	2.148	0,10
50	Yulon Nissan Motor Co Ltd	382	0,02
		<u>1.992.814</u>	<u>95,67</u>
	Aktien insgesamt	<u>2.054.278</u>	<u>98,62</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>2.054.278</u>	<u>98,62</u>
		Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Anlageportfolio	2.054.278	98,62
	Sonstiges Nettovermögen	28.676	1,38
	Nettovermögen	<u>2.082.954</u>	<u>100,00</u>
			% des Gesamt- vermö- gens
	Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		98,61
	Sonstiges Umlaufvermögen		1,39
	Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten vorliegen.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 88,09 % (30. Juni 2021: 97,16 %)		
	Unternehmensanleihen: 55,75 % (30. Juni 2021: 64,00 %)		
	Australien: null (30. Juni 2021: 0,93 %)		
	Österreich: 0,86 % (30. Juni 2021: 1,03 %)		
1.000.000	Verbund AG 0.90% 01/04/2041	718.482	0,86
		<u>718.482</u>	<u>0,86</u>
	Belgien: 1,28 % (30. Juni 2021: 0,91 %)		
1.400.000	FLUVIUS System Operator CVBA 0.25% 02/12/2030	1.073.374	1,28
		<u>1.073.374</u>	<u>1,28</u>
	Dänemark: 1,81 % (30. Juni 2021: 1,63 %)		
1.800.000	Orsted AS 1.75% 09/12/3019	1.524.267	1,81
		<u>1.524.267</u>	<u>1,81</u>
	Frankreich: 11,73 % (30. Juni 2021: 12,08 %)		
1.200.000	AXA SA 1.38% 07/10/2041	921.384	1,10
1.000.000	BNP Paribas SA 0.38% 14/10/2027	885.423	1,05
1.100.000	CNP Assurances 2.00% 27/07/2050	908.175	1,08
1.300.000	Electricite de France SA 1.00% 13/10/2026	1.230.712	1,46
1.100.000	Engie SA 1.50% Perp	842.282	1,00
1.000.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	832.653	0,99
1.200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	939.395	1,12
1.200.000	Societe Generale SA 0.88% 22/09/2028	1.047.132	1,25
1.000.000	Suez SACA 2.38% 24/05/2030	922.394	1,10
500.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	390.668	0,47
1.100.000	Vinci SA 0.00% 27/11/2028	928.429	1,11
		<u>9.848.647</u>	<u>11,73</u>
	Deutschland: 8,43 % (30. Juni 2021: 9,38 %)		
1.100.000	Bayerische Landesbank 1.00% 23/09/2031	941.294	1,12
800.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 1.38% 16/04/2040	595.513	0,71
1.200.000	Deutsche Bahn Finance GMBH 1.60% Perp	933.498	1,11
1.100.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	903.332	1,08
2.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/06/2029	1.769.598	2,10
1.000.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg 1.50% 03/02/2025	1.090.715	1,30
1.100.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 1.25% 26/05/2041	844.100	1,01
		<u>7.078.050</u>	<u>8,43</u>
	Island: 1,51 % (30. Juni 2021: null)		
1.400.000	Arion Banki HF 0.38% 14/07/2025	1.265.428	1,51
		<u>1.265.428</u>	<u>1,51</u>
	Irland: null (30. Juni 2021: 0,98 %)		
	Indien: 0,80 % (30. Juni 2021: null)		
800.000	Power Finance Corp Ltd 1.84% 21/09/2028	669.040	0,80
		<u>669.040</u>	<u>0,80</u>
	Italien: 5,05 % (30. Juni 2021: 7,02 %)		
1.100.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 02/02/2029	922.597	1,10
1.400.000	ERG SpA 0.50% 11/09/2027	1.228.623	1,46
1.500.000	Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 16/03/2028	1.273.364	1,52
1.000.000	Iren SpA 0.88% 14/10/2029	816.855	0,97
		<u>4.241.439</u>	<u>5,05</u>
	Luxemburg: 2,32 % (30. Juni 2021: 2,12 %)		
350.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	311.870	0,37
1.100.000	Segro Capital Sarl 0.50% 22/09/2031	827.023	0,99
1.000.000	SELP Finance Sarl 0.88% 27/05/2029	804.510	0,96
		<u>1.943.403</u>	<u>2,32</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 88,09 % (30. Juni 2021: 97,16 %) (Fortsetzung)		
	Unternehmensanleihen: 55,75 % (30. Juni 2021: 64,00 %) (Fortsetzung)		
	Niederlande: 13,33 % (30. Juni 2021: 14,19 %)		
1.000.000	Enel Finance International NV 0.38% 17/06/2027	887.040	1,06
1.000.000	Enel Finance International NV 1.00% 20/10/2027	1.012.064	1,21
1.100.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	885.328	1,05
1.000.000	ING Groep NV 1.13% 07/12/2028	973.323	1,16
1.100.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.25% 09/09/2029	895.353	1,07
400.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	364.416	0,43
1.000.000	PostNL NV 0.63% 23/09/2026	921.620	1,10
1.200.000	Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026	1.070.317	1,28
1.000.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	886.074	1,06
400.000	Telefonica Europe BV 2.50% Perp	328.500	0,39
1.200.000	TenneT Holding BV 1.50% 03/06/2039	896.316	1,07
1.000.000	Vestas Wind Systems Finance BV 2.00% 15/06/2034	832.888	0,99
1.000.000	Vesteda Finance BV 1.50% 24/05/2027	935.127	1,11
400.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	297.468	0,35
		<u>11.185.834</u>	<u>13,33</u>
	Portugal: 1,06 % (30. Juni 2021: 1,03 %)		
1.100.000	EDP - Energias de Portugal SA 1.88% 02/08/2081	891.388	1,06
		<u>891.388</u>	<u>1,06</u>
	Spanien: 3,43 % (30. Juni 2021: 5,21 %)		
1.200.000	Banco de Sabadell SA 1.13% 11/03/2027	1.099.608	1,32
1.100.000	CaixaBank SA 0.50% 09/02/2029	909.622	1,08
1.100.000	Iberdrola Finanzas SA 1.58% Perp	866.113	1,03
		<u>2.875.343</u>	<u>3,43</u>
	Schweden: 2,66 % (30. Juni 2021: 3,40 %)		
1.100.000	Telia Co AB 1.38% 11/05/2081	977.038	1,16
600.000	Vattenfall AB 2.50% 29/06/2083	558.283	0,67
600.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	522.377	0,62
200.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	174.126	0,21
		<u>2.231.824</u>	<u>2,66</u>
	Türkei: 0,51 % (30. Juni 2021: 0,56 %)		
500.000	Arcelik AS 3.00% 27/05/2026	427.989	0,51
		<u>427.989</u>	<u>0,51</u>
	Vereinigtes Königreich: 0,97 % (30. Juni 2021: 3,53 %)		
300.000	Co-Operative Group Ltd 5.13% 17/05/2024	325.674	0,39
500.000	Whitbread Group Plc 3.00% 31/05/2031	490.699	0,58
		<u>816.373</u>	<u>0,97</u>
	Unternehmensanleihen insgesamt	<u>46.790.881</u>	<u>55,75</u>
	Staatsanleihen: 32,34 % (30. Juni 2021: 33,16 %)		
	Belgien: 1,77 % (30. Juni 2021: 3,87 %)		
1.600.000	Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 22/04/2033	1.486.803	1,77
		<u>1.486.803</u>	<u>1,77</u>
	Chile: 1,59 % (30. Juni 2021: 1,98 %)		
1.700.000	Chile Government International Bond 0.83% 02/07/2031	1.331.035	1,59
		<u>1.331.035</u>	<u>1,59</u>
	Frankreich: 6,58 % (30. Juni 2021: 7,19 %)		
1.100.000	Bpifrance SACA 0.00% 25/05/2028	994.403	1,18
1.300.000	French Republic Government Bond OAT 1.75% 25/06/2039	1.211.829	1,44
1.900.000	Societe Du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	1.609.693	1,92
1.900.000	Societe Nationale SNCF SA 0.63% 17/04/2030	1.713.095	2,04
		<u>5.529.020</u>	<u>6,58</u>
	Deutschland: 8,54 % (30. Juni 2021: 5,35 %)		
3.200.000	Bundesobligation 0.00% 10/10/2025	3.118.673	3,71
2.700.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030	2.449.070	2,91
2.500.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2050	1.607.858	1,92
		<u>7.175.601</u>	<u>8,54</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens		
	Wertpapiere: 88,09 % (30. Juni 2021: 97,16 %) (Fortsetzung)				
	Staatsanleihen: 32,34 % (30. Juni 2021: 33,16 %) (Fortsetzung)				
	Ungarn: 1,61 % (30. Juni 2021: 1,87 %)				
1.900.000	Hungary Government International Bond 1.75% 05/06/2035	1.348.523	1,61		
		<u>1.348.523</u>	<u>1,61</u>		
	Irland: 3,22 % (30. Juni 2021: 2,92 %)				
2.800.000	Ireland Government Bond 1.35% 18/03/2031	2.703.316	3,22		
		<u>2.703.316</u>	<u>3,22</u>		
	Niederlande: 4,77 % (30. Juni 2021: 8,52 %)				
5.100.000	Netherlands Government Bond 0.50% 15/01/2040	3.999.797	4,77		
		<u>3.999.797</u>	<u>4,77</u>		
	Spanien: 3,43 % (30. Juni 2021: 1,46 %)				
1.300.000	Autonomous Community of Madrid Spain 0.83% 30/07/2027	1.235.965	1,47		
2.300.000	Spain Government Bond 1.00% 30/07/2042	1.644.656	1,96		
		<u>2.880.621</u>	<u>3,43</u>		
	Vereinigtes Königreich: 0,83 % (30. Juni 2021: null)				
700.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	695.455	0,83		
		<u>695.455</u>	<u>0,83</u>		
	Staatsanleihen insgesamt	<u>27.150.171</u>	<u>32,34</u>		
	Wertpapiere insgesamt	<u>73.941.052</u>	<u>88,09</u>		
Derivative Finanzinstrumente: 0,32 % (30. Juni 2021: 0,01 %)					
Terminkontrakte (Futures): 0,08 % (30. Juni 2021: null)*					
Nominal- betrag EUR	Durchschnittlicher Anschaffungskurs EUR	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermö- gens		
(5.234.447)	(125)	42 of Euro-Btp Short Future Futures Contracts Expiring September 2022	63.407		
		Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures)	<u>63.407</u>		
			<u>0,08</u>		
Devisenterminkontrakte: 0,24 % (30. Juni 2021: 0,01 %)					
Abrechnungs- datum	Betrag gekauft	Betrag verkauft	Gegenpartei	Nicht realisierter □ Gewinn/(Verlust) □ EUR	% des Netto- vermö- gens
25.07.2022	EUR 7.081.784	GBP 5.920.000	Citibank	211.894	0,25
25.07.2022	GBP 500.000	EUR 587.010	Citibank	(6.783)	(0,01)
		Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten		<u>211.894</u>	<u>0,25</u>
		Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten		<u>(6.783)</u>	<u>(0,01)</u>
		Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		<u>205.111</u>	<u>0,24</u>
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt		<u>268.518</u>	<u>0,32</u>
			Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens	
		Anlageportfolio	74.209.570	88,41	
		Sonstiges Nettovermögen	9.726.433	11,59	
		Nettovermögen	<u>83.936.003</u>	<u>100,00</u>	
				% des Gesamt- vermö- gens	
		Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)			
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		88,14	
		Börsengehandelte derivative Instrumente		0,25	
		Sonstiges Umlaufvermögen		11,61	
		Gesamtvermögen		<u>100,00</u>	

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 105.974 EUR.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 88,72 % (30. Juni 2021: 91,25 %)		
	Unternehmensanleihen: 44,90 % (30. Juni 2021: 53,65 %)		
	Australien: 1,19 % (30. Juni 2021: 2,10 %)		
1.200.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd 0.25% 17/03/2025	1.158.510	0,17
600.000	Commonwealth Bank of Australia 0.38% 11/04/2024	590.026	0,09
2.093.000	Commonwealth Bank of Australia 0.38% 24/04/2023	2.088.487	0,31
2.000.000	Commonwealth Bank of Australia 1.94% 03/10/2029	1.924.186	0,29
2.300.000	National Australia Bank Ltd 0.63% 10/11/2023	2.269.455	0,33
		<u>8.030.664</u>	<u>1,19</u>
	Österreich: 0,46 % (30. Juni 2021: null)		
1.100.000	BAWAG Group AG 2.38% 26/03/2029	1.067.055	0,16
2.000.000	Hypo Vorarlberg Bank AG 0.63% 19/09/2022	1.999.606	0,30
		<u>3.066.661</u>	<u>0,46</u>
	Belgien: 0,18 % (30. Juni 2021: 0,85 %)		
1.200.000	Belfius Bank SA 0.38% 24/10/2023	1.189.513	0,18
		<u>1.189.513</u>	<u>0,18</u>
	Bermuda: 0,33 % (30. Juni 2021: 0,70 %)		
2.223.000	Bacardi Ltd 2.75% 03/07/2023	2.239.343	0,33
		<u>2.239.343</u>	<u>0,33</u>
	Kanada: 1,47 % (30. Juni 2021: 1,01 %)		
2.200.000	Bank of Montreal 0.10% 20/10/2023	2.172.674	0,32
2.810.000	Bank of Montreal 0.13% 26/03/2023	2.802.146	0,42
1.000.000	Bank of Nova Scotia 0.45% 16/03/2026	953.669	0,14
1.000.000	Royal Bank of Canada 0.25% 02/05/2024	969.680	0,14
3.000.000	Toronto-Dominion Bank 0.00% 27/12/2022	2.996.025	0,45
		<u>9.894.194</u>	<u>1,47</u>
	China: null (30. Juni 2021: 0,67 %)		
	Dänemark: 0,82 % (30. Juni 2021: 2,54 %)		
3.000.000	Danske Bank A/S 1.63% 15/03/2024	2.975.841	0,45
2.500.000	Nykredit Realkredit AS 2.75% 17/11/2027	2.508.240	0,37
		<u>5.484.081</u>	<u>0,82</u>
	Finnland: 0,19 % (30. Juni 2021: 0,84 %)		
1.300.000	OP Corporate Bank Plc 0.38% 26/02/2024	1.272.167	0,19
		<u>1.272.167</u>	<u>0,19</u>
	Frankreich: 6,60 % (30. Juni 2021: 5,62 %)		
2.000.000	Arkea Home Loans SFH SA 0.38% 04/03/2024	1.971.392	0,29
1.500.000	AXA SA 5.13% 04/07/2043	1.546.298	0,23
1.000.000	BNP Paribas SA 1.00% 17/04/2024	981.471	0,15
3.400.000	BNP Paribas SA 1.13% 10/10/2023	3.367.744	0,50
1.000.000	BPCE SA 0.88% 31/01/2024	982.854	0,15
4.000.000	BPCE SA 1.13% 14/12/2022	4.014.624	0,60
1.200.000	BPCE SA 2.75% 30/11/2027	1.203.739	0,18
3.000.000	BPCE SFH SA 0.38% 10/02/2023	3.000.798	0,45
2.700.000	BPCE SFH SA 2.38% 29/11/2023	2.748.603	0,41
1.400.000	Cie de Financement Foncier SA 0.25% 11/04/2023	1.396.707	0,21
1.000.000	Cie de Financement Foncier SA 0.33% 12/09/2023	992.581	0,15
3.500.000	Cie de Financement Foncier SA 0.63% 10/02/2023	3.504.906	0,51
2.500.000	Credit Agricole SA 1.00% 18/09/2025	2.403.693	0,36
1.600.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.88% 05/10/2023	1.584.080	0,24
2.000.000	Engie SA 0.88% 27/03/2024	1.980.200	0,29
3.000.000	HSBC SFH France SA 2.00% 16/10/2023	3.036.897	0,45
2.000.000	L'Oreal SA 0.38% 29/03/2024	1.967.588	0,29
2.900.000	Pernod Ricard SA 0.00% 24/10/2023	2.852.353	0,42
1.000.000	RCI Banque SA 0.50% 14/07/2025	902.291	0,13
4.000.000	Societe Generale SA 1.50% 30/05/2025	3.949.728	0,59
		<u>44.388.547</u>	<u>6,60</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 88,72 % (30. Juni 2021: 91,25 %) (Fortsetzung)		
	Unternehmensanleihen: 44,90 % (30. Juni 2021: 53,65 %) (Fortsetzung)		
	Deutschland: 4,14 % (30. Juni 2021: 2,94 %)		
1.000.000	Aareal Bank AG 0.13% 01/02/2023	998.799	0,15
3.600.000	Allianz SE 5.63% 17/10/2042	3.646.058	0,54
2.000.000	Commerzbank AG 0.50% 13/09/2023	1.961.064	0,29
500.000	DZ HYP AG 0.13% 01/03/2024	491.230	0,07
700.000	DZ HYP AG 0.25% 30/06/2023	696.275	0,10
2.104.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/12/2022	2.103.891	0,31
13.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.13% 07/06/2023	12.962.690	1,94
3.000.000	Natixis Pfandbriefbank AG 0.50% 23/05/2025	2.910.008	0,43
792.000	Peach Property Finance GmbH 3.50% 15/02/2023	680.358	0,10
1.500.000	Volkswagen Financial Services AG 0.25% 31/01/2025	1.407.675	0,21
		<u>27.858.048</u>	<u>4,14</u>
	Guernsey: null (30. Juni 2021: 0,68 %)		
	Island: 0,58 % (30. Juni 2021: 2,53 %)		
600.000	Arion Banki HF 0.38% 14/07/2025	542.326	0,08
2.400.000	Arion Banki HF 1.00% 20/03/2023	2.389.351	0,36
1.000.000	Landsbankinn HF 0.50% 20/05/2024	952.365	0,14
		<u>3.884.042</u>	<u>0,58</u>
	Italien: 2,39 % (30. Juni 2021: 2,63 %)		
2.000.000	Assicurazioni Generali SpA 7.75% 12/12/2042	2.046.734	0,30
1.200.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	1.196.330	0,18
2.700.000	Enel SpA 2.50% Perp	2.605.500	0,39
2.500.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 0.88% 07/12/2023	2.477.266	0,37
3.500.000	Intesa Sanpaolo SpA 1.00% 27/01/2023	3.512.642	0,53
2.000.000	Intesa Sanpaolo SpA 1.50% 10/04/2024	1.982.010	0,29
750.000	Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 12/04/2023	751.011	0,11
1.500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.45% 15/09/2027	1.504.892	0,22
		<u>16.076.385</u>	<u>2,39</u>
	Japan: 1,04 % (30. Juni 2021: 1,52 %)		
2.000.000	Asahi Group Holdings Ltd 0.01% 19/04/2024	1.933.328	0,29
1.000.000	Asahi Group Holdings Ltd 0.16% 23/10/2024	955.720	0,14
3.000.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 0.68% 26/01/2023	3.002.216	0,44
700.000	NTT Finance Corp 0.08% 13/12/2025	651.054	0,10
500.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.01% 10/09/2025	472.559	0,07
		<u>7.014.877</u>	<u>1,04</u>
	Luxemburg: 3,79 % (30. Juni 2021: 2,54 %)		
1.200.000	CNH Industrial Finance Europe SA 0.00% 01/04/2024	1.163.092	0,17
12.185.000	European Financial Stability Facility 1.88% 23/05/2023	12.332.706	1,84
1.828.000	European Investment Bank 0.05% 24/05/2024	1.793.036	0,27
5.643.000	European Investment Bank 2.13% 15/01/2024	5.747.136	0,85
1.000.000	Logicor Financing Sarl 0.75% 15/07/2024	948.813	0,14
1.500.000	Segro Capital Sarl 1.25% 23/03/2026	1.396.725	0,21
1.600.000	SELP Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	1.569.920	0,23
600.000	Vivion Investments Sarl 3.00% 08/08/2024	519.990	0,08
		<u>25.471.418</u>	<u>3,79</u>
	Niederlande: 4,68 % (30. Juni 2021: 6,82 %)		
2.000.000	ABB Finance BV 0.49% 31/03/2024	2.013.220	0,30
1.500.000	American Medical Systems Europe BV 0.75% 08/03/2025	1.438.472	0,21
2.200.000	ATF Netherlands BV 3.75% Perp	1.936.440	0,29
200.000	ATF Netherlands BV Company 3.75% Perp	176.040	0,03
1.200.000	CTP NV 0.88% 20/01/2026	1.005.083	0,15
2.005.000	Deutsche Telekom International Finance BV 0.63% 01/12/2022	2.007.314	0,30
1.000.000	Enel Finance International NV 1.00% 16/09/2024	978.805	0,15
750.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 1.25% 29/03/2026	719.897	0,11
1.500.000	ING Groep NV 1.00% 20/09/2023	1.491.252	0,22
900.000	ING Groep NV 1.25% 16/02/2027	837.395	0,12
2.500.000	ING Groep NV 3.00% 11/04/2028	2.506.274	0,37
3.000.000	Nationale-Nederlanden Bank NV 0.25% 27/02/2024	2.951.019	0,43

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 88,72 % (30. Juni 2021: 91,25 %) (Fortsetzung)		
	Unternehmensanleihen: 44,90 % (30. Juni 2021: 53,65 %) (Fortsetzung)		
	Niederlande: 4,68 % (30. Juni 2021: 6,82 %) (Fortsetzung)		
2.500.000	NN Group NV 4.63% 08/04/2044	2.494.827	0,37
1.200.000	Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.00% 04/06/2024	1.166.391	0,17
1.000.000	Novo Nordisk Finance Netherlands BV 0.75% 31/03/2025	976.232	0,15
2.000.000	Stellantis NV 3.38% 07/07/2023	2.025.452	0,30
800.000	Telefonica Europe BV 3.00% Perp	774.480	0,12
2.200.000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 0.00% 18/11/2023	2.156.483	0,32
500.000	Upjohn Finance BV 1.02% 23/06/2024	480.368	0,07
2.200.000	Volkswagen International Finance NV 2.70% Perp	2.171.532	0,32
1.200.000	Volkswagen International Finance NV 5.13% Perp	1.200.622	0,18
		<u>31.507.598</u>	<u>4,68</u>
	Neuseeland: 1,39 % (30. Juni 2021: 0,85 %)		
3.500.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd 0.13% 22/09/2023	3.463.221	0,52
2.000.000	ASB Finance Ltd 0.13% 18/10/2023	1.975.142	0,29
1.000.000	BNZ International Funding Ltd 0.63% 03/07/2025	968.972	0,14
3.000.000	Westpac Securities NZ Ltd 0.50% 17/01/2024	2.967.272	0,44
		<u>9.374.607</u>	<u>1,39</u>
	Norwegen: 0,76 % (30. Juni 2021: 0,86 %)		
700.000	DNB Bank ASA 1.13% 20/03/2028	690.597	0,10
2.000.000	DNB Bank ASA 1.63% 31/05/2026	1.954.384	0,29
500.000	DNB Boligkreditt AS 1.88% 21/11/2022	503.512	0,07
2.000.000	Sparebank 1 Oestlandet 0.88% 13/03/2023	1.996.897	0,30
		<u>5.145.390</u>	<u>0,76</u>
	Portugal: 0,15 % (30. Juni 2021: null)		
1.000.000	Caixa Geral de Depositos SA 5.75% 28/06/2028	993.763	0,15
		<u>993.763</u>	<u>0,15</u>
	Singapur: 0,43 % (30. Juni 2021: null)		
3.000.000	United Overseas Bank Ltd 0.39% 17/03/2025	2.903.905	0,43
		<u>2.903.905</u>	<u>0,43</u>
	Spanien: 1,75 % (30. Juni 2021: 2,39 %)		
1.100.000	Abanca Corp Bancaria SA 6.13% 18/01/2029	1.097.203	0,16
400.000	Banco de Sabadell SA 1.75% 10/05/2024	387.298	0,06
1.500.000	Banco de Sabadell SA 5.38% 12/12/2028	1.502.055	0,22
2.200.000	Banco Santander SA 0.10% 26/01/2025	2.135.036	0,32
200.000	CaixaBank SA 1.00% 14/03/2023	200.624	0,03
2.500.000	CaixaBank SA 1.13% 12/01/2023	2.502.272	0,37
1.500.000	CaixaBank SA 2.75% 14/07/2028	1.480.646	0,22
2.500.000	Ibercaja Banco SA 0.25% 18/10/2023	2.470.870	0,37
		<u>11.776.004</u>	<u>1,75</u>
	Schweden: 2,12 % (30. Juni 2021: 2,20 %)		
1.997.000	Heimstaden Bostad AB 2.13% 05/09/2023	1.960.235	0,29
1.300.000	Heimstaden Bostad AB 3.25% Perp	789.919	0,12
2.500.000	SBAB Bank AB 1.88% 10/12/2025	2.457.896	0,37
2.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.75% 28/06/2027	1.894.979	0,27
600.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.38% 31/10/2028	587.712	0,09
1.800.000	Svenska Handelsbanken AB 1.25% 02/03/2028	1.788.026	0,27
2.800.000	Swedbank AB 0.25% 07/11/2022	2.800.309	0,41
1.000.000	Swedbank Hypotek AB 0.40% 08/05/2024	983.625	0,15
1.000.000	Swedbank Hypotek AB 0.45% 23/08/2023	994.471	0,15
		<u>14.257.172</u>	<u>2,12</u>
	Schweiz: 1,19 % (30. Juni 2021: 1,21 %)		
3.500.000	Credit Suisse AG 0.86% 31/05/2024	3.512.750	0,51
1.600.000	Credit Suisse AG 1.00% 07/06/2023	1.591.178	0,24
3.000.000	UBS Group AG 1.00% 21/03/2025	2.930.310	0,44
		<u>8.034.238</u>	<u>1,19</u>
	Vereinigtes Königreich: 4,94 % (30. Juni 2021: 5,61 %)		
1.900.000	Barclays Plc 0.63% 14/11/2023	1.897.990	0,28
1.000.000	Barclays Plc 2.00% 07/02/2028	988.654	0,15
3.990.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 0.13% 12/05/2023	3.962.656	0,58

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 88,72 % (30. Juni 2021: 91,25 %) (Fortsetzung)		
	Unternehmensanleihen: 44,90 % (30. Juni 2021: 53,65 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigtes Königreich: 4,94 % (30. Juni 2021: 5,61 %) (Fortsetzung)		
2.000.000	HSBC Holdings Plc 0.32% 05/10/2023	2.000.262	0,30
800.000	HSBC Holdings Plc 5.25% Perp	790.480	0,12
400.000	Lloyds Banking Group Plc 0.61% 21/06/2024	403.078	0,06
4.000.000	Lloyds Banking Group Plc 0.63% 15/01/2024	3.984.811	0,59
3.914.000	National Westminster Bank Plc 0.50% 15/05/2024	3.851.627	0,57
2.226.000	Nationwide Building Society 0.50% 23/02/2024	2.199.021	0,33
3.000.000	Nationwide Building Society 0.75% 26/10/2022	3.007.209	0,45
3.000.000	Santander UK Plc 0.10% 12/05/2024	2.932.065	0,44
2.500.000	Smiths Group Plc 1.25% 28/04/2023	2.490.043	0,37
1.300.000	Standard Chartered Plc 3.63% 23/11/2022	1.312.318	0,20
2.700.000	Thames Water Utilities Finance Plc 0.19% 23/10/2023	2.636.070	0,39
800.000	Vodafone Group Plc 3.10% 03/01/2019	766.319	0,11
		<u>33.222.603</u>	<u>4,94</u>
	Vereinigte Staaten: 4,31 % (30. Juni 2021: 6,61 %)		
1.500.000	AbbVie Inc 1.50% 15/11/2023	1.494.973	0,22
2.750.000	Apple Inc 1.00% 10/11/2022	2.757.747	0,41
3.000.000	Apple Inc 1.38% 17/01/2024	3.007.565	0,46
2.000.000	AT&T Inc 1.95% 15/09/2023	2.011.438	0,30
1.500.000	Bank of America Corp 0.24% 25/04/2024	1.499.294	0,22
2.500.000	Bank of America Corp 0.75% 26/07/2023	2.482.053	0,37
2.700.000	Citigroup Inc 0.75% 26/10/2023	2.667.244	0,39
900.000	Citigroup Inc 2.38% 22/05/2024	903.512	0,13
400.000	Fiserv Inc 0.38% 01/07/2023	394.828	0,06
600.000	Fiserv Inc 0.38% 01/07/2023	592.242	0,09
1.700.000	Goldman Sachs Group Inc 0.43% 26/09/2023	1.700.199	0,25
700.000	Goldman Sachs Group Inc 0.56% 30/04/2024	700.402	0,10
400.000	Goldman Sachs Group Inc 1.38% 26/07/2022	400.302	0,06
2.000.000	JPMorgan Chase & Co 2.75% 01/02/2023	2.023.298	0,30
1.000.000	Kraft Heinz Foods Co 2.00% 30/06/2023	1.001.536	0,15
1.000.000	Morgan Stanley 2.10% 08/05/2026	980.903	0,15
1.000.000	National Grid North America Inc 0.41% 20/01/2026	916.565	0,14
3.000.000	Stryker Corp 1.13% 30/11/2023	2.978.856	0,44
500.000	Utah Acquisition Sub Inc 2.25% 22/11/2024	485.823	0,07
		<u>28.998.780</u>	<u>4,31</u>
	Unternehmensanleihen insgesamt	<u>302.084.000</u>	<u>44,90</u>
	Staatsanleihen: 43,42 % (30. Juni 2021: 36,82 %)		
	Belgien: 4,76 % (30. Juni 2021: 3,44 %)		
10.000.000	Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 08/09/2022	10.008.716	1,49
10.000.000	Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 12/01/2023	10.005.550	1,49
12.000.000	Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 09/03/2023	11.984.973	1,78
		<u>31.999.239</u>	<u>4,76</u>
	Zypern: 0,06 % (30. Juni 2021: 0,73 %)		
400.000	Cyprus Government International Bond 3.75% 26/07/2023	410.314	0,06
		<u>410.314</u>	<u>0,06</u>
	Frankreich: 8,15 % (30. Juni 2021: 5,06 %)		
18.000.000	France Treasury Bill BTF 0.00% 10/08/2022	18.011.014	2,68
20.000.000	France Treasury Bill BTF 0.00% 30/11/2022	20.013.335	2,97
15.707.385	French Republic Government Bond OAT 0.25% 25/07/2024	16.814.756	2,50
		<u>54.839.105</u>	<u>8,15</u>
	Deutschland: 11,55 % (30. Juni 2021: 11,44 %)		
20.000.000	Bundesschatzanweisungen 0.00% 10/10/2025	19.491.707	2,90
20.000.000	Bundesschatzanweisungen 0.00% 15/03/2024	19.825.700	2,95
32.258.112	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.10% 15/04/2023	33.495.533	4,98
5.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.25% 30/06/2025	4.868.301	0,72
		<u>77.681.241</u>	<u>11,55</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 88,72 % (30. Juni 2021: 91,25 %) (Fortsetzung)		
	Staatsanleihen: 43,42 % (30. Juni 2021: 36,82 %) (Fortsetzung)		
	Griechenland: 0,21 % (30. Juni 2021: 0,71 %)		
1.400.000	Hellenic Republic Government Bond 3.50% 30/01/2023	1.422.070	0,21
		<u>1.422.070</u>	<u>0,21</u>
	Island: 0,07 % (30. Juni 2021: 0,84 %)		
500.000	Iceland Government International Bond 0.50% 20/12/2022	500.103	0,07
		<u>500.103</u>	<u>0,07</u>
	Indonesien: 0,67 % (30. Juni 2021: 2,05 %)		
500.000	Indonesia Government International Bond 2.15% 18/07/2024	496.250	0,07
4.000.000	Indonesia Government International Bond 2.63% 14/06/2023	4.042.540	0,60
		<u>4.538.790</u>	<u>0,67</u>
	Italien: 4,46 % (30. Juni 2021: 5,85 %)		
15.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0.00% 14/11/2022	14.994.438	2,23
15.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0.00% 14/12/2022	14.990.565	2,23
		<u>29.985.003</u>	<u>4,46</u>
	Niederlande: 3,05 % (30. Juni 2021: 4,19 %)		
20.000.000	Netherlands Government Bond 2.00% 15/07/2024	20.520.380	3,05
		<u>20.520.380</u>	<u>3,05</u>
	Polen: 0,15 % (30. Juni 2021: 1,35 %)		
1.000.000	Republic of Poland Government International Bond 0.00% 07/07/2023	989.020	0,15
		<u>989.020</u>	<u>0,15</u>
	Rumänien: 0,67 % (30. Juni 2021: 0,37 %)		
4.500.000	Romanian Government International Bond 2.88% 28/10/2024	4.504.020	0,67
		<u>4.504.020</u>	<u>0,67</u>
	Spanien: 9,62 % (30. Juni 2021: 0,89 %)		
1.300.000	Autonomous Community of Madrid Spain 2.88% 17/07/2023	1.327.697	0,20
10.000.000	Instituto de Credito Oficial 1.30% 31/10/2026	9.873.521	1,47
15.024.521	Spain Government Inflation Linked Bond 1.80% 30/11/2024	16.552.665	2,46
20.000.000	Spain Letras del Tesoro 0.00% 07/10/2022	20.008.393	2,96
17.000.000	Spain Letras del Tesoro 0.00% 09/12/2022	16.999.253	2,53
		<u>64.761.529</u>	<u>9,62</u>
	Staatsanleihen insgesamt	<u>292.150.814</u>	<u>43,42</u>
	Hypothekenbesicherte Wertpapiere: 0,10 % (30. Juni 2021: 0,78 %)		
	Irland: 0,10 % (30. Juni 2021: 0,78 %)		
689.871	Primrose Residential 2021-1 DAC 0.24% 24/03/2061	685.456	0,10
		<u>685.456</u>	<u>0,10</u>
	Hypothekenbesicherte Wertpapiere insgesamt	<u>685.456</u>	<u>0,10</u>
	Kurzfristige Anlagen: 0,30 % (30. Juni 2021: null)		
	Finnland: 0,30 % (30. Juni 2021: null)		
2.000.000	Op Corporate Bank Plc 0.00% 06/01/2023	1.997.878	0,30
		<u>1.997.878</u>	<u>0,30</u>
	Kurzfristige Anlagen insgesamt	<u>1.997.878</u>	<u>0,30</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>596.918.148</u>	<u>88,72</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: 0,06 % (30. Juni 2021: (0,03) %)

Terminkontrakte (Futures): 0,06 % (30. Juni 2021: (0,03) %)*

Nominal- betrag EUR	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs EUR		Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermö- gens
(67.154.416)	(124)	540 of Euro-Bobl Short Futures Contracts Expiring September 2022	91.816	0,01
(174.974.730)	(109)	1600 of Euro-Schatz Short Futures Contracts Expiring September 2022	342.730	0,05
		Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures)	434.546	0,06
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	434.546	0,06
			Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
		Anlageportfolio	597.352.694	88,78
		Sonstiges Nettovermögen	75.492.357	11,22
		Nettovermögen	672.845.051	100,00
				% des Gesamt- vermö- gens
		Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		88,71
		Börsengehandelte derivative Instrumente		0,06
		Sonstiges Umlaufvermögen		11,23
		Gesamtvermögen		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 910.641 EUR.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 96,38 % (30. Juni 2021: 98,22 %)		
	Unternehmensanleihen: 93,32 % (30. Juni 2021: 98,22 %)		
	Österreich: 0,62 % (30. Juni 2021: 0,61 %)		
100.000	Suzano Austria GmbH 3.75% 15/01/2031	81.021	0,62
		<u>81.021</u>	<u>0,62</u>
	Kanada: 1,41 % (30. Juni 2021: 4,69 %)		
200.000	Toronto-Dominion Bank 1.15% 12/06/2025	184.715	1,41
		<u>184.715</u>	<u>1,41</u>
	Frankreich: 3,60 % (30. Juni 2021: 6,75 %)		
125.000	AXA SA 8.60% 15/12/2030	146.791	1,12
200.000	BNP Paribas SA 3.38% 09/01/2025	195.564	1,49
100.000	Orange SA 9.00% 01/03/2031	129.182	0,99
		<u>471.537</u>	<u>3,60</u>
	Italien: 1,32 % (30. Juni 2021: null)		
200.000	UniCredit SpA 1.98% 03/06/2027	173.238	1,32
		<u>173.238</u>	<u>1,32</u>
	Japan: 1,14 % (30. Juni 2021: 1,18 %)		
200.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.18% 09/07/2050	150.019	1,14
		<u>150.019</u>	<u>1,14</u>
	Niederlande: 2,72 % (30. Juni 2021: 1,63 %)		
200.000	EDP Finance BV 1.71% 24/01/2028	171.870	1,31
200.000	Enel Finance International NV 3.50% 06/04/2028	185.051	1,41
		<u>356.921</u>	<u>2,72</u>
	Norwegen: 1,03 % (30. Juni 2021: 0,95 %)		
150.000	Aker BP ASA 3.75% 15/01/2030	134.525	1,03
		<u>134.525</u>	<u>1,03</u>
	Spanien: 0,77 % (30. Juni 2021: 0,76 %)		
90.000	Telefonica Emisiones SA 7.05% 20/06/2036	100.602	0,77
		<u>100.602</u>	<u>0,77</u>
	Schweiz: 1,69 % (30. Juni 2021: 1,64 %)		
250.000	Credit Suisse Group AG 4.19% 01/04/2031	221.445	1,69
		<u>221.445</u>	<u>1,69</u>
	Vereinigtes Königreich: 4,44 % (30. Juni 2021: 6,30 %)		
165.000	AstraZeneca Plc 4.38% 16/11/2045	159.200	1,21
200.000	Coca-Cola Europacific Partners Plc 0.50% 05/05/2023	194.474	1,49
250.000	HSBC Holdings Plc 1.65% 18/04/2026	229.349	1,75
		<u>583.023</u>	<u>4,45</u>
	Vereinigte Staaten: 74,57 % (30. Juni 2021: 70,57 %)		
100.000	AbbVie Inc 4.25% 21/11/2049	88.944	0,68
135.000	Aflac Inc 4.75% 15/01/2049	130.545	1,00
125.000	Allstate Corp 4.20% 15/12/2046	113.976	0,87
200.000	American Express Co 3.30% 03/05/2027	192.534	1,46
165.000	Amgen Inc 2.45% 21/02/2030	144.038	1,10
150.000	Anheuser-Busch Co LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.70% 01/02/2036	143.946	1,10
185.000	Anthem Inc 4.10% 01/03/2028	183.247	1,40
175.000	Apple Inc 2.70% 05/08/2051	130.909	1,00
150.000	Archer-Daniels-Midland Co 2.90% 01/03/2032	135.467	1,03
250.000	AT&T Inc 3.50% 01/06/2041	200.035	1,52
145.000	Baker Hughes Holdings LLC 4.08% 15/12/2047	122.881	0,94
300.000	Bank of America Corp 4.18% 25/11/2027	291.833	2,22
120.000	Berkshire Hathaway Energy Co 6.13% 01/04/2036	132.779	1,01
116.000	Bristol-Myers Squibb Co 5.00% 15/08/2045	120.767	0,92
100.000	Brixmor Operating Partnership LP 4.13% 15/05/2029	93.251	0,71
100.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 5.75% 01/05/2040	109.930	0,84
175.000	Carrier Global Corp 3.58% 05/04/2050	132.825	1,01
120.000	Caterpillar Inc 2.60% 09/04/2030	108.716	0,83

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

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

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 96,38 % (30. Juni 2021: 98,22 %) (Fortsetzung)		
	Unternehmensanleihen: 93,32 % (30. Juni 2021: 98,22 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 74,57 % (30. Juni 2021: 70,57 %) (Fortsetzung)		
100.000	Centene Corp 3.38% 15/02/2030	85.092	0,65
150.000	Charter Communications Operating LLC 2.80% 01/04/2031	120.284	0,92
50.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.88% 31/03/2025	51.251	0,39
240.000	Cigna Corp 3.05% 15/10/2027	225.701	1,71
50.000	Citigroup Inc 3.35% 24/04/2025	49.015	0,37
290.000	Citigroup Inc 3.67% 24/07/2028	274.023	2,09
125.000	Comcast Corp 4.95% 15/10/20	125.179	0,96
150.000	ConocoPhillips Co 3.80% 15/03/2052	128.694	0,98
150.000	Costco Wholesale Corp 1.75% 20/04/2032	123.574	0,94
145.000	CSX Corp 3.25% 01/06/2027	139.262	1,06
205.000	CVS Health Corp 5.30% 05/12/2043	205.154	1,57
75.000	Devon Energy Corp 5.00% 15/06/2045	69.717	0,53
185.000	Dominion Energy Inc 3.90% 01/10/2025	184.159	1,41
130.000	Duke Energy Corp 4.80% 15/12/2045	118.963	0,91
100.000	DuPont de Nemours Inc 5.42% 15/11/2048	99.543	0,76
150.000	Ecolab Inc 2.70% 15/12/2051	107.134	0,82
100.000	ERP Operating LP 4.50% 01/07/2044	95.295	0,73
190.000	Essex Portfolio LP 2.65% 15/03/2032	157.961	1,21
175.000	Exelon Corp 4.05% 15/04/2030	168.110	1,28
170.000	FedEx Corp 4.75% 15/11/2045	156.169	1,19
125.000	Fidelity National Information Services Inc 2.25% 01/03/2031	101.583	0,78
200.000	Fiserv Inc 3.20% 01/07/2026	189.755	1,45
200.000	Goldman Sachs Group Inc 4.25% 21/10/2025	198.779	1,52
210.000	Home Depot Inc 3.35% 15/04/2050	171.001	1,30
140.000	Honeywell International Inc 1.95% 01/06/2030	120.337	0,92
50.000	John Deere Capital Corp 3.90% 07/06/2032	49.474	0,38
230.000	JPMorgan Chase & Co 3.38% 01/05/2023	230.107	1,75
250.000	JPMorgan Chase & Co 2.52% 22/04/2031	213.152	1,63
60.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.50% 01/03/2044	56.330	0,43
125.000	Kraft Heinz Foods Co 4.25% 01/03/2031	119.008	0,91
135.000	MDC Holdings Inc 2.50% 15/01/2031	99.779	0,76
120.000	MetLife Inc 6.40% 15/12/2036	120.980	0,92
275.000	Microsoft Corp 2.53% 01/06/2050	202.897	1,55
70.000	Mohawk Industries Inc 3.63% 15/05/2030	62.533	0,48
215.000	Morgan Stanley 3.59% 22/07/2028	203.720	1,55
170.000	MPLX LP 4.13% 01/03/2027	164.511	1,26
150.000	Netflix Inc 5.75% 01/03/2024	152.493	1,16
70.000	PulteGroup Inc 5.00% 15/01/2027	70.053	0,53
100.000	Regeneron Pharmaceuticals Inc 1.75% 15/09/2030	80.273	0,61
240.000	RELX Capital Inc 3.00% 22/05/2030	215.943	1,65
30.000	S&P Global Inc 4.75% 01/08/2028	30.516	0,23
205.000	ServiceNow Inc 1.40% 01/09/2030	160.617	1,23
150.000	Simon Property Group LP 3.38% 01/12/2027	140.950	1,08
175.000	SVB Financial Group 3.13% 05/06/2030	150.752	1,15
200.000	Thermo Fisher Scientific Inc 1.22% 18/10/2024	189.698	1,45
230.000	T-Mobile USA Inc 3.75% 15/04/2027	221.658	1,69
135.000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 7.85% 01/02/2026	149.248	1,14
205.000	UnitedHealth Group Inc 3.05% 15/05/2041	165.585	1,26
265.000	Verizon Communications Inc 3.40% 22/03/2041	216.197	1,65
165.000	Vistra Operations Co LLC 3.55% 15/07/2024	159.426	1,22
110.000	WRKCo Inc 3.90% 01/06/2028	106.142	0,81
		<u>9.774.400</u>	<u>74,57</u>
	Unternehmensanleihen insgesamt	<u>12.231.446</u>	<u>93,32</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

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

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 96,38 % (30. Juni 2021: 98,22 %) (Fortsetzung)		
	Staatsanleihen: 3,06 % (30. Juni 2021: null)		
	Vereinigte Staaten: 3,06 % (30. Juni 2021: null)		
400.000	United States Treasury Floating Rate Note 1.74% 31/01/2024	400.466	3,06
	Staatsanleihen insgesamt	<u>400.466</u>	<u>3,06</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>12.631.912</u>	<u>96,38</u>
		Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Anlageportfolio	12.631.912	96,38
	Sonstiges Nettovermögen	474.006	3,62
	Nettovermögen	<u>13.105.918</u>	<u>100,00</u>
			% des Gesamt- vermö- gens
	Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		96,36
	Sonstiges Umlaufvermögen		3,64
	Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,53 %)		
	Aktien: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,52 %)		
	Bermuda: 0,85 % (30. Juni 2021: 0,99 %)		
3.000	CK Infrastructure Holdings Ltd	18.389	0,36
9.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	7.616	0,15
664	Orient Overseas International Ltd	17.601	0,34
		<u>43.606</u>	<u>0,85</u>
	Kaimaninseln: 8,88 % (30. Juni 2021: 12,13 %)		
402	360 DigiTech Inc ADR	6.955	0,14
9.000	China Conch Venture Holdings Ltd	19.613	0,38
21.000	China Feihe Ltd	24.139	0,47
14.500	China Hongqiao Group Ltd	16.390	0,32
5.000	China Lesso Group Holdings Ltd	7.544	0,15
9.000	China Medical System Holdings Ltd	14.039	0,27
7.800	China Overseas Property Holdings Ltd	8.399	0,16
16.000	China Resources Cement Holdings Ltd	10.746	0,21
7.600	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	14.295	0,28
12.000	CK Asset Holdings Ltd	84.874	1,65
13.000	Dali Foods Group Co Ltd	6.908	0,13
163	Daqo New Energy Corp ADR	11.635	0,23
3.000	Haitian International Holdings Ltd	7.665	0,15
3.500	Hengan International Group Co Ltd	16.436	0,32
4.000	Kingboard Holdings Ltd	15.140	0,29
6.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd	7.402	0,14
190	Parade Technologies Ltd	7.349	0,14
8.000	Seazen Group Ltd	3.956	0,08
26.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	16.468	0,32
8.000	SITC International Holdings Co Ltd	22.632	0,44
10.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	17.128	0,33
8.000	Topsports International Holdings Ltd	7.269	0,14
6.000	Uni-President China Holdings Ltd	5.146	0,10
1.878	Vipshop Holdings Ltd ADR	18.573	0,36
28.000	Want Want China Holdings Ltd	24.336	0,47
40.000	WH Group Ltd	30.891	0,60
10.000	Xinyi Glass Holdings Ltd	23.984	0,47
2.000	Yihai International Holding Ltd	7.213	0,14
		<u>457.125</u>	<u>8,88</u>
	China: 29,90 % (30. Juni 2021: 25,58 %)		
26.200	Agricultural Bank of China Ltd 'A' Shares	11.802	0,23
175.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H' Shares	66.013	1,28
3.000	A-Living Smart City Services Co Ltd	4.825	0,09
1.600	Anhui Conch Cement Co Ltd 'A' Shares	8.420	0,16
9.000	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H' Shares	38.996	0,76
400	Anhui Gujing Distillery Co Ltd	6.239	0,12
7.000	Bank of Beijing Co Ltd	4.740	0,09
900	Bank of Chengdu Co Ltd	2.226	0,04
6.200	Bank of China Ltd 'A' Shares	3.015	0,06
270.000	Bank of China Ltd 'H' Shares	107.698	2,09
13.500	Bank of Communications Co Ltd 'A' Shares	10.028	0,19
54.000	Bank of Communications Co Ltd 'H' Shares	37.299	0,72
4.190	Bank of Jiangsu Co Ltd	4.450	0,09
3.000	Bank of Nanjing Co Ltd	4.663	0,09
4.070	Bank of Shanghai Co Ltd	3.976	0,08
7.300	Baoshan Iron & Steel Co Ltd	6.555	0,13
500	Beijing New Building Materials Plc	2.582	0,05
100	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd	2.316	0,05
600	By-health Co Ltd	1.938	0,04
49.000	China Cinda Asset Management Co Ltd	7.681	0,15
57.000	China CITIC Bank Corp Ltd	25.497	0,50
9.000	China Coal Energy Co Ltd	7.627	0,15

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,53 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,52 %) (Fortsetzung)		
	China: 29,90 % (30. Juni 2021: 25,58 %) (Fortsetzung)		
12.000	China Communications Services Corp Ltd	5.276	0,10
700	China Construction Bank Corp 'A' Shares	633	0,01
151.000	China Construction Bank Corp 'H' Shares	101.411	1,97
12.600	China Everbright Bank Co Ltd 'A' Shares	5.657	0,11
19.000	China Everbright Bank Co Ltd 'H' Shares	6.150	0,12
10.900	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A' Shares	6.048	0,12
33.000	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' Shares	11.775	0,23
20.000	China National Building Material Co Ltd	21.359	0,42
8.300	China Petroleum & Chemical Corp 'A' Shares	5.051	0,10
130.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H' Shares	58.481	1,14
3.100	China Railway Group Ltd 'A' Shares	2.839	0,06
22.000	China Railway Group Ltd 'H' Shares	13.598	0,26
100	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd	671	0,01
2.600	China Shenhua Energy Co Ltd 'A' Shares	12.914	0,25
25.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H' Shares	71.684	1,39
10.500	China State Construction Engineering Corp Ltd	8.332	0,16
400	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	13.898	0,27
6.800	China Yangtze Power Co Ltd	23.450	0,46
200	Chongqing Brewery Co Ltd	4.373	0,09
2.200	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	1.214	0,02
400	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	6.623	0,13
3.500	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A' Shares	7.257	0,14
14.500	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' Shares	20.252	0,39
11.000	CRRC Corp Ltd	4.093	0,08
552	Da An Gene Co Ltd of Sun Yat-Sen University	1.415	0,03
2.500	Daqin Railway Co Ltd	2.457	0,05
14.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd	10.633	0,21
5.200	Focus Media Information Technology Co Ltd	5.220	0,10
1.100	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	14.826	0,29
400	Fujian Sunner Development Co Ltd	1.144	0,02
500	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	2.515	0,05
1.100	Guanghui Energy Co Ltd	1.729	0,03
100	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd	1.231	0,02
200	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	2.247	0,04
11.200	Haitong Securities Co Ltd	8.221	0,16
200	Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	1.075	0,02
700	Heilongjiang Agriculture Co Ltd	1.541	0,03
400	Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd	780	0,02
1.200	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	5.244	0,10
200	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	2.868	0,06
500	Huaibei Mining Holdings Co Ltd	1.086	0,02
4.000	Huaxia Bank Co Ltd	3.109	0,06
600	Huaxin Cement Co Ltd	1.746	0,03
200	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd	1.312	0,03
2.500	Hunan Valin Steel Co Ltd	1.898	0,04
400	Huolinhe Opencut Coal Industry Corp Ltd of Inner Mongolia	854	0,02
10.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A' Shares	7.115	0,14
171.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares	101.550	1,97
280	Inner Mongolia ERDOS Resources Co Ltd	754	0,01
2.600	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	1.893	0,04
1.700	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	9.877	0,19
3.500	Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd	5.737	0,11
600	Inner Mongolia Yuan Xing Energy Co Ltd	941	0,02
300	Intco Medical Technology Co Ltd	1.135	0,02
300	Jafron Biomedical Co Ltd	2.277	0,04
260	Jason Furniture Hangzhou Co Ltd	2.196	0,04
6.000	Jiangsu Expressway Co Ltd	6.041	0,12
300	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	2.762	0,05

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,53 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,52 %) (Fortsetzung)		
	China: 29,90 % (30. Juni 2021: 25,58 %) (Fortsetzung)		
200	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd	765	0,01
800	Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd	2.756	0,05
900	Jinke Properties Group Co Ltd	384	0,01
600	Jizhong Energy Resources Co Ltd	668	0,01
300	Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd	533	0,01
200	Juewei Food Co Ltd	1.725	0,03
600	Kingfa Sci & Tech Co Ltd	852	0,02
600	Kunlun Tech Co Ltd	1.432	0,03
400	Kweichow Moutai Co Ltd	122.013	2,37
500	Luxi Chemical Group Co Ltd	1.289	0,03
400	Luzhou Laojiao Co Ltd	14.710	0,29
1.100	Maanshan Iron & Steel Co Ltd	622	0,01
160	Maxscend Microelectronics Co Ltd	3.222	0,06
1.500	Muyuan Foodstuff Co Ltd	12.366	0,24
4.200	New China Life Insurance Co Ltd	11.802	0,23
1.700	Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd	3.715	0,07
7.200	Nongfu Spring Co Ltd	41.336	0,80
43.000	People's Insurance Co Group of China Ltd	13.152	0,26
600	Perfect World Co Ltd	1.286	0,02
4.900	PetroChina Co Ltd 'H' Shares	3.874	0,08
106.000	PetroChina Co Ltd 'A' Shares	50.522	0,98
26.000	PICC Property & Casualty Co Ltd	27.037	0,53
400	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co Ltd	811	0,02
40.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd	31.758	0,62
2.100	Sany Heavy Industry Co Ltd	5.970	0,12
150	SG Micro Corp	4.073	0,08
3.900	Shaanxi Coal Industry Co Ltd	12.321	0,24
400	Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co Ltd	922	0,02
200	Shandong Buchang Pharmaceuticals Co Ltd	588	0,01
650	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	2.831	0,06
800	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd	1.469	0,03
1.400	Shanghai Baosight Software Co Ltd	5.905	0,11
1.400	Shanghai International Port Group Co Ltd	1.217	0,02
3.100	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	5.136	0,10
8.700	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	10.395	0,20
1.000	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd	2.181	0,04
1.700	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd	1.382	0,03
280	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	13.565	0,26
400	Shengyi Technology Co Ltd	1.014	0,02
400	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	18.687	0,36
100	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co Ltd	673	0,01
300	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co Ltd	1.087	0,02
800	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd	1.422	0,03
2.400	Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd	1.525	0,03
200	Sichuan Swellfun Co Ltd	2.761	0,05
5.200	Sinopharm Group Co Ltd	12.604	0,24
392	Toly Bread Co Ltd	968	0,02
600	Tongkun Group Co Ltd	1.421	0,03
900	Wanhua Chemical Group Co Ltd	13.020	0,25
100	Weihai Guangwei Composites Co Ltd	878	0,02
900	Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	2.850	0,06
430	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd	947	0,02
900	Xiamen C & D Inc	1.755	0,03
100	Xiamen Faratronic Co Ltd	3.060	0,06
10.000	Yankuang Energy Group Co Ltd 'A' Shares	31.351	0,61
800	Yankuang Energy Group Co Ltd 'H' Shares	4.711	0,09
200	Yealink Network Technology Corp Ltd	2.272	0,04
600	Yintai Gold Co Ltd	872	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,53 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,52 %) (Fortsetzung)		
	China: 29,90 % (30. Juni 2021: 25,58 %) (Fortsetzung)		
6.000	Zhejiang Expressway Co Ltd	5.536	0,11
1.200	Zhejiang Huafeng Spandex Co Ltd	1.511	0,03
864	Zhejiang NHU Co Ltd	2.940	0,06
42	Zhejiang Orient Gene Biotech Co Ltd	715	0,01
700	Zhejiang Semir Garment Co Ltd	618	0,01
100	Zhejiang Supor Co Ltd	840	0,02
600	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	2.151	0,04
100	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co Ltd	776	0,02
700	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd	1.331	0,03
1.700	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'A' Shares	1.562	0,03
5.400	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' Shares	2.883	0,06
		<u>1.538.380</u>	<u>29,90</u>
	Hongkong: 6,78 % (30. Juni 2021: 5,19 %)		
2.500	Beijing Enterprises Holdings Ltd	8.889	0,17
4.000	China Merchants Port Holdings Co Ltd	6.800	0,13
5.600	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	6.908	0,13
23.000	CITIC Ltd	23.302	0,45
7.000	CLP Holdings Ltd	58.074	1,14
36.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	35.739	0,69
20.000	HKT Trust & HKT Ltd	26.864	0,52
18.000	Lenovo Group Ltd	16.814	0,33
8.244	Power Assets Holdings Ltd	51.847	1,01
17.000	Sino Land Co Ltd	25.087	0,49
3.500	Sinotruk Hong Kong Ltd	4.906	0,10
6.333	Sun Hung Kai Properties Ltd	74.815	1,45
7.000	Yuexiu Property Co Ltd	8.974	0,17
		<u>349.019</u>	<u>6,78</u>
	Indien: 15,99 % (30. Juni 2021: 17,18 %)		
1.218	Adani Gas Ltd	36.906	0,72
1.569	Asian Paints Ltd	53.547	1,04
345	Bajaj Auto Ltd	16.193	0,31
4.440	Bharat Electronics Ltd	13.162	0,26
3.606	Bharat Petroleum Corp Ltd	14.082	0,27
545	Britannia Industries Ltd	23.922	0,46
10.107	Coal India Ltd	23.753	0,46
754	Colgate-Palmolive India Ltd	14.196	0,28
2.659	Dabur India Ltd	16.699	0,32
8.557	GAIL India Ltd	14.649	0,28
5.492	HCL Technologies Ltd	67.683	1,32
564	Hero MotoCorp Ltd	19.423	0,38
4.115	Hindustan Petroleum Corp Ltd	11.318	0,22
5.202	Indian Oil Corp Ltd	4.891	0,10
10.405	Indian Oil Corp Ltd INR	9.783	0,19
5.771	Infosys Ltd	106.830	2,08
17.076	ITC Ltd	59.138	1,15
2.846	Marico Ltd	17.222	0,33
241	Mindtree Ltd	8.810	0,17
192	Nestle India Ltd	42.474	0,83
16.625	NTPC Ltd	30.083	0,58
7.305	Oil & Natural Gas Corp Ltd	14.018	0,27
31	Page Industries Ltd	15.767	0,31
3.901	Petronet LNG Ltd	10.734	0,21
686	Pidilite Industries Ltd	18.154	0,35
12.630	Power Grid Corp of India Ltd	33.889	0,66
2.525	Tata Consultancy Services Ltd	104.460	2,03
95	Tata Elxsi Ltd	9.829	0,19
3.975	Vedanta Ltd	11.224	0,22
		<u>822.839</u>	<u>15,99</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,53 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,52 %) (Fortsetzung)		
	Indonesien: 2,86 % (30. Juni 2021: 2,13 %)		
88.000	Adaro Energy Tbk PT	16.894	0,33
2.800	Gudang Garam Tbk PT	5.859	0,11
21.800	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	10.317	0,20
297.000	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	79.745	1,55
48.200	Unilever Indonesia Tbk PT	15.433	0,30
10.000	United Tractors Tbk PT	19.064	0,37
		<u>147.312</u>	<u>2,86</u>
	Malaysia: 2,08 % (30. Juni 2021: 2,60 %)		
18.100	DiGi.Com Bhd	14.373	0,28
13.400	Hartalega Holdings Bhd	9.303	0,18
1.200	Kuala Lumpur Kepong Bhd	5.973	0,12
5.800	MISC Bhd	9.343	0,18
400	Nestle Malaysia Bhd	12.035	0,23
7.400	Petronas Chemicals Group Bhd	15.111	0,29
4.400	Petronas Gas Bhd	16.412	0,33
6.800	RHB Bank Bhd	8.840	0,17
12.800	Sime Darby Bhd	6.186	0,12
40.100	Top Glove Corp Bhd	9.462	0,18
		<u>107.038</u>	<u>2,08</u>
	Philippinen: 0,57 % (30. Juni 2021: 0,49 %)		
2.760	International Container Terminal Services Inc	9.236	0,18
1.210	Manila Electric Co	7.922	0,15
390	PLDT Inc	11.916	0,24
		<u>29.074</u>	<u>0,57</u>
	Singapur: 3,36 % (30. Juni 2021: 2,87 %)		
8.700	Capitaland Investment Ltd	23.880	0,46
5.000	Singapore Exchange Ltd	33.987	0,66
7.700	Singapore Technologies Engineering Ltd	22.574	0,44
41.500	Singapore Telecommunications Ltd	75.444	1,47
1.400	Venture Corp Ltd	16.729	0,33
		<u>172.614</u>	<u>3,36</u>
	Südkorea: 9,43 % (30. Juni 2021: 9,33 %)		
195	DB Insurance Co Ltd	9.206	0,18
64	F&F Co Ltd	6.630	0,13
1.641	Hana Financial Group Inc	49.733	0,97
1.023	HMM Co Ltd	19.382	0,38
1.672	Industrial Bank of Korea	12.388	0,24
1.818	KB Financial Group Inc	67.419	1,31
112	Korea Investment Holdings Co Ltd	5.322	0,10
646	KT&G Corp	40.897	0,79
122	Kumho Petrochemical Co Ltd	13.061	0,25
10	LG Household & Health Care Ltd	2.515	0,05
37	LG Innotek Co Ltd	9.760	0,19
112	Meritz Fire & Marine Insurance Co Ltd	2.860	0,06
476	NH Investment & Securities Co Ltd	3.318	0,06
314	POSCO	55.743	1,08
1.730	Samsung Electronics Co Ltd	75.947	1,48
310	Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock)	12.415	0,24
209	SD Biosensor Inc	6.254	0,12
220	Seegene Inc	6.125	0,12
2.120	Shinhan Financial Group Co Ltd	60.494	1,18
2.762	Woori Financial Group Inc	25.740	0,50
		<u>485.209</u>	<u>9,43</u>
	Taiwan: 15,79 % (30. Juni 2021: 18,24 %)		
12.000	Acer Inc	8.758	0,17
1.840	Advantech Co Ltd	21.412	0,42
11.000	Asia Cement Corp	16.204	0,31
4.000	Asustek Computer Inc	41.771	0,81

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,53 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,93 % (30. Juni 2021: 99,52 %) (Fortsetzung)		
	Taiwan: 15,79 % (30. Juni 2021: 18,24 %) (Fortsetzung)		
21.000	AU Optronics Corp	11.512	0,22
34.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	58.204	1,13
61.000	China Development Financial Holding Corp	30.158	0,59
19.000	Chunghwa Telecom Co Ltd	77.959	1,52
16.000	Compal Electronics Inc	12.242	0,24
245	eMemory Technology Inc	8.528	0,17
13.400	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	38.127	0,74
4.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	11.247	0,22
33.000	Fubon Financial Holding Co Ltd	66.370	1,29
11.000	Lite-On Technology Corp	21.420	0,42
3.500	Micro-Star International Co Ltd	13.360	0,26
940	Nien Made Enterprise Co Ltd	9.263	0,18
3.710	Novatek Microelectronics Corp	37.682	0,73
11.000	Quanta Computer Inc	29.522	0,57
8.000	Ruentex Development Co Ltd	19.749	0,38
7.000	Synnex Technology International Corp	12.525	0,24
8.000	Taiwan Mobile Co Ltd	29.058	0,56
6.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	96.053	1,88
49.000	United Microelectronics Corp	64.518	1,25
4.578	Vanguard International Semiconductor Corp	11.825	0,23
3.732	Wan Hai Lines Ltd	14.936	0,29
9.000	Yang Ming Marine Transport Corp	24.911	0,48
38.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	25.177	0,49
		<u>812.491</u>	<u>15,79</u>
	Thailand: 2,44 % (30. Juni 2021: 2,75 %)		
6.500	Advanced Info Service PCL	35.760	0,69
2.200	Bumrungrad Hospital PCL	11.138	0,22
8.300	Intouch Holdings PCL	16.081	0,31
14.900	Krung Thai Bank PCL	6.532	0,13
53.400	Land & Houses PCL	12.612	0,25
6.200	Osotspa PCL	6.006	0,12
3.500	Siam Cement PCL	37.024	0,72
		<u>125.153</u>	<u>2,44</u>
	Aktien insgesamt	<u>5.089.860</u>	<u>98,93</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>5.089.860</u>	<u>98,93</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,02) % (30. Juni 2021: null)

Terminkontrakte (Futures): (0,02) % (30. Juni 2021: null)*

Nominal- betrag USD	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermö- gens
51.190	1.024	1 of MSCI Emgmt Long Futures Contracts Expiring September 2022	(1.055)	(0,02)
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	<u>(1.055)</u>	<u>(0,02)</u>
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	<u>(1.055)</u>	<u>(0,02)</u>

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 3.500 USD.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia ex Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
Anlageportfolio	5.088.805	98,91
Sonstige Nettverbindlichkeiten	56.173	1,09
Nettovermögen	<u>5.144.978</u>	<u>100,00</u>
		% des Gesamt- vermö- gens
Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		98,19
Sonstiges Umlaufvermögen		1,81
Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %)		
	Unternehmensanleihen: null (30. Juni 2021: 0,00 %)		
	Indien: null (30. Juni 2021: 0,00 %)		
	Aktien: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %)		
	Bermuda: 0,41 % (30. Juni 2021: 0,62 %)		
42.000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	35.540	0,11
3.500	Orient Overseas International Ltd	92.775	0,30
		<u>128.315</u>	<u>0,41</u>
	Brasilien: 6,80 % (30. Juni 2021: 3,68 %)		
117.600	Ambev SA ADR	295.176	0,93
135.800	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	284.613	0,90
21.000	Banco do Brasil SA	134.045	0,43
28.700	BB Seguridade Participacoes SA	142.472	0,45
2.800	Braskem SA	19.939	0,06
39.200	Cia Energetica de Minas Gerais	77.809	0,25
11.200	Cia Siderurgica Nacional SA	33.068	0,10
4.200	CPFL Energia SA	24.801	0,08
5.600	Engie Brasil Energia SA	44.226	0,14
33.600	Gerdau SA	143.602	0,46
12.600	JBS SA	76.114	0,24
21.000	Petroleo Brasileiro SA	122.640	0,39
26.600	Petroleo Brasileiro SA (preferred stock)	142.068	0,45
17.500	Telefonica Brasil SA	157.483	0,50
25.200	TIM SA	61.489	0,20
2.791	Vale SA	40.861	0,13
17.892	Vale SA ADR	261.760	0,83
25.200	Vibra Energia SA	80.523	0,26
		<u>2.142.689</u>	<u>6,80</u>
	Kaimaninseln: 3,96 % (30. Juni 2021: 7,12 %)		
2.492	360 DigiTech Inc ADR	43.112	0,14
53.000	China Conch Venture Holdings Ltd	115.497	0,37
112.000	China Feihe Ltd	128.744	0,40
77.000	China Hongqiao Group Ltd	87.039	0,28
42.000	China Medical System Holdings Ltd	65.513	0,21
45.000	China Overseas Property Holdings Ltd	48.458	0,15
84.000	China Resources Cement Holdings Ltd	56.414	0,18
63.000	Dali Foods Group Co Ltd	33.479	0,11
924	Daqo New Energy Corp ADR	65.955	0,21
14.000	Haitian International Holdings Ltd	35.772	0,11
18.000	Hengan International Group Co Ltd	84.530	0,27
21.000	Kingboard Holdings Ltd	79.483	0,25
35.000	Kingboard Laminates Holdings Ltd	43.176	0,14
1.120	Parade Technologies Ltd	43.318	0,14
58.666	Seazen Group Ltd	29.008	0,09
21.000	Shimao Group Holdings Ltd	5.888	0,02
42.000	Sunac China Holdings Ltd	12.072	0,04
28.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	47.957	0,15
28.000	Topsports International Holdings Ltd	25.442	0,08
28.000	Uni-President China Holdings Ltd	24.014	0,08
140.000	Want Want China Holdings Ltd	121.678	0,38
14.000	Yihai International Holding Ltd	50.491	0,16
		<u>1.247.040</u>	<u>3,96</u>
	Chile: 0,48 % (30. Juni 2021: 0,66 %)		
29.134	Cencosud SA	36.322	0,12
4.130	Cia Cervecerias Unidas SA	25.568	0,08
355.684	Cia Sud Americana de Vapores SA	31.128	0,10
5.642	Empresas Copec SA	40.770	0,12
786.142	Enel Chile SA	17.412	0,06
		<u>151.200</u>	<u>0,48</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	China: 22,08 % (30. Juni 2021: 18,65 %)		
116.200	Agricultural Bank of China Ltd 'A' Shares	52.344	0,17
770.000	Agricultural Bank of China Ltd 'H' Shares	290.457	0,91
17.500	A-Living Smart City Services Co Ltd	28.145	0,09
9.800	Anhui Conch Cement Co Ltd 'A' Shares	51.571	0,16
49.000	Anhui Conch Cement Co Ltd 'H' Shares	212.312	0,67
2.800	Anhui Gujing Distillery Co Ltd	43.676	0,14
40.600	Bank of Beijing Co Ltd	27.494	0,09
2.800	Bank of Changsha Co Ltd	3.312	0,01
5.600	Bank of Chengdu Co Ltd	13.849	0,04
16.800	Bank of China Ltd 'A' Shares	8.169	0,03
854.000	Bank of China Ltd 'H' Shares	340.645	1,07
82.600	Bank of Communications Co Ltd 'A' Shares	61.357	0,19
322.000	Bank of Communications Co Ltd 'H' Shares	222.410	0,71
22.400	Bank of Jiangsu Co Ltd	23.789	0,08
15.400	Bank of Nanjing Co Ltd	23.935	0,08
18.200	Bank of Shanghai Co Ltd	17.781	0,06
42.000	Baoshan Iron & Steel Co Ltd	37.714	0,12
2.800	By-health Co Ltd	9.042	0,03
294.000	China Cinda Asset Management Co Ltd	46.084	0,15
336.000	China CITIC Bank Corp Ltd	150.295	0,48
56.000	China Coal Energy Co Ltd	47.458	0,15
56.000	China Communications Services Corp Ltd	24.621	0,08
1.400	China Construction Bank Corp 'A' Shares	1.265	0,00
476.000	China Construction Bank Corp 'H' Shares	319.681	1,00
77.000	China Everbright Bank Co Ltd 'A' Shares	34.571	0,11
126.000	China Everbright Bank Co Ltd 'H' Shares	40.785	0,13
168.000	China Life Insurance Co Ltd	292.455	0,92
68.600	China Minsheng Banking Corp Ltd 'A' Shares	38.065	0,12
203.000	China Minsheng Banking Corp Ltd 'H' Shares	72.436	0,23
118.000	China National Building Material Co Ltd	126.016	0,40
9.800	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'A' Shares	34.395	0,11
75.600	China Pacific Insurance Group Co Ltd 'H' Shares	184.786	0,59
36.400	China Petroleum & Chemical Corp 'A' Shares	22.152	0,07
616.000	China Petroleum & Chemical Corp 'H' Shares	277.111	0,88
126.000	China Railway Group Ltd	77.877	0,25
9.800	China Shenhua Energy Co Ltd 'A' Shares	48.677	0,15
91.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H' Shares	260.929	0,83
58.800	China State Construction Engineering Corp Ltd	46.660	0,15
36.400	China Yangtze Power Co Ltd	125.528	0,40
14.000	China Zheshang Bank Co Ltd	6.933	0,02
1.000	Chongqing Brewery Co Ltd	21.867	0,07
16.800	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	9.272	0,03
18.200	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'A' Shares	37.735	0,12
77.000	COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd 'H' Shares	107.548	0,34
2.800	Da An Gene Co Ltd of Sun Yat-Sen University	7.179	0,02
14.000	Daqin Railway Co Ltd	13.762	0,04
84.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd	63.801	0,20
25.200	Focus Media Information Technology Co Ltd	25.297	0,08
7.000	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	94.347	0,30
200	G-bits Network Technology Xiamen Co Ltd	11.575	0,04
2.800	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	14.083	0,04
5.600	Guanghui Energy Co Ltd	8.804	0,03
1.400	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	15.729	0,05
67.200	Haitong Securities Co Ltd	49.328	0,16
2.800	Heilongjiang Agriculture Co Ltd	6.164	0,02
2.800	Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd	5.463	0,02
5.600	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	24.474	0,08
1.400	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	20.078	0,06

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	China: 22,08 % (30. Juni 2021: 18,65 %) (Fortsetzung)		
2.800	Huaibei Mining Holdings Co Ltd	6.081	0,02
22.400	Huaxia Bank Co Ltd	17.408	0,06
2.800	Huaxin Cement Co Ltd	8.148	0,03
1.400	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd	9.186	0,03
14.000	Hunan Valin Steel Co Ltd	10.629	0,03
1.400	Huolinhe Opencut Coal Industry Corp Ltd of Inner Mongolia	2.990	0,01
29.400	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'A' Shares	20.918	0,07
546.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' Shares	324.249	1,02
1.960	Inner Mongolia ERDOS Resources Co Ltd	5.277	0,02
15.400	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	11.210	0,04
18.200	Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd	29.830	0,09
5.600	Inner Mongolia Yuan Xing Energy Co Ltd	8.779	0,03
1.620	Intco Medical Technology Co Ltd	6.128	0,02
1.400	Jafron Biomedical Co Ltd	10.627	0,03
28.000	Jiangsu Expressway Co Ltd	28.189	0,09
1.400	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd	5.358	0,02
11.200	Jinke Properties Group Co Ltd	4.778	0,02
2.800	Jizhong Energy Resources Co Ltd	3.116	0,01
5.600	Kingfa Sci & Tech Co Ltd	7.952	0,03
2.800	Kunlun Tech Co Ltd	6.682	0,02
1.300	Kweichow Moutai Co Ltd	396.543	1,25
5.600	Maanshan Iron & Steel Co Ltd	3.166	0,01
800	Maxscend Microelectronics Co Ltd	16.109	0,05
2.800	New China Life Insurance Co Ltd 'A' Shares	13.444	0,04
26.600	New China Life Insurance Co Ltd 'H' Shares	74.746	0,24
9.800	Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd	21.415	0,07
25.200	Nongfu Spring Co Ltd	144.675	0,46
266.000	People's Insurance Co Group of China Ltd	81.356	0,26
2.800	Perfect World Co Ltd	6.002	0,02
25.200	PetroChina Co Ltd 'A' Shares	19.922	0,06
588.000	PetroChina Co Ltd 'H' Shares	280.252	0,89
196.000	PICC Property & Casualty Co Ltd	203.819	0,65
2.800	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co Ltd	5.676	0,02
224.000	Postal Savings Bank of China Co Ltd	177.842	0,56
2.800	Seazen Holdings Co Ltd	10.621	0,03
21.000	Shaanxi Coal Industry Co Ltd	66.343	0,21
1.400	Shandong Buchang Pharmaceuticals Co Ltd	4.116	0,01
4.200	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	18.293	0,06
4.200	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd	7.712	0,02
15.400	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd	13.537	0,04
19.600	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	32.471	0,10
47.600	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	56.871	0,18
4.200	Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd	9.159	0,03
9.800	Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd	7.967	0,03
2.000	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	93.434	0,30
2.800	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co Ltd	10.149	0,03
14.000	Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd	8.896	0,03
900	Sichuan Swellfun Co Ltd	12.423	0,04
1.960	Toly Bread Co Ltd	4.838	0,02
4.200	Tongkun Group Co Ltd	9.948	0,03
700	Weihai Guangwei Composites Co Ltd	6.147	0,02
4.200	Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	13.300	0,04
4.200	Xiamen C & D Inc	8.188	0,03
4.200	Yankuang Energy Group Co Ltd 'A' Shares	24.733	0,08
56.000	Yankuang Energy Group Co Ltd 'H' Shares	175.559	0,56
1.400	Yealink Network Technology Corp Ltd	15.902	0,05
4.200	Yintai Gold Co Ltd	6.102	0,02
4.200	Zhejiang Huafeng Spandex Co Ltd	5.287	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	China: 22,08 % (30. Juni 2021: 18,65 %) (Fortsetzung)		
5.040	Zhejiang NHU Co Ltd	17.148	0,05
235	Zhejiang Orient Gene Biotech Co Ltd	4.001	0,01
4.200	Zhejiang Semir Garment Co Ltd	3.709	0,01
1.400	Zhejiang Supor Co Ltd	11.765	0,04
4.200	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	15.060	0,05
4.200	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd	7.988	0,03
7.000	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'A' Shares	6.432	0,02
30.800	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd 'H' Shares	16.446	0,05
		<u>6.960.335</u>	<u>22,08</u>
	Kolumbien: 0,13 % (30. Juni 2021: null)		
73.332	Ecopetrol SA	39.705	0,13
		<u>39.705</u>	<u>0,13</u>
	Zypern: 0,00 % (30. Juni 2021: 0,50 %)		
3.360	TCS Group Holding Plc GDR	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	Tschechische Republik: 0,60 % (30. Juni 2021: 0,19 %)		
4.214	CEZ AS	189.326	0,60
		<u>189.326</u>	<u>0,60</u>
	Ägypten: 0,08 % (30. Juni 2021: 0,12 %)		
47.222	Eastern Co SAE	25.872	0,08
		<u>25.872</u>	<u>0,08</u>
	Griechenland: 0,56 % (30. Juni 2021: 0,37 %)		
7.168	Hellenic Telecommunications Organization SA	124.172	0,40
3.542	JUMBO SA	51.323	0,16
		<u>175.495</u>	<u>0,56</u>
	Hongkong: 1,94 % (30. Juni 2021: 1,18 %)		
14.000	Beijing Enterprises Holdings Ltd	49.777	0,16
112.000	China Jinmao Holdings Group Ltd	30.116	0,10
40.000	China Merchants Port Holdings Co Ltd	68.001	0,22
47.600	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	58.719	0,19
126.000	CITIC Ltd	127.655	0,40
196.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	194.578	0,61
21.000	Sinotruk Hong Kong Ltd	29.438	0,09
42.000	Yuexiu Property Co Ltd	53.845	0,17
		<u>612.129</u>	<u>1,94</u>
	Ungarn: 0,44 % (30. Juni 2021: 0,15 %)		
9.898	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	76.098	0,24
3.556	Richter Gedeon Nyrt	63.992	0,20
		<u>140.090</u>	<u>0,44</u>
	Indien: 13,43 % (30. Juni 2021: 13,02 %)		
7.336	Adani Gas Ltd	222.284	0,71
8.540	Asian Paints Ltd	291.456	0,92
2.100	Bajaj Auto Ltd	98.564	0,31
25.382	Bharat Electronics Ltd	75.240	0,24
21.686	Bharat Petroleum Corp Ltd	84.687	0,27
3.332	Britannia Industries Ltd	146.254	0,46
59.934	Coal India Ltd	140.856	0,45
4.480	Colgate-Palmolive India Ltd	84.347	0,27
16.772	Dabur India Ltd	105.329	0,33
51.352	GAIL India Ltd	87.914	0,28
25.970	HCL Technologies Ltd	320.052	1,02
3.458	Hero MotoCorp Ltd	119.089	0,38
24.346	Hindustan Petroleum Corp Ltd	66.959	0,21
91.098	Indian Oil Corp Ltd	85.650	0,27
7.574	Indraprastha Gas Ltd	34.133	0,11
16.744	Indus Towers Ltd	44.334	0,14
18.354	Infosys Ltd	339.760	1,08

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Indien: 13,43 % (30. Juni 2021: 13,02 %) (Fortsetzung)		
94.332	ITC Ltd	326.693	1,04
1.330	Larsen & Toubro Infotech Ltd	66.952	0,21
17.752	Marico Ltd	107.426	0,34
1.554	Mindtree Ltd	56.811	0,18
1.694	Mphasis Ltd	49.209	0,16
1.176	Nestle India Ltd	260.150	0,83
41.188	Oil & Natural Gas Corp Ltd	79.041	0,25
196	Page Industries Ltd	99.688	0,32
23.338	Petronet LNG Ltd	64.217	0,20
4.102	Pidilite Industries Ltd	108.554	0,34
8.022	Tata Consultancy Services Ltd	331.871	1,05
574	Tata Elxsi Ltd	59.386	0,19
16.730	Tech Mahindra Ltd	211.846	0,67
22.652	Vedanta Ltd	63.964	0,20
		<u>4.232.716</u>	<u>13,43</u>
	Indonesien: 2,67 % (30. Juni 2021: 1,87 %)		
516.600	Adaro Energy Tbk PT	99.176	0,31
284.200	Astra International Tbk PT	126.385	0,40
15.400	Gudang Garam Tbk PT	32.227	0,10
117.600	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	55.652	0,18
1.184.400	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	318.013	1,02
294.000	Unilever Indonesia Tbk PT	94.135	0,30
60.200	United Tractors Tbk PT	114.763	0,36
		<u>840.351</u>	<u>2,67</u>
	Jersey: 0,00 % (30. Juni 2021: 0,69 %)		
13.552	Polymetal International Plc	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	Kuwait: 0,36 % (30. Juni 2021: 0,26 %)		
59.024	Mobile Telecommunications Co KSCP	114.240	0,36
		<u>114.240</u>	<u>0,36</u>
	Malaysia: 1,97 % (30. Juni 2021: 2,13 %)		
106.400	DiGi.Com Bhd	84.492	0,27
82.600	Hartalega Holdings Bhd	57.347	0,18
57.400	Inari Amertron Bhd	34.381	0,11
7.000	Kuala Lumpur Kepong Bhd	34.845	0,11
32.200	MISC Bhd	51.871	0,16
2.800	Nestle Malaysia Bhd	84.238	0,27
40.600	Petronas Chemicals Group Bhd	82.904	0,26
26.600	Petronas Gas Bhd	99.218	0,32
74.200	Sime Darby Bhd	35.858	0,11
239.400	Top Glove Corp Bhd	56.489	0,18
		<u>621.643</u>	<u>1,97</u>
	Mexiko: 2,44 % (30. Juni 2021: 2,55 %)		
9.394	Arca Continental SAB de CV	61.693	0,20
11.270	Coca-Cola Femsa SAB de CV	62.194	0,20
65.926	Grupo Mexico SAB de CV	272.092	0,86
48.818	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	65.887	0,21
89.124	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	306.257	0,97
		<u>768.123</u>	<u>2,44</u>
	Philippinen: 0,64 % (30. Juni 2021: 0,45 %)		
840	Globe Telecom Inc	34.648	0,11
15.120	International Container Terminal Services Inc	50.597	0,16
7.280	Manila Electric Co	47.664	0,15
2.240	PLDT Inc	68.440	0,22
		<u>201.349</u>	<u>0,64</u>
	Pakistan: null (30. Juni 2021: 0,04 %)		

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Polen: 1,03 % (30. Juni 2021: 0,57 %)		
1.680	CD Projekt SA	35.754	0,11
9.142	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	139.331	0,44
51.422	Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA	65.332	0,21
12.796	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	85.328	0,27
		<u>325.745</u>	<u>1,03</u>
	Katar: 1,34 % (30. Juni 2021: 1,22 %)		
55.650	Industries Qatar QSC	243.734	0,77
64.036	Mesaieed Petrochemical Holding Co	43.784	0,14
14.322	Qatar Electricity & Water Co QSC	68.901	0,22
13.720	Qatar Fuel QSC	67.248	0,21
		<u>423.667</u>	<u>1,34</u>
	Russland: 0,00 % (30. Juni 2021: 9,43 %)		
102.144	Alrosa PJSC	-	0,00
83.636	Gazprom PJSC	-	0,00
1.511.510	Inter RAO UES PJSC	-	0,00
4.242	LUKOIL PJSC	-	0,00
1.302	MMC Norilsk Nickel PJSC	-	0,00
39.606	Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC	-	0,00
65.240	Novolipetsk Steel PJSC	-	0,00
39	Phosagro PJSC GDR	-	0,00
5.995	PhosAgro PJSC GDR (Reg S)	-	0,00
1.428	Polyus PJSC	-	0,00
37.254	Rosneft Oil Co PJSC	-	0,00
11.452	Severstal PAO	-	0,00
246.834	Surgutneftegas PJSC	-	0,00
303.786	Surgutneftegas PJSC (preferred stock)	-	0,00
55.916	Tatneft PJSC	-	0,00
44.856	United Co RUSAL International PJSC	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	Saudi-Arabien: 5,35 % (30. Juni 2021: 4,10 %)		
4.214	Advanced Petrochemical Co	57.728	0,18
13.426	Al Rajhi Bank	295.207	0,94
1.820	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	94.005	0,30
2.324	Jarir Marketing Co	100.712	0,32
251	Mouwamat Medical Services Co	14.249	0,05
7.910	SABIC Agri-Nutrients Co	290.503	0,92
5.642	Sahara International Petrochemical Co	75.485	0,24
31.822	Saudi Arabian Oil Co	329.068	1,04
518	Saudi Research & Media Group	25.955	0,08
11.956	Saudi Telecom Co	309.407	0,98
7.112	Yanbu National Petrochemical Co	95.721	0,30
		<u>1.688.040</u>	<u>5,35</u>
	Südafrika: 6,08 % (30. Juni 2021: 4,92 %)		
4.648	African Rainbow Minerals Ltd	60.645	0,19
1.946	Anglo American Platinum Ltd	169.269	0,54
12.684	AngloGold Ashanti Ltd	189.712	0,60
7.112	Clicks Group Ltd	118.650	0,38
11.032	Exxaro Resources Ltd	133.455	0,42
25.620	Gold Fields Ltd	239.271	0,76
12.278	Harmony Gold Mining Co Ltd	38.949	0,12
28.098	Impala Platinum Holdings Ltd	310.678	0,99
3.416	Kumba Iron Ore Ltd	109.606	0,35
7.994	Mr Price Group Ltd	86.549	0,27
5.012	Northam Platinum Holdings Ltd	52.404	0,17
94.010	Sibanye Stillwater Ltd	233.382	0,74
21.854	Vodacom Group Ltd	174.925	0,55
		<u>1.917.495</u>	<u>6,08</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Südkorea: 8,02 % (30. Juni 2021: 7,71 %)		
1.540	Coway Co Ltd	75.790	0,24
658	DB Insurance Co Ltd	31.065	0,10
392	F&F Co Ltd	40.607	0,13
9.366	Hana Financial Group Inc	283.851	0,90
5.964	HMM Co Ltd	112.996	0,36
9.674	Industrial Bank of Korea	71.676	0,23
7.546	KB Financial Group Inc	279.837	0,89
616	Korea Investment Holdings Co Ltd	29.272	0,09
238	Korea Zinc Co Ltd	89.360	0,28
3.794	KT&G Corp	240.193	0,76
742	Kumho Petrochemical Co Ltd	79.435	0,25
56	LG Household & Health Care Ltd	14.082	0,04
210	LG Innotek Co Ltd	55.395	0,18
574	Meritz Fire & Marine Insurance Co Ltd	14.655	0,05
2.660	NH Investment & Securities Co Ltd	18.541	0,06
1.512	POSCO	268.420	0,85
476	S-1 Corp	23.536	0,07
5.460	Samsung Electronics Co Ltd	239.695	0,76
966	Samsung Electronics Co Ltd (preferred stock)	38.688	0,12
1.260	SD Biosensor Inc	37.701	0,12
1.400	Seegene Inc	38.979	0,12
10.500	Shinhan Financial Group Co Ltd	299.619	0,96
15.722	Woori Financial Group Inc	146.516	0,46
		<u>2.529.909</u>	<u>8,02</u>
	Taiwan: 13,05 % (30. Juni 2021: 13,10 %)		
70.000	Acer Inc	51.087	0,16
10.550	Advantech Co Ltd	122.767	0,39
63.560	Asia Cement Corp	93.629	0,30
22.000	Asustek Computer Inc	229.741	0,73
196.000	AU Optronics Corp	107.448	0,34
154.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	263.629	0,84
80.640	Chunghwa Telecom Co Ltd	330.875	1,04
98.000	Compal Electronics Inc	74.983	0,24
1.526	eMemory Technology Inc	53.119	0,17
73.220	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	208.331	0,66
28.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	78.726	0,25
161.000	Fubon Financial Holding Co Ltd	323.803	1,03
210.000	Innolux Corp	85.459	0,27
2.800	Largan Precision Co Ltd	162.443	0,52
64.400	Lite-On Technology Corp	125.406	0,40
20.000	Micro-Star International Co Ltd	76.345	0,24
14.000	Nanya Technology Corp	23.260	0,07
5.320	Nien Made Enterprise Co Ltd	52.424	0,17
22.820	Novatek Microelectronics Corp	231.780	0,74
6.566	Realtek Semiconductor Corp	80.161	0,25
28.000	Ruentex Development Co Ltd	69.121	0,22
42.000	Synnex Technology International Corp	75.148	0,24
47.214	Taiwan Mobile Co Ltd	171.494	0,54
19.320	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	309.292	0,98
196.000	United Microelectronics Corp	258.073	0,82
28.000	Vanguard International Semiconductor Corp	72.322	0,23
22.400	Wan Hai Lines Ltd	89.650	0,28
56.000	Yang Ming Marine Transport Corp	155.004	0,49
210.000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	139.136	0,44
		<u>4.114.656</u>	<u>13,05</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 98,94 % (30. Juni 2021: 99,21 %) (Fortsetzung)		
	Thailand: 1,88 % (30. Juni 2021: 1,46 %)		
39.200	Advanced Info Service PCL	215.653	0,69
14.000	Bumrungrad Hospital PCL	70.881	0,22
7.000	Carabao Group PCL	21.086	0,07
50.400	Intouch Holdings PCL	97.650	0,31
86.800	Krung Thai Bank PCL	38.054	0,12
36.400	Osotspa PCL	35.262	0,11
19.600	PTT Exploration & Production PCL	88.423	0,28
51.800	Thai Union Group PCL	25.054	0,08
		<u>592.063</u>	<u>1,88</u>
	Türkei: 1,25 % (30. Juni 2021: 1,18 %)		
22.694	Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS	31.071	0,10
17.178	BIM Birlesik Magazalar AS	83.182	0,26
57.750	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	93.873	0,30
2.870	Ford Otomotiv Sanayi AS	45.895	0,15
17.472	Haci Omer Sabanci Holding AS	19.788	0,06
43.316	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	42.028	0,13
128.579	Türkiye Is Bankasi AS	33.730	0,11
35.476	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS	45.682	0,14
		<u>395.249</u>	<u>1,25</u>
	Vereinigte Arabische Emirate: 1,74 % (30. Juni 2021: 1,27 %)		
87.556	Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC	100.593	0,32
53.718	Aldar Properties PJSC	65.080	0,21
70.056	Dubai Islamic Bank PJSC	109.859	0,35
38.640	Emirates Telecommunications Group Co PJSC	274.564	0,86
		<u>550.096</u>	<u>1,74</u>
	Vereinigte Staaten: 0,21 % (30. Juni 2021: null)		
1.316	Southern Copper Corp	65.550	0,21
		<u>65.550</u>	<u>0,21</u>
	Aktien insgesamt	<u>31.193.088</u>	<u>98,94</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>31.193.088</u>	<u>98,94</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2021: 0,00 %)*

Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2021: 0,00 %)*

Nominal- betrag USD	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermö- gens
304.090	1.014	6 of MSCI Emgmt Long Futures Contracts Expiring September 2022	(3.280)	(0,01)
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	<u>(3.280)</u>	<u>(0,01)</u>
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	<u>(3.280)</u>	<u>(0,01)</u>

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 15.985 USD.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
Anlageportfolio	31.189.808	98,93
Sonstige Nettoverbindlichkeiten	338.515	1,07
Nettovermögen	<u>31.528.323</u>	<u>100,00</u>
		% des Gesamt- vermö- gens
Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		98,08
Sonstiges Umlaufvermögen		1,92
Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,52 % (30. Juni 2021: 99,35 %)		
	Aktien: 99,52 % (30. Juni 2021: 99,35 %)		
	Belgien: 1,11 % (30. Juni 2021: 1,31 %)		
24.600	Proximus SADP	345.999	1,11
		<u>345.999</u>	<u>1,11</u>
	Dänemark: 3,58 % (30. Juni 2021: 2,76 %)		
7.750	Scandinavian Tobacco Group A/S	144.648	0,47
45.125	Tryg A/S	966.923	3,11
		<u>1.111.571</u>	<u>3,58</u>
	Finnland: 9,41 % (30. Juni 2021: 10,18 %)		
18.175	Elisa OYJ	974.543	3,14
36.400	Kesko OYJ	819.364	2,64
23.600	Nokian Renkaat OYJ	246.148	0,79
30.375	UPM-Kymmene OYJ	881.179	2,84
		<u>2.921.234</u>	<u>9,41</u>
	Frankreich: 10,66 % (30. Juni 2021: 8,73 %)		
7.925	Gaztransport Et Technigaz SA	947.038	3,05
5.975	Nexity SA	152.363	0,49
6.025	Rubis SCA	134.237	0,43
9.650	Sanofi	929.680	3,00
3.900	Societe BIC SA	203.580	0,66
18.675	TotalEnergies SE	940.660	3,03
		<u>3.307.558</u>	<u>10,66</u>
	Deutschland: 7,22 % (30. Juni 2021: 5,50 %)		
4.950	Allianz SE	901.494	2,91
17.200	Freenet AG	407.124	1,31
6.725	Hannover Rueck SE	931.413	3,00
		<u>2.240.031</u>	<u>7,22</u>
	Israel: null (30. Juni 2021: 1,10 %)		
	Italien: 7,03 % (30. Juni 2021: 7,68 %)		
53.300	Assicurazioni Generali SpA	811.493	2,61
29.600	Azimut Holding SpA	490.916	1,58
175.775	Snam SpA	878.699	2,84
		<u>2.181.108</u>	<u>7,03</u>
	Luxemburg: 0,56 % (30. Juni 2021: 0,42 %)		
6.500	APERAM SA	172.250	0,56
		<u>172.250</u>	<u>0,56</u>
	Niederlande: 5,55 % (30. Juni 2021: 3,81 %)		
14.225	BE Semiconductor Industries NV	652.501	2,10
291.000	Koninklijke KPN NV	989.691	3,20
27.200	PostNL NV	78.744	0,25
		<u>1.720.936</u>	<u>5,55</u>
	Norwegen: 5,05 % (30. Juni 2021: 6,59 %)		
13.425	Aker BP ASA	444.650	1,43
12.400	Atea ASA	122.934	0,40
78.875	Telenor ASA	1.000.372	3,22
		<u>1.567.956</u>	<u>5,05</u>
	Spanien: 15,47 % (30. Juni 2021: 10,79 %)		
138.175	Bankinter SA	822.418	2,65
295.625	CaixaBank SA	980.587	3,16
9.825	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	183.335	0,59
46.700	Endesa SA	840.600	2,71
51.350	Faes Farma SA	199.238	0,64
89.375	Iberdrola SA	884.455	2,85
49.450	Red Electrica Corp SA	891.336	2,87
		<u>4.801.969</u>	<u>15,47</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,52 % (30. Juni 2021: 99,35 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,52 % (30. Juni 2021: 99,35 %) (Fortsetzung)		
	Schweden: 3,51 % (30. Juni 2021: 3,63 %)		
18.225	Axfood AB	500.658	1,61
54.100	Tele2 AB	588.310	1,90
		<u>1.088.968</u>	<u>3,51</u>
	Schweiz: 8,48 % (30. Juni 2021: 7,38 %)		
4.600	Cembra Money Bank AG	313.450	1,01
5.250	Swiss Prime Site AG	439.309	1,42
1.764	Swisscom AG	929.533	3,00
2.289	Zurich Insurance Group AG	949.575	3,05
		<u>2.631.867</u>	<u>8,48</u>
	Vereinigtes Königreich: 21,89 % (30. Juni 2021: 29,47 %)		
38.000	Admiral Group Plc	990.565	3,20
82.725	Ashmore Group Plc	213.145	0,69
109.375	BAE Systems Plc	1.054.815	3,39
47.425	Brewin Dolphin Holdings Plc	282.068	0,91
47.125	GlaxoSmithKline Plc	966.541	3,11
87.150	IG Group Holdings Plc	699.049	2,25
44.850	Imperial Brands Plc	956.559	3,08
71.725	Jupiter Fund Management Plc	123.396	0,40
50.850	Moneysupermarket.com Group Plc	102.841	0,33
15.300	Rio Tinto Plc	873.824	2,82
61.000	Tate & Lyle Plc	531.031	1,71
		<u>6.793.834</u>	<u>21,89</u>
	Aktien insgesamt	<u>30.885.281</u>	<u>99,52</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>30.885.281</u>	<u>99,52</u>
	Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2021: (0,00) %)		
	Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2021: (0,00) %)*		
Nominal- betrag EUR	Durchschnittlicher Anschaffungskurs EUR	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermögens
123.330	411		
	6 of Stoxx Europe 600 Long Futures Contracts Expiring September 2022	(1.890)	(0,01)
	Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	<u>(1.890)</u>	<u>(0,01)</u>
	Derivative Finanzinstrumente insgesamt	<u>(1.890)</u>	<u>(0,01)</u>
		Zeitwert EUR	% des Netto- vermögens
	Anlageportfolio	30.883.391	99,51
	Sonstiges Nettovermögen	150.896	0,49
	Nettovermögen	<u>31.034.287</u>	<u>100,00</u>
			% des Gesamt- vermögens
	Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,36
	Sonstiges Umlaufvermögen		0,64
	Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 12.046 EUR.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,56 % (30. Juni 2021: 99,72 %)		
	Aktien: 99,56 % (30. Juni 2021: 99,72 %)		
	Österreich: 0,50 % (30. Juni 2021: 0,33 %)		
656	OMV AG	29.363	0,50
		<u>29.363</u>	<u>0,50</u>
	Belgien: 0,31 % (30. Juni 2021: 0,43 %)		
48	D'ieren Group	6.701	0,12
804	Proximus SADP	11.308	0,19
		<u>18.009</u>	<u>0,31</u>
	Dänemark: 6,64 % (30. Juni 2021: 7,56 %)		
14	AP Moller - Maersk A/S 'A' Shares	30.780	0,53
31	AP Moller - Maersk A/S 'B' Shares	69.010	1,18
688	Coloplast A/S	74.789	1,28
1.240	Novo Nordisk A/S	131.259	2,25
880	Novozymes A/S	50.410	0,86
528	Pandora A/S	31.701	0,54
		<u>387.949</u>	<u>6,64</u>
	Finnland: 2,16 % (30. Juni 2021: 3,70 %)		
700	Elisa OYJ	37.534	0,64
1.448	Kone OYJ	65.681	1,13
540	Orion OYJ	23.004	0,39
		<u>126.219</u>	<u>2,16</u>
	Frankreich: 8,56 % (30. Juni 2021: 9,06 %)		
164	BioMerieux	15.285	0,26
115	Hermes International	122.705	2,09
176	Ipsen SA	15.849	0,27
960	Klepierre SA	17.626	0,30
372	La Francaise des Jeux SAEM	12.283	0,21
7.164	Orange SA	80.380	1,38
1.216	Sanofi	117.149	2,01
2.360	TotalEnergies SE	118.873	2,04
		<u>500.150</u>	<u>8,56</u>
	Deutschland: 6,54 % (30. Juni 2021: 5,22 %)		
1.756	BASF SE	72.918	1,25
204	Bayerische Motoren Werke AG (common stock)	13.790	0,24
1.096	Bayerische Motoren Werke AG (preferred stock)	80.512	1,38
728	Covestro AG	24.009	0,41
3.244	Deutsche Post AG	115.942	1,99
744	Porsche Automobil Holding SE	46.961	0,80
18	Rational AG	9.981	0,17
80	Rheinmetall AG	17.624	0,30
		<u>381.737</u>	<u>6,54</u>
	Italien: 3,02 % (30. Juni 2021: 3,66 %)		
4.240	Assicurazioni Generali SpA	64.554	1,11
116	DiaSorin SpA	14.523	0,25
816	Moncler SpA	33.399	0,57
496	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	20.589	0,35
8.700	Snam SpA	43.491	0,74
		<u>176.556</u>	<u>3,02</u>
	Jersey: 1,68 % (30. Juni 2021: null)		
18.932	Glencore Plc	97.888	1,68
		<u>97.888</u>	<u>1,68</u>
	Luxemburg: 0,59 % (30. Juni 2021: null)		
1.324	ArcelorMittal SA	28.479	0,49
1.952	Aroundtown SA	5.920	0,10
		<u>34.399</u>	<u>0,59</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,56 % (30. Juni 2021: 99,72 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,56 % (30. Juni 2021: 99,72 %) (Fortsetzung)		
	Niederlande: 11,22 % (30. Juni 2021: 11,95 %)		
241	ASML Holding NV	109.860	1,88
532	Ferrari NV	93.206	1,60
4.824	Koninklijke Ahold Delhaize NV	119.925	2,06
13.164	Koninklijke KPN NV	44.771	0,77
1.300	NN Group NV	56.342	0,96
224	OCI NV	7.052	0,12
396	Randstad NV	18.295	0,31
9.012	Stellantis NV	106.270	1,82
1.072	Wolters Kluwer NV	99.224	1,70
		<u>654.945</u>	<u>11,22</u>
	Norwegen: 3,95 % (30. Juni 2021: 1,65 %)		
304	Aker BP ASA	10.069	0,17
2.420	Equinor ASA	80.258	1,38
600	Gjensidige Forsikring ASA	11.589	0,20
168	Kongsberg Gruppen ASA	5.742	0,10
4.180	Norsk Hydro ASA	22.323	0,38
3.316	Orkla ASA	25.273	0,43
3.532	Telenor ASA	44.796	0,77
764	Yara International ASA	30.445	0,52
		<u>230.495</u>	<u>3,95</u>
	Portugal: 0,42 % (30. Juni 2021: 0,25 %)		
1.184	Jeronimo Martins SGPS SA	24.556	0,42
		<u>24.556</u>	<u>0,42</u>
	Spanien: 8,80 % (30. Juni 2021: 8,15 %)		
32.188	Banco Santander SA	86.521	1,47
17.908	CaixaBank SA	59.401	1,02
1.100	Enagas SA	23.177	0,40
1.552	Endesa SA	27.936	0,48
4.768	Industria de Diseno Textil SA	102.941	1,76
792	Naturgy Energy Group SA	21.756	0,37
2.036	Red Electrica Corp SA	36.699	0,63
3.596	Repsol SA	50.524	0,87
21.596	Telefonica SA	105.000	1,80
		<u>513.955</u>	<u>8,80</u>
	Schweden: 6,05 % (30. Juni 2021: 7,35 %)		
380	Aker BP ASA ADR	17.631	0,31
8.024	Atlas Copco AB 'A' Shares	71.581	1,23
4.800	Atlas Copco AB 'B' Shares	38.326	0,66
1.388	Boliden A	42.153	0,72
712	Electrolux AB	9.149	0,16
2.744	Epiroc AB 'A' Shares	40.456	0,69
1.628	Epiroc AB 'B' Shares	21.001	0,36
1.416	Husqvarna AB	9.945	0,17
1.408	Investor AB	24.137	0,41
6.212	Swedish Match AB	60.420	1,03
1.688	Tele2 AB	18.356	0,31
		<u>353.155</u>	<u>6,05</u>
	Schweiz: 16,33 % (30. Juni 2021: 17,32 %)		
36	EMS-Chemie Holding AG	25.556	0,43
180	Geberit AG	82.513	1,40
276	Kuehne & Nagel International AG	62.322	1,07
868	Logitech International SA	43.250	0,74
1.104	Nestle SA	122.924	2,11
1.460	Novartis AG	117.939	2,02
117	Partners Group Holding AG	100.557	1,72
380	Roche Holding AG (non-voting rights)	120.945	2,07
12	Roche Holding AG (voting rights)	4.417	0,08
26	SGS SA	56.761	0,97

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,56 % (30. Juni 2021: 99,72 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,56 % (30. Juni 2021: 99,72 %) (Fortsetzung)		
	Schweiz: 16,33 % (30. Juni 2021: 17,32 %) (Fortsetzung)		
124	Swisscom AG	65.341	1,12
76	VAT Group AG	17.283	0,30
88	Vifor Pharma AG	14.551	0,25
288	Zurich Insurance Group AG	119.475	2,05
		<u>953.834</u>	<u>16,33</u>
	Vereinigtes Königreich: 22,79 % (30. Juni 2021: 23,09 %)		
1.044	Admiral Group Plc	27.214	0,47
2.980	Anglo American Plc	101.671	1,74
816	Antofagasta Plc	10.948	0,19
4.444	Auto Trader Group Plc	28.651	0,49
5.968	BAE Systems Plc	57.556	0,99
3.412	Barratt Developments Plc	18.129	0,31
24.944	BP Plc	112.515	1,93
3.004	British American Tobacco Plc	122.817	2,09
5.952	GlaxoSmithKline Plc	122.076	2,09
1.924	Hargreaves Lansdown Plc	17.607	0,30
648	Hikma Pharmaceuticals Plc	12.176	0,21
5.472	Imperial Brands Plc	116.707	2,00
560	Intertek Group Plc	27.361	0,47
596	Next Plc	40.571	0,69
1.720	Persimmon Plc	37.224	0,64
4.596	RELX Plc	118.845	2,04
1.932	Rio Tinto Plc	110.342	1,89
4.424	Shell Plc	109.670	1,88
6.900	Taylor Wimpey Plc	9.350	0,16
2.984	Unilever Plc	128.984	2,21
		<u>1.330.414</u>	<u>22,79</u>
	Aktien insgesamt	<u>5.813.624</u>	<u>99,56</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>5.813.624</u>	<u>99,56</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2021: null)*

Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2021: null)*

Nominal- betrag EUR	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs EUR		Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto- vermö- gens
20.675	414	1 of Stoxx Europe 600 Long Futures Contracts Expiring September 2022	(435)	(0,01)
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	<u>(435)</u>	<u>(0,01)</u>
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	<u>(435)</u>	<u>(0,01)</u>

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist JP Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 2.163 EUR.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
Anlageportfolio	5.813.189	99,55
Sonstiges Nettovermögen	26.379	0,45
Nettovermögen	<u>5.839.568</u>	<u>100,00</u>
		% des Gesamt- vermö- gens
Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,23
Sonstiges Umlaufvermögen		0,77
Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,97 % (30. Juni 2021: 99,92 %)		
	Aktien: 99,97 % (30. Juni 2021: 99,92 %)		
	Australien: 6,64 % (30. Juni 2021: 5,28 %)		
6.328	ASX Ltd	355.557	0,88
11.480	Commonwealth Bank of Australia	713.480	1,77
6.356	Macquarie Group Ltd	719.025	1,79
9.324	Rio Tinto Ltd	658.476	1,63
10.206	Sonic Healthcare Ltd	231.669	0,57
		<u>2.678.207</u>	<u>6,64</u>
	Belgien: 0,10 % (30. Juni 2021: 0,14 %)		
2.870	Proximus SADP	42.201	0,10
		<u>42.201</u>	<u>0,10</u>
	Kanada: 7,65 % (30. Juni 2021: 8,84 %)		
13.440	Bank of Nova Scotia	793.720	1,97
2.170	IGM Financial Inc	58.037	0,14
8.484	Royal Bank of Canada	819.757	2,03
11.018	Sun Life Financial Inc	503.773	1,25
6.482	TELUS Corp	144.067	0,36
11.732	Toronto-Dominion Bank	767.703	1,90
		<u>3.087.057</u>	<u>7,65</u>
	Kaimaninseln: 1,43 % (30. Juni 2021: 1,45 %)		
33.600	Chailease Holding Co Ltd	235.612	0,58
28.000	China Medical System Holdings Ltd	43.676	0,11
15.000	Logan Group Co Ltd	4.167	0,01
39.000	Longfor Group Holdings Ltd	184.142	0,46
38.000	SITC International Holdings Co Ltd	107.507	0,27
		<u>575.104</u>	<u>1,43</u>
	China: 0,35 % (30. Juni 2021: 0,57 %)		
21.000	China Merchants Bank Co Ltd	132.185	0,33
4.200	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd	7.988	0,02
		<u>140.173</u>	<u>0,35</u>
	Dänemark: null (30. Juni 2021: 0,33 %)		
	Finnland: 1,46 % (30. Juni 2021: 2,57 %)		
3.220	Elisa OYJ	180.504	0,45
8.652	Kone OYJ	410.291	1,01
		<u>590.795</u>	<u>1,46</u>
	Deutschland: 2,61 % (30. Juni 2021: 2,35 %)		
4.088	Allianz SE	778.344	1,93
1.330	Hannover Rueck SE	192.577	0,48
994	LEG Immobilien AG	82.220	0,20
		<u>1.053.141</u>	<u>2,61</u>
	Griechenland: 0,12 % (30. Juni 2021: null)		
2.814	Hellenic Telecommunications Organization SA	48.747	0,12
		<u>48.747</u>	<u>0,12</u>
	Hongkong: 0,20 % (30. Juni 2021: 0,15 %)		
56.000	Sino Land Co Ltd	82.641	0,20
		<u>82.641</u>	<u>0,20</u>
	Indien: 0,30 % (30. Juni 2021: null)		
34.510	ITC Ltd	119.516	0,30
		<u>119.516</u>	<u>0,30</u>
	Indonesien: null (30. Juni 2021: 0,43 %)		
	Irland: 3,07 % (30. Juni 2021: 3,30 %)		
6.202	Eaton Corp Plc	781.390	1,94
6.384	Seagate Technology Holdings Plc	456.073	1,13
		<u>1.237.463</u>	<u>3,07</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,97 % (30. Juni 2021: 99,92 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,97 % (30. Juni 2021: 99,92 %) (Fortsetzung)		
	Japan: 8,76 % (30. Juni 2021: 8,25 %)		
2.600	Daito Trust Construction Co Ltd	224.107	0,56
7.900	Daiwa House Industry Co Ltd	183.871	0,46
5.600	Hulic Co Ltd	43.281	0,11
1.400	Iida Group Holdings Co Ltd	21.527	0,05
23.800	KDDI Corp	751.376	1,85
22.000	Nippon Telegraph & Telephone Corp	630.908	1,56
23.800	ORIX Corp	398.725	0,99
9.800	Sekisui House Ltd	171.431	0,43
6.200	Sompo Holdings Inc	273.046	0,68
8.400	T&D Holdings Inc	100.413	0,25
12.600	Tokio Marine Holdings Inc	732.971	1,82
		<u>3.531.656</u>	<u>8,76</u>
	Jersey: 0,00 % (30. Juni 2021: 0,32 %)		
19.136	Polymetal International Plc	-	0,00
		-	0,00
	Malaysia: 0,14 % (30. Juni 2021: 0,11 %)		
15.400	Petronas Gas Bhd	57.442	0,14
		<u>57.442</u>	<u>0,14</u>
	Niederlande: 1,22 % (30. Juni 2021: 1,21 %)		
5.628	LyondellBasell Industries NV	492.225	1,22
		<u>492.225</u>	<u>1,22</u>
	Neuseeland: 0,37 % (30. Juni 2021: 0,44 %)		
49.378	Spark New Zealand Ltd	147.364	0,37
		<u>147.364</u>	<u>0,37</u>
	Norwegen: 0,27 % (30. Juni 2021: 0,28 %)		
13.734	Orkla ASA	109.430	0,27
		<u>109.430</u>	<u>0,27</u>
	Philippinen: 0,04 % (30. Juni 2021: 0,04 %)		
350	Globe Telecom Inc	14.437	0,04
		<u>14.437</u>	<u>0,04</u>
	Katar: 0,61 % (30. Juni 2021: 1,56 %)		
15.246	Qatar International Islamic Bank QSC	44.628	0,11
32.970	Qatar Islamic Bank SAQ	201.436	0,50
		<u>246.064</u>	<u>0,61</u>
	Russland: 0,00 % (30. Juni 2021: 0,47 %)		
61.664	Tatneft PJSC	-	0,00
		-	0,00
	Saudi-Arabien: 2,49 % (30. Juni 2021: 3,55 %)		
33.726	Al Rajhi Bank	741.557	1,84
10.108	Saudi Telecom Co	261.583	0,65
		<u>1.003.140</u>	<u>2,49</u>
	Singapur: 0,17 % (30. Juni 2021: 0,88 %)		
5.600	Venture Corp Ltd	66.917	0,17
		<u>66.917</u>	<u>0,17</u>
	Südafrika: 0,31 % (30. Juni 2021: 0,24 %)		
1.400	African Rainbow Minerals Ltd	18.266	0,05
3.024	Exxaro Resources Ltd	36.581	0,09
6.538	Mr Price Group Ltd	70.787	0,17
		<u>125.634</u>	<u>0,31</u>
	Spanien: 0,32 % (30. Juni 2021: 0,29 %)		
6.832	Red Electrica Corp SA	128.744	0,32
		<u>128.744</u>	<u>0,32</u>
	Schweiz: 9,03 % (30. Juni 2021: 9,31 %)		
196	EMS-Chemie Holding AG	145.462	0,36
4.466	Garmin Ltd	438.785	1,09
9.576	Novartis AG	808.711	2,01
2.492	Roche Holding AG (non-voting rights)	829.191	2,06

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,97 % (30. Juni 2021: 99,92 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,97 % (30. Juni 2021: 99,92 %) (Fortsetzung)		
	Schweiz: 9,03 % (30. Juni 2021: 9,31 %) (Fortsetzung)		
84	Roche Holding AG (voting rights)	32.324	0,08
140	SGS SA	319.528	0,79
448	Swisscom AG	246.801	0,61
1.890	Zurich Insurance Group AG	819.688	2,03
		<u>3.640.490</u>	<u>9,03</u>
	Taiwan: 2,41 % (30. Juni 2021: 2,38 %)		
3.000	Nien Made Enterprise Co Ltd	29.563	0,07
9.000	Realtek Semiconductor Corp	109.876	0,27
48.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	768.426	1,91
25.000	Vanguard International Semiconductor Corp	64.574	0,16
		<u>972.439</u>	<u>2,41</u>
	Türkei: 0,17 % (30. Juni 2021: 0,09 %)		
6.076	BIM Birlesik Magazalar AS	29.422	0,07
2.394	Ford Otomotiv Sanayi AS	38.283	0,10
		<u>67.705</u>	<u>0,17</u>
	Vereinigte Arabische Emirate: 1,20 % (30. Juni 2021: 0,38 %)		
49.056	Aldar Properties PJSC	59.432	0,15
59.864	Emirates Telecommunications Group Co PJSC	425.376	1,05
		<u>484.808</u>	<u>1,20</u>
	Vereinigtes Königreich: 7,57 % (30. Juni 2021: 6,00 %)		
39.032	GlaxoSmithKline Plc	836.937	2,08
115.038	Legal & General Group Plc	334.600	0,83
12.586	Rio Tinto Plc	751.490	1,86
2.968	Schroders Plc	96.312	0,24
11.536	St James's Place Plc	154.459	0,38
19.502	Unilever Plc	881.290	2,18
		<u>3.055.088</u>	<u>7,57</u>
	Vereinigte Staaten: 40,96 % (30. Juni 2021: 38,71 %)		
5.740	3M Co	742.813	1,84
3.444	Amgen Inc	837.925	2,08
2.604	CF Industries Holdings Inc	223.241	0,55
20.174	Cisco Systems Inc	860.219	2,13
14.014	Coca-Cola Co	881.621	2,19
3.178	Cummins Inc	615.038	1,52
10.094	Emerson Electric Co	802.877	1,99
8.078	Fidelity National Financial Inc	298.563	0,74
4.830	Johnson & Johnson	857.373	2,13
6.538	Kimberly-Clark Corp	883.611	2,19
1.974	Lockheed Martin Corp	848.741	2,10
9.128	Merck & Co Inc	832.200	2,06
2.604	NetApp Inc	169.885	0,42
6.972	Nucor Corp	727.947	1,80
2.044	Packaging Corp of America	281.050	0,70
7.266	Paychex Inc	827.379	2,05
16.604	Pfizer Inc	870.548	2,16
8.358	Philip Morris International Inc	825.269	2,05
5.936	Procter & Gamble Co	853.537	2,12
6.440	QUALCOMM Inc	822.646	2,04
1.134	Southern Copper Corp	56.485	0,14
5.110	T Rowe Price Group Inc	580.547	1,44
5.502	Target Corp	777.047	1,93
5.040	United Parcel Service Inc	920.002	2,28
7.686	Western Union Co	126.588	0,31
		<u>16.523.152</u>	<u>40,96</u>
	Aktien insgesamt	<u>40.321.780</u>	<u>99,97</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>40.321.780</u>	<u>99,97</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
Anlageportfolio	40.321.780	99,97
Sonstiges Nettovermögen	12.393	0,03
Nettovermögen	<u>40.334.173</u>	<u>100,00</u>
		% des Gesamt- vermö- gens
Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,77
Sonstiges Umlaufvermögen		0,23
Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %)		
	Aktien: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %)		
	Australien: 4,71 % (30. Juni 2021: 4,35 %)		
2.088	ASX Ltd	117.320	0,47
5.232	BlueScope Steel Ltd	57.205	0,23
16.592	Brambles Ltd	122.196	0,48
15.296	Coles Group Ltd	187.331	0,74
11.920	Dexus	72.787	0,29
9.960	Evolution Mining Ltd	16.301	0,06
19.424	Fortescue Metals Group Ltd	234.146	0,93
7.672	Goodman Group	94.118	0,37
1.152	Mineral Resources Ltd	38.238	0,15
31.064	Mirvac Group	42.188	0,17
9.360	Newcrest Mining Ltd	134.456	0,53
384	REA Group Ltd	29.530	0,12
5.792	Suncorp Group Ltd	43.732	0,17
		<u>1.189.548</u>	<u>4,71</u>
	Bermuda: 0,22 % (30. Juni 2021: 0,38 %)		
3.440	Invesco Ltd	55.487	0,22
		<u>55.487</u>	<u>0,22</u>
	Brasilien: 0,46 % (30. Juni 2021: 0,71 %)		
1.600	Banco Santander Brasil SA	8.815	0,03
16.800	Cia Energetica de Minas Gerais	33.347	0,13
6.400	Telefonica Brasil SA	57.593	0,24
6.400	TIM SA	15.616	0,06
		<u>115.371</u>	<u>0,46</u>
	Kanada: 7,35 % (30. Juni 2021: 5,42 %)		
2.264	Agnico Eagle Mines Ltd	103.411	0,41
4.232	Bank of Nova Scotia	249.927	0,99
2.408	Canadian National Railway Co	270.285	1,07
568	Canadian Tire Corp Ltd	71.509	0,28
936	Gildan Activewear Inc	26.884	0,11
840	Intact Financial Corp	118.230	0,47
2.696	Magna International Inc	147.721	0,59
1.328	Metro Inc	71.128	0,28
2.632	Nutrien Ltd	209.160	0,83
2.720	Pembina Pipeline Corp	95.942	0,38
3.376	Rogers Communications Inc	161.426	0,64
2.368	TELUS Corp	52.630	0,21
392	Toromont Industries Ltd	31.629	0,13
3.720	Toronto-Dominion Bank	243.425	0,96
		<u>1.853.307</u>	<u>7,35</u>
	Kaimaninseln: 0,47 % (30. Juni 2021: 1,53 %)		
11.550	Chailease Holding Co Ltd	80.992	0,32
8.000	China Lesso Group Holdings Ltd	12.071	0,05
16.000	China Medical System Holdings Ltd	24.957	0,10
		<u>118.020</u>	<u>0,47</u>
	Chile: 0,08 % (30. Juni 2021: 0,15 %)		
223.040	Enel Americas SA	20.736	0,08
		<u>20.736</u>	<u>0,08</u>
	China: 0,07 % (30. Juni 2021: 1,17 %)		
6.000	A-Living Smart City Services Co Ltd	9.650	0,04
3.200	Sinotrans Ltd	1.852	0,01
800	Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	2.533	0,01
800	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	2.869	0,01
		<u>16.904</u>	<u>0,07</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Tschechische Republik: 0,03 % (30. Juni 2021: null)		
2.056	Moneta Money Bank AS	7.447	0,03
		<u>7.447</u>	<u>0,03</u>
	Dänemark: 2,70 % (30. Juni 2021: 3,33 %)		
22	AP Moller - Maersk A/S 'A' Shares	50.567	0,20
40	AP Moller - Maersk A/S 'B' Shares	93.093	0,37
1.600	Coloplast A/S	181.833	0,72
2.552	Novo Nordisk A/S	282.416	1,12
1.176	Pandora A/S	73.817	0,29
		<u>681.726</u>	<u>2,70</u>
	England: null (30. Juni 2021: 0,80 %)		
	Finnland: 1,09 % (30. Juni 2021: 1,04 %)		
1.512	Elisa OYJ	84.758	0,34
1.192	Orion OYJ	53.087	0,21
4.544	UPM-Kymmene OYJ	137.813	0,54
		<u>275.658</u>	<u>1,09</u>
	Frankreich: 1,80 % (30. Juni 2021: 1,88 %)		
5.504	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	149.464	0,59
1.248	Klepierre SA	23.955	0,09
816	L'Oreal SA	280.921	1,12
		<u>454.340</u>	<u>1,80</u>
	Deutschland: 0,97 % (30. Juni 2021: 2,13 %)		
1.288	Allianz SE	245.232	0,97
		<u>245.232</u>	<u>0,97</u>
	Hongkong: 0,92 % (30. Juni 2021: 1,63 %)		
36.000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	142.221	0,57
32.000	China Everbright Environment Group Ltd	18.881	0,07
48.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	47.652	0,19
9.600	Swire Properties Ltd	23.832	0,09
		<u>232.586</u>	<u>0,92</u>
	Indien: 1,67 % (30. Juni 2021: 1,72 %)		
1.264	Colgate-Palmolive India Ltd	23.798	0,09
5.336	Dabur India Ltd	33.510	0,13
1.216	Hero MotoCorp Ltd	41.877	0,17
7.128	Hindustan Unilever Ltd	201.332	0,80
5.704	Marico Ltd	34.518	0,14
392	Nestle India Ltd	86.717	0,34
		<u>421.752</u>	<u>1,67</u>
	Indonesien: 0,64 % (30. Juni 2021: 0,06 %)		
186.400	Kalbe Farma Tbk PT	20.770	0,08
464.000	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	124.585	0,50
50.400	Unilever Indonesia Tbk PT	16.137	0,06
		<u>161.492</u>	<u>0,64</u>
	Irland: 0,23 % (30. Juni 2021: 0,31 %)		
2.608	James Hardie Industries Plc	56.976	0,23
		<u>56.976</u>	<u>0,23</u>
	Israel: 0,36 % (30. Juni 2021: null)		
10.232	Bank Leumi Le-Israel BM	90.717	0,36
		<u>90.717</u>	<u>0,36</u>
	Italien: null (30. Juni 2021: 1,22 %)		

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Japan: 8,48 % (30. Juni 2021: 11,53 %)		
4.000	Ajinomoto Co Inc	97.162	0,39
11.200	Asahi Kasei Corp	85.409	0,34
17.600	Astellas Pharma Inc	273.999	1,09
1.500	Fujitsu Ltd	187.314	0,74
4.000	Hulic Co Ltd	30.915	0,12
2.400	JFE Holdings Inc	25.262	0,10
4.000	Kao Corp	161.113	0,64
7.500	KDDI Corp	236.778	0,94
1.400	Nitto Denko Corp	90.479	0,36
2.900	Nomura Research Institute Ltd	77.060	0,31
9.900	ORIX Corp	165.856	0,66
6.400	Sekisui House Ltd	111.955	0,44
3.200	SG Holdings Co Ltd	53.916	0,21
16.000	SoftBank Corp	177.424	0,70
1.600	Sompo Holdings Inc	70.463	0,28
7.200	Sumitomo Chemical Co Ltd	28.142	0,11
800	Suntory Beverage & Food Ltd	30.209	0,12
586	Tokyo Electron Ltd	191.085	0,76
2.400	Yamaha Motor Co Ltd	43.917	0,17
		<u>2.138.458</u>	<u>8,48</u>
	Jersey: 0,92 % (30. Juni 2021: 1,25 %)		
2.072	Ferguson Plc	231.201	0,92
3.654	Polymetal International Plc	-	0,00
		<u>231.201</u>	<u>0,92</u>
	Malaysia: 0,86 % (30. Juni 2021: 0,68 %)		
16.800	AMMB Holdings Bhd	14.218	0,06
36.000	DiGi.Com Bhd	28.588	0,11
6.400	HAP Seng Consolidated Bhd	10.353	0,04
26.400	Hartalega Holdings Bhd	18.329	0,07
2.400	Kuala Lumpur Kepong Bhd	11.947	0,05
24.000	Malayan Banking Bhd	46.774	0,18
18.400	Maxis Bhd	13.777	0,05
800	Nestle Malaysia Bhd	24.068	0,10
2.400	Petronas Dagangan Bhd	11.500	0,05
16.800	RHB Bank Bhd	21.841	0,09
29.600	Sime Darby Bhd	14.305	0,06
		<u>215.700</u>	<u>0,86</u>
	Mexiko: 0,09 % (30. Juni 2021: null)		
2.312	Arca Continental SAB de CV	15.184	0,06
792	Industrias Penoles SAB de CV	7.309	0,03
		<u>22.493</u>	<u>0,09</u>
	Niederlande: 1,37 % (30. Juni 2021: 1,31 %)		
504	ASML Holding NV	240.190	0,95
2.336	NN Group NV	105.844	0,42
		<u>346.034</u>	<u>1,37</u>
	Neuseeland: null (30. Juni 2021: 0,65 %)		
	Norwegen: 0,64 % (30. Juni 2021: 0,64 %)		
7.704	Orkla ASA	61.384	0,24
7.576	Telenor ASA	100.454	0,40
		<u>161.838</u>	<u>0,64</u>
	Pakistan: null (30. Juni 2021: 0,01 %)		

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Philippinen: null (30. Juni 2021: 0,02 %)		
	Portugal: null (30. Juni 2021: 0,13 %)		
	Katar: 0,10 % (30. Juni 2021: 0,08 %)		
5.064	Qatar Fuel QSC	24.821	0,10
		<u>24.821</u>	<u>0,10</u>
	Russland: 0,00 % (30. Juni 2021: 0,31 %)		
9	Phosagro PJSC	-	0,00
1.342	PhosAgro PJSC GDR	-	0,00
357	Polyus PJSC	-	0,00
		<u>-</u>	<u>0,00</u>
	Saudi-Arabien: null (30. Juni 2021: 0,04 %)		
	Singapur: 0,15 % (30. Juni 2021: 0,27 %)		
13.600	Capitaland Investment Ltd	37.330	0,15
		<u>37.330</u>	<u>0,15</u>
	Südafrika: 1,55 % (30. Juni 2021: 0,60 %)		
2.304	Clicks Group Ltd	38.438	0,15
7.560	Gold Fields Ltd	70.604	0,28
16.560	Growthpoint Properties Ltd	12.484	0,05
7.304	Impala Platinum Holdings Ltd	80.760	0,32
1.160	Kumba Iron Ore Ltd	37.220	0,15
7.768	MTN Group Ltd	62.609	0,25
2.280	Shoprite Holdings Ltd	27.540	0,11
7.584	Vodacom Group Ltd	60.704	0,24
		<u>390.359</u>	<u>1,55</u>
	Südkorea: 1,48 % (30. Juni 2021: 1,22 %)		
552	Coway Co Ltd	27.166	0,11
1.592	Hana Financial Group Inc	48.248	0,19
2.144	KB Financial Group Inc	79.508	0,32
912	LG Corp	54.717	0,22
4.640	Shinhan Financial Group Co Ltd	132.404	0,52
3.272	Woori Financial Group Inc	30.492	0,12
		<u>372.535</u>	<u>1,48</u>
	Spanien: 1,28 % (30. Juni 2021: 2,17 %)		
10.320	Industria de Diseno Textil SA	232.936	0,92
4.832	Red Electrica Corp SA	91.055	0,36
		<u>323.991</u>	<u>1,28</u>
	Schweden: 0,61 % (30. Juni 2021: 0,71 %)		
3.384	Boliden AB	107.440	0,42
2.016	Electrolux AB	27.082	0,11
2.792	Husqvarna AB	20.500	0,08
		<u>155.022</u>	<u>0,61</u>
	Schweiz 2,74 % (30. Juni 2021: 2,55 %)		
608	Kuehne & Nagel International AG	143.530	0,57
816	Roche Holding AG	271.517	1,08
48	SGS SA	109.552	0,43
2.168	Swiss Re AG	167.534	0,66
		<u>692.133</u>	<u>2,74</u>
	Taiwan: 3,59 % (30. Juni 2021: 2,62 %)		
16.000	Acer Inc	11.677	0,05
66.000	Cathay Financial Holding Co Ltd	112.984	0,45
40.000	Chunghwa Telecom Co Ltd	164.125	0,65

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Taiwan: 3,59 % (30. Juni 2021: 2,62 %) (Fortsetzung)		
27.000	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	76.822	0,30
16.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	44.986	0,18
64.000	Fubon Financial Holding Co Ltd	128.717	0,51
4.400	President Chain Store Corp	40.325	0,16
48.000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	27.121	0,11
16.000	Taiwan Mobile Co Ltd	58.116	0,23
15.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	240.133	0,95
		<u>905.006</u>	<u>3,59</u>
	Thailand: 0,81 % (30. Juni 2021: 1,01 %)		
12.800	Advanced Info Service PCL	70.417	0,28
52.800	Home Product Center PCL	18.966	0,08
16.800	Intouch Holdings PCL	32.550	0,13
7.700	Siam Cement PCL	81.454	0,32
		<u>203.387</u>	<u>0,81</u>
	Türkei: null (30. Juni 2021: 0,08 %)		
	Vereinigte Arabische Emirate: 0,13 % (30. Juni 2021: null)		
13.448	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	32.438	0,13
		<u>32.438</u>	<u>0,13</u>
	Vereinigtes Königreich 5,27 % (30. Juni 2021: 4,31 %)		
12.288	Barratt Developments Plc	68.259	0,27
1.096	Berkeley Group Holdings Plc	49.568	0,20
63.520	BT Group Plc	143.715	0,57
1.600	Bunzl Plc	52.833	0,21
15.048	J Sainsbury Plc	37.281	0,15
1.512	Johnson Matthey Plc	35.357	0,14
21.880	Kingfisher Plc	64.916	0,26
4.656	Mondi Plc	82.273	0,33
17.320	National Grid Plc	221.281	0,88
9.520	RELX Plc	257.361	1,01
1.136	Schroders Plc	36.863	0,15
6.160	Unilever Plc	278.368	1,10
		<u>1.328.075</u>	<u>5,27</u>
	Vereinigte Staaten 45,63 % (30. Juni 2021: 39,72 %)		
664	A O Smith Corp	36.308	0,14
1.136	American Tower Corp	290.350	1,16
1.256	AmerisourceBergen Corp	177.699	0,70
1.080	Amgen Inc	262.764	1,04
6.112	Bank of New York Mellon Corp	254.932	1,01
2.640	Best Buy Co Inc	172.102	0,68
1.368	Biogen Inc	278.990	1,11
3.008	Cardinal Health Inc	157.228	0,62
1.192	CH Robinson Worldwide Inc	120.833	0,48
1.448	Clorox Co	204.139	0,81
4.424	Coca-Cola Co	278.314	1,10
3.552	Colgate-Palmolive Co	284.657	1,13
2.328	Conagra Brands Inc	79.711	0,32
2.800	Consolidated Edison Inc	266.280	1,06
1.312	Cummins Inc	253.911	1,01
2.040	Electronic Arts Inc	248.166	0,98
1.640	Expeditors International of Washington Inc	159.834	0,63
400	FactSet Research Systems Inc	153.828	0,61
5.168	Fastenal Co	257.987	1,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,47 % (30. Juni 2021: 99,74 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten 45,63 % (30. Juni 2021: 39,72 %) (Fortsetzung)		
4.016	General Mills Inc	303.007	1,20
4.192	Gilead Sciences Inc	259.108	1,03
1.304	HCA Healthcare Inc	219.150	0,87
1.344	Hologic Inc	93.139	0,37
920	Home Depot Inc	252.328	1,00
2.616	Hormel Foods Corp	123.894	0,49
728	IDEXX Laboratories Inc	255.331	1,01
1.320	Illinois Tool Works Inc	240.570	0,95
3.160	Interpublic Group of Co Inc	86.995	0,34
2.616	Kellogg Co	186.625	0,74
2.056	Kimberly-Clark Corp	277.868	1,10
784	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	36.291	0,14
456	Laboratory Corp of America Holdings	106.868	0,42
1.224	LKQ Corp	60.086	0,24
1.424	Lowe's Co Inc	248.730	0,99
1.744	Marsh & McLennan Co Inc	270.756	1,07
216	Mettler-Toledo International Inc	248.134	0,98
1.048	Microsoft Corp	269.158	1,07
936	Moody's Corp	254.564	1,01
4.016	Newmont Corp	239.635	0,95
472	Old Dominion Freight Line Inc	120.964	0,48
496	Owens Corning	36.858	0,15
1.648	PepsiCo Inc	274.656	1,09
2.224	Phillips 66	182.346	0,72
1.376	Quest Diagnostics Inc	182.980	0,73
1.176	ResMed Inc	246.525	0,98
1.208	Robert Half International Inc	90.467	0,36
800	S&P Global Inc	269.648	1,07
2.216	T Rowe Price Group Inc	251.760	1,00
1.736	Target Corp	245.175	0,97
1.592	Texas Instruments Inc	244.611	0,97
1.016	Tractor Supply Co	196.952	0,78
1.136	Travelers Co Inc	192.132	0,76
1.000	UGI Corp	38.610	0,15
1.904	Ventas Inc	97.923	0,39
1.032	Vertex Pharmaceuticals Inc	290.808	1,16
600	Waters Corp	198.588	0,79
616	West Pharmaceutical Services Inc	186.260	0,74
424	WW Grainger Inc	192.678	0,76
		<u>11.510.211</u>	<u>45,63</u>
	Aktien insgesamt	<u>25.088.331</u>	<u>99,47</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>25.088.331</u>	<u>99,47</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2021: (0,00) %)

Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2021: (0,00) %)*

Nominal- betrag USD	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermö- gens
63.403	317	MSCI ACWI Long Futures Contracts Expiring September 2022	(1.053)	(0,01)
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	(1.053)	(0,01)
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	(1.053)	(0,01)
			Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
		Anlageportfolio	25.087.278	99,46
		Sonstiges Nettovermögen	134.965	0,54
		Nettovermögen	25.222.243	100,00
				% des Gesamt- vermö- gens
		Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,40
		Sonstiges Umlaufvermögen		0,60
		Gesamtvermögen		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 6.833 USD.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %)		
	Aktien: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %)		
	Bermuda: 0,31 % (30. Juni 2021: 0,27 %)		
360,00	Axis Capital Holdings Ltd	20.552	0,02
1.305,00	Bunge Ltd	118.351	0,13
5.625,00	Invesco Ltd	90.731	0,10
1.800,00	Lazard Ltd	58.338	0,06
		<u>287.972</u>	<u>0,31</u>
	Guernsey: 0,22 % (30. Juni 2021: 0,18 %)		
2.475,00	Amdocs Ltd	206.192	0,22
		<u>206.192</u>	<u>0,22</u>
	Irland: 1,12 % (30. Juni 2021: 1,89 %)		
3.375,00	Accenture Plc	937.069	0,99
1.215,00	Allegion Plc	118.948	0,13
		<u>1.056.017</u>	<u>1,12</u>
	Jersey: 0,20 % (30. Juni 2021: 0,08 %)		
14.760,00	Amcor Plc	183.467	0,20
		<u>183.467</u>	<u>0,20</u>
	Niederlande: 0,55 % (30. Juni 2021: 0,52 %)		
5.940,00	LyondellBasell Industries NV	519.512	0,55
		<u>519.512</u>	<u>0,55</u>
	Vereinigte Staaten: 97,41 % (30. Juni 2021: 96,39 %)		
6.795,00	3M Co	879.341	0,93
1.845,00	A O Smith Corp	100.885	0,11
6.885,00	AbbVie Inc	1.054.507	1,12
9.810,00	Activision Blizzard Inc	763.807	0,81
3.285,00	Air Products & Chemicals Inc	789.977	0,84
4.005,00	Alliant Energy Corp	234.733	0,25
1.800,00	Allison Transmission Holdings Inc	69.210	0,07
232,00	Alphabet Inc 'A' Shares	505.588	0,54
214,00	Alphabet Inc 'C' Shares	468.114	0,50
18.720,00	Altria Group Inc	781.934	0,83
3.870,00	Ameren Corp	349.693	0,37
6.885,00	American Electric Power Co Inc	660.547	0,70
3.915,00	Amgen Inc	952.520	1,00
1.575,00	APA Corp	54.968	0,06
6.750,00	Apple Inc	922.860	0,98
8.640,00	Applied Materials Inc	786.067	0,84
5.670,00	Archer-Daniels-Midland Co	439.992	0,47
451,00	Aspen Technology Inc	82.840	0,09
47.565,00	AT&T Inc	996.962	1,06
4.545,00	Automatic Data Processing Inc	954.632	1,02
450,00	AutoNation Inc	50.292	0,05
384,00	AutoZone Inc	825.262	0,88
630,00	AvalonBay Communities Inc	122.378	0,13
4.545,00	Best Buy Co Inc	296.289	0,32
585,00	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	36.457	0,04
5.130,00	Blackstone Inc	468.010	0,50
1.980,00	Booz Allen Hamilton Holding Corp	178.913	0,19
13.410,00	Bristol-Myers Squibb Co	1.032.569	1,10
765,00	Brunswick Corp	50.016	0,05
810,00	Builders FirstSource Inc	43.497	0,05
1.935,00	Cadence Design Systems Inc	290.308	0,31
2.610,00	Campbell Soup Co	125.411	0,13
810,00	Carter's Inc	57.089	0,06
630,00	Casey's General Stores Inc	116.537	0,12

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 97,41 % (30. Juni 2021: 96,39 %) (Fortsetzung)		
1.845,00	Celanese Corp	216.990	0,23
1.080,00	CF Industries Holdings Inc	92.588	0,10
2.475,00	CH Robinson Worldwide Inc	250.891	0,27
270,00	Chemed Corp	126.735	0,13
5.805,00	Chevron Corp	840.448	0,89
135,00	Choice Hotels International Inc	15.070	0,02
4.410,00	Church & Dwight Co Inc	408.631	0,43
1.440,00	Cintas Corp	537.883	0,57
22.500,00	Cisco Systems Inc	959.400	1,02
3.735,00	Cleveland-Cliffs Inc	57.407	0,06
15.975,00	Coca-Cola Co	1.004.986	1,07
8.685,00	Cognizant Technology Solutions Corp	586.151	0,62
675,00	Coinbase Global Inc	31.739	0,03
22.680,00	Comcast Corp	889.963	0,95
4.635,00	Conagra Brands Inc	158.702	0,17
6.525,00	ConocoPhillips	586.010	0,62
5.940,00	Consolidated Edison Inc	564.894	0,60
180,00	Continental Resources Inc	11.763	0,01
2.160,00	Costco Wholesale Corp	1.035.244	1,10
10.215,00	Coterra Energy Inc	263.445	0,28
2.700,00	Cummins Inc	522.531	0,56
10.395,00	CVS Health Corp	963.201	1,02
2.160,00	Dell Technologies Inc	99.814	0,11
2.970,00	Devon Energy Corp	163.677	0,17
765,00	Diamondback Energy Inc	92.680	0,10
675,00	Dick's Sporting Goods Inc	50.875	0,05
4.275,00	Dollar General Corp	1.049.255	1,12
8.145,00	Dow Inc	420.363	0,45
4.635,00	DR Horton Inc	306.791	0,33
360,00	Eagle Materials Inc	39.578	0,04
7.470,00	eBay Inc	311.275	0,33
3.645,00	Electronic Arts Inc	443.414	0,47
3.240,00	Eli Lilly & Co	1.050.505	1,12
10.485,00	Emerson Electric Co	833.977	0,89
2.835,00	EOG Resources Inc	313.097	0,33
540,00	Evercore Inc	50.549	0,05
3.465,00	Evergy Inc	226.091	0,24
3.150,00	Expeditors International of Washington Inc	306.999	0,33
1.485,00	Extra Space Storage Inc	252.628	0,27
10.575,00	Exxon Mobil Corp	905.643	0,96
675,00	FactSet Research Systems Inc	259.585	0,28
315,00	Fair Isaac Corp	126.284	0,13
11.340,00	Fastenal Co	566.093	0,60
450,00	First American Financial Corp	23.814	0,03
3.555,00	Flowers Foods Inc	93.568	0,10
1.485,00	FNB Corp	16.127	0,02
3.150,00	Fox Corp	101.304	0,11
450,00	FTI Consulting Inc	81.383	0,09
1.125,00	Gaming and Leisure Properties Inc	51.593	0,05
2.520,00	General Dynamics Corp	557.550	0,59
11.745,00	General Mills Inc	886.160	0,94
4.680,00	Gentex Corp	130.900	0,14
15.615,00	Gilead Sciences Inc	965.163	1,02
2.880,00	Graco Inc	171.101	0,18

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 97,41 % (30. Juni 2021: 96,39 %) (Fortsetzung)		
495,00	Grand Canyon Education Inc	46.624	0,05
1.440,00	Hanesbrands Inc	14.818	0,02
1.935,00	Hawaiian Electric Industries Inc	79.142	0,08
3.015,00	Hershey Co	648.707	0,69
13.410,00	Hewlett Packard Enterprise Co	177.817	0,19
1.890,00	Hologic Inc	130.977	0,14
3.330,00	Home Depot Inc	913.319	0,97
5.175,00	Hormel Foods Corp	245.088	0,26
26.100,00	HP Inc	855.558	0,91
585,00	Hubbell Inc	104.469	0,11
720,00	Huntington Ingalls Industries Inc	156.830	0,17
2.835,00	Huntsman Corp	80.372	0,09
1.080,00	IDEXX Laboratories Inc	378.788	0,40
4.860,00	Illinois Tool Works Inc	885.735	0,94
1.170,00	Ingredion Inc	103.147	0,11
22.590,00	Intel Corp	845.092	0,90
7.245,00	International Business Machines Corp	1.022.921	1,09
4.815,00	International Paper Co	201.411	0,21
6.615,00	Interpublic Group of Co Inc	182.111	0,19
1.845,00	J M Smucker Co	236.178	0,25
1.395,00	Jack Henry & Associates Inc	251.128	0,27
1.530,00	JB Hunt Transport Services Inc	240.929	0,26
2.790,00	Jefferies Financial Group Inc	77.060	0,08
5.625,00	Johnson & Johnson	998.494	1,06
4.140,00	Kellogg Co	295.348	0,31
3.690,00	Kimberly-Clark Corp	498.704	0,53
2.790,00	KLA Corp	890.233	0,95
1.170,00	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	54.159	0,06
585,00	Kohl's Corp	20.879	0,02
12.330,00	Kroger Co	583.579	0,62
900,00	Laboratory Corp of America Holdings	210.924	0,22
1.890,00	Lam Research Corp	805.424	0,86
675,00	Landstar System Inc	98.159	0,10
2.655,00	Lennar Corp	187.363	0,20
495,00	Lennox International Inc	102.262	0,11
765,00	Life Storage Inc	85.420	0,09
720,00	Lincoln Electric Holdings Inc	88.819	0,09
135,00	Lithia Motors Inc	37.099	0,04
2.295,00	Lockheed Martin Corp	986.758	1,05
990,00	Louisiana-Pacific Corp	51.886	0,06
4.905,00	Lowe's Co Inc	856.756	0,91
4.635,00	Lumen Technologies Inc	50.568	0,05
1.350,00	Macy's Inc	24.732	0,03
450,00	Manhattan Associates Inc	51.570	0,05
540,00	ManpowerGroup Inc	41.261	0,04
3.150,00	Marathon Oil Corp	70.812	0,08
2.385,00	Marathon Petroleum Corp	196.071	0,21
495,00	Maravai LifeSciences Holdings Inc	14.063	0,01
2.835,00	Mastercard Inc	894.386	0,95
1.530,00	Mattel Inc	34.165	0,04
4.005,00	McDonald's Corp	988.754	1,05
10.980,00	Merck & Co Inc	1.001.047	1,06
5.265,00	Meta Platforms Inc	848.981	0,90
1.350,00	MGIC Investment Corp	17.010	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 97,41 % (30. Juni 2021: 96,39 %) (Fortsetzung)		
3.735,00	Microsoft Corp	959.260	1,02
3.780,00	Moderna Inc	539.973	0,57
6.255,00	Monster Beverage Corp	579.839	0,62
2.565,00	Moody's Corp	697.603	0,74
1.710,00	Mosaic Co	80.763	0,09
2.880,00	Motorola Solutions Inc	603.648	0,64
855,00	MSC Industrial Direct Co Inc	64.219	0,07
945,00	National Fuel Gas C	62.417	0,07
3.285,00	National Retail Properties Inc	141.255	0,15
4.320,00	NetApp Inc	281.837	0,30
1.980,00	New Residential Investment Corp	18.454	0,02
4.905,00	New York Community Bancorp Inc	44.783	0,05
135,00	NewMarket Corp	40.630	0,04
10.080,00	Newmont Corp	601.474	0,64
8.460,00	NIKE Inc	864.612	0,92
2.160,00	Northrop Grumman Corp	1.033.710	1,10
2.115,00	NRG Energy Inc	80.730	0,09
4.950,00	Nucor Corp	516.830	0,55
57,00	NVR Inc	228.236	0,24
2.025,00	OGE Energy Corp	78.084	0,08
1.530,00	Old Dominion Freight Line Inc	392.108	0,42
2.880,00	Old Republic International Corp	64.397	0,07
1.080,00	Omega Healthcare Investors Inc	30.445	0,03
3.870,00	Omnicom Group Inc	246.171	0,26
14.085,00	Oracle Corp	984.119	1,05
1.305,00	O'Reilly Automotive Inc	824.447	0,88
2.970,00	Organon & Co	100.238	0,11
4.950,00	PACCAR Inc	407.583	0,43
1.665,00	Packaging Corp of America	228.938	0,24
6.300,00	Paychex Inc	717.381	0,76
405,00	PDC Energy Inc	24.952	0,03
315,00	Penske Automotive Group Inc	32.977	0,04
6.075,00	PepsiCo Inc	1.012.459	1,08
19.125,00	Pfizer Inc	1.002.724	1,07
9.540,00	Philip Morris International Inc	941.980	1,00
2.160,00	Phillips 66	177.098	0,19
1.215,00	Pioneer Natural Resources Co	271.042	0,29
585,00	Polaris Inc	58.079	0,06
3.240,00	PPL Corp	87.901	0,09
1.665,00	Premier Inc	59.407	0,06
6.885,00	Procter & Gamble Co	989.994	1,05
3.060,00	Public Storage	956.770	1,02
4.095,00	PulteGroup Inc	162.285	0,17
7.020,00	QUALCOMM Inc	896.735	0,95
1.530,00	Quest Diagnostics Inc	203.459	0,22
585,00	QuidelOrtho Corp	56.850	0,06
8.010,00	Realty Income Corp	546.763	0,58
1.530,00	Regeneron Pharmaceuticals Inc	904.429	0,96
945,00	Reliance Steel & Aluminum Co	160.518	0,17
2.475,00	ResMed Inc	518.834	0,55
2.250,00	Robert Half International Inc	168.503	0,18
4.185,00	Rollins Inc	146.140	0,16
360,00	Ryder System Inc	25.582	0,03
900,00	Schneider National Inc	20.142	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,81 % (30. Juni 2021: 99,69 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 97,41 % (30. Juni 2021: 96,39 %) (Fortsetzung)		
1.935,00	SEI Investments Co	104.529	0,11
810,00	Silgan Holdings Inc	33.494	0,04
3.150,00	Skyworks Solutions Inc	291.816	0,31
720,00	SL Green Realty Corp	33.228	0,04
900,00	Snap-on Inc	177.327	0,19
13.410,00	Southern Co	956.267	1,02
1.080,00	Southern Copper Corp	53.795	0,06
2.160,00	Spirit Realty Capital Inc	81.605	0,09
1.260,00	Starwood Property Trust Inc	26.321	0,03
3.510,00	Steel Dynamics Inc	232.187	0,25
4.275,00	STORE Capital Corp	111.492	0,12
5.490,00	Synchrony Financial	151.634	0,16
3.375,00	T Rowe Price Group Inc	383.434	0,41
5.445,00	Target Corp	768.997	0,82
810,00	Tempur Sealy International Inc	17.310	0,02
1.800,00	Teradyne Inc	161.190	0,17
5.760,00	Texas Instruments Inc	885.024	0,94
45,00	Texas Pacific Land Corp	66.961	0,07
225,00	Thor Industries Inc	16.814	0,02
495,00	Toll Brothers Inc	22.077	0,02
1.890,00	Toro Co	143.243	0,15
2.205,00	Tractor Supply Co	427.439	0,45
1.530,00	Trex Co Inc	83.263	0,09
5.220,00	Tyson Foods Inc	449.233	0,48
2.115,00	UGI Cor	81.660	0,09
225,00	Ulta Beauty Inc	86.733	0,09
4.590,00	Union Pacific Corp	978.955	1,04
5.535,00	United Parcel Service Inc	1.010.358	1,07
2.160,00	United States Steel Corp	38.686	0,04
450,00	United Therapeutics Corp	106.038	0,11
2.025,00	UnitedHealth Group Inc	1.040.100	1,11
945,00	Unum Group	32.149	0,03
1.890,00	Valero Energy Corp	200.869	0,21
19.755,00	Verizon Communications Inc	1.002.566	1,07
3.600,00	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.014.443	1,08
8.505,00	VICI Properties Inc	253.364	0,27
585,00	Victoria's Secret & Co	16.362	0,02
13.140,00	Walgreens Boots Alliance Inc	498.006	0,53
7.875,00	Walmart Inc	957.443	1,02
855,00	Waters Corp	282.988	0,30
630,00	Watsco Inc	150.457	0,16
3.960,00	WEC Energy Group Inc	398.534	0,42
3.330,00	Western Union Co	54.845	0,06
135,00	Westlake Corp	13.233	0,01
585,00	Whirlpool Corp	90.599	0,10
1.575,00	Williams-Sonoma Inc	174.746	0,19
495,00	World Wrestling Entertainment Inc	30.933	0,03
3.195,00	WP Carey Inc	264.738	0,28
855,00	WW Grainger Inc	388.538	0,41
2.205,00	Yum! Brands Inc	250.290	0,27
		<u>91.614.740</u>	<u>97,41</u>
	Aktien insgesamt	<u>93.867.900</u>	<u>99,81</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>93.867.900</u>	<u>99,81</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2021: 0,00 %)

Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2021: 0,00 %)*

Nominal- betrag USD	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermö- gens
160.706	4.018	8 of Sp500 Mic Emin Long Futures Contracts Expiring September 2022	(9.126)	(0,01)
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	(9.126)	(0,01)
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	(9.126)	(0,01)
			Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
		Anlageportfolio	93.858.774	99,80
		Sonstiges Nettovermögen	190.516	0,20
		Nettovermögen	94.049.290	100,00
				% des Gesamt- vermö- gens
		Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
		Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,78
		Sonstiges Umlaufvermögen		0,22
		Gesamtvermögen		100,00

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 16.266 USD.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %)		
	Österreich: 0,61 % (30. Juni 2021: 0,37 %)		
145	ams AG	1.246	0,01
60	BAWAG Group AG	2.410	0,02
160	Erste Group Bank AG	3.872	0,03
200	Raiffeisen Bank International AG	2.068	0,01
790	Verbund AG	73.746	0,52
100	voestalpine AG	2.028	0,01
65	Wienerberger AG	1.331	0,01
		<u>86.701</u>	<u>0,61</u>
	Belgien: 1,35 % (30. Juni 2021: 1,05 %)		
16	Aedifica SA	1.464	0,01
165	Ageas SA	6.927	0,05
2.020	Anheuser-Busch InBev SA	103.747	0,72
40	Cofinimmo SA	4.144	0,03
20	Elia Group SA	2.704	0,02
15	Groupe Bruxelles Lambert SA	1.195	0,01
240	KBC Group NV	12.850	0,09
435	Proximus SADP	6.118	0,04
5	Sofina SA	975	0,01
255	UCB SA	20.563	0,14
810	Umicore SA	26.989	0,19
175	Warehouses De Pauw CVA	5.250	0,04
		<u>192.926</u>	<u>1,35</u>
	Bermuda: 0,04 % (30. Juni 2021: 0,04 %)		
490	Hiscox Ltd	5.364	0,04
		<u>5.364</u>	<u>0,04</u>
	Dänemark: 6,93 % (30. Juni 2021: 5,80 %)		
100	ALK-Abello A/S	1.657	0,01
140	Ambu A/S	1.297	0,01
7	AP Moller - Maersk A/S	15.583	0,11
180	Carlsberg AS	21.881	0,15
175	Chr Hansen Holding A/S	12.157	0,09
185	Coloplast A/S	20.110	0,14
675	Danske Bank A/S	9.104	0,06
65	Demant A/S	2.328	0,02
1.010	DSV PANALPINA A/S	134.619	0,95
30	Genmab A/S	9.266	0,07
160	GN Store Nord AS	5.351	0,04
120	ISS A/S	1.806	0,01
15	Netcompany Group A/S	782	0,01
4.900	Novo Nordisk A/S	518.684	3,64
880	Novozymes A/S	50.410	0,35
355	Pandora A/S	21.314	0,15
15	Ringkjoebing Landbobank A/S	1.559	0,01
50	ROCKWOOL International A/S	10.741	0,08
25	Royal Unibrew A/S	2.113	0,01
30	SimCorp A/S	2.078	0,01
385	Tryg A/S	8.250	0,06
6.740	Vestas Wind Systems A/S	135.857	0,95
		<u>986.947</u>	<u>6,93</u>
	Färöer Inseln: 0,01 % (30. Juni 2021: 0,01 %)		
30	Bakkafrost P/F	1.830	0,01
		<u>1.830</u>	<u>0,01</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Finnland: 1,20 % (30. Juni 2021: 2,44 %)		
380	Elisa OYJ	20.376	0,14
35	Huhtamaki OYJ	1.323	0,01
315	Kesko OYJ	7.091	0,05
75	Kojamo OYJ	1.235	0,01
355	Kone OY	16.103	0,11
570	Metso Outotec OYJ	4.076	0,03
4.555	Nokia OYJ	20.222	0,14
4.340	Nordea Bank Abp	36.438	0,26
105	Orion OYJ	4.473	0,03
720	Sampo OYJ	29.894	0,21
815	Stora Enso OYJ	12.196	0,09
525	UPM-Kymmene OYJ	15.230	0,11
90	Valmet OYJ	2.107	0,01
		170.764	1,20
	Frankreich: 19,01 % (30. Juni 2021: 19,97 %)		
80	Accor SA	2.066	0,01
25	Aeroports de Paris	3.021	0,02
1.265	Air Liquide SA	162.071	1,14
775	Alstom SA	16.732	0,12
50	Alten SA	5.190	0,04
60	Amundi SA	3.132	0,02
180	Arkema SA	15.286	0,11
200	Atos SE	2.557	0,02
5.555	AXA SA	120.321	0,84
40	BioMerieux	3.728	0,03
2.055	BNP Paribas SA	93.225	0,65
220	Bouygues SA	6.459	0,05
780	Capgemini SE	127.491	0,90
765	Carrefour SA	12.917	0,09
5	Christian Dior SE	2.830	0,02
575	Cie de Saint-Gobain	23.543	0,17
125	Covivio	6.619	0,05
1.810	Credit Agricole SA	15.803	0,11
1.150	Danone SA	61.249	0,43
2.300	Dassault Systemes SE	80.765	0,57
405	Edenred	18.213	0,13
100	Eiffage SA	8.588	0,06
2.825	Electricite de France SA	22.052	0,15
120	Elis SA	1.524	0,01
105	EssilorLuxottica SA	15.005	0,11
15	Eurazeo SE	887	0,01
79	Faurecia SE	1.494	0,01
170	Gecina SA	15.130	0,11
460	Getlink SE	7.742	0,05
125	Hermes International	133.374	0,94
90	Ipsen SA	8.105	0,06
305	Kering SA	149.480	1,05
635	Klepierre SA	11.659	0,08
225	La Francaise des Jeux SAEM	7.430	0,05
630	Legrand SA	44.390	0,31
895	L'Oreal SA	294.723	2,07

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Frankreich: 19,01 % (30. Juni 2021: 19,97 %) (Fortsetzung)		
848	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	493.281	3,45
4.870	Orange SA	54.641	0,38
420	Pernod Ricard SA	73.626	0,52
640	Publicis Groupe SA	29.862	0,21
55	Remy Cointreau SA	9.169	0,06
135	Renault SA	3.212	0,02
235	Rexel SA	3.449	0,02
3.045	Sanofi	293.354	2,06
10	Sartorius Stedim Biotech	2.993	0,02
875	Schneider Electric SE	98.788	0,69
290	SCOR SE	5.945	0,04
40	SEB SA	3.662	0,03
1.285	Societe Generale SA	26.844	0,19
65	Sodexo SA	4.359	0,03
35	SOITEC	4.743	0,03
55	Sopra Steria Group	7.843	0,06
100	SPIE SA	2.070	0,01
50	Teleperformance	14.665	0,10
145	Ubisoft Entertainment SA	6.076	0,04
95	Unibail-Rodamco-Westfield	4.622	0,03
150	Valeo SA	2.764	0,02
585	Veolia Environnement SA	13.625	0,10
750	Vivendi SE	7.272	0,05
15	Wendel SE	1.196	0,01
1.000	Worldline SA	35.380	0,25
		2.708.242	19,01
	Deutschland: 13,30 % (30. Juni 2021: 13,60 %)		
425	adidas AG	71.723	0,50
1.170	Allianz SE	213.080	1,50
100	Aurubis AG	6.476	0,05
3.120	Bayer AG	176.966	1,24
295	Bayerische Motoren Werke AG	21.671	0,15
50	Bechtle AG	1.951	0,01
325	Beiersdorf AG	31.681	0,22
150	Brenntag SE	9.315	0,07
15	Carl Zeiss Meditec AG	1.709	0,01
1.225	Commerzbank AG	8.190	0,06
65	Continental AG	4.323	0,03
345	Covestro AG	11.378	0,08
30	CTS Eventim AG & Co KGaA	1.500	0,01
770	Daimler AG	42.519	0,30
50	Delivery Hero SE	1.789	0,01
1.475	Deutsche Bank AG	12.269	0,09
170	Deutsche Boerse AG	27.132	0,19
1.475	Deutsche Lufthansa AG	8.207	0,06
5.080	Deutsche Post AG	181.559	1,27
9.475	Deutsche Telekom AG	179.513	1,26
350	Evonik Industries AG	7.126	0,05
60	Evotec SE	1.380	0,01
100	Freenet AG	2.367	0,02
140	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	6.668	0,05

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Deutschland: 13,30 % (30. Juni 2021: 13,60 %) (Fortsetzung)		
290	Fresenius SE & Co KGaA	8.381	0,06
60	FUCHS PETROLUB SE	1.596	0,01
90	GEA Group AG	2.960	0,02
80	Hannover Rueck SE	11.080	0,08
130	HeidelbergCement AG	5.959	0,04
190	HelloFresh SE	5.862	0,04
395	Henkel AG & Co KGaA	23.218	0,16
200	HUGO BOSS AG	10.072	0,07
1.215	Infineon Technologies AG	28.054	0,20
135	K&S AG	3.131	0,02
25	KION Group AG	990	0,01
50	Knorr-Bremse AG	2.721	0,02
155	LANXESS AG	5.298	0,04
30	LEG Immobilien AG	2.374	0,02
115	Merck KGaA	18.515	0,13
15	MTU Aero Engines AG	2.606	0,02
260	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	58.292	0,41
30	Nemetschek SE	1.733	0,01
175	Porsche Automobil Holding SE	11.046	0,08
130	ProSiebenSat.1 Media SE	1.145	0,01
555	Puma SE	34.876	0,24
5	Rational AG	2.773	0,02
15	Rheinmetall AG	3.305	0,02
3.410	SAP SE	296.431	2,08
20	Sartorius AG	6.668	0,05
60	Scout24 AG	2.939	0,02
1.810	Siemens AG	175.733	1,23
510	Siemens Healthineers AG	24.730	0,17
600	Symrise AG	62.310	0,44
95	TAG Immobilien AG	1.035	0,01
1.845	thyssenkrupp AG	9.981	0,07
420	TUI AG	646	0,00
45	United Internet AG	1.225	0,01
110	Volkswagen AG	14.016	0,10
250	Vonovia SE	7.350	0,05
565	Zalando SE	14.102	0,10
		<u>1.893.645</u>	<u>13,30</u>
	Irland: 3,08 % (30. Juni 2021: 1,80 %)		
1.065	Bank of Ireland Group Plc	6.424	0,05
815	CRH Plc	26.895	0,19
75	Flutter Entertainment Plc	7.236	0,05
175	Glanbia Plc	1.808	0,01
90	Grafton Group Plc	812	0,01
250	Kerry Group Plc	22.835	0,16
915	Kingspan Group Plc	52.521	0,37
1.110	Linde Plc	304.085	2,12
360	Ryanair Holdings Plc	4.059	0,03
380	Smurfit Kappa Group Plc	12.190	0,09
		<u>438.865</u>	<u>3,08</u>
	Isle of Man: 0,02 % (30. Juni 2021: 0,02 %)		
240	GVC Holdings Plc	3.471	0,02
		<u>3.471</u>	<u>0,02</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Italien: 1,22 % (30. Juni 2021: 1,62 %)		
160	Amplifon SpA	4.680	0,03
1.615	Assicurazioni Generali SpA	24.588	0,18
755	Atlantia SpA	16.897	0,12
1.105	Banco BPM SpA	3.001	0,02
10	DiaSorin SpA	1.252	0,01
235	FinecoBank Banca Fineco SpA	2.684	0,02
125	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	1.211	0,01
40	Interpump Group SpA	1.455	0,01
15.260	Intesa Sanpaolo SpA	27.162	0,20
600	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	4.955	0,03
220	Moncler SpA	9.005	0,06
2.860	Nexi SpA	22.605	0,16
1.330	Poste Italiane SpA	11.853	0,08
215	Prysmian SpA	5.635	0,04
50	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	2.076	0,01
10	Reply SpA	1.157	0,01
6.860	Telecom Italia SpA	1.713	0,01
1.975	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	14.789	0,10
1.850	UniCredit SpA	16.770	0,12
		<u>173.488</u>	<u>1,22</u>
	Jersey: 0,92 % (30. Juni 2021: 0,61 %)		
2.245	Experian Plc	62.747	0,44
380	Ferguson Plc	40.559	0,28
435	IWG Plc	945	0,01
995	Man Group Plc	2.887	0,02
25	Wizz Air Holdings Plc	509	0,00
2.515	WPP Plc	24.091	0,17
		<u>131.738</u>	<u>0,92</u>
	Luxemburg: 0,08 % (30. Juni 2021: 0,08 %)		
320	Allegro.eu SA	1.623	0,01
435	Aroundtown SA	1.319	0,01
855	B&M European Value Retail SA	3.643	0,03
35	Eurofins Scientific SE	2.628	0,02
50	Millicom International Cellular SA SDR	681	0,00
205	SES SA	1.710	0,01
		<u>11.604</u>	<u>0,08</u>
	Malta: 0,01 % (30. Juni 2021: null)		
155	Kindred Group Plc SDR	1.231	0,01
		<u>1.231</u>	<u>0,01</u>
	Niederlande: 6,36 % (30. Juni 2021: 8,57 %)		
800	ABN AMRO Bank NV	8.572	0,06
9	Adyen NV	12.492	0,09
2.145	Aegon NV	8.855	0,06
730	Akzo Nobel NV	45.713	0,32
20	Argenx SE	7.150	0,05
15	ASM International NV	3.579	0,03
585	ASML Holding NV	266.671	1,86
220	ASR Nederland NV	8.485	0,06
35	BE Semiconductor Industries NV	1.605	0,01
720	CNH Industrial NV	7.934	0,06
220	Davide Campari-Milano NV	2.208	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Niederlande: 6,36 % (30. Juni 2021: 8,57 %) (Fortsetzung)		
35	Euronext NV	2.727	0,02
25	EXOR NV	1.487	0,01
140	Ferrari NV	24.528	0,17
50	Heineken Holding NV	3.473	0,02
260	Heineken NV	22.620	0,16
85	IMCD NV	11.131	0,08
7.035	ING Groep NV	66.347	0,47
65	JDE Peet's NV	1.765	0,01
95	Just Eat Takeaway.com NV	1.431	0,01
1.270	Koninklijke Ahold Delhaize NV	31.572	0,22
800	Koninklijke DSM NV	109.680	0,76
8.940	Koninklijke KPN NV	30.405	0,21
1.985	Koninklijke Philips NV	40.802	0,29
590	NN Group NV	25.571	0,18
685	Prosus NV	42.799	0,30
80	QIAGEN NV	3.576	0,03
335	Randstad NV	15.477	0,11
205	Signify NV	6.484	0,05
1.210	Stellantis NV	14.268	0,10
2.085	STMicroelectronics NV	62.519	0,44
150	Wolters Kluwer NV	13.884	0,10
		<u>905.810</u>	<u>6,36</u>
	Norwegen: 0,57 % (30. Juni 2021: 0,93 %)		
295	Adevinta ASA	2.032	0,01
990	DNB Bank ASA	16.923	0,12
295	Gjensidige Forsikring ASA	5.698	0,04
1.115	Mowi ASA	24.193	0,18
100	Nordic Semiconductor ASA	1.479	0,01
550	Norsk Hydro ASA	2.937	0,02
1.510	Orkla ASA	11.508	0,08
65	Salmar ASA	4.358	0,03
425	Telenor ASA	5.390	0,04
150	Yara International ASA	5.977	0,04
		<u>80.495</u>	<u>0,57</u>
	Polen: 0,08 % (30. Juni 2021: 0,08 %)		
105	Bank Polska Kasa Opieki SA	1.822	0,01
30	Dino Polska SA	2.036	0,01
45	KGHM Polska Miedz SA	1.138	0,01
1	LPP SA	1.914	0,01
360	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	2.145	0,02
465	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	2.966	0,02
		<u>12.021</u>	<u>0,08</u>
	Portugal: 0,74 % (30. Juni 2021: 0,02 %)		
22.710	EDP - Energias de Portugal SA	101.105	0,71
195	Jeronimo Martins SGPS SA	4.044	0,03
		<u>105.149</u>	<u>0,74</u>
	Spanien: 4,74 % (30. Juni 2021: 4,36 %)		
60	Acciona SA	10.530	0,07
40	Aena SME SA	4.850	0,03
445	Amadeus IT Group SA	23.656	0,17
6.205	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	26.871	0,19

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Spanien: 4,74 % (30. Juni 2021: 4,36 %) (Fortsetzung)		
4.010	Banco de Sabadell SA	3.050	0,02
15.955	Banco Santander SA	42.887	0,30
355	Bankinter SA	2.113	0,01
3.805	CaixaBank SA	12.621	0,09
730	Cellnex Telecom SA	27.032	0,19
663	Ferrovial SA	16.038	0,11
35	Fluidra SA	677	0,00
500	Grifols SA	9.018	0,06
28.125	Iberdrola SA	278.324	1,96
2.400	Industria de Diseno Textil SA	51.816	0,37
530	Inmobiliaria Colonial Socimi SA	3.236	0,02
3.820	International Consolidated Airlines Group SA	4.776	0,03
140	Merlin Properties Socimi SA	1.289	0,01
630	Red Electrica Corp SA	11.356	0,08
1.635	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	29.283	0,21
23.816	Telefonica SA	115.792	0,82
		<u>675.215</u>	<u>4,74</u>
	Schweden: 2,59 % (30. Juni 2021: 4,97 %)		
100	AAK AB	1.558	0,01
45	AddLife AB	645	0,00
365	AddTech AB	4.545	0,03
335	Assa Abloy AB	6.795	0,05
2.320	Atlas Copco AB	20.696	0,15
105	Avanza Bank Holding AB	1.682	0,01
110	Beijer Ref AB	1.436	0,01
348	BillerudKorsnas AB	3.881	0,02
75	Boliden AB	2.278	0,02
270	Castellum AB	3.313	0,02
315	Dometic Group AB	1.764	0,01
235	Electrolux AB	3.020	0,02
780	Elekta AB	5.145	0,04
1.520	EQT AB	29.710	0,20
800	Essity AB	19.946	0,14
50	Evolution AB	4.341	0,03
455	Fabege AB	4.102	0,03
270	Fastighets AB Balder	1.235	0,01
440	Getinge AB	9.709	0,07
1.225	Hennes & Mauritz AB	13.968	0,10
505	Hexagon AB	5.008	0,04
425	Hexpol AB	3.453	0,02
110	Holmen AB	4.260	0,03
990	Husqvarna AB	6.953	0,05
120	Industrivarden AB	2.579	0,02
160	Indutrade AB	2.786	0,02
65	Investment AB Latour	1.227	0,01
585	Investor AB	9.184	0,06
130	Kinnevik AB	2.000	0,01
40	L E Lundbergforetagen AB	1.553	0,01
250	Lifco AB	3.833	0,03
780	Nibe Industrier AB	5.592	0,04
45	Nordic Entertainment Group AB	882	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Schweden: 2,59 % (30. Juni 2021: 4,97 %) (Fortsetzung)		
50	Sagax AB	881	0,01
450	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	716	0,01
85	Sectra AB	1.090	0,01
475	Securitas AB	3.907	0,03
530	Sinch AB	1.647	0,01
1.910	Skandinaviska Enskilda Banken AB	17.900	0,13
930	Skanska AB	13.612	0,10
245	SKF AB	3.442	0,02
210	Svenska Cellulosa AB SCA	2.995	0,02
1.990	Svenska Handelsbanken AB	16.239	0,11
510	Sweco AB	5.060	0,04
1.615	Swedbank AB	19.492	0,14
115	Swedish Orphan Biovitrum AB	2.374	0,02
1.545	Tele2 AB	16.801	0,12
2.925	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	20.824	0,14
6.490	Telia Co AB	23.735	0,16
245	Thule Group AB	5.747	0,04
115	Trelleborg AB	2.212	0,02
125	Vitrolife AB	2.744	0,02
875	Volvo AB	12.936	0,09
180	Wallenstam AB	752	0,01
500	Wihlborgs Fastigheter AB	3.339	0,02
		<u>367.524</u>	<u>2,59</u>
	Schweiz: 17,50 % (30. Juni 2021: 15,33 %)		
580	Adecco Group AG	18.799	0,13
220	Alcon Inc	14.657	0,10
10	Allreal Holding AG	1.577	0,01
15	Bachem Holding AG	994	0,01
55	Baloise Holding AG	8.567	0,06
8	Barry Callebaut AG	17.025	0,12
5	Belimo Holding AG	1.679	0,01
5	Bucher Industries AG	1.659	0,01
2.250	Cie Financiere Richemont SA	228.516	1,60
365	Coca-Cola HBC AG	7.725	0,05
2.660	Credit Suisse Group AG	14.405	0,10
15	DKSH Holding AG	1.181	0,01
105	Dufry AG	3.238	0,02
5	EMS-Chemie Holding AG	3.549	0,02
15	Flughafen Zurich AG	2.163	0,02
105	Galenica AG	7.690	0,05
15	Geberit AG	6.876	0,05
50	Givaudan SA	167.706	1,18
55	Helvetia Holding AG	6.138	0,04
535	Holcim Ltd	21.836	0,15
1	Interroll Holding AG	2.138	0,02
140	Julius Baer Group Ltd	6.160	0,04
65	Kuehne & Nagel International AG	14.677	0,10
255	Logitech International SA	12.706	0,09
85	Lonza Group AG	43.228	0,30
5.635	Nestle SA	627.423	4,41
6.445	Novartis AG	520.629	3,66

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Schweiz: 17,50 % (30. Juni 2021: 15,33 %) (Fortsetzung)		
25	Partners Group Holding AG	21.486	0,15
25	PSP Swiss Property AG	2.653	0,02
625	Roche Holding AG	198.922	1,40
55	Schindler Holding AG	9.567	0,07
3	Siegfried Holding AG	1.828	0,01
360	SIG Combibloc Group AG	7.561	0,05
380	Sika AG	83.528	0,59
70	Sonova Holding AG	21.262	0,15
117	Straumann Holding AG	13.403	0,09
10	Swatch Group AG	2.263	0,02
55	Swiss Life Holding AG	25.553	0,18
30	Swiss Prime Site AG	2.510	0,02
835	Swiss Re AG	61.720	0,43
115	Swisscom AG	60.599	0,43
10	Tecan Group AG	2.770	0,02
45	Temenos AG	3.670	0,03
2.930	UBS Group AG	45.054	0,32
5	VAT Group AG	1.137	0,01
395	Zurich Insurance Group AG	163.863	1,15
		2.492.290	17,50
	Vereinigtes Königreich: 19,50 % (30. Juni 2021: 18,21 %)		
680	3i Group Plc	8.756	0,06
95	Admiral Group Plc	2.476	0,02
205	Allfunds Group Plc	1.509	0,01
175	Antofagasta Plc	2.348	0,02
90	Ashtead Group Plc	3.595	0,03
355	Associated British Foods Plc	6.507	0,05
3.865	AstraZeneca Plc	484.898	3,39
3.655	Auto Trader Group Plc	23.564	0,17
465	Avast Plc	2.793	0,02
155	AVEVA Group Plc	4.053	0,03
6.985	Aviva Plc	32.562	0,23
13.235	Barclays Plc	23.541	0,17
2.695	Barratt Developments Plc	14.320	0,10
820	Beazley Plc	4.753	0,03
150	Bellway Plc	3.739	0,03
395	Berkeley Group Holdings Plc	17.088	0,12
305	Big Yellow Group Plc	4.648	0,03
780	British Land Co Plc	4.051	0,03
675	Britvic Plc	6.359	0,04
17.170	BT Group Plc	37.159	0,26
265	Bunzl Plc	8.370	0,06
2.560	Burberry Group Plc	48.801	0,34
185	Close Brothers Group Plc	2.203	0,02
1.000	Compass Group Plc	19.516	0,14
2.495	ConvaTec Group Plc	6.504	0,05
410	Croda International Plc	30.825	0,22
55	Dechra Pharmaceuticals Plc	2.209	0,02
350	Derwent London Plc	10.620	0,07
7.280	Diageo Plc	298.569	2,09
45	Diploma Plc	1.165	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigtes Königreich: 19,50 % (30. Juni 2021: 18,21 %) (Fortsetzung)		
1.745	Direct Line Insurance Group Plc	5.102	0,04
1.205	Drax Group Plc	9.001	0,06
535	DS Smith Plc	1.723	0,01
685	easyJet Plc	2.917	0,02
445	Electrocomponents Plc	4.492	0,03
55	Future Plc	1.101	0,01
20	Games Workshop Group Plc	1.552	0,01
30	Genus Plc	874	0,01
10.835	GlaxoSmithKline Plc	222.227	1,55
75	Greggs Plc	1.575	0,01
250	Hargreaves Lansdown Plc	2.288	0,02
3.280	Hays Plc	4.252	0,03
70	Hikma Pharmaceuticals Plc	1.315	0,01
165	HomeServe Plc	2.246	0,02
165	Howden Joinery Group Plc	1.155	0,01
28.145	HSBC Holdings Plc	175.113	1,23
245	IG Group Holdings Plc	1.965	0,01
185	Inchcape Plc	1.495	0,01
4.855	Informa Plc	29.823	0,21
50	InterContinental Hotels Group Plc	2.527	0,02
505	Intermediate Capital Group Plc	7.679	0,05
645	Investec Plc	3.333	0,02
7.125	ITV Plc	5.401	0,04
1.840	JD Sports Fashion Plc	2.467	0,02
1.000	Johnson Matthey Plc	22.368	0,16
2.475	Kingfisher Plc	7.024	0,05
1.250	Land Securities Group Plc	9.642	0,07
16.355	Legal & General Group Plc	45.502	0,32
52.955	Lloyds Banking Group Plc	26.027	0,18
1.445	London Stock Exchange Group Plc	128.110	0,90
505	LondonMetric Property Plc	1.340	0,01
3.690	M&G Plc	8.342	0,06
3.180	Marks & Spencer Group Plc	5.005	0,04
1.075	Melrose Industries Plc	1.869	0,01
505	Mondi Plc	8.536	0,06
8.595	Natwest Group Plc	21.796	0,15
145	Next Plc	9.871	0,07
680	Ocado Group Plc	6.171	0,04
340	OSB Group Plc	1.897	0,01
2.665	Pearson Plc	23.212	0,16
175	Pennon Group Plc	1.936	0,01
665	Persimmon Plc	14.392	0,10
1.180	Phoenix Group Holdings Plc	8.093	0,06
625	Primary Health Properties Plc	990	0,01
2.845	Prudential Plc	33.578	0,24
545	Reckitt Benckiser Group Plc	39.062	0,27
3.480	RELX Plc	89.987	0,63
815	Rentokil Initial Plc	4.493	0,03
500	Rightmove Plc	3.301	0,02
295	Rio Tinto Plc	16.848	0,12
1.710	Royal Mail Plc	5.357	0,04
345	Safestore Holdings Plc	4.252	0,03

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,86 % (30. Juni 2021: 99,88 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigtes Königreich: 19,50 % (30. Juni 2021: 18,21 %) (Fortsetzung)		
2.610	Sage Group Plc	19.247	0,14
165	Schroders Plc	5.122	0,04
640	Segro Plc	7.262	0,05
775	Severn Trent Plc	24.479	0,17
815	Smith & Nephew Plc	10.864	0,08
60	Softcat Plc	918	0,01
95	Spectris Plc	2.992	0,02
30	Spirax-Sarco Engineering Plc	3.442	0,02
1.035	St James's Place Plc	13.255	0,09
2.355	Standard Chartered Plc	16.923	0,12
2.990	Standard Life Aberdeen Plc	5.552	0,04
339	Tate & Lyle Plc	2.951	0,02
6.765	Taylor Wimpey Plc	9.167	0,06
10.305	Tesco Plc	30.585	0,21
105	Travis Perkins Plc	1.180	0,01
1.670	Tritax Big Box REIT Plc	3.521	0,02
7.735	Unilever Plc	334.346	2,34
175	UNITE Group Plc	2.163	0,02
2.460	United Utilities Group Plc	29.148	0,20
880	Virgin Money UK Plc	1.337	0,01
140	Vistry Group Plc	1.360	0,01
57.825	Vodafone Group Plc	85.081	0,60
500	Watches of Switzerland Group Plc	4.467	0,03
150	Whitbread Plc	4.318	0,03
		2.777.805	19,50
	Aktien insgesamt	14.223.125	99,86
	Wertpapiere insgesamt	14.223.125	99,86

Derivative Finanzinstrumente: 0,00 % (30. Juni 2021: null)

Terminkontrakte (Futures): 0,00 % (30. Juni 2021: null)*

Nominal- betrag EUR	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs EUR		Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto- vermö- gens
220	400	1 of Euro Stoxx 600 Long Futures Contracts Expiring September 2022	235	0,00
		Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten (Futures)	235	0,00
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	235	0,00

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Netto- vermö- gens
Anlageportfolio	14.223.360	99,86
Sonstiges Nettovermögen	19.672	0,14
Nettovermögen	<u>14.243.032</u>	<u>100,00</u>
		% des Gesamt- vermö- gens
Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		99,85
Börsengehandelte derivative Instrumente		0,00
Sonstiges Umlaufvermögen		0,15
Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 1.468 EUR.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %)		
	Aktien: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %)		
	Bermuda: 0,04 % (30. Juni 2021: 0,17 %)		
1.776	Invesco Ltd	28.647	0,03
1.036	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	11.520	0,01
		<u>40.167</u>	<u>0,04</u>
	Irland: 2,27 % (30. Juni 2021: 2,39 %)		
2.516	Accenture Plc	698.567	0,64
444	Allegion Plc	43.468	0,04
444	Aon Plc	119.738	0,11
11.470	Johnson Controls International Plc	549.184	0,50
9.324	Medtronic Plc	836.828	0,76
1.850	Pentair Plc	84.675	0,08
740	Trane Technologies Plc	96.104	0,09
296	Willis Towers Watson Plc	58.427	0,05
		<u>2.486.991</u>	<u>2,27</u>
	Jersey: 0,16 % (30. Juni 2021: 0,07 %)		
3.700	Amcor Plc	45.991	0,04
1.406	Aptiv Plc	125.232	0,12
		<u>171.223</u>	<u>0,16</u>
	Schweiz: 0,30 % (30. Juni 2021: 0,27 %)		
740	Chubb Ltd	145.469	0,13
222	Garmin Ltd	21.812	0,02
1.406	TE Connectivity Ltd	159.089	0,15
		<u>326.370</u>	<u>0,30</u>
	Vereinigtes Königreich: 0,07 % (30. Juni 2021: 0,06 %)		
3.256	Nielsen Holdings Plc	75.604	0,07
		<u>75.604</u>	<u>0,07</u>
	Vereinigte Staaten: 96,93 % (30. Juni 2021: 96,82 %)		
8.732	Abbott Laboratories	948.732	0,87
12.284	AbbVie Inc	1.881.417	1,72
1.406	Activision Blizzard Inc	109.471	0,10
3.552	Adobe Inc	1.300.245	1,19
296	Advance Auto Parts Inc	51.236	0,05
6.808	Advanced Micro Devices Inc	520.608	0,48
2.368	Aflac Inc	131.021	0,12
1.850	Agilent Technologies Inc	219.725	0,20
1.110	Albemarle Corp	231.968	0,21
518	Alexandria Real Estate Equities Inc	75.126	0,07
148	Align Technology Inc	35.028	0,03
740	Allstate Corp	93.780	0,09
1.258	Alphabet Inc 'A' Shares	2.741.509	2,51
1.164	Alphabet Inc 'C' Shares	2.546.192	2,33
49.876	Amazon.com Inc	5.297.329	4,84
4.144	American Express Co	574.441	0,53
1.258	American International Group Inc	64.322	0,06
444	American Water Works Co Inc	66.054	0,06
444	Ameriprise Financial Inc	105.530	0,10
2.294	AmerisourceBergen Corp	324.555	0,30
3.848	Amgen Inc	936.218	0,86
444	ANSYS Inc	106.245	0,10
740	Anthem Inc	357.109	0,33
39.442	Apple Inc	5.392.509	4,94
3.774	Applied Materials Inc	343.359	0,31
888	Arista Networks Inc	83.241	0,08
296	Arthur J Gallagher & Co	48.260	0,04
38.998	AT&T Inc	817.398	0,75

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 96,93 % (30. Juni 2021: 96,82 %) (Fortsetzung)		
1.554	Autodesk Inc	267.226	0,24
1.332	Automatic Data Processing Inc	279.773	0,26
26	AutoZone Inc	55.877	0,05
740	AvalonBay Communities Inc	143.745	0,13
296	Avery Dennison Corp	47.914	0,04
3.256	Ball Corp	223.931	0,20
54.612	Bank of America Corp	1.700.072	1,55
5.032	Bank of New York Mellon Corp	209.885	0,19
888	Becton Dickinson and Co	218.919	0,20
1.036	Biogen Inc	211.282	0,19
74	Bio-Rad Laboratories Inc	36.630	0,03
929	BlackRock Inc	565.798	0,52
148	Booking Holdings Inc	258.851	0,24
370	BorgWarner Inc	12.347	0,01
1.406	Boston Properties Inc	125.106	0,11
5.476	Boston Scientific Corp	204.091	0,19
9.398	Bristol-Myers Squibb Co	723.646	0,66
1.258	Broadcom Inc	611.155	0,56
222	Broadridge Financial Solutions Inc	31.646	0,03
222	Brown & Brown Inc	12.951	0,01
1.184	Cadence Design Systems Inc	177.636	0,16
2.294	Capital One Financial Corp	239.012	0,22
3.256	Cardinal Health Inc	170.191	0,16
5.254	Caterpillar Inc	939.205	0,86
296	Cboe Global Markets Inc	33.504	0,03
444	Ceridian HCM Holding Inc	20.904	0,02
3.922	CH Robinson Worldwide Inc	397.573	0,36
7.104	Charles Schwab Corp	448.831	0,41
370	Charter Communications Inc	173.356	0,16
101	Chipotle Mexican Grill Inc	132.034	0,12
1.480	Church & Dwight Co Inc	137.137	0,13
222	Cigna Corp	58.501	0,05
370	Cincinnati Financial Corp	44.023	0,04
335	Cintas Corp	125.133	0,11
21.830	Cisco Systems Inc	930.831	0,85
13.172	Citigroup Inc	605.780	0,55
1.110	Citizens Financial Group Inc	39.616	0,04
444	Citrix Systems Inc	43.143	0,04
592	Clorox Co	83.460	0,08
1.184	CME Group Inc	242.365	0,22
18.352	Coca-Cola Co	1.154.524	1,06
6.882	Colgate-Palmolive Co	551.523	0,50
28.342	Comcast Corp	1.112.140	1,02
666	Comerica Inc	48.871	0,04
5.994	Conagra Brands Inc	205.235	0,19
1.110	Constellation Energy Corp	63.559	0,06
148	Cooper Co Inc	46.343	0,04
814	Copart Inc	88.449	0,08
2.812	Corteva Inc	152.256	0,14
1.036	Crown Castle International Corp	174.442	0,16
17.982	CSX Corp	522.557	0,48
6.290	CVS Health Corp	582.831	0,53
1.258	Danaher Corp	318.928	0,29
148	DaVita Inc	11.834	0,01
2.812	Deere & Co	842.110	0,77
1.924	DENTSPLY SIRONA Inc	68.745	0,06

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 96,93 % (30. Juni 2021: 96,82 %) (Fortsetzung)		
888	Discover Financial Services	83.987	0,08
1.554	Dover Corp	188.531	0,17
888	Duke Realty Corp	48.796	0,04
6.660	eBay Inc	277.522	0,25
3.774	Ecolab Inc	580.290	0,53
4.292	Edwards Lifesciences Corp	408.126	0,37
1.036	Electronic Arts Inc	126.029	0,12
3.256	Eli Lilly & Co	1.055.693	0,97
296	Enphase Energy Inc	57.793	0,05
444	Equifax Inc	81.154	0,07
480	Equinix Inc	315.370	0,29
1.850	Equity Residential	133.607	0,12
296	Essex Property Trust Inc	77.407	0,07
2.072	Estee Lauder Co Inc	527.676	0,48
2.072	Etsy Inc	151.691	0,14
2.294	Eversource Energy	193.774	0,18
3.182	Exelon Corp	144.208	0,13
592	Expedia Group Inc	56.139	0,05
2.220	Expeditors International of Washington Inc	216.361	0,20
444	Extra Space Storage Inc	75.533	0,07
148	FactSet Research Systems Inc	56.916	0,05
3.848	Fastenal Co	192.092	0,18
444	Federal Realty OP LP	42.509	0,04
1.036	Fidelity National Information Services Inc	94.970	0,09
3.478	Fifth Third Bancorp	116.861	0,11
518	First Republic Bank	74.696	0,07
7.696	FirstEnergy Corp	295.449	0,27
888	Fiserv Inc	79.005	0,07
222	FleetCor Technologies Inc	46.644	0,04
1.924	FMC Corp	205.887	0,19
2.368	Fortinet Inc	133.981	0,12
4.440	Fortive Corp	241.447	0,22
962	Franklin Resources Inc	22.424	0,02
74	Gartner Inc	17.895	0,02
222	Generac Holdings Inc	46.749	0,04
3.774	General Mills Inc	284.748	0,26
1.406	Genuine Parts Co	186.998	0,17
8.288	Gilead Sciences Inc	512.281	0,47
444	Global Payments Inc	49.124	0,04
148	Globe Life Inc	14.426	0,01
2.294	Goldman Sachs Group Inc	681.364	0,62
1.258	Hartford Financial Services Group Inc	82.311	0,08
1.036	Hasbro Inc	84.828	0,08
1.628	Henry Schein Inc	124.933	0,11
1.258	Hershey Co	270.671	0,25
12.284	Hewlett Packard Enterprise Co	162.886	0,15
1.110	Hologic Inc	76.923	0,07
3.626	Home Depot Inc	994.503	0,91
7.252	Host Hotels & Resorts Inc	113.711	0,10
9.398	HP Inc	308.066	0,28
175	Humana Inc	81.912	0,07
5.846	Huntington Bancshares Inc	70.327	0,06
296	IDEX Corp	53.762	0,05

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 96,93 % (30. Juni 2021: 96,82 %) (Fortsetzung)		
248	IDEXX Laboratories Inc	86.981	0,08
2.738	Illinois Tool Works Inc	499.001	0,46
1.258	Illumina Inc	231.925	0,21
6.512	Ingersoll Rand Inc	274.025	0,25
2.072	Intercontinental Exchange Inc	194.851	0,18
1.998	International Business Machines Corp	282.098	0,26
4.440	International Flavors & Fragrances Inc	528.893	0,48
2.812	Interpublic Group of Co Inc	77.414	0,07
1.595	Intuit Inc	614.777	0,56
444	Intuitive Surgical Inc	89.115	0,08
296	IQVIA Holdings Inc	64.229	0,06
814	Iron Mountain Inc	39.638	0,04
148	J M Smucker Co	18.945	0,02
148	Jack Henry & Associates Inc	26.643	0,02
12.876	JPMorgan Chase & Co	1.449.966	1,33
1.850	Juniper Networks Inc	52.725	0,05
4.662	KeyCorp	80.326	0,07
888	Keysight Technologies Inc	122.411	0,11
5.698	Kimco Realty Corp	112.649	0,10
740	KLA Corp	236.119	0,22
2.590	Kraft Heinz Co	98.783	0,09
1.480	L Brands Inc	39.842	0,04
222	Laboratory Corp of America Holdings	52.029	0,05
1.998	Lam Research Corp	851.448	0,78
148	Live Nation Entertainment Inc	12.222	0,01
666	LKQ Corp	32.697	0,03
2.886	Lowe's Co Inc	504.098	0,46
444	M&T Bank Corp	70.769	0,06
148	MarketAxess Holdings Inc	37.889	0,03
1.184	Marsh & McLennan Co Inc	183.816	0,17
3.404	Masco Corp	172.242	0,16
4.958	Mastercard Inc	1.564.150	1,43
370	Match Group Inc	25.785	0,02
2.294	McCormick & Co Inc	190.976	0,17
3.552	McDonald's Corp	876.918	0,80
1.184	McKesson Corp	386.233	0,35
11.470	Merck & Co Inc	1.045.720	0,96
2.072	Meta Platforms Inc	334.110	0,31
962	MetLife Inc	60.404	0,06
108	Mettler-Toledo International Inc	124.067	0,11
1.480	Microchip Technology Inc	85.966	0,08
9.324	Micron Technology Inc	515.431	0,47
24.938	Microsoft Corp	6.404.826	5,87
296	Mid-America Apartment Communities Inc	51.702	0,05
1.332	Moderna Inc	190.276	0,17
6.586	Mondelez International Inc	408.925	0,37
74	Monolithic Power Systems Inc	28.419	0,03
1.258	Monster Beverage Corp	116.617	0,11
1.184	Moody's Corp	322.012	0,29
10.360	Morgan Stanley	787.982	0,72
666	Motorola Solutions Inc	139.594	0,13
444	MSCI Inc	182.995	0,17
814	Nasdaq Inc	124.168	0,11
1.554	Netflix Inc	271.748	0,25
2.146	Newmont Corp	128.063	0,12
3.108	News Corp 'A' Shares	48.423	0,04

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 96,93 % (30. Juni 2021: 96,82 %) (Fortsetzung)		
962	News Corp 'B' Shares	15.286	0,01
5.994	NIKE Inc	612.587	0,56
222	Nordson Corp	44.942	0,04
1.480	Northern Trust Corp	142.790	0,13
3.404	NortonLifeLock Inc	74.752	0,07
17.760	NVIDIA Corp	2.692.238	2,46
5	NVR Inc	20.021	0,02
222	Old Dominion Freight Line Inc	56.894	0,05
888	Omnicom Group Inc	56.486	0,05
8.732	Oracle Corp	610.105	0,56
1.554	Otis Worldwide Corp	109.821	0,10
1.480	PACCAR Inc	121.863	0,11
296	Packaging Corp of America	40.700	0,04
1.998	Paramount Global	49.321	0,05
814	Paychex Inc	92.690	0,08
148	Paycom Software Inc	41.458	0,04
4.144	PayPal Holdings Inc	289.417	0,26
11.322	PepsiCo Inc	1.886.925	1,73
518	PerkinElmer Inc	73.670	0,07
12.284	Pfizer Inc	644.050	0,59
1.628	PNC Financial Services Group Inc	256.850	0,23
148	Pool Corp	51.982	0,05
1.036	PPG Industries Inc	118.456	0,11
666	Principal Financial Group Inc	44.482	0,04
9.546	Procter & Gamble Co	1.372.619	1,25
1.924	Progressive Corp	223.713	0,20
6.142	Prologis Inc	722.606	0,66
666	Prudential Financial Inc	63.723	0,06
370	PTC Inc	39.346	0,04
1.776	Public Service Enterprise Group Inc	112.385	0,10
962	Public Storage	300.789	0,28
1.258	PVH Corp	71.580	0,07
4.810	QUALCOMM Inc	614.429	0,56
444	Quanta Services Inc	55.651	0,05
222	Quest Diagnostics Inc	29.522	0,03
740	Raymond James Financial Inc	66.163	0,06
1.554	Realty Income Corp	106.076	0,10
1.036	Regency Centers Corp	61.445	0,06
740	Regeneron Pharmaceuticals Inc	437.436	0,40
4.736	Regions Financial Corp	88.800	0,08
1.554	Republic Services Inc	203.372	0,19
370	ResMed Inc	77.563	0,07
1.036	Robert Half International Inc	77.586	0,07
1.258	Rockwell Automation Inc	250.732	0,23
962	Rollins Inc	33.593	0,03
296	Roper Technologies Inc	116.816	0,11
518	Ross Stores Inc	36.379	0,03
3.034	S&P Global Inc	1.022.640	0,93
4.440	salesforce.com Inc	732.778	0,67
296	SBA Communications Corp	94.735	0,09
222	Sealed Air Corp	12.814	0,01
1.150	ServiceNow Inc	546.848	0,50
3.256	Sherwin-Williams Co	729.051	0,67
148	Signature Bank	26.523	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 96,93 % (30. Juni 2021: 96,82 %) (Fortsetzung)		
1.702	Simon Property Group Inc	161.554	0,15
222	Snap-on Inc	43.741	0,04
296	SolarEdge Technologies Inc	81.009	0,07
2.664	Stanley Black & Decker Inc	279.347	0,26
2.294	Starbucks Corp	175.239	0,16
2.442	State Street Corp	150.549	0,14
592	Stryker Corp	117.767	0,11
148	SVB Financial Group	58.459	0,05
3.330	Synchrony Financial	91.975	0,08
740	Synopsys Inc	224.738	0,21
2.590	Sysco Corp	219.399	0,20
1.332	T Rowe Price Group Inc	151.329	0,14
518	Take-Two Interactive Software Inc	63.471	0,06
2.368	Tapestry Inc	72.271	0,07
740	Target Corp	104.510	0,10
74	Teleflex Inc	18.193	0,02
592	Teradyne Inc	53.017	0,05
2.146	Tesla Inc	1.445.159	1,32
3.848	Texas Instruments Inc	591.245	0,54
1.432	Thermo Fisher Scientific Inc	777.977	0,71
4.958	TJX Co Inc	276.904	0,25
444	T-Mobile US Inc	59.738	0,05
592	Tractor Supply Co	114.759	0,10
222	Travelers Co Inc	37.547	0,03
814	Trimble Inc	47.399	0,04
3.848	Truist Financial Corp	182.511	0,17
2.738	Twitter Inc	102.374	0,09
222	Tyler Technologies Inc	73.811	0,07
370	Tyson Foods Inc	31.842	0,03
888	UDR Inc	40.884	0,04
222	Ulta Beauty Inc	85.578	0,08
2.960	Union Pacific Corp	631.309	0,58
3.848	United Airlines Holdings Inc	136.315	0,12
592	United Rentals Inc	143.803	0,13
3.774	UnitedHealth Group Inc	1.938.440	1,77
4.958	US Bancorp	228.167	0,21
2.220	Ventas Inc	114.175	0,10
222	VeriSign Inc	37.147	0,03
1.924	Verisk Analytics Inc	333.025	0,30
5.550	Verizon Communications Inc	281.663	0,26
1.998	Vertex Pharmaceuticals Inc	563.016	0,51
1.850	VF Corp	81.715	0,07
9.842	Visa Inc	1.937.791	1,77
370	Vornado Realty Trust	10.578	0,01
296	W R Berkley Corp	20.206	0,02
3.626	Walgreens Boots Alliance Inc	137.425	0,13
12.284	Walt Disney Co	1.159.610	1,06
9.768	Warner Bros Discovery Inc	131.087	0,12
335	Waters Corp	110.878	0,10
370	Welltower Inc	30.470	0,03
296	West Pharmaceutical Services Inc	89.502	0,08
666	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	54.669	0,05
5.402	Weyerhaeuser Co	178.914	0,16
1.924	Xylem Inc	150.418	0,14
1.480	Yum! Brands Inc	167.995	0,15
296	Zebra Technologies Corp	87.011	0,08
888	Zimmer Biomet Holdings Inc	93.293	0,09

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,77 % (30. Juni 2021: 99,78 %) (Fortsetzung)		
	Vereinigte Staaten: 96,93 % (30. Juni 2021: 96,82 %) (Fortsetzung)		
518	Zions Bancorp NA	26.366	0,02
1.332	Zoetis Inc	228.957	0,21
		<u>106.018.857</u>	<u>96,93</u>
	Aktien insgesamt	<u>109.119.212</u>	<u>99,77</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>109.119.212</u>	<u>99,77</u>

Derivative Finanzinstrumente: (0,01) % (30. Juni 2021: null)

Terminkontrakte (Futures): (0,01) % (30. Juni 2021: null)*

Nominal- betrag USD	Durch- schnittlicher Anschaffungs- kurs USD		Nicht realisierter Verlust USD	% des Netto- vermö- gens
274.016	3.915	14 of Sp500 Mic Emin Long Futures Contracts Expiring September 2022	(8.751)	(0,01)
		Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten (Futures)	<u>(8.751)</u>	<u>(0,01)</u>
		Derivative Finanzinstrumente insgesamt	<u>(8.751)</u>	<u>(0,01)</u>

	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
Anlageportfolio	109.110.461	99,76
Sonstiges Nettovermögen	263.987	0,24
Nettovermögen	<u>109.374.448</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermö- gens
Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	88,63
Sonstiges Umlaufvermögen	11,37
Gesamtvermögen	<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Die Gegenpartei für die Terminkontrakte (Futures) ist J.P. Morgan. Der Wert der Bareinschüsse bei Maklern beträgt zum 30. Juni 2022 57.803 USD.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,36 %		
	Aktien: 99,36 %		
	Bermuda: 1,70 %		
6.000	Alibaba Health Information Technology Ltd	4.129	0,16
60.000	Alibaba Pictures Group Ltd	5.888	0,23
90.000	Beijing Enterprises Water Group Ltd	27.183	1,05
12.000	China Ruyi Holdings Ltd	4.404	0,17
1.540	Hopson Development Holdings Ltd	2.351	0,09
		<u>43.955</u>	<u>1,70</u>
	Kaimaninseln: 52,63 %		
50	360 DigiTech Inc ADR	865	0,03
2.500	3SBio Inc	1.988	0,08
18.845	Alibaba Group Holding Ltd	268.736	10,41
600	ANTA Sports Products Ltd	7.371	0,29
115	Autohome Inc ADR	4.523	0,18
3.050	Baidu Inc	57.720	2,23
64	BeiGene Ltd ADR	10.358	0,40
200	Bilibili Inc	5.123	0,20
4.000	Bosideng International Holdings Ltd	2.482	0,10
19.000	China Conch Venture Holdings Ltd	41.404	1,61
600	China Literature Ltd	2.898	0,11
2.000	China Medical System Holdings Ltd	3.120	0,12
4.000	China Resources Land Ltd	18.657	0,72
200	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	991	0,04
6.240	CIFI Holdings Group Co Ltd	3.133	0,12
3.500	Country Garden Services Holdings Co Ltd	15.589	0,60
13	Daqo New Energy Corp ADR	928	0,04
1.700	GDS Holdings Ltd	7.160	0,28
2.525	Genscript Biotech Corp	9.155	0,36
2.000	Greentown Service Group Co Ltd	2.263	0,09
2.000	Haidilao International Holding Ltd	4.664	0,18
4.000	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	8.074	0,31
170	Huazhu Group Ltd ADR	6.477	0,25
344	HUTCHMED China Ltd ADR	4.348	0,17
600	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	3.988	0,15
2.000	Innovent Biologics Inc	8.895	0,35
400	iQIYI Inc ADR	1.680	0,07
400	JD Health International Inc	3.138	0,12
1.800	JD.com Inc	57.989	2,24
3.000	Jinxin Fertility Group Ltd	2.764	0,11
93	JOYY Inc ADR	2.777	0,11
369	KE Holdings Inc ADR	6.624	0,26
7.000	Kingdee International Software Group Co Ltd	16.414	0,64
800	Kingsoft Corp Ltd	3.120	0,12
1.400	Kuaishou Technology	15.593	0,60
153	Legend Biotech Corp ADR	8.415	0,33
587	Li Auto Inc ADR	22.488	0,87
2.000	Li Ning Co Ltd	18.529	0,72
4.631	Meituan	114.610	4,44
3.000	Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd	4.802	0,19
1.940	NetEase Inc	35.626	1,38
1.900	New Oriental Education & Technology Group Inc	3.831	0,15
1.660	NIO Inc ADR	36.054	1,40
482	Pinduoduo Inc ADR	29.788	1,16
900	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	2.667	0,10
2.000	Seazen Group Ltd	989	0,04
1.000	Shenzhou International Group Holdings Ltd	12.113	0,47
14.000	Sino Biopharmaceutical Ltd	8.867	0,34

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,36 % (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,36 % (Fortsetzung)		
	Kaimaninseln: 52,63 % (Fortsetzung)		
200	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	3.260	0,13
491	TAL Education Group ADR	2.391	0,09
7.244	Tencent Holdings Ltd	327.168	12,68
290	Tencent Music Entertainment Group ADR	1.456	0,06
4.000	Topsports International Holdings Ltd	3.635	0,14
688	Trip.com Group Ltd ADR	18.886	0,73
120	Weibo Corp ADR	2.776	0,11
3.650	Wuxi Biologics Cayman Inc	33.398	1,30
20.000	Xinyi Solar Holdings Ltd	30.891	1,20
517	XPeng Inc ADR	16.410	0,64
200	Yihai International Holding Ltd	721	0,03
175	Zai Lab Ltd ADR	6.069	0,24
		<u>1.356.849</u>	<u>52,63</u>
	China: 41,62 %		
300	Aier Eye Hospital Group Co Ltd	2.003	0,08
250	A-Living Smart City Services Co Ltd	402	0,02
600	Anhui Gujing Distillery Co Ltd	9.359	0,36
1.200	AVIC Industry-Finance Holdings Co Ltd	619	0,02
4.800	Bank of Chengdu Co Ltd	11.871	0,46
2.000	Bank of Hangzhou Co Ltd	4.469	0,17
5.100	Bank of Shanghai Co Ltd	4.983	0,19
1.400	Beijing Enlight Media Co Ltd	1.978	0,08
4.400	Beijing Originwater Technology Co Ltd	3.419	0,13
2.200	Beijing Sinnet Technology Co Ltd	3.419	0,13
200	Beijing Tiantan Biological Products Corp Ltd	724	0,03
26.100	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd	19.543	0,76
13.400	BOE Technology Group Co Ltd	7.875	0,31
1.479	BYD Co Ltd	59.184	2,30
400	CanSino Biologics Inc	4.096	0,16
4.000	CECEP Solar Energy Co Ltd	4.982	0,19
6.600	CECEP Wind-Power Corp	4.725	0,18
200	Chacha Food Co Ltd	1.698	0,07
1.300	Changjiang Securities Co Ltd	1.150	0,04
100	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd	2.551	0,10
42.000	China Cinda Asset Management Co Ltd	6.583	0,26
122.000	China Construction Bank Corp	81.936	3,18
4.000	China Galaxy Securities Co Ltd	2.309	0,09
3.000	China Great Wall Securities Co Ltd	4.546	0,18
2.000	China International Capital Corp Ltd	4.262	0,17
15.441	China Life Insurance Co Ltd	26.880	1,04
14.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd	27.047	1,05
2.500	China Merchants Bank Co Ltd	16.726	0,65
300	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	601	0,02
4.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd	9.777	0,38
2.852	China Railway Signal & Communication Corp Ltd	1.927	0,07
4.000	China Southern Airlines Co Ltd	2.314	0,09
5.200	China Vanke Co Ltd	13.068	0,51
5.800	China Yangtze Power Co Ltd	20.002	0,78
100	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	1.656	0,06
4.500	CITIC Securities Co Ltd	10.059	0,39
300	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	23.895	0,93
700	CSC Financial Co Ltd	3.019	0,12
200	Da An Gene Co Ltd of Sun Yat-Sen University	513	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,36 % (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,36 % (Fortsetzung)		
	China: 41,62 % (Fortsetzung)		
4.200	DHC Software Co Ltd	3.959	0,15
200	Dong-E-E-Jiao Co Ltd	1.102	0,04
1.100	East Money Information Co Ltd	4.168	0,16
100	Eve Energy Co Ltd	1.454	0,06
1.400	First Capital Securities Co Ltd	1.339	0,05
2.400	Focus Media Information Technology Co Ltd	2.409	0,09
1.700	Founder Securities Co Ltd	1.701	0,07
280	Ganfeng Lithium Co Ltd 'H' Shares	3.081	0,12
7.700	GCL System Integration Technology Co Ltd	4.273	0,17
300	Giant Network Group Co Ltd	409	0,02
1.800	Gotion High-tech Co Ltd	12.243	0,47
300	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	3.370	0,13
1.215	Guangzhou Yuexiu Financial Holdings Group Co Ltd	1.274	0,05
800	Guotai Junan Securities Co Ltd	1.814	0,07
1.200	Guoyuan Securities Co Ltd	1.113	0,04
6.800	Haitong Securities Co Ltd	4.991	0,19
100	Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd	776	0,03
600	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' Shares	6.935	0,27
3.100	Hengtong Optic-electric Co Ltd	6.723	0,26
100	Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	1.434	0,06
100	Huadong Medicine Co Ltd	674	0,03
200	Huagong Tech Co Ltd	691	0,03
200	Hualan Biological Engineering Inc	680	0,03
5.200	Huatai Securities Co Ltd	7.714	0,30
2.200	Huaxi Securities Co Ltd	2.573	0,10
300	Hundsun Technologies Inc	1.948	0,08
1.400	Industrial Securities Co Ltd	1.472	0,06
2.940	JA Solar Technology Co Ltd	34.601	1,34
2.000	Jiangsu Expressway Co Ltd	2.014	0,08
100	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	2.732	0,11
500	Kunlun Tech Co Ltd	1.193	0,05
100	Kweichow Moutai Co Ltd	30.504	1,18
6.100	LONGi Green Energy Technology Co Ltd	60.626	2,35
100	Luxshare Precision Industry Co Ltd	504	0,02
100	Mango Excellent Media Co Ltd	498	0,02
600	Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd	498	0,02
100	Muyuan Foodstuff Co Ltd	824	0,03
2.300	Nanjing Securities Co Ltd	2.861	0,11
7.200	NARI Technology Co Ltd	28.997	1,12
2.400	New China Life Insurance Co Ltd	6.744	0,26
1.200	Nongfu Spring Co Ltd	6.889	0,27
100	Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' Shares	1.001	0,04
2.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	16.997	0,66
3.500	Qingdao Rural Commercial Bank Corp	1.733	0,07
1.300	Riyue Heavy Industry Co Ltd	4.925	0,19
300	Sangfor Technologies Inc	4.644	0,18
3.600	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	4.184	0,16
200	Shanghai Baosight Software Co Ltd	844	0,03
1.500	Shanghai Baosight Software Co Ltd 'A' Shares	12.216	0,47
100	Shanghai International Airport Co Ltd	846	0,03
8.300	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd	7.296	0,28
1.300	Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd	16.366	0,63
2.100	Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd	1.857	0,07
300	Shanxi Securities Co Ltd	257	0,01
9.200	Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	5.887	0,23

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 99,36 % (Fortsetzung)		
	Aktien: 99,36 % (Fortsetzung)		
	China: 41,62 % (Fortsetzung)		
1.200	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	11.790	0,46
200	Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd	1.348	0,05
200	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	9.343	0,36
100	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd	419	0,02
4.900	Sichuan Chuantou Energy Co Ltd	8.712	0,34
800	Songcheng Performance Development Co Ltd	1.832	0,07
900	SooChow Securities Co Ltd	930	0,04
1.900	Sungrow Power Supply Co Ltd	27.844	1,08
300	Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co Ltd	1.410	0,05
3.000	Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co Ltd	26.352	1,02
2.400	Titan Wind Energy Suzhou Co Ltd	5.903	0,23
4.100	Tongwei Co Ltd	36.609	1,42
100	Topchoice Medical Corp	2.602	0,10
3.000	TravelSky Technology Ltd	5.826	0,23
1.402	Trina Solar Co Ltd	13.645	0,53
180	Tsingtao Brewery Co Ltd	1.872	0,07
1.400	Unisplendour Corp Ltd	4.051	0,16
300	Walvax Biotechnology Co Ltd	2.165	0,08
1.500	Western Securities Co Ltd	1.463	0,06
200	Wuliangye Yibin Co Ltd	6.024	0,23
1.000	WuXi AppTec Co Ltd	13.317	0,52
1.000	WuXi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	9.424	0,37
200	Xiamen Intretech Inc	642	0,02
4.600	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'A' Shares	10.155	0,39
17.000	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd 'H' Shares	31.804	1,23
1.100	Yealink Network Technology Corp Ltd	12.494	0,48
400	Yunnan Baiyao Group Co Ltd	3.603	0,14
100	Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co Ltd	5.321	0,21
2.900	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	15.477	0,60
7.167	Zhejiang Expressway Co Ltd	6.613	0,26
200	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	2.016	0,08
200	Zhejiang Wolvo Bio-Pharmaceutical Co Ltd	1.552	0,06
1.700	Zheshang Securities Co Ltd	2.886	0,11
1.100	ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	3.582	0,14
1.700	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	8.384	0,33
3.800	ZTE Corp 'A' Shares	14.471	0,56
6.800	ZTE Corp 'H' Shares	15.841	0,61
		<u>1.072.750</u>	<u>41,62</u>
	Hongkong: 2,24 %		
6.000	China Overseas Land & Investment Ltd	18.963	0,74
690	China Resources Beer Holdings Co Ltd	5.144	0,20
12.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	11.913	0,46
4.540	Wharf Holdings Ltd	16.547	0,64
4.000	Yuexiu Property Co Ltd	5.128	0,20
		<u>57.695</u>	<u>2,24</u>
	Singapur: 0,36 %		
1.100	BOC Aviation Ltd	9.245	0,36
		<u>9.245</u>	<u>0,36</u>
	Vereinigte Staaten: 0,81 %		
432	Yum China Holdings Inc	20.952	0,81
		<u>20.952</u>	<u>0,81</u>
	Aktien insgesamt	<u>2.561.446</u>	<u>99,36</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>2.561.446</u>	<u>99,36</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF* (Fortsetzung)

	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
Anlageportfolio	2.561.446	99,36
Sonstiges Nettovermögen	16.621	0,64
Nettovermögen	<u>2.578.067</u>	<u>100,00</u>

	% des Gesamt- vermö- gens
Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	99,35
Sonstiges Umlaufvermögen	0,65
Gesamtvermögen	<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten vorliegen.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 95,23 %		
	Staatsanleihen: 95,23 %		
	Albanien: 0,33 %		
110.000	Albania Government International Bond 3.50% 16/06/2027	98.828	0,33
		<u>98.828</u>	<u>0,33</u>
	Armenien: 0,47 %		
200.000	Republic of Armenia International Bond 3.60% 02/02/2031	139.048	0,47
		<u>139.048</u>	<u>0,47</u>
	Benin: 0,25 %		
100.000	Benin Government International Bond 4.88% 19/01/2032	75.453	0,25
		<u>75.453</u>	<u>0,25</u>
	Brasilien: 6,93 %		
1.400.000	Brazilian Government International Bond 2.88% 06/06/2025	1.321.602	4,42
1.100.000	Brazilian Government International Bond 4.75% 14/01/2050	748.584	2,51
		<u>2.070.186</u>	<u>6,93</u>
	Chile: 6,81 %		
1.100.000	Chile Government International Bond 0.56% 21/01/2029	953.897	3,20
630.000	Chile Government International Bond 2.55% 27/07/2033	515.690	1,73
630.000	Chile Government International Bond 4.34% 07/03/2042	562.047	1,88
		<u>2.031.634</u>	<u>6,81</u>
	Kolumbien: 5,13 %		
240.000	Colombia Government International Bond 4.00% 26/02/2024	233.745	0,78
1.400.000	Colombia Government International Bond 7.38% 18/09/2037	1.298.718	4,35
		<u>1.532.463</u>	<u>5,13</u>
	Costa Rica: 0,63 %		
200.000	Costa Rica Government International Bond 6.13% 19/02/2031	187.160	0,63
		<u>187.160</u>	<u>0,63</u>
	Kroatien: 3,27 %		
250.000	Croatia Government International Bond 2.70% 15/06/2028	260.140	0,87
720.000	Croatia Government International Bond 2.88% 22/04/2032	714.641	2,40
		<u>974.781</u>	<u>3,27</u>
	Dominikanische Republik: 4,33 %		
730.000	Dominican Republic International Bond 5.88% 30/01/2060	501.339	1,68
850.000	Dominican Republic International Bond 6.00% 19/07/2028	792.625	2,65
		<u>1.293.964</u>	<u>4,33</u>
	Ghana: 1,52 %		
550.000	Ghana Government International Bond 8.63% 16/06/2049	261.250	0,88
220.000	Ghana Government International Bond 10.75% 14/10/2030	190.350	0,64
		<u>451.600</u>	<u>1,52</u>
	Ungarn: 3,41 %		
100.000	Hungary Government International Bond 1.63% 28/04/2032	80.231	0,27
520.000	Hungary Government International Bond 3.13% 21/09/2051	344.840	1,16
580.000	Hungary Government International Bond 5.38% 25/03/2024	592.215	1,98
		<u>1.017.286</u>	<u>3,41</u>
	Israel: 6,26 %		
1.100.000	Israel Government International Bond 2.75% 03/07/2030	1.021.475	3,43
960.000	Israel Government International Bond 3.88% 03/07/2050	846.242	2,83
		<u>1.867.717</u>	<u>6,26</u>
	Elfenbeinküste: 1,27 %		
500.000	Ivory Coast Government International Bond 4.88% 30/01/2032	378.467	1,27
		<u>378.467</u>	<u>1,27</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 95,23 % (Fortsetzung)		
	Staatsanleihen: 95,23 % (Fortsetzung)		
	Kenia: 1,04 %		
200.000	Republic of Kenya Government International Bond 6.88% 24/06/2024	167.996	0,56
200.000	Republic of Kenya Government International Bond 8.00% 22/05/2032	142.440	0,48
		<u>310.436</u>	<u>1,04</u>
	Mazedonien: 0,34 %		
130.000	North Macedonia Government International Bond 1.63% 10/03/2028	102.623	0,34
		<u>102.623</u>	<u>0,34</u>
	Mexiko: 9,35 %		
1.400.000	Mexico Government International Bond 3.63% 09/04/2029	1.389.335	4,66
150.000	Mexico Government International Bond 4.00% 15/03/2115	111.622	0,37
870.000	Mexico Government International Bond 4.50% 31/01/2050	680.501	2,28
730.000	Mexico Government International Bond 4.75% 08/03/2044	609.762	2,04
		<u>2.791.220</u>	<u>9,35</u>
	Mongolei: 0,54 %		
200.000	Mongolia Government International Bond 3.50% 07/07/2027	162.488	0,54
		<u>162.488</u>	<u>0,54</u>
	Montenegro: 0,27 %		
100.000	Montenegro Government International Bond 2.88% 16/12/2027	81.347	0,27
		<u>81.347</u>	<u>0,27</u>
	Panama: 5,04 %		
650.000	Panama Government International Bond 2.25% 29/09/2032	508.402	1,70
200.000	Panama Government International Bond 3.16% 23/01/2030	178.092	0,60
800.000	Panama Government International Bond 3.87% 23/07/2060	567.867	1,90
250.000	Panama Government International Bond 4.00% 22/09/2024	249.702	0,84
		<u>1.504.063</u>	<u>5,04</u>
	Paraguay: 1,00 %		
100.000	Paraguay Government International Bond 5.00% 15/04/2026	98.442	0,33
230.000	Paraguay Government International Bond 6.10% 11/08/2044	201.070	0,67
		<u>299.512</u>	<u>1,00</u>
	Peru: 5,00 %		
1.350.000	Peruvian Government International Bond 2.78% 23/01/2031	1.151.076	3,86
500.000	Peruvian Government International Bond 3.60% 15/01/2072	339.718	1,14
		<u>1.490.794</u>	<u>5,00</u>
	Philippinen: 7,25 %		
650.000	Philippine Government International Bond 3.00% 01/02/2028	616.485	2,07
1.050.000	Philippine Government International Bond 3.70% 02/02/2042	869.636	2,91
200.000	Philippine Government International Bond 3.95% 20/01/2040	174.476	0,58
500.000	Philippine Government International Bond 4.20% 21/01/2024	505.000	1,69
		<u>2.165.597</u>	<u>7,25</u>
	Polen: 5,56 %		
800.000	Republic of Poland Government International Bond 0.00% 07/07/2023	829.155	2,78
650.000	Republic of Poland Government International Bond 2.75% 25/05/2032	635.607	2,13
200.000	Republic of Poland Government International Bond 3.25% 06/04/2026	194.488	0,65
		<u>1.659.250</u>	<u>5,56</u>
	Rumänien: 8,43 %		
1.400.000	Romanian Government International Bond 2.88% 28/10/2024	1.468.441	4,92
1.400.000	Romanian Government International Bond 4.63% 03/04/2049	1.046.819	3,51
		<u>2.515.260</u>	<u>8,43</u>
	Senegal: 0,64 %		
250.000	Senegal Government International Bond 6.25% 23/05/2033	192.500	0,64
		<u>192.500</u>	<u>0,64</u>
	Serbien: 1,35 %		
440.000	Serbia International Bond 1.50% 26/06/2029	335.773	1,13
100.000	Serbia International Bond 1.65% 03/03/2033	66.056	0,22
		<u>401.829</u>	<u>1,35</u>

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022 (Fortsetzung)

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF* (Fortsetzung)

Bestand	Anlage	Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Wertpapiere: 95,23 % (Fortsetzung)		
	Staatsanleihen: 95,23 % (Fortsetzung)		
	Südafrika: 3,99 %		
350.000	Republic of South Africa Government International Bond 5.75% 30/09/2049 ...	240.102	0,80
1.050.000	Republic of South Africa Government International Bond 5.88% 22/06/2030 ...	950.145	3,19
		<u>1.190.247</u>	<u>3,99</u>
	Südkorea: 1,74 %		
550.000	Korea International Bond 2.50% 19/06/2029	520.393	1,74
		<u>520.393</u>	<u>1,74</u>
	Uruguay: 3,08 %		
420.000	Uruguay Government International Bond 4.50% 14/08/2024	425.083	1,42
500.000	Uruguay Government International Bond 4.98% 20/04/2055	495.321	1,66
		<u>920.404</u>	<u>3,08</u>
	Staatsanleihen insgesamt	<u>28.426.550</u>	<u>95,23</u>
	Wertpapiere insgesamt	<u>28.426.550</u>	<u>95,23</u>
		Zeitwert USD	% des Netto- vermö- gens
	Anlageportfolio	28.426.550	95,23
	Sonstiges Nettovermögen	1.425.039	4,77
	Nettovermögen	<u>29.851.589</u>	<u>100,00</u>
			% des Gesamt- Vermögen swerte
	Analyse des Gesamtvermögens (ungeprüft)		
	Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind		74,19
	Sonstiges Umlaufvermögen		25,81
	Gesamtvermögen		<u>100,00</u>

Länderklassifizierung basiert auf dem Gründungsland und/oder dem Sitzland.

* Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt, weshalb keine Vergleichsdaten vorliegen.

OFFENLEGUNG ZU VERGÜTUNGEN (UNGEPRÜFT)

Vergütungspolitik

FTIS ist eine Verwaltungsgesellschaft, die für die Verwaltung von OGAW-Fonds zugelassen ist und nach der Umsetzung der EU-Richtlinie 2014/91/EU zur Änderung der Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (EU-Richtlinie 2009/65/EG) („OGAW V“) am 18. März 2016 dem OGAW-Vergütungskodex unterliegt.

Zweck und Umfang der Erklärung zur Vergütungspolitik

Die Vergütungspolitik von FTIS wurde entwickelt, um die persönlichen Ziele der Mitarbeiter mit den langfristigen Interessen von FTIS und den von FTIS verwalteten OGAW und AIF abzustimmen. Sie zielt darauf ab, Anreizpraktiken abzuschwächen, welche die Mitarbeiter ermutigen können, unnötige Risiken einzugehen.

Die Vergütungspolitik gilt für eine bestimmte Kategorie von Mitarbeitern, die als identifizierte Mitarbeiter bezeichnet werden, zu denen Mitglieder des Verwaltungsrats, leitende Angestellte, Mitglieder von Kontrollfunktionen, Risikoträger und alle Mitarbeiter mit einer Vergütung gehören, die sie in die gleiche Kategorie wie leitende Angestellte oder Risikoträger einordnet, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder des von ihr verwalteten OGAW haben.

Beschreibung der Struktur der Vergütung

Die Vergütung beinhaltet einen festen und einen variablen Bestandteil.

Feste Vergütung: Die feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt zuzüglich wesentlicher, von der Gesellschaft erbrachter Leistungen, die Dienstwagen, Betriebsrentenbeiträge, private Krankenversicherungsprämien und Lebensversicherungsprämien umfassen können.

Das Grundgehalt (einschließlich Leistungen) wird unter Bezugnahme auf Marktvergleichsdaten (Branchenumfragen) festgelegt, die regelmäßig überprüft werden.

Die Festgehälter werden als ausreichend hoher Anteil an der Gesamtvergütung festgelegt, so dass FTIS in der Lage ist, eine vollständig flexible Bonuspolitik mit der Möglichkeit, keinen Bonus zu zahlen, zu betreiben.

Variable Vergütung: Variable Vergütung: Die variable Vergütung ist definiert als jährliche Boni, die im Rahmen des Annual Incentive Plan (AIP) ausgezahlt werden, Langzeitprämien in Form von leistungsabhängigen Anteilszuteilungen und Verkaufsbonuszahlungen. Die Bonusstufen werden in Abhängigkeit von der Gesamtleistung des Unternehmens und der Geschäftseinheiten sowie der individuellen Leistung bei FTIS festgelegt.

Vergütung

Der AIFM verfügt über eine Vergütungspolitik, die für alle von ihm verwalteten alternativen Investmentfonds („AIF“) gilt.

Nachfolgend werden quantitative, für die Gesellschaft relevante Informationen dargestellt. Weitere qualitative Details sind auf Anfrage am eingetragenen Geschäftssitz des AIFM erhältlich.

Gesamtbetrag der festen Vergütungen, die von FTIS und ihren Beauftragten während des zum 30. September 2021 endenden Geschäftsjahres gezahlt wurden *, **, ***	461.814 EUR
Gesamtbetrag der von FTIS und ihren Beauftragten während des zum 30. September 2021 endenden Geschäftsjahres gezahlten variablen Vergütung *, **, ***	234.052 EUR
Anzahl der Mitarbeiter/innen von FTIS und ihren Beauftragten zum 30. September 2021	480
Gesamtbetrag der von FTIS und ihren Beauftragten im Laufe des zum 30. September 2021 endenden Geschäftsjahres an leitende Angestellte gezahlten Vergütungen *, **, ***	306.446 EUR
Gesamtbetrag, den FTIS und ihre Beauftragten während des zum 30. September 2021 endenden Geschäftsjahres an andere Mitarbeiter/innen gezahlt haben, die einen wesentlichen Einfluss auf das Profil von OGAW/AIFM haben *, **, ***	129.434 EUR

* Der Gesamtbetrag der von FTIS gezahlten Vergütungen wurde dem UCITS auf der Grundlage seines Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen zum Monatsende der von FTIS verwalteten Fonds insgesamt für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 zugewiesen.

** Der Gesamtbetrag der von den FTIS-Beauftragten gezahlten Vergütungen wurde dem UCITS auf der Grundlage seines Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen zum Monatsende der von FTIS verwalteten Fonds insgesamt für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 zugewiesen.

*** Beauftragte sind Anlageverwaltungsgesellschaften, die regulatorischen Anforderungen unterliegen, die gleichermaßen wirksam sind wie die in Artikel 69(3)(a) der OGAW-Richtlinie aufgeführten.

Einzelheiten zur Vergütungspolitik sind auf der Website der Verwaltungsgesellschaft abrufbar:

<https://www.franklintempleton.lu/investor/our-approach/our-company/regulatory-information>

Ein gedrucktes Exemplar der FTIS-Vergütungspolitik ist auf Anfrage kostenlos in unserer Niederlassung erhältlich.

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT)

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Vale SA ADR	190.325	2.972.231
Petroleo Brasileiro SA ADR	135.609	1.513.785
Itau Unibanco Holding SA ADR	233.122	1.063.142
Petroleo Brasileiro SA ADR	88.840	1.048.997
Banco Bradesco SA ADR	232.289	893.808
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	303.800	716.029
Ambev SA ADR	213.364	589.874
Centrais Eletricas Brasileiras SA	76.100	586.313
WEG SA	73.500	458.138
Itausa SA	230.360	443.770
JBS SA ADR	28.805	405.819
Rede D'Or Sao Luiz SA	35.000	377.443
Suzano SA	35.900	366.927
Vale SA	18.190	303.658
Banco BTG Pactual SA	65.100	296.835
Localiza Rent a Car SA	29.600	292.752
Gerdau SA	53.700	278.825
Petro Rio SA	64.500	277.563
Lojas Renner SA	51.860	275.697
Natura & Co Holding SA	46.700	268.980
Embraer SA	70.000	267.736
Banco do Brasil SA	42.200	250.836
Magazine Luiza SA	149.500	250.251
JBS SA	33.600	249.212
Cosan SA	59.100	241.275
Equatorial Energia SA	52.800	240.291
BRF SA	63.300	239.305
Petroleo Brasileiro SA	33.700	234.839
Hapvida Participacoes e Investimentos SA	109.091	229.208
Petroleo Brasileiro SA	35.300	229.134

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin FTSE Brazil UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Vale SA ADR	93.182	1.522.341
Petroleo Brasileiro SA ADR	73.607	917.278
Petroleo Brasileiro SA ADR	52.716	704.857
Itau Unibanco Holding SA ADR	126.372	588.026
Banco Bradesco SA ADR	128.306	481.746
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	139.400	331.016
Ambev SA ADR	110.398	306.118
XP Inc	5.007	208.878
JBS SA ADR	14.732	196.049
Itausa S	101.400	186.083
WEG SA	31.800	174.034
Suzano SA	16.000	165.536
Cosan SA	36.600	149.012
Localiza Rent a Car SA	13.200	135.358
Equatorial Energia SA	27.000	129.091
Gerdau SA	24.800	127.745
Banco do Brasil SA	18.800	126.167
BRF SA	41.400	116.742
Hapvida Participacoes e Investimentos SA	69.500	115.584
Banco Bradesco SA	35.750	113.449
Vibra Energia SA	28.100	112.748
Lojas Renner SA	21.740	106.492

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin FTSE China UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Tencent Holdings Ltd	400.700	22.805.743
Alibaba Group Holding Ltd	1.012.700	16.495.120
Meituan	275.100	7.304.518
JD.com Inc	151.407	5.089.085
China Construction Bank Corp	6.232.000	4.613.585
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	5.274.000	3.122.958
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	385.150	3.023.294
Wuxi Biologics Cayman Inc	246.900	2.614.212
Baidu Inc ADR	15.461	2.464.080
Kuaishou Technology	208.800	2.449.238
NIO Inc ADR	85.484	2.424.090
Xiaomi Corp	1.004.000	2.240.570
China Merchants Bank Co Ltd	254.500	2.041.032
Bank of China Ltd	5.118.000	1.952.385
Pinduoduo Inc ADR	25.021	1.636.576
XPeng Inc ADR	42.736	1.542.326
Kweichow Moutai Co Ltd	5.400	1.535.691
BYD Co Ltd	48.397	1.529.739
NetEase Inc	78.700	1.513.050
Li Ning Co Ltd	138.000	1.446.832
Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Tencent Holdings Ltd	145.200	7.388.096
Alibaba Group Holding Ltd	325.700	4.802.923
Meituan	89.100	2.046.586
China Construction Bank Corp	2.242.000	1.644.265
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1.894.000	1.122.159
JD.com Inc	31.007	977.256
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	127.650	940.178
China Merchants Bank Co Ltd	97.000	758.356
NIO Inc ADR	27.654	721.554
Bank of China Ltd	1.858.000	713.808
NetEase Inc	37.900	710.861
Wuxi Biologics Cayman Inc	74.400	706.124
DiDi Global Inc	273.700	641.213
Xiaomi Corp	286.000	554.303
Baidu Inc ADR	3.436	530.628
China Railway Group Ltd	510.000	502.489
Pinduoduo Inc ADR	8.936	486.068
JA Solar Technology Co Ltd	40.400	471.750
Kanzhun Ltd ADR	20.711	467.347
Kweichow Moutai Co Ltd	1.700	465.024

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin FTSE India UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Reliance Industries Ltd	198.371	6.292.084
Infosys Ltd	212.550	4.568.114
Housing Development Finance Corp Ltd	104.034	3.329.715
Tata Consultancy Services Ltd	61.435	2.815.372
Hindustan Unilever Ltd	52.860	1.591.197
Axis Bank Ltd	135.247	1.277.996
Bharti Airtel Ltd	136.115	1.193.630
Bajaj Finance Ltd	13.991	1.186.355
Asian Paints Ltd	26.883	1.082.553
HCL Technologies Ltd	64.705	930.840
Larsen & Toubro Ltd	41.044	905.926
ICICI Bank Ltd	92.888	875.565
Adani Transmission Ltd	33.501	865.012
Maruti Suzuki India Ltd	7.889	792.693
Tata Steel Ltd	47.917	745.232
Titan Co Ltd	24.814	708.132
Sun Pharmaceutical Industries Ltd	64.852	695.601
HDFC Life Insurance Co Ltd	78.639	667.942
State Bank of India	106.476	660.517
Mahindra & Mahindra Ltd	54.753	616.238
Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Infosys Ltd	28.059	633.868
Reliance Industries Ltd	16.347	527.759
Tata Consultancy Services Ltd	8.200	376.442
Housing Development Finance Corp Ltd	10.542	352.862
Hindustan Unilever Ltd	5.880	180.087
Sundaram Finance Ltd	7.119	173.233
Indus Towers Ltd	56.235	153.823
Axis Bank Ltd	14.530	141.166
Bharti Airtel Ltd	15.110	138.239
Bajaj Finance Ltd	1.301	120.138
Asian Paints Ltd	2.907	118.022
HCL Technologies Ltd	7.231	110.803
Larsen & Toubro Ltd	4.603	103.084
Motherson Sumi Wiring India Ltd	117.392	102.381
ICICI Bank Ltd	9.575	90.210
Maruti Suzuki India Ltd	851	83.941
Titan Co Ltd	2.755	83.301
Sun Pharmaceutical Industries Ltd	7.153	77.091
State Bank of India	12.003	74.215
UltraTech Cement Ltd	734	64.666

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin FTSE Korea UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Samsung Electronics Co Ltd	267.849	15.174.773
Krafton Inc	12.880	5.346.306
KakaoBank Corp	68.360	3.541.429
LG Energy Solution Ltd	10.212	3.376.285
Samsung Electronics Co Ltd	44.446	2.328.687
SK Bioscience Co Ltd	9.947	2.288.098
HMM Co Ltd	68.029	2.044.216
SK IE Technology Co Ltd	11.853	1.711.795
Ecopro BM Co Ltd	4.313	1.683.072
SK Hynix Inc	14.885	1.555.546
L&F Co Ltd	9.546	1.471.283
NAVER Corp	4.323	1.322.429
Kakao Corp	15.050	1.228.320
Samsung Biologics Co Ltd	1.828	1.216.270
F&F Co Ltd	1.482	1.135.489
Pearl Abyss Corp	15.457	1.102.123
SK Square Co Ltd	24.402	1.088.121
POSCO	4.748	1.067.734
SK Inc	4.081	899.337
Samsung SDI Co Ltd	1.509	839.931
Kakao Games Corp	12.099	811.215
LG Chem Ltd	1.331	790.602
SD Biosensor Inc	14.985	728.215
Hyundai Motor Co	3.997	709.295

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin FTSE Korea UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Samsung Electronics Co Ltd	999.082	60.737.284
SK Hynix Inc	134.275	11.894.445
NAVER Corp	34.055	11.171.403
Samsung Electronics Co Ltd	174.708	9.815.298
Samsung SDI Co Ltd	14.587	8.607.404
LG Chem Ltd	12.332	7.895.710
Kakao Corp	70.739	7.495.179
Hyundai Motor Co	38.451	6.490.738
Celltrion Inc	28.246	5.527.541
Kia Corp	70.842	4.834.983
KB Financial Group Inc	107.359	4.795.434
Shinhan Financial Group Co Ltd	137.813	4.497.598
POSCO	16.904	4.447.848
Hyundai Mobis Co Ltd	18.490	3.853.134
LG Electronics Inc	29.666	3.308.537
SK Innovation Co Ltd	16.150	3.136.073
Hana Financial Group Inc	79.409	2.928.700
Samsung Biologics Co Ltd	3.425	2.641.008
NCSOFT Corp	4.940	2.580.571
LG Household & Health Care Ltd	2.400	2.447.440

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT)

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF*

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	38.600	789.748
MediaTek Inc	3.630	124.738
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	29.200	107.176
United Microelectronics Corp	28.550	53.645
Delta Electronics Inc	5.290	48.510
Cathay Financial Holding Co Ltd	20.300	45.346
Formosa Plastics Corp	11.930	45.045
Fubon Financial Holding Co Ltd	17.200	44.888
Nan Ya Plastics Corp	13.830	44.738
CTBC Financial Holding Co Ltd	44.000	43.736
China Steel Corp	30.000	41.885
Chunghwa Telecom Co Ltd	9.200	40.880
Mega Financial Holding Co Ltd	27.000	38.502
E.Sun Financial Holding Co Ltd	31.000	33.917
Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	6.480	32.888
ASE Technology Holding Co Ltd	8.400	30.979
Chailease Holding Co Ltd	3.300	28.803
Uni-President Enterprises Corp	11.700	27.011
China Development Financial Holding Corp	39.000	25.753
Yuanta Financial Holding Co Ltd	28.000	25.668

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin FTSE Taiwan UCITS ETF* (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	410	1.649
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	400	1.475
Mega Financial Holding Co Ltd	1.000	1.183
MediaTek Inc	40	1.121
Chailease Holding Co Ltd	150	1.103
Pou Chen Corp	1.000	1.031
Cathay Financial Holding Co Ltd	500	897
Inventec Corp	1.000	843
ASPEED Technology Inc	10	726
ASE Technology Holding Co Ltd	200	657
Nan Ya Plastics Corp	230	641
Formosa Plastics Corp	180	639
Delta Electronics Inc	80	610
AU Optronics Corp	1.000	578
SinoPac Financial Holdings Co Ltd	1.000	561
Taishin Financial Holding Co Ltd	1.000	556
Walsin Lihwa Corp	390	554
Far Eastern New Century Corp	531	549
Ruentex Development Co Ltd	200	503
Taiwan Fertilizer Co Ltd	220	496
United Microelectronics Corp	290	467
ASMedia Technology Inc	10	426
Micro-Star International Co Ltd	100	421
Fubon Financial Holding Co Ltd	200	410
Taiwan Business Bank	1.000	400
E Ink Holdings Inc	50	343
Asustek Computer Inc	30	327
Unimicron Technology Corp	50	280
Formosa Chemicals & Fibre Corp	100	272
President Chain Store Corp	30	263
Hiwin Technologies Corp	30	243

* Der Teilfonds wurde am 21. März 2022 aufgelegt.

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
Bundesobligation 0.00% 10/10/2025	5.000.000	4.931.512
Spain Government Bond 1.00% 30/07/2042	3.400.000	3.258.197
Netherlands Government Bond 0.50% 15/01/2040	2.500.000	2.345.390
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/06/2029	2.200.000	2.078.714
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2050	2.500.000	2.018.180
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 0.38% 07/10/2027	2.000.000	1.993.155
Ireland Government Bond 1.35% 18/03/2031	1.400.000	1.533.406
Arion Banki HF 0.38% 14/07/2025	1.500.000	1.497.863
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0.25% 09/09/2029	1.500.000	1.493.490
Segro Capital Sarl 0.50% 22/09/2031	1.400.000	1.340.180
Iberdrola Finanzas SA 1.58% Perp	1.300.000	1.298.600
Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026	1.300.000	1.295.658
Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 22/04/2033	1.225.000	1.279.759
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	1.200.000	1.141.990
FLUVIUS System Operator CVBA 0.25% 02/12/2030	1.000.000	1.008.106
Valeo 1.00% 03/08/2028	1.000.000	1.000.357
Sparebank 1 Oestlandet 1.75% 27/04/2027	1.000.000	996.120
Vestas Wind Systems Finance BV 2.00% 15/06/2034	1.000.000	987.210
Suez SACA 2.38% 24/05/2030	1.000.000	966.299
Societe Du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	900.000	826.234
United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	700.000	815.717
Power Finance Corp Ltd 1.84% 21/09/2028	800.000	784.000
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030	800.000	769.454
Vesteda Finance BV 1.50% 24/05/2027	600.000	645.498
European Union 0.40% 04/02/2037	600.000	595.314
Orsted AS 1.75% 09/12/3019	600.000	586.828
Societe Nationale SNCF SA 0.63% 17/04/2030	600.000	563.514
Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	500.000	534.331
AXA SA 1.38% 07/10/2041	500.000	510.172
ACEA SpA 0.00% 28/09/2025	500.000	501.729

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Netherlands Government Bond 0.50% 15/01/2040	6.100.000	6.257.007
Bundesobligation 0.00% 10/10/2025	4.300.000	4.338.051
Kingdom of Belgium Government Bond 1.25% 22/04/2033	3.325.000	3.563.225
Acciona Energia Financiacion Filiales SA 0.38% 07/10/2027	2.000.000	1.872.071
HSBC Holdings PLC 1.50% 04/12/2024	1.700.000	1.736.901
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.38% 14/05/2025	1.700.000	1.723.030
Berlin Hyp AG 1.13% 25/10/2027	1.700.000	1.653.347
ABN AMRO Bank NV 0.50% 15/04/2026	1.500.000	1.498.632
Ireland Government Bond 1.35% 18/03/2031	1.400.000	1.492.684
Swedbank AB 0.30% 20/05/2027	1.500.000	1.434.064
Credit Agricole SA 0.38% 21/10/2025	1.400.000	1.421.392
Assicurazioni Generali SpA 2.43% 14/07/2031	1.400.000	1.408.450
ACEA SpA 0.00% 28/09/2025	1.400.000	1.364.668
NE Property BV 3.38% 14/07/2027	1.400.000	1.333.802
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU 0.82% 04/12/2023	1.300.000	1.317.442
Iberdrola International BV 1.45% Perp.	1.300.000	1.300.650
Barclays PLC 1.70% 03/11/2026	1.100.000	1.256.551
Westpac Banking Corp 0.77% 13/05/2031	1.300.000	1.185.383
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030	1.200.000	1.182.472
ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	1.200.000	1.176.899
Arkema SA 0.13% 14/10/2026	1.200.000	1.159.270
Naturgy Finance BV 0.88% 15/05/2025	1.000.000	1.034.160
Deutsche Wohnen SE 0.50% 07/04/2031	1.000.000	1.005.960
Spain Government Bond 1.00% 30/07/2042	1.100.000	987.975
Sparebank 1 Oestlandet 1.75% 27/04/2027	1.000.000	986.720
Societe Du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	1.000.000	951.692
Vonovia SE 0.63% 24/03/2031	1.000.000	858.900
Engie SA 1.75% 27/03/2028	800.000	857.320
French Republic Government Bond OAT 1.75% 25/06/2039	700.000	791.024

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.10% 15/04/2023	35.868.734	37.627.612
Netherlands Government Bond 2.00% 15/07/2024	20.000.000	20.746.600
Spain Letras del Tesoro 0.00% 07/10/2022	20.000.000	20.077.125
France Treasury Bill BTF 0.00% 30/11/2022	20.000.000	20.057.102
Bundesschatzanweisungen 0.00% 15/03/2024	20.000.000	19.925.000
Bundesobligation 0.00% 10/10/2025	20.000.000	19.675.400
France Treasury Bill BTF 0.00% 10/08/2022	18.000.000	18.070.353
Spain Letras del Tesoro 0.00% 09/12/2022	17.000.000	17.044.172
Spain Government Inflation Linked Bond 1.80% 30/11/2024	14.454.919	16.662.713
French Republic Government Bond OAT 0.25% 25/07/2024	14.983.568	16.439.212
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0.00% 14/11/2022	15.000.000	15.053.957
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0.00% 14/12/2022	15.000.000	15.047.145
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.13% 07/06/2023	13.000.000	13.005.690
European Financial Stability Facility 1.88% 23/05/2023	12.185.000	12.448.853
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 09/03/2023	12.000.000	12.059.539
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 12/01/2023	10.000.000	10.052.194
Kingdom of Belgium Treasury Bill 0.00% 08/09/2022	10.000.000	10.051.318
Instituto de Credito Oficial 1.30% 31/10/2026	10.000.000	9.998.310
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0.00% 14/01/2022	6.000.000	6.014.257
French Republic Government Bond OAT 0.00% 24/11/2021	6.000.000	6.005.991

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe*	Anteile	Erlöse EUR
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.10% 15/04/2023	7.967.680	8.428.371
Wells Fargo & Co 1.50% 12/09/2022	3.000.000	3.011.700
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 0.38% 17/10/2023	3.000.000	2.963.400
Digital Dutch Finco BV 0.32% 23/09/2022	2.000.000	2.001.160
Deutsche Bank SA Espanola 0.50% 11/03/2024	2.000.000	1.985.380
KBC Group NV 0.30% 23/02/2025	1.500.000	1.501.860
Deutsche Bank AG 2.38% 11/01/2023	1.300.000	1.316.250
Wells Fargo & Co 0.50% 26/04/2024	1.300.000	1.266.798
KBC Group NV 1.13% 25/01/2024	1.000.000	1.001.930
Vonovia SE 0.00% 01/09/2023	1.000.000	994.372
Air Liquide Finance SA 0.75% 13/06/2024	1.000.000	992.500
JDE Peet's NV 0.24% 16/01/2025	700.000	651.280
Vonovia Finance BV 0.27% 22/12/2022	600.000	600.600
Vonovia Finance BV 1.63% 07/04/2024	500.000	504.760
SBB Treasury Oyj 0.09% 01/02/2023	500.000	500.955
Grand City Properties SA 2.75% Ap/N /N Ap	300.000	300.330
Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	300.000	292.545
Cloverie PLC for Swiss Reinsurance Co Ltd 6.63% 01/09/2042	200.000	202.960
ADLER Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	100.000	99.887

* In vorstehender Tabelle sind alle Verkäufe im Geschäftsjahr angegeben.

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin Liberty USD Investment Grade Corporate Bond UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
United States Treasury Note 0.88% 30/06/2026	515.000	518.179
United States Treasury Floating Rate Note 1.74% 31/01/2024	400.000	400.308
United States Treasury Note 1.63% 15/05/2031	335.000	345.089
United States Treasury Note 2.00% 15/08/2051	300.000	303.211
AT&T Inc 3.50% 01/06/2041	250.000	253.156
Procter & Gamble Co 3.00% 25/03/2030	225.000	250.376
salesforce.com Inc 2.70% 15/07/2041	200.000	204.496
UniCredit SpA 1.98% 03/06/2027	200.000	200.324
Thermo Fisher Scientific Inc 1.22% 18/10/2024	200.000	200.114
EDP Finance BV 1.71% 24/01/2028	200.000	199.852
SVB Financial Group 3.13% 05/06/2030	175.000	189.579
Fidelity National Information Services Inc 2.25% 01/03/2031	175.000	176.732
Regeneron Pharmaceuticals Inc 1.75% 15/09/2030	175.000	168.634
Netflix Inc 5.75% 01/03/2024	150.000	164.984
Apple Inc 2.70% 05/08/2051	175.000	156.427
ConocoPhillips Co 3.80% 15/03/2052	150.000	153.170
Cigna Corp 3.05% 15/10/2027	140.000	152.180
Archer-Daniels-Midland Co 2.90% 01/03/2032	150.000	149.690
Kraft Heinz Foods Co 4.25% 01/03/2031	125.000	144.019
Ecolab Inc 2.70% 15/12/2051	150.000	131.175
DuPont de Nemours Inc 5.42% 15/11/2048	100.000	124.893
Dominion Energy Inc 3.90% 01/10/2025	100.000	110.394
FedEx Corp 4.75% 15/11/2045	80.000	101.250
Verizon Communications Inc 3.40% 22/03/2041	90.000	96.311
Baker Hughes Holdings LLC 4.08% 15/12/2047	80.000	90.538
UnitedHealth Group Inc 3.05% 15/05/2041	80.000	83.747
Devon Energy Corp 5.00% 15/06/2045	75.000	83.643
AstraZeneca Plc 4.38% 16/11/2045	65.000	83.617
RELX Capital Inc 3.00% 22/05/2030	75.000	80.888
Microchip Technology Inc 0.98% 01/09/2024	75.000	75.058
Microsoft Corp 2.53% 01/06/2050	75.000	73.901

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

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

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
United States Treasury Note 0.88% 30/06/2026	515.000	512.148
United States Treasury Note 1.63% 15/05/2031	335.000	347.053
BPCE SA 5.70% 22/10/2023	300.000	332.052
Lloyds Banking Group Plc 2.91% 07/11/2023	300.000	309.333
United States Treasury Note 2.00% 15/08/2051	300.000	308.473
Bank of Montreal 2.90% 26/03/2022	300.000	301.914
Procter & Gamble Co 3.00% 25/03/2030	225.000	245.156
Georgia Power Co 4.30% 15/03/2042	200.000	231.223
Tencent Holdings Ltd 3.60% 19/01/2028	200.000	219.108
TotalEnergies Capital International SA 2.88% 17/02/2022	200.000	203.138
salesforce.com Inc 2.70% 15/07/2041	200.000	196.856
Wachovia Corp 5.50% 01/08/2035	150.000	191.012
Prudential Plc 3.13% 14/04/2030	175.000	190.575
AT&T Inc 3.80% 15/02/2027	175.000	190.265
Marsh & McLennan Cos Inc 4.90% 15/03/2049	140.000	188.696
TransCanada PipeLines Ltd 4.25% 15/05/2028	150.000	173.798
Microchip Technology Inc 0.98% 01/09/2024	175.000	171.806
Sherwin-Williams Co 2.30% 15/05/2030	170.000	170.155
HCA Inc 4.13% 15/06/2029	150.000	165.388
STERIS Irish FinCo UnLtd Co 3.75% 15/03/2051	150.000	163.314
Valero Energy Corp 4.35% 01/06/2028	140.000	160.464
Amazon.com Inc 0.40% 03/06/2023	160.000	160.274
Intel Corp 2.45% 15/11/2029	150.000	155.211
Target Corp 2.25% 15/04/2025	150.000	154.906
Walt Disney Co 6.20% 15/12/2034	100.000	140.786
Arch Capital Group Ltd 3.64% 30/06/2050	115.000	126.972
Jabil Inc 3.60% 15/01/2030	115.000	124.796
Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 4.30% 29/07/2049	100.000	123.994
Berkshire Hathaway Energy Co 6.13% 01/04/2036	80.000	114.024
Commonwealth Edison Co 4.00% 01/03/2048	90.000	110.147
Truist Financial Corp 3.88% 19/03/2029	100.000	105.168
Biogen Inc 3.25% 15/02/2051	84.000	85.221
Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 7.85% 01/02/2026	65.000	82.861

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia Ex-Japan UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
POSCO	314	70.568
Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	13.400	62.352
Nongfu Spring Co Ltd	7.200	40.898
Yang Ming Marine Transport Corp	9.000	37.936
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	36.000	37.778
Fubon Financial Holding Co Ltd	13.514	35.345
Intouch Holdings PCL	14.400	35.148
Yuanta Financial Holding Co Ltd	38.000	32.232
Cathay Financial Holding Co Ltd	15.000	31.669
SITC International Holdings Co Ltd	8.000	31.407
Kweichow Moutai Co Ltd	100	31.082
China Petroleum & Chemical Corp	66.000	29.917
HMM Co Ltd	1.023	26.836
CLP Holdings Ltd	2.700	26.640
Capitaland Investment Ltd	8.700	25.078
COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	14.500	25.041
PetroChina Co Ltd	50.000	23.632
PICC Property & Casualty Co Ltd	26.000	23.265
Infosys Ltd	1.153	22.657
CITIC Ltd	23.000	22.605
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.110	21.353
Orient Overseas International Ltd	664	20.425
Samsung Electronics Co Ltd	316	18.656
Lenovo Group Ltd	18.000	17.782
Vedanta Ltd	3.975	17.763
eMemory Technology Inc	245	17.545

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ AC Asia Ex-Japan UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	35.000	134.979
Hindustan Unilever Ltd	3.638	112.080
CK Hutchison Holdings Ltd	11.200	79.406
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	10.000	69.229
Country Garden Services Holdings Co Ltd	7.700	46.502
NCSOFT Corp	81	46.315
Tech Mahindra Ltd	3.010	45.656
Wuliangye Yibin Co Ltd	1.200	40.949
Infosys Ltd	1.775	40.383
Taiwan Cement Corp	25.100	36.724
Globalwafers Co Ltd	1.160	33.895
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	5.800	29.344
Accton Technology Corp	2.590	26.627
Henderson Land Development Co Ltd	6.000	25.432
Pegatron Corp	9.000	21.487
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.000	21.365
Wharf Holdings Ltd	6.000	20.942
Kweichow Moutai Co Ltd	65	19.483
Tata Consultancy Services Ltd	410	19.226
Far EasTone Telecommunications Co Ltd	8.000	17.637
Coway Co Ltd	303	17.449
Bank of China Ltd	43.000	17.241
China Resources Power Holdings Co Ltd	8.000	16.455

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Saudi Arabian Oil Co	31.822	355.649
Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	73.220	339.275
POSCO	1.512	336.738
Cathay Financial Holding Co Ltd	154.000	323.407
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	135.800	300.983
China Life Insurance Co Ltd	168.000	270.488
Banco Bradesco SA	70.000	246.880
Petroleo Brasileiro SA	46.200	240.592
Yang Ming Marine Transport Corp	56.000	236.892
Intouch Holdings PCL	88.900	216.591
Vale SA ADR	16.800	211.118
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	196.000	205.121
Petroleo Brasileiro SA	36.400	197.369
Gerdau SA	33.600	177.649
Yuanta Financial Holding Co Ltd	210.000	177.405
HMM Co Ltd	5.964	156.451
Sibanye Stillwater Ltd	45.409	147.504
Astra International Tbk PT	284.200	143.356
Nongfu Spring Co Ltd	25.200	140.880
AU Optronics Corp	196.000	134.017
Banco do Brasil SA	21.000	133.090
COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd	77.000	132.950

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Emerging Markets UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
NetEase Inc	3.780	407.177
Hindustan Unilever Ltd	12.327	379.773
Banco Bradesco SA	77.000	332.915
Vale SA ADR	17.108	308.792
NCSOFT Corp	497	284.180
Country Garden Services Holdings Co Ltd	40.600	245.190
Al Rajhi Bank	7.714	244.558
Wuliangye Yibin Co Ltd	7.000	238.870
Taiwan Cement Corp	154.000	226.615
Emirates Telecommunications Group Co PJSC	24.430	206.408
Globalwafers Co Ltd	7.000	204.505
China Shenhua Energy Co Ltd	63.500	198.819
United Microelectronics Corp	82.000	187.242
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	636.300	183.236
Wipro Ltd	28.784	177.049
Accton Technology Corp	16.000	165.468
Gazprom PJSC	34.272	155.755
Wharf Holdings Ltd	42.000	146.592
Masraf Al Rayan QSC	112.714	145.593
Grupo Mexico SAB de CV	29.064	143.279
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	40.068	139.493
Infosys Ltd	5.782	131.547
Petroleo Brasileiro SA	19.600	124.261
China Resources Power Holdings Co Ltd	56.000	115.188

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
CaixaBank SA	299.729	1.011.982
BHP Group Plc	32.880	805.392
Rio Tinto Plc	12.350	758.898
Admiral Group Plc	23.752	744.118
BE Semiconductor Industries NV	11.231	737.308
Hannover Rueck SE	4.711	727.609
Kesko OYJ	26.917	701.387
Telenor ASA	44.226	599.332
Koninklijke KPN NV	191.067	574.101
BAE Systems Plc	74.791	570.281
Endesa SA	28.532	566.351
Tryg A/S	25.894	550.970
Aker BP ASA	13.569	547.137
Iberdrola SA	53.157	543.618
GlaxoSmithKline Plc	28.494	538.980
Allianz SE	2.625	537.414
Zurich Insurance Group AG	1.331	536.962
TotalEnergies SE	11.672	525.946
Swisscom AG	1.013	525.212
Imperial Brands Plc	26.444	516.753
Elisa OYJ	9.609	516.189
Red Electrica Corp SA	28.239	511.219
Sanofi	5.589	510.912
Snam SpA	99.360	503.751
UPM-Kymmene OYJ	15.490	503.133
Swiss Prime Site AG	5.322	497.340
Assicurazioni Generali SpA	27.371	496.794
IG Group Holdings Plc	53.838	492.585
Tele2 AB	38.275	472.917
Axfood AB	18.489	471.143
Orion OYJ	12.714	464.771
Bankinter SA	83.696	429.311
Gjensidige Forsikring ASA	21.072	428.125
Gaztransport Et Technigaz SA	4.176	387.737
Azimut Holding SpA	15.482	336.655
Nokian Renkaat OYJ	11.893	268.348

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
BHP Group Plc	32.880	940.488
AstraZeneca Plc	9.232	904.934
Mowi ASA	40.288	822.552
Games Workshop Group Plc	6.797	781.391
Telia Co AB	191.356	667.203
BAE Systems Plc	78.915	604.487
Orion OYJ	12.714	485.682
TotalEnergies SE	10.313	479.713
GlaxoSmithKline Plc	24.335	449.159
Rio Tinto Plc	6.518	446.155
Gjensidige Forsikring ASA	21.072	428.547
Evraz Plc	70.343	390.610
Zurich Insurance Group AG	1.022	384.386
Swisscom AG	743	382.842
Imperial Brands Plc	18.872	374.051
Red Electrica Corp SA	21.116	371.442
Koninklijke KPN NV	119.397	367.839
Sanofi	3.823	356.991
Snam SpA	65.110	335.651
Zardoya Otis SA	47.167	323.861
Plus500 Ltd	19.879	301.568
Elisa OYJ	5.618	294.687
Iberdrola SA	27.364	292.199
Endesa SA	11.613	242.194
Assicurazioni Generali SpA	13.122	223.903
Admiral Group Plc	5.858	212.253
UPM-Kymmene OYJ	6.274	205.994
Close Brothers Group Plc	12.254	192.535
Tryg A/S	8.804	188.006
Allianz SE	843	176.181
Telenor ASA	12.187	172.803

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
TotalEnergies SE	2.360	131.568
BP Plc	24.944	128.068
Investor AB	6.200	127.118
Zurich Insurance Group AG	294	124.918
Shell Plc	4.424	124.304
Bayerische Motoren Werke AG	1.460	122.701
Glencore Plc	18.932	116.288
Banco Santander SA	32.188	97.220
E.ON SE	8.466	92.591
BASF SE	1.756	90.071
Rio Tinto Plc	1.568	87.691
Equinor ASA	2.420	86.642
Stellantis NV	4.630	68.138
Deutsche Post AG	1.462	66.318
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	12.624	60.662
AP Moller - Maersk A/S	22	58.971
Anglo American Plc	1.606	54.948
Repsol SA	3.596	54.007
BAE Systems Plc	5.968	53.347
BHP Group Plc	2.157	52.643
AP Moller - Maersk A/S	18	46.813
Covestro AG	960	46.006
Unilever Plc	1.003	45.748
VAT Group AG	108	44.109
Orange SA	4.530	43.643
British American Tobacco Plc	1.353	42.993
Investor AB	1.974	41.416
ArcelorMittal SA	1.324	39.660
ASML Holding NV	70	38.263
Hermes International	32	36.509
Barratt Developments Plc	4.554	34.852
Norsk Hydro ASA	5.660	34.660
Industria de Diseno Textil SA	1.288	33.707

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ European Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
BHP Group Plc	9.198	263.259
Zurich Insurance Group AG	534	194.329
L'Oreal SA	544	186.180
Iberdrola SA	16.767	166.044
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	32.754	165.444
Novo Nordisk A/S	1.636	156.159
Anglo American Plc	3.420	154.233
British American Tobacco Plc	3.962	152.340
Rio Tinto Plc	2.156	148.059
Adyen NV	91	144.133
Hermes International	90	127.530
Genmab A/S	406	117.096
GlaxoSmithKline Plc	6.116	116.447
ASML Holding NV	183	115.193
Novartis AG	1.482	114.992
Sanofi	1.192	114.406
RELX Plc	4.328	113.715
Investor AB	6.200	108.817
BT Group Plc	57.816	107.765
UPM-Kymmene OYJ	3.297	105.658
Roche Holding AG	299	103.000
Nestle SA	816	92.070
Evolution AB	963	89.630
Partners Group Holding AG	71	89.006
Koninklijke Ahold Delhaize NV	3.115	88.624
E.ON SE	8.466	83.665
Imperial Brands Plc	4.012	75.685
Unilever Plc	1.688	69.631
Telefonica SA	15.942	67.341
Ferrari NV	374	67.335
Geberit AG	126	67.217
Wolters Kluwer NV	738	66.945
Publicis Groupe SA	1.089	62.219

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Rio Tinto Plc	36.889	2.611.288
Amgen Inc	10.807	2.373.388
International Business Machines Corp	13.698	1.801.692
Altria Group Inc	35.001	1.757.135
Allianz SE	6.780	1.718.444
Cisco Systems Inc	30.223	1.700.670
Philip Morris International Inc	16.264	1.684.494
Unilever Plc	32.242	1.677.813
Bank of Nova Scotia	22.944	1.662.068
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	72.127	1.658.881
Toronto-Dominion Bank	19.825	1.624.785
United Parcel Service Inc	7.811	1.615.139
Novartis AG	18.340	1.613.969
Zurich Insurance Group AG	3.357	1.607.913
Royal Bank of Canada	13.829	1.595.835
Coca-Cola Co	26.033	1.592.004
KDDI Corp	50.076	1.588.138
GlaxoSmithKline Plc	70.901	1.585.549
QUALCOMM Inc	9.370	1.574.344
3M Co	9.324	1.568.025
Procter & Gamble Co	9.833	1.566.939
Target Corp	7.628	1.566.017
Johnson & Johnson	9.104	1.530.346
Commonwealth Bank of Australia	21.197	1.529.739
Emerson Electric Co	15.997	1.528.710
Al Rajhi Bank	37.644	1.517.262
Kimberly-Clark Corp	10.854	1.500.497
Eaton Corp Plc	9.334	1.483.903
Roche Holding AG	3.796	1.466.780
Gilead Sciences Inc	21.498	1.445.925
Macquarie Group Ltd	10.032	1.440.088
Paychex Inc	11.612	1.422.997
Merck & Co Inc	17.371	1.383.360
Rio Tinto Ltd	17.688	1.379.254
Nucor Corp	11.376	1.307.752
Cummins Inc	5.357	1.219.994
Sun Life Financial Inc	20.822	1.160.820
Tokio Marine Holdings Inc	19.080	1.146.864
Seagate Technology Holdings Plc	10.182	1.075.096
Nippon Telegraph & Telephone Corp	35.260	1.009.971

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Käufe (Fortsetzung)	Anteile	Kosten USD
Kone OYJ	14.405	949.293
Emirates Telecommunications Group Co PJSC	107.203	922.950
Garmin Ltd	7.257	915.827
Pfizer Inc	16.674	884.389
Lockheed Martin Corp	1.988	874.939
ORIX Corp	40.200	865.146

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Altria Group Inc	50.091	2.627.315
International Business Machines Corp	18.918	2.477.580
Gilead Sciences Inc	32.478	2.009.027
Rio Tinto Plc	24.303	1.761.016
Amgen Inc	7.363	1.717.876
KDDI Corp	49.676	1.642.298
Coca-Cola Co	25.885	1.546.508
Philip Morris International Inc	15.676	1.493.042
Johnson & Johnson	8.720	1.492.850
Al Rajhi Bank	38.400	1.470.386
Novartis AG	17.284	1.468.913
Zurich Insurance Group AG	3.261	1.465.172
Bank of Nova Scotia	20.178	1.451.732
GlaxoSmithKline Plc	70.767	1.450.097
Paychex Inc	11.936	1.449.374
Commonwealth Bank of Australia	19.695	1.431.490
Toronto-Dominion Bank	18.449	1.418.104
Merck & Co Inc	17.729	1.410.841
QUALCOMM Inc	8.774	1.394.174
Procter & Gamble Co	9.399	1.391.719
Royal Bank of Canada	12.839	1.384.038
Macquarie Group Ltd	10.156	1.381.479
Cisco Systems Inc	24.359	1.340.508
Roche Holding AG	3.494	1.317.988
United Parcel Service Inc	6.275	1.294.266
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	62.827	1.291.361
Emerson Electric Co	13.835	1.287.284
Target Corp	5.732	1.253.352
Eaton Corp Plc	8.256	1.251.037
Kimberly-Clark Corp	9.986	1.236.301
Allianz SE	5.560	1.233.315
Nucor Corp	8.736	1.157.073
Unilever Plc	25.190	1.146.953
3M Co	7.268	1.065.798
Cummins Inc	5.017	1.009.988

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Dividend UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe (Fortsetzung)	Anteile	Erlöse USD
Nippon Telegraph & Telephone Corp	31.860	932.080
Tokio Marine Holdings Inc	16.400	907.952
Seagate Technology Holdings Plc	9.402	868.847
Sun Life Financial Inc	16.080	844.491
ORIX Corp	43.400	833.473
Japan Tobacco Inc	45.260	815.926
Analog Devices Inc	4.725	790.508

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Toronto-Dominion Bank	3.720	284.294
Target Corp	1.736	280.915
Coca-Cola Co	4.424	280.386
S&P Global Inc	800	279.493
Newmont Corp	4.016	272.516
Nutrien Ltd	2.632	256.731
National Grid Plc	17.320	256.695
Phillips 66	2.224	224.493
Travelers Co Inc	1.136	203.383
Swiss Re AG	2.168	194.272
SoftBank Corp	16.000	183.985
AmerisourceBergen Corp	1.256	169.764
Fortescue Metals Group Ltd	12.282	161.490
Bank of New York Mellon Corp	3.097	160.434
Vertex Pharmaceuticals Inc	691	158.792
Amgen Inc	686	152.357
IDEXX Laboratories Inc	365	151.508
T Rowe Price Group Inc	1.112	145.602
ASML Holding NV	243	142.791
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	19.000	133.585

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
NVIDIA Corp	1.800	450.336
Bank of Montreal	2.891	314.223
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	50.576	275.178
Cerner Corp	2.792	264.997
Cisco Systems Inc	5.816	262.005
Daikin Industries Ltd	1.505	246.298
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	38.000	243.293
Intesa Sanpaolo SpA	111.240	241.966
Franco-Nevada Corp	1.704	240.936
Rockwell Automation Inc	1.036	237.102
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	5.200	224.511
Deutsche Post AG	4.912	202.613
eBay Inc	4.032	196.233
Vertex Pharmaceuticals Inc	664	178.380
Swisscom AG	270	159.415
Shionogi & Co Ltd	2.846	155.402
Chugai Pharmaceutical Co Ltd	5.200	142.606
FUJIFILM Holdings Corp	2.570	141.980
Genmab A/S	408	124.134
Amgen Inc	464	119.125
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	43.200	116.349
Croda International Plc	1.265	110.584
Pool Corp	272	108.422
Novozymes A/S	1.664	105.399
KDDI Corp	3.000	104.613
Singapore Telecommunications Ltd	55.200	104.246
Shenzhen International Group Holdings Ltd	7.000	99.684
Snam SpA	17.088	99.033
ABIOMED Inc	367	97.541
Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	7.069	96.821
Novo Nordisk A/S	870	93.530
Nippon Yusen KK	1.060	88.165
Systemx Corp	1.332	86.943

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Home Depot Inc	3.793	1.377.105
NIKE Inc	9.353	1.298.286
Lowe's Co Inc	5.395	1.170.429
Exxon Mobil Corp	10.575	919.308
Chevron Corp	5.805	840.545
CVS Health Corp	6.789	666.324
Meta Platforms Inc	2.977	626.567
Moderna Inc	2.791	616.916
ConocoPhillips	6.525	593.339
Blackstone Inc	5.191	568.945
AT&T Inc	23.549	550.053
3M Co	3.291	533.587
Bristol-Myers Squibb Co	8.015	520.446
Amgen Inc	2.237	503.444
Altria Group Inc	9.719	479.816
Mastercard Inc	1.368	477.611
Intel Corp	9.813	471.881
Comcast Corp	9.939	469.811
International Business Machines Corp	3.558	463.693
Philip Morris International Inc	4.632	451.420

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ U.S. Equity UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
NVIDIA Corp	7.102	1.976.190
Thermo Fisher Scientific Inc	2.677	1.527.590
Intuit Inc	2.783	1.362.456
S&P Global Inc	3.273	1.208.196
Estee Lauder Co Inc	4.091	1.146.760
Adobe Inc	2.467	1.098.863
Zoetis Inc	5.921	1.065.516
Honeywell International Inc	4.982	1.025.528
Progressive Corp	8.069	913.239
Advanced Micro Devices Inc	7.600	884.027
Dominion Energy Inc	11.289	863.488
Eli Lilly & Co	3.048	862.537
Bristol-Myers Squibb Co	10.301	748.818
Biogen Inc	3.336	719.065
Pfizer Inc	12.887	700.317
Costco Wholesale Corp	1.306	696.498
AbbVie Inc	4.663	670.487
Mettler-Toledo International Inc	513	620.341
Amgen Inc	2.642	618.363
Public Service Enterprise Group Inc	9.646	617.766
Lockheed Martin Corp	1.483	602.140
Humana Inc	1.325	600.266
Rockwell Automation Inc	2.656	591.126
Philip Morris International Inc	5.796	587.155
Apple Inc	3.535	585.522
Eaton Corp Plc	4.265	582.602
Merck & Co Inc	6.773	577.225
Fortinet Inc	7.843	575.342
QUALCOMM Inc	3.381	574.869
Microsoft Corp	1.789	563.743

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten EUR
Nestle SA	4.986	581.531
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	735	484.880
Novartis AG	5.436	413.966
L'Oreal SA	932	369.944
AstraZeneca Plc	3.690	367.085
Roche Holding AG	879	305.701
Linde Plc	1.071	302.717
Novo Nordisk A/S	3.183	297.541
Schneider Electric SE	1.716	272.252
SAP SE	2.267	263.283
Unilever Plc	5.700	256.174
Deutsche Post AG	5.482	253.897
ASML Holding NV	373	252.899
Diageo Plc	5.544	250.961
Cie Financiere Richemont SA	2.103	247.439
Iberdrola SA	24.705	244.620
DSV PANALPINA A/S	1.019	185.520
Allianz SE	861	176.600
Sanofi	2.019	176.593
Kering SA	243	166.846
Siemens AG	1.143	166.256
Air Liquide SA	1.067	160.785
Givaudan SA	40	157.858
Vestas Wind Systems A/S	5.595	152.289

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse EUR
Roche Holding AG	1.166	405.543
Schneider Electric SE	2.464	364.101
L'Oreal SA	916	326.685
AstraZeneca Plc	2.576	298.411
Koninklijke Philips NV	6.463	181.019
Novartis AG	1.844	142.401
Novo Nordisk A/S	1.343	135.993
Nestle SA	1.211	130.219
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	178	101.335
Vestas Wind Systems A/S	3.478	90.344
HSBC Holdings Plc	14.843	88.484
Kering SA	148	83.759
GlaxoSmithKline Plc	4.170	81.970
ASML Holding NV	163	79.308
adidas AG	379	78.274
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	9.246	76.689
Diageo Plc	1.822	76.639
Reckitt Benckiser Group Plc	1.087	76.462
Linde Plc	270	75.174
Holcim Ltd	1.667	74.943

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Microsoft Corp	32.411	9.912.178
Amazon.com Inc	12.022	7.918.999
Apple Inc	44.971	7.185.461
Alphabet Inc 'A' Shares	1.585	4.398.278
NVIDIA Corp	16.905	4.372.219
Alphabet Inc 'C' Shares	1.515	4.227.514
Adobe Inc	6.255	3.482.893
Visa Inc	13.403	2.943.875
Bank of America Corp	66.764	2.912.754
AbbVie Inc	20.573	2.617.006
Tesla Inc	2.723	2.584.678
UnitedHealth Group Inc	5.433	2.472.285
Meta Platforms Inc	7.835	2.450.894
Mastercard Inc	6.737	2.370.826
salesforce.com Inc	9.188	2.282.642
Cisco Systems Inc	38.798	2.187.118
JPMorgan Chase & Co	12.786	1.955.549
PepsiCo Inc	11.000	1.828.345
Medtronic Plc	16.199	1.801.498
Walt Disney Co	11.133	1.702.386

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (Fortsetzung)

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Größte Verkäufe	Anteile	Erlöse USD
Microsoft Corp	16.572	4.630.651
Apple Inc	24.375	4.117.215
Alphabet Inc 'A' Shares	1.065	2.923.262
Alphabet Inc 'C' Shares	1.056	2.914.684
Meta Platforms Inc	10.272	2.483.982
AbbVie Inc	15.309	2.319.893
UnitedHealth Group Inc	3.954	1.980.233
Adobe Inc	4.215	1.960.235
Visa Inc	8.691	1.903.790
NVIDIA Corp	7.305	1.860.587
Pfizer Inc	34.428	1.762.832
Cisco Systems Inc	31.629	1.694.080
Tesla Inc	1.549	1.581.266
Bank of America Corp	38.288	1.552.476
Mastercard Inc	4.398	1.538.259
salesforce.com Inc	7.097	1.475.423
Merck & Co Inc	17.117	1.405.225
Medtronic Plc	11.735	1.311.506
Thermo Fisher Scientific Inc	2.045	1.205.933
AmerisourceBergen Corp	7.440	1.076.487
Abbott Laboratories	8.963	1.058.781
Danaher Corp	3.279	1.055.905
Eli Lilly & Co	3.676	1.042.289
United Parcel Service Inc	5.112	935.184
Amgen Inc	3.905	928.530
JPMorgan Chase & Co	6.282	919.368
Intel Corp	21.089	910.255

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF*

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Tencent Holdings Ltd	7.244	347.551
Alibaba Group Holding Ltd	18.845	243.349
Meituan	4.631	114.873
China Construction Bank Corp	122.000	86.243
BYD Co Ltd	1.479	57.296
JD.com Inc	1.800	55.399
LONGi Green Energy Technology Co Ltd	6.100	53.587
Baidu Inc	3.050	53.007
China Conch Venture Holdings Ltd	19.000	41.361
NetEase Inc	1.940	40.375
Xinyi Solar Holdings Ltd	20.000	32.870
Tongwei Co Ltd	4.100	32.539
NIO Inc ADR	1.660	30.984
JA Solar Technology Co Ltd	2.100	30.839
Wuxi Biologics Cayman Inc	3.650	30.270
Pinduoduo Inc ADR	482	29.372
NARI Technology Co Ltd	6.000	28.509
China Longyuan Power Group Corp Ltd	14.000	28.404
Kweichow Moutai Co Ltd	100	27.703
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	17.000	27.289
Beijing Enterprises Water Group Ltd	90.000	26.873
Sungrow Power Supply Co Ltd	1.900	24.765

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 wurden keine Verkäufe vorgenommen.

* Der Teilfonds wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

ÜBERSICHT ÜBER PORTFOLIOVERÄNDERUNGEN (UNGEPRÜFT) (Fortsetzung)

Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF*

Übersicht über Portfolioveränderungen für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022.

Gemäß den OGAW-Vorschriften gibt diese Aufstellung die Gesamtkäufe und -verkäufe eines Wertpapiers an, die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe beziehungsweise Verkäufe für den Zeitraum übersteigen, oder mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe.

Größte Käufe	Anteile	Kosten USD
Romanian Government International Bond 2.88% 28/10/2024	1.400.000	1.476.349
Mexico Government International Bond 3.63% 09/04/2029	1.400.000	1.416.997
Brazilian Government International Bond 2.88% 06/06/2025	1.400.000	1.328.600
Colombia Government International Bond 7.38% 18/09/2037	1.400.000	1.320.200
Peruvian Government International Bond 2.78% 23/01/2031	1.350.000	1.145.475
Romanian Government International Bond 4.63% 03/04/2049	1.400.000	1.088.631
Israel Government International Bond 2.75% 03/07/2030	1.100.000	1.024.474
Republic of South Africa Government International Bond 5.88% 22/06/2030	1.050.000	990.066
Chile Government International Bond 0.56% 21/01/2029	1.100.000	953.896
Philippine Government International Bond 3.70% 02/02/2042	1.050.000	886.714
Israel Government International Bond 3.88% 03/07/2050	960.000	849.504
Republic of Poland Government International Bond 0.00% 07/07/2023	800.000	833.278
Dominican Republic International Bond 6.00% 19/07/2028	850.000	802.145
Brazilian Government International Bond 4.75% 14/01/2050	1.100.000	767.800
Croatia Government International Bond 2.88% 22/04/2032	720.000	707.128
Mexico Government International Bond 4.50% 31/01/2050	870.000	682.080
Republic of Poland Government International Bond 2.75% 25/05/2032	650.000	637.011
Philippine Government International Bond 3.00% 01/02/2028	650.000	617.688
Mexico Government International Bond 4.75% 08/03/2044	730.000	611.010
Hungary Government International Bond 5.38% 25/03/2024	580.000	592.099
Panama Government International Bond 3.87% 23/07/2060	800.000	577.600
Chile Government International Bond 4.34% 07/03/2042	630.000	560.007
Korea International Bond 2.50% 19/06/2029	550.000	517.293
Panama Government International Bond 2.25% 29/09/2032	650.000	513.500
Chile Government International Bond 2.55% 27/07/2033	630.000	513.450
Dominican Republic International Bond 5.88% 30/01/2060	730.000	510.854
Philippine Government International Bond 4.20% 21/01/2024	500.000	506.875
Uruguay Government International Bond 4.98% 20/04/2055	500.000	497.500
Uruguay Government International Bond 4.50% 14/08/2024	420.000	426.720
Ivory Coast Government International Bond 4.88% 30/01/2032	500.000	398.107
Hungary Government International Bond 3.13% 21/09/2051	520.000	345.696
Serbia International Bond 1.50% 26/06/2029	440.000	340.149
Peruvian Government International Bond 3.60% 15/01/2072	500.000	340.000

Im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 wurden keine Verkäufe vorgenommen.

* Der Teilfonds wurde am 27. Juni 2022 aufgelegt.

Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft)

Regelmäßige Berichterstattung für FLICAV nur für Produkte gemäß Artikel 8 und Artikel 9 der SFDR

Transparenz bei (i) der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale und bei nachhaltigen Investitionen und bei (ii) ökologischen oder sozialen Zielen und bei nachhaltigen Investitionen in regelmäßigen Berichten

Die Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor ((EU) 2019/2088) (die Offenlegungsverordnung, kurz „SFDR“) hat verschiedene Anforderungen für regelmäßige Berichte im Zusammenhang mit der Offenlegung für Finanzmarktteilnehmer eingeführt (so wie in der SFDR definiert), in denen sie Finanzprodukte verfügbar machen, nämlich eine Beschreibung:

- (i) inwieweit ein gemäß Artikel 8 der SFDR klassifizierter Fonds (ein „Artikel-8-Fonds“) seine ökologischen oder sozialen Merkmale erfüllt; und
- (ii) für einen gemäß Artikel 9 der SFDR klassifizierten Fonds (einen „Artikel-9-Fonds“):
 1. die Gesamtnachhaltigkeitswirkung des Fonds, belegt durch relevante Nachhaltigkeitsindikatoren; und
 2. wenn ein Index als Referenzwert bestimmt wurde, Vergleich der Gesamtnachhaltigkeitswirkung des Fonds mit den Wirkungen des bestimmten Indexes und bei Zugrundelegung eines breiten Marktindex anhand von Nachhaltigkeitsindikatoren.

Die SFDR überträgt ferner der Europäischen Bankenaufsichtsbehörde, der Europäischen Aufsichtsbehörde für das Versicherungswesen und die betriebliche Altersversorgung und der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (zusammen die Europäischen Aufsichtsbehörden, kurz „ESAs“) die Befugnis, Entwürfe für technische Regulierungsstandards („RTS“) auszuarbeiten, in denen das Format der Informationen und der Darstellung in den regelmäßigen Berichten näher festgelegt wird. Nach Angaben der EU-Kommission verzögert sich das Inkrafttreten der RTS bis zum 1. Januar 2023. Die ESAs haben in den am 2. Juni 2022¹ veröffentlichten „Clarifications on the ESAs' draft RTS under SFDR“ festgestellt: „Wie in der Aufsichtserklärung der ESAs angegeben², müssen die regelmäßigen Berichte im Sinne von Artikel 11 Absatz 2 der SFDR ab dem 1. Januar 2022 die in diesem Artikel dargelegten Anforderungen erfüllen. Das bedeutet, dass 2022 regelmäßige Berichte, ungeachtet des Referenzzeitraums, gemäß den in Artikel 11 Absatz 2 genannten sektoralen Rechtsvorschriften SFDR-konform zu erstellen sind.“ Da die RTS noch nicht in Kraft getreten sind, sind in Ermangelung gemeinsamer Offenlegungen zur Nachhaltigkeit oder Berichtsanforderungen, die mit dem Inkrafttreten der RTS wirksam werden, von den Finanzmarktteilnehmern die folgenden Offenlegungen erstellt worden.

Die Offenlegungen für die einzelnen Klassifizierungen werden wie folgt zusammengefasst:

Name des Teilfonds	SFDR-Klassifizierung
Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF	Artikel 8
Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF	Artikel 8
Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	Artikel 8
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 9
Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 9
Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	Artikel 9
Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	Artikel 9

¹ https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/jc_2022_23_-_clarifications_on_the_esas_draft_rts_under_sfdr.pdf

² <https://www.esma.europa.eu/press-news/esma-news/esas-issue-updated-supervisory-statement-application-sustainable-finance>

Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Artikel 8:

<p>Teilfonds</p> <p>Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF</p>	<p>Die Anlagepolitik des Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des ICE Catholic Principles ESG Emerging Markets External Sovereign Index (der „Index“) nachzubilden. Der Index setzt beim Anlageuniversum des ICE BofA Diversified Emerging Markets External Debt Sovereign Bond Index (der „übergeordnete Index“) an und schließt Anleihen von Ländern aus, die nach folgenden, vom Indexanbieter als römisch-katholische Grundsätze vorgegebenen Kriterien schlecht abschneiden: moralische Integrität der Regierungen (d. h. Eindämmung der Korruption, Rechtsstaatlichkeit, Wirksamkeit des Regierungshandelns und Qualität der Rechtsvorschriften), soziale Gerechtigkeit (d. h. politische Stabilität und politische Rechte und Freiheiten), Abschaffung der Todesstrafe und Klimaschutz (d. h. Verringerung von Treibhausgasemissionen) auf der Grundlage von Rating-Daten zu Umwelt, Sozialem und Regierungsführung (Environmental, Social, Governance, „ESG“), die von Sustainalytics sowie von der Emissions Database for Global Atmospheric Research („EDGAR“) bereitgestellt wurden. Die Indexmethode gleicht diese Grundsätze mit den Daten und Werten der jeweiligen Anleihe im übergeordneten Index ab und schließt diejenigen Anleihen aus dem Index aus, deren Wertung unter einem akzeptablen Niveau liegen. Die in dieser Anlagepolitik festgelegten Anlagekriterien finden auf mindestens 90 % der Komponenten des übergeordneten Index Anwendung. Durch die Anwendung der Anlagekriterien liegt der Index mit seiner gesamten CO2-Bilanz um 30 % unter dem übergeordneten Index, berechnet auf der Grundlage der durchschnittlichen CO2-Emissionen pro Kopf für des betreffende Land in emittierten Tonnen CO2 anhand der von EDGAR veröffentlichten Daten. Die Verringerung im Vergleich zum übergeordneten Index wird erreicht durch eine Analyse der CO2-Emissionen solcher Komponenten des übergeordneten Index, die nach Anwendung der vorgenannten Ausschlusskriterien zulässig sind. Dabei werden die Anteile am Index bei Bedarf neu gewichtet, um die angestrebte Verringerung der CO2-Emissionen im Vergleich zum übergeordneten Index zu erreichen. Das Index-Engagement in Einzelländer ist auf 10 % begrenzt. Die Indexkomponenten sind auf der Grundlage ihrer aktuell ausstehenden Beträge kapitalisierungsgewichtet, wobei die Gesamtallokation in ein Einzelland 10 % nicht überschreiten darf.</p> <p>Der Teilfonds erfüllt die ESG-Merkmale, die er durch die Umsetzung der vorstehend dargelegten Prozesse bewirbt.</p>
<p>Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF</p>	<p>ESG-Faktoren sind ein wichtiger Bestandteil des Research-Prozesses des Anlageverwalters für Unternehmensanleihen. Dabei werden fundamentale Bottom-up-Kreditanalysen mit einer Überprüfung aller wesentlichen ESG-Faktoren kombiniert, darunter beispielsweise Umweltrisiken wie Verschmutzung durch Emittenten aus den Sparten Bergbau, Energie und Industrie, gesellschaftliche Risiken wie missbräuchliche Praktiken von Emittenten aus dem Finanzsektor beim Vertrieb von Produkten an Verbraucher sowie Unternehmensführungsrisiken wie die Strukturierung von Anleihen und interne Compliance-Verfahren für den Anlegerschutz, um die mit den Anleihen eines Emittenten verbundenen Stärken, Schwächen und potenziellen Risiken ganzheitlich zu beurteilen. Die Analysten des Anlageverwalters können mit Emittenten zusammenarbeiten, indem sie konkrete Probleme im Hinblick auf CO2-Emissionen, Wasser und Abwasser ansprechen, um das Risikomanagement, das sie in diesen Bereichen anwenden, zu optimieren. Der Anlageverwalter setzt im Auftrag des Teilfonds eine unternehmenseigene Rating-Methode für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) ein. Dadurch sollen Anlagen in Unternehmen und Länder vermieden werden, die hinsichtlich des Übergangs zur Förderung einer CO2-armen Wirtschaft rückständig sind. Die ESG-Rating-Methode wird auf mindestens 90 % der Emittenten im Portfolio des Teilfonds angewandt und ist für den Portfolioaufbau verbindlich.</p> <p>Im Zusammenhang mit staatlichen und privatwirtschaftlichen Emittenten setzt der Teilfonds eine Mischung aus externen und internen Eingabedaten ein, um die „Leistung in Bezug auf die Klimawende“ zu ermitteln. Anhand der Ergebnisse dieser Feststellungen schließt der Teilfonds Emittenten der einzelnen Kategorien (d. h. staatliche Stellen und Unternehmen) aus seinem Portfolio aus, deren Wertung in den unteren 20 % des jeweiligen Anlageuniversums liegt. Ferner meidet der Teilfonds nach Möglichkeit Anlagen in Wertpapieren, die von Emittenten begeben wurden, welche nach Maßgabe konzernunabhängiger externer Research-Dienste eines oder mehrere der folgenden Kriterien erfüllen:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Sie verstoßen wiederholt und schwerwiegend gegen die Prinzipien des United Nations Global Compact • Sie produzieren militärische Ausrüstung und/oder kontroverse Waffen – also solche, die als unterschiedslos wirkend definiert sind – oder stellen Teile her, die zur Verwendung in solchen Waffen bestimmt sind. • Sie produzieren Tabak oder Tabakprodukte oder erwirtschaften mehr als 5 % ihrer Umsätze aus solchen Produkten. • Sie erwirtschaften Umsätze in unannehmbare Höhe aus den umweltbelastendsten fossilen Brennstoffen (5 % der Umsätze aus der Gewinnung von Kraftstoffkohle oder 10 % der Umsätze aus unkonventioneller Öl- und Gasförderung). • Sie verfehlen den vom Anlageverwalter vorgegebenen Schwellenwert für den Einsatz CO2-ärmerer fossiler Brennstoffe. • Sie überschreiten die Toleranzgrenze des Anlageverwalters für die Verstromung fossiler Brennstoffe. <p>Der Teilfonds erfüllt die ESG-Merkmale, die er durch die Umsetzung der vorstehend dargelegten Prozesse bewirbt.</p>

Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Artikel 8: (Fortsetzung)

Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF	<p>Die Anlagepolitik des Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des LibertyQ Global Equity SRI Index (der „Index“) nachzubilden. Bei dem Index handelt es sich um einen systematischen, regelbasierten unternehmenseigenen Index im Eigentum und berechnet von MSCI Inc. Dieser setzt sich aus rund 230 Aktien zusammen, die aus dem MSCI ACWI SRI Index ausgewählt wurden – einem rund 540 Aktien umfassenden, streubesitzadjustierten, marktkapitalisierungsgewichteten Index, der die Wertentwicklung der Aktien von Unternehmen aus Industrie- und Schwellenländern messen soll, die herausragende Ratings für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) aufweisen, und Unternehmen ausschließt, deren Produkte nachteilige soziale oder ökologische Auswirkungen haben.</p> <p>Der MSCI ACWI SRI Index wählt Wertpapiere aus den rund 3.000 im MSCI ACWI Index (der „übergeordnete Index“) erfassten Aktien aus. Der MSCI ACWI SRI Index wendet auf 100 % des übergeordneten Index Kriterien an, die auf den Ausschluss von Unternehmen abzielen, bei deren Produkten oder Dienstleistungen von nachteiligen ökologischen oder sozialen Auswirkungen auszugehen ist, und schließt Unternehmen mit starkem Nachhaltigkeitsprofil ein.</p> <p>Anschließend wendet der MSCI ACWI SRI Index weitere Ausschlusskriterien auf Aktien an, die im übergeordneten Index vertreten sind:</p> <ul style="list-style-type: none"> - sämtliche Unternehmen, die Vorkommen fossiler Energieträger besitzen, welche zur Energieerzeugung eingesetzt werden oder eingesetzt werden sollen - sämtliche Unternehmen, die Umsätze aus dem Abbau von Kraftwerkskohle oder deren Verkauf an externe Parteien und/oder aus der unkonventionellen Öl- und Gasförderung erwirtschaften; und - sämtliche Unternehmen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Verstromung von Kraftwerkskohle erwirtschaften. <p>Im Anschluss werden die obersten 25 % der Emittenten des jeweiligen Sektors aus dem übergeordneten Index ausgewählt. Voraussetzung für die Aufnahme in den MSCI ACWI SRI Index ist ein Mindest-ESG-Rating des Indexanbieters von „A“. Das Portfolio-ESG-Rating des MSCI ACWI SRI Index wird voraussichtlich höher ausfallen als das Portfolio-ESG-Rating des übergeordneten Index.</p> <p>Der Teilfonds erfüllt die ESG-Merkmale, die er durch die Umsetzung der vorstehend dargelegten Prozesse bewirbt</p>
--	---

Artikel 9:

Teilfonds	Wortlaut für regelmäßige Offenlegungen
Franklin MSCI China Paris Aligned Climate UCITS ETF	<p>Die Anlagepolitik des Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des MSCI China Climate Paris Aligned Net Total Return Index (der „Index“) nachzubilden.</p> <p>Der Index basiert auf seinem übergeordneten Index, dem MSCI China Index, und umfasst chinesische Aktien mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung. Der Index ist gezielt auf Anleger ausgerichtet, die ihre Übergangs- und physischen Klimarisiken verringern und Chancen wahrnehmen möchten, die sich aus dem Übergang zu einer CO₂-armen Wirtschaft ergeben und gleichzeitig Konformität mit dem Pariser Klimaabkommen bieten. Der Index ist so aufgebaut, dass er die EU-Vorschriften für auf das Übereinkommen von Paris abgestimmte EU-Referenzwerte (EU Paris-aligned Benchmarks, PAB) (Verordnung (EU) 2019/2089) (die „PAB-Vorschriften“) befolgt.</p> <p>Der Index berücksichtigt die Empfehlungen der Taskforce on Climate-related Financial Disclosures und ist so konzipiert, dass er die Mindeststandards der PAB-Vorschriften übersteigt. Der Index ist auf ein 1,5°C-Klimaszenario abgestimmt und zieht dabei den MSCI Climate Value-at-Risk und eine „Selbst-Dekarbonisierungsrate“ von 10 % im Jahresvergleich heran. Der Index zielt darauf ab, die durch extreme Wetterereignisse bedingten physischen Risiken um mindestens 50 % zu verringern und die Indexgewichtung von „braun“ auf „grün“ zu verlagern. Dafür zieht er den MSCI Low Carbon Transition Score heran (der misst, inwieweit Unternehmen den Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Übergang zu einer CO₂-armen Wirtschaft ausgesetzt sind und wie sie diese managen) und schließt Kategorien von Unternehmen aus, die mit fossilen Brennstoffen in Verbindung stehen. Des Weiteren strebt der Index im Verhältnis zum übergeordneten Index eine Übergewichtung von Unternehmen an, die sich in Chancen durch die Klimawende engagieren, sowie eine Untergewichtung von Unternehmen, die im Zusammenhang mit der Klimawende Risiken ausgesetzt sind. Abschließend verringert der Index nach Möglichkeit die Gewichtung von Unternehmen, die anhand der Scope-1-, -2- und -3-Emissionen als starke CO₂-Emittenten einstuft werden wie in den PAB-Vorschriften beschrieben und erhöht die Gewichtung von Unternehmen mit glaubwürdigen CO₂-Verringerungszielen, während er gleichzeitig im Vergleich zum übergeordneten Index einen moderaten Tracking Error (Nachbildungsfehler) und eine geringe Portfolioumschichtungsquote bietet. Die vorstehend aufgeführten Kriterien werden auf mindestens 90 % der Komponenten des übergeordneten Index angewandt und resultieren in einer Verringerung der Treibhausgasintensität des Index um mindestens 20 % gegenüber dem übergeordneten Index.</p> <p>Bestimmte Wertpapiere aus dem übergeordneten Index sind aus dem Universum zulässiger Aktien ausgeschlossen. Dazu gehören Wertpapiere, die Umsätze aus Kohle-, Öl- und Gasexploration oder -verarbeitung erzielen, welche die in den PAB-Vorschriften festgelegten Schwellenwerte übersteigen, sowie Wertpapiere von Unternehmen, die mehr als 50 % ihrer Umsätze aus der Verstromung von Kraftwerkskohle, Flüssiggas und Erdgas erwirtschaften.</p> <p>Aus dem Index ausgeschlossen werden ferner Unternehmen, die im übergeordneten Index vertreten sind, aber gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen, eines Pakts der Vereinten Nationen, um Unternehmen weltweit dazu anzuhelfen, nachhaltige und sozialverantwortliche Strategien zu verfolgen, oder die an Tabak oder kontroversen Waffen wie Landminen oder Streumunition beteiligt sind.</p> <p>Vom 14. Juni 2022 bis zum 30. Juni 2022 hat der Teilfonds unter Nachbildung der Wertentwicklung des Index seine ökologischen und sozialen Ziele durch die Umsetzung der vorstehend dargelegten Prozesse erfüllt. Des Weiteren hat der Teilfonds anhand der vorstehenden Nachhaltigkeitsindikatoren zum Klimaschutz und zur Klimaanpassung beigetragen. Die CO₂-Intensität des Teilfonds liegt bei 57,2, was mit dem abgebildeten Index übereinstimmt, dessen CO₂-Intensität 57,4 beträgt. Da entspricht einer Verringerung um 84,7 % gegenüber dem Anlageuniversum, dem MSCI China Index, der der übergeordnete Index des Teilfonds ist.</p>

Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Artikel 9: (Fortsetzung)

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF	<p>Die Anlagepolitik des Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des S&P 500 Paris-Aligned Climate Index (der „Index“) nachzubilden.</p> <p>Der Index bietet ein Engagement in US-Wertpapieren mit großer Marktkapitalisierung, die aus dem S&P 500 Index (der „übergeordnete Index“) ausgewählt werden, und soll Anleger beim Übergang zu einer CO₂-armen Wirtschaft und bei der Ausrichtung von Anlagen auf das Pariser Klimaabkommen unterstützen. Der Index ist so aufgebaut, dass er die EU-Vorschriften für auf das Übereinkommen von Paris abgestimmte EU-Referenzwerte (EU Paris-aligned Benchmarks, PAB) (Verordnung (EU) 2019/2089) (die „PAB-Vorschriften“) befolgt. Der übergeordnete Index umfasst 500 der nach Marktkapitalisierung größten US-Unternehmen. Der Index wurde so aufgebaut, dass er auf den Übergang zu einer CO₂-armen Wirtschaft ausgerichtet ist. Im Vergleich zum übergeordneten Index wird der Index (i) diejenigen Unternehmen übergewichtet, die sich für eine Verringerung von Treibhausgasemissionen einsetzen, beurteilt anhand der Treibhausgasintensität, wie sie von den in den PAB-Vorschriften beschriebenen Scope-1-, -2- und -3-Emissionen gemessen wird, und (ii) eine 50 %-ige Dekarbonisierung aufweisen. Ferner muss sich die gesamte Treibhausgasintensität des Index jedes Jahr um 7 % verringern. Diese Kriterien werden auf 100 % des übergeordneten Index angewandt und bewirken, dass der Index einen gewichteten durchschnittlichen ESG-Wert hat, der größer oder gleich dem gewichteten durchschnittlichen ESG-Wert des übergeordneten Index ist, nachdem die 20 % der Unternehmen mit den schlechtesten ESG-Werten aus dem Index herausgenommen und deren Gewichtungen anteilig auf die verbleibenden Komponenten umgelegt wurden.</p> <p>Auswahl und Gewichtung der Indexwertpapiere stützen sich auf Einschätzungen des Indexanbieters dazu, wie stark einzelne Unternehmen innerhalb des übergeordneten Index auf das Szenario einer globalen Erwärmung um 1,5°C ausgerichtet sind, z. B. die Emissionen eines Unternehmens, die grünen Umsätze, die ökologischen Werte, wissenschaftlich fundierte Klimaziele und ergriffene Maßnahmen und Strategien zur Emissionsverringerung. Dabei werden Unternehmen, die nicht oder schlecht auf dieses Szenario ausgerichtet sind, geringer gewichtet als solche, die besser darauf ausgerichtet sind. Die Gewichtungen von Sektoren mit starker Auswirkung auf den Klimawandel im Index (z. B. NACE-Branchenkategorien wie Elektrizitäts-, Gas-, Dampf- und Wärme- und Kälteversorgung, -beförderung, -lagerung und -herstellung) entsprechen mindestens den Gewichtungen solcher Sektoren im übergeordneten Index. Wertpapiere, die Umsätze aus Kohle-, Öl- und Gasexploration oder -verarbeitung erzielen, welche die in den PAB-Vorschriften aufgestellten Schwellenwerte übersteigen, sowie solche Wertpapiere, die mehr als 10 % ihrer Umsätze aus der Verstromung von Kraftwerkskohle bzw. mehr als 50 % aus der Stromerzeugung mit einer CO₂-Intensität der Lebenszyklusemissionen von über 100gCO₂e/kWh erwirtschaften, werden jedoch ausgeschlossen. Aus dem Index ausgeschlossen werden ferner Unternehmen, die im übergeordneten Index vertreten sind, aber gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen, eines Pakts der Vereinten Nationen, um Unternehmen weltweit dazu anzuhalten, nachhaltige und sozialverantwortliche Strategien zu verfolgen, oder die an Tabak oder kontroversen Waffen wie Landminen oder Streumunition beteiligt sind.</p> <p>Der Teilfonds hat durch die Nachbildung der Wertentwicklung des Index seine ökologischen und sozialen Ziele durch die Umsetzung der vorstehend dargelegten Prozesse erfüllt. Des Weiteren hat der Teilfonds anhand der vorstehenden Nachhaltigkeitsindikatoren zum Klimaschutz und zur Klimaanpassung beigetragen. Die CO₂-Intensität des Teilfonds liegt bei 33,0, was mit dem abgebildeten Index übereinstimmt, dessen CO₂-Intensität 32,9 beträgt. Das entspricht einer Verringerung um 77,2 % gegenüber dem Anlageuniversum des übergeordneten Index.</p>
---	--

Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Artikel 9: (Fortsetzung)

Franklin STOXX Europe 600 Paris Aligned Climate UCITS ETF	<p>Die Anlagepolitik des Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des STOXX® Europe 600 Paris-Aligned Benchmark Index (der „Index“) nachzubilden.</p> <p>Der Index bietet ein Engagement in europäischen Wertpapieren mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung, die aus dem STOXX Europe 600 Index (der „übergeordnete Index“) ausgewählt werden, und soll Anleger beim Übergang zu einer CO₂-armen Wirtschaft und bei der Ausrichtung von Anlagen auf das Pariser Klimaabkommen unterstützen. Der Index ist so aufgebaut, dass er die EU-Vorschriften für auf das Übereinkommen von Paris abgestimmte EU-Referenzwerte (EU Paris-aligned Benchmarks, PAB) (Verordnung (EU) 2019/2089) (die „PAB-Vorschriften“) befolgt. Der übergeordnete Index umfasst 600 der nach Marktkapitalisierung größten Unternehmen aus Europa. Im Vergleich zum übergeordneten Index wird der Index (i) diejenigen Unternehmen übergewichtet, die sich für eine Verringerung von Treibhausgasemissionen einsetzen, beurteilt anhand der Treibhausgasintensität, wie sie von den in den PAB-Vorschriften beschriebenen Scope-1-, -2- und -3-Emissionen gemessen wird, und (ii) eine 50 %-ige Dekarbonisierung aufweisen. Ferner muss sich die gesamte Treibhausgasintensität des Index jedes Jahr um 7 % verringern. Diese Kriterien werden auf 90 % des übergeordneten Index angewandt, was eine Verringerung der Treibhausgasintensität gegenüber dem Anlageuniversum um mehr als 20 % bewirkt.</p> <p>Auswahl und Gewichtung der Indexwertpapiere stützen sich auf Einschätzungen des Indexanbieters dazu, wie stark einzelne Unternehmen innerhalb des übergeordneten Index auf das Szenario einer globalen Erwärmung um 2°C ausgerichtet sind, z. B. anhand der Emissionen eines Unternehmens, wissenschaftlich fundierter Klimaziele, „grüner“ Umsätze und ergriffener Maßnahmen und Strategien zur Emissionsverringering. Dabei werden Unternehmen, die nicht oder schlecht auf dieses Szenario ausgerichtet sind, geringer gewichtet als solche, die besser darauf ausgerichtet sind. Die Gewichtungen von Sektoren mit starker Auswirkung auf den Klimawandel im Index (z. B. NACE-Branchenkategorien wie Elektrizitäts-, Gas-, Dampf- und Wärme- und Kälteversorgung, -beförderung, -lagerung und -herstellung) entsprechen mindestens den Gewichtungen solcher Sektoren im übergeordneten Index.</p> <p>Der Index schließt Wertpapiere aus, die Umsätze aus Kohle-, Öl- und Gasexploration oder -verarbeitung erzielen, welche die in den PAB-Vorschriften aufgestellten Schwellenwerte übersteigen, sowie solche Wertpapiere, die mehr als 10 % ihrer Umsätze aus der Verstromung von Kraftwerkskohle bzw. mehr als 50 % aus der Stromerzeugung mit einer CO₂-Intensität der Lebenszyklusemissionen von über 100gCO₂e/kwh erwirtschaften. Aus dem Index ausgeschlossen werden ferner Unternehmen, die im übergeordneten Index vertreten sind, aber gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen, eines Pakts der Vereinten Nationen, um Unternehmen weltweit dazu anzuhalten, nachhaltige und sozialverantwortliche Strategien zu verfolgen, oder die an Tabak oder kontroversen Waffen wie Landminen oder Streumunition beteiligt sind. Der Index wird jährlich im März neu gewichtet. Zum Zeitpunkt einer Neugewichtung darf kein Indexwertpapier mehr als 4,5 % des Index ausmachen. Der Index ist mit dieser Einschränkung konzipiert, um Diversifizierung sicherzustellen und Konzentrationen auf Einzeltitelebene zu minimieren. Weitere Informationen über den Index einschließlich seiner Regeln, Komponenten und Wertentwicklung finden Sie auf https://www.stoxx.com/index-details?symbol=SXXPPAB&searchTerm=SXXPPAB.</p> <p>Der Teilfonds hat durch die Nachbildung der Wertentwicklung des Index seine ökologischen und sozialen Ziele durch die Umsetzung der vorstehend dargelegten Prozesse erfüllt. Des Weiteren hat der Teilfonds anhand der vorstehenden Nachhaltigkeitsindikatoren zum Klimaschutz und zur Klimaanpassung beigetragen. Die CO₂-Intensität des Teilfonds liegt bei 88,6, was mit dem abgebildeten Index übereinstimmt, dessen CO₂-Intensität 90,4 beträgt. Das entspricht einer Verringerung um 44,5 % gegenüber dem Anlageuniversum des übergeordneten Index.</p>
--	---

Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Artikel 9: (Fortsetzung)

Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF	<p>Der Teilfonds strebt sein Anlageziel durch die überwiegende Anlage in Anleihen an, die als „grün“ zertifiziert sind und auf europäische Währungen lauten.</p> <p>Unter normalen Marktbedingungen investiert der Teilfonds mindestens 75 % seines Nettoinventarwerts in als „grün“ zertifizierte Anleihen. Dabei werden bis zu 25 % seines Nettoinventarwerts in Anleihen angelegt, die nach Einschätzung des Anlageverwalters den nachstehend aufgeführten Kriterien zufolge einer CO₂-armen Zukunft förderlich sind. Durch diese Anlagepolitik sollte der Teilfonds Liquidität für neue und bestehende klimaschutzkonforme Projekte mit ökologischem Nutzen bereitstellen.</p> <p>Die Anleihen, in die der Teilfonds investiert, können mit beliebiger Duration begeben, sowohl fest- als auch variabel verzinslich und von staatlichen Stellen und Unternehmen aufgelegt sein. Zu staatlichen Emittenten zählen Behörden und quasistaatliche Stellen. Engagements des Teilfonds in anderen Währungen als dem Euro werden gegen den Euro abgesichert.</p> <p>Die Strategie setzt fundamentale Bottom-up-Research-Analysen ein, um alle Emissionen auszuwählen. Der Schwerpunkt liegt zwar auf zulässigen „grünen“ Anleihen, doch jede Anlage erfordert eine Kreditentscheidung des Anlageverwalters. Der Prozess zur Auswahl der Emissionen sowie sonstige Methoden der aktiven Verwaltung wie Durations- und Kurvenmanagement werden eingesetzt, um solche Anlagen auszuwählen, die es dem Teilfonds nach Ansicht des Anlageverwalters ermöglichen, den Bloomberg Barclays MSCI Euro Green Bond Index (den „Referenzwert“) zu übertreffen. Der Anlageverwalter kann das Durationsengagement in bestimmten Ländern gezielt steigern oder verringern, je nach wirtschaftlichen Fundamentaldaten, Zinserwartungen, Geldpolitik, geopolitischen Trends sowie Fiskalpolitik.</p> <p>Ermittlung grüner und anderer Anleihen, die einer CO₂-armen Zukunft förderlich sind. Um diese Anlagepolitik anzuwenden und geeignete Anleihen zu ermitteln, zieht der Teilfonds die Definition des Begriffs „grün“ der International Capital Market Association heran wie auf deren Website www.icmagroup.org angegeben.</p> <p>Zur Ermittlung von Anleihen, die einer CO₂-armen Zukunft förderlich, aber nicht als grün zertifiziert sind, investiert der Teilfonds in Wertpapiere, die von Emittenten begeben wurde, welche(n):</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.) ein Produkt oder eine Dienstleistung bereitstellen, das bzw. die dem Übergang zu einer CO₂-armen Zukunft Vorschub leistet; 2.) eine entsprechende Unternehmensführungsstruktur zugrunde liegt; und 3.) ein gutes operatives Umweltmanagement an den Tag legen. <p>Jede infrage kommende Anleihe wird von dem für grüne Anleihen zuständigen Unternehmensführungsausschuss des Anlageverwalters anhand dieser drei Kriterien geprüft und nur dann ins Portfolio aufgenommen, wenn der Ausschuss dem mehrheitlich zustimmt.</p> <p>Bei der Auswahl von Anlagen berücksichtigt der Anlageverwalter in erster Linie, ob das Unternehmen, das durch die Anleihenemission finanziert werden soll, in der sich der Teilfonds engagieren könnte, dem Übergang zu einer CO₂-armen Zukunft förderlich ist. Der Anlageverwalter beurteilt eine vorgesehene Anleihe ganzheitlich und berücksichtigt dabei gebührend die ökologische Lebensdauer der Anlage oder des Projekts, die oder das finanziert werden sollten, die eingesparten CO₂-Emissionen, die operative ökologische Leistung des Emittenten sowie die Auswirkungen seiner Produkte und Dienstleistungen über den gesamten Lebenszyklus. Anleihen, die möglicherweise nicht als grün zertifiziert sind, aber dennoch Finanzierungslösungen darstellen, die zu einer CO₂-armen Zukunft beitragen und dabei gleichzeitig die eigene CO₂-Intensität verringern, gelten als zulässige Anlagen für den Teilfonds.</p> <p>Ungeachtet dessen, ob eine Anleihe als grün zertifiziert ist oder nicht, legt der Anlageverwalter mit den Emittenten ein Basisniveau für die Berichterstattung nach der Emission durch die Emittenten fest, das es dem Anlageverwalter ermöglicht, den Projektfortschritt zu verfolgen. Diese Berichterstattung nach der Emission umfasst neben den üblichen Finanzberichten und qualitativen Bewertungen von ökologischen Praktiken in erster Linie Berichte über ökologische Auswirkungen. Einheitliche Kennzahlen, die eine solche Berichterstattung ermöglichen, sind unter anderem die jährlichen Energieeinsparungen, Verringerungen der Treibhausgasemissionen, erzeugte erneuerbare Energie oder zusätzliche erneuerbare Kapazitäten.</p> <p>Der Teilfonds hat seine ökologischen und sozialen Ziele durch die Umsetzung der vorstehend dargelegten Prozesse erfüllt. Des Weiteren hat der Teilfonds anhand der vorstehenden Nachhaltigkeitsindikatoren zum Klimaschutz und zur Klimaanpassung beigetragen. Gemäß seiner Verpflichtung, in Unternehmen zu investieren, die sich im Übergang zu einer CO₂-armen Zukunft befinden, setzt sich der Teilfonds zu 51,7 % aus Unternehmen mit Zielen zur Verringerung der THG-Emissionen zusammen (gegenüber 43,9 % im Referenzwert), zu 24,9 % aus Unternehmen mit Zielen für Scope-1-, -2- und -3-Emissionen (Referenzwert = 16,5 %) und zu 27,4 % aus Unternehmen mit von der SBTi genehmigten Zielen (Referenzwert = 12,1 %)*</p> <p><i>*Daten basieren auf MSCI ESG Research LLC. Der Portfoliowert des 27850 Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF zum 30. Juni 2022 betrug 84.660.336,89 EUR. Auf der Grundlage des EUR-USD-Mittelkurses (1,04836) sind das 88.754.510,78 USD. MSCI schreibt vor, dass der Portfoliowert in USD anzugeben ist, und rundet die Zahl auf 88.754.511 USD auf. Diese Analyse stützt sich auf den Climate Risk Report von MSCI für den Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF und den Referenzwert (Bloomberg Barclays MSCI Euro Green Bond Total Return Gross (EUR) Index). Beides per 30. Juni 2022. Berichtsparameter: Die Allokationsgrundlage ist EVIC mit Zuordnung der Tochtergesellschaften.</i></p>
---	---

Angaben gemäß Offenlegungsverordnung („SFDR“) und Taxonomieverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Taxonomie

Transparenz in regelmäßigen Berichten bei ökologisch nachhaltigen Investitionen – Artikel 8

in Übereinstimmung mit seiner ESG-Investment-Methode, derzufolge ein Artikel-8-Fonds Investitionen beinhalten kann, die zum Klimaschutz und zur Klimaanpassung beitragen. Da keine verlässlichen, aktuellen und überprüfbaren Daten vorliegen, ist es derzeit jedoch nicht möglich, zu bestimmen, wie in und in welchem Umfang die den Investitionen zugrunde liegenden Tätigkeiten Wirtschaftstätigkeiten darstellen, die gemäß Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen und zur Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088 in ihrer jeweils gültigen Fassung (die „Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltig gelten. Daher ist es nicht möglich, sich zu einem Mindestanteil an zugrunde liegenden Investitionen eines Artikel-8-Fonds zu verpflichten, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten und Übergangstätigkeiten, im Sinne der Taxonomieverordnung erfüllen. Die ICAV prüft diese Situation fortlaufend aktiv. Sobald angemessene, ausreichende verlässliche, aktuelle und überprüfbare Daten zu Investitionen eines Artikel-8-Fonds vorliegen und die einschlägigen technischen Kriterien zur Verfügung stehen, werden die Bewertungen vorgenommen und dieser Prospekt wird entsprechend aktualisiert.

Anleger sollten beachten, dass der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ gemäß Taxonomieverordnung nur bei denjenigen dem Artikel-8-Fonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung findet, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil eines Artikel-8-Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten gemäß der Taxonomieverordnung. Die vorstehende Erklärung gilt für die folgenden Artikel-8-Fonds

- Franklin Catholic Principles Emerging Markets Sovereign Debt UCITS ETF
- Franklin Liberty Euro Short Maturity UCITS ETF
- Franklin LibertyQ Global Equity SRI UCITS ETF

Transparenz in regelmäßigen Berichten bei ökologisch nachhaltigen Investitionen – Artikel 9

In Übereinstimmung mit seinem nachhaltigen Investitionsziel investiert der Fonds in nachhaltige Investitionen, von denen manche einen Beitrag zu dem Umweltziel des Klimaschutzes leisten können. Da keine verlässlichen, aktuellen und überprüfbaren Daten vorliegen, ist es derzeit jedoch nicht möglich, zu bestimmen, wie in und in welchem Umfang die den Investitionen zugrunde liegenden Tätigkeiten Wirtschaftstätigkeiten darstellen, die gemäß Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen und zur Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088 in ihrer jeweils gültigen Fassung (die „Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltig gelten. Daher ist es nicht möglich, den Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Fonds anzugeben, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten und Übergangstätigkeiten, im Sinne der Taxonomieverordnung erfüllen. Die ICAV prüft diese Situation fortlaufend aktiv. Sobald angemessene, ausreichende verlässliche, aktuelle und überprüfbare Daten zu Investitionen des Fonds vorliegen und die einschlägigen technischen Kriterien zur Verfügung stehen, werden die Bewertungen vorgenommen und die Gründungsurkunde des Fonds wird entsprechend aktualisiert.

Der Vertrieb ist nur in Verbindung mit oder vor der Veröffentlichung eines zusammenfassenden Prospekts und/oder Prospekts zugelassen. Anleger sollten die Anlageziele, Risiken, Gebühren und Aufwendungen eines Fonds sorgfältig prüfen, bevor sie investieren. Ein Prospekt enthält diese und andere Informationen. Bitte lesen Sie ihn sorgfältig durch, bevor Sie investieren.

Um sicherzustellen, dass wir Ihnen einen qualitativ hochwertigen Service bieten, werden alle Anrufe zu und von unseren Servicebereichen überwacht und/oder aufgezeichnet.



**Jahresbericht
Franklin LibertyShares ICAV**