

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF

Klasse **SINGLCLASS** • ISIN **IE00BMDPBZ72** • En afdeling i Franklin LibertyShares ICAV

Administrationsselskabet er Franklin Templeton International Services S.à r.l.

Mål og investeringspolitik

Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF ("fonden") giver eksponering over for amerikanske large cap-aktier, der er på linje med omstillingen til en økonomi med lav CO₂-udledning.

Fonden forvaltes passivt og tilstræber at følge resultaterne for S&P 500 Paris-Aligned Climate Index (Net Return) ("**Indekset**") så tæt som muligt, uanset om indekset stiger eller falder.

Indekset giver eksponering over for amerikanske large og mid cap-værdipapirer, der er udvalgt fra S&P 500 Index (Net Return) (det "**overordnede indeks**"), som er bedre på linje med overgangen til en økonomi med lav CO₂-udledning, og hjælper investorer med at rette deres investeringer ind efter Parisaftalen. Indekset er sammensat med henblik på at følge EU's benchmarkbestemmelser, der er justeret efter Parisaftalen (EU PAB – forordning (EU) 2019/2089) ("PAB-bestemmelserne"). Det overordnede indeks omfatter 500 af de største virksomheder efter markedsværdi i USA.

Indekset er sammensat, så det stemmer overens med overgangen til en økonomi med lav CO₂-udledning i forhold til det overordnede indeks, vægter indekset (i) de virksomheder højere, der har forpligtet sig på at reducere drivhusgasemissioner, vurderet ved hjælp af drivhusgasintensitet målt efter Scope 1-, 2- og 3-emissionerne beskrevet i forordningerne om Paristilpassede EU-benchmarks og (ii) opnår en 50 % dekarbonisering. Derudover skal indeksets samlede drivhusgasintensitet reduceres med 7 % årligt. Disse kriterier anvendes på 100 % af det overordnede indeks og resulterer i, at indekset har en vægget gennemsnitlig ESG-score, der er større end eller lig med den vægtede gennemsnitlige ESG-score for det overordnede indeks, efter at 20 % af de virksomheder, der scorer dårligst på ESG-kriterier, er fjernet fra indekset og deres vægt omfordelt proportionelt med de resterende komponenter.

Der er flere oplysninger om indekset, herunder dets bestemmelser, bestanddele og resultater på

<https://us.spindices.com/index-family/esg/climate>.

Fonden kan kun anvende derivater til effektiv porteføljeforvaltning.

De værdipapirer, som fonden investerer i, vil først og fremmest være børsnoterede eller handlet på internationalt anerkendte markeder i overensstemmelse med de grænser, der er fastsat i love og regler om investeringsinstitutter.

Denne fond er muligvis ikke egnet for investorer, som planlægger at trække deres penge ud inden for fem (5) år.

Fondens aktier er børsnoterede og bliver handlet på mindst én børs. Under normale omstændigheder må kun godkendte deltagere (f.eks. udvalgte finansielle institutioner) handle aktier direkte med fonden. Andre investorer kan handle aktier dagligt via en mægler på den børs/de børser, hvor aktierne handles.

Ved akkumulerende aktier bliver afkastet fra investeringer geninvesteret i fonden, og det afspejles i kursen på aktier.

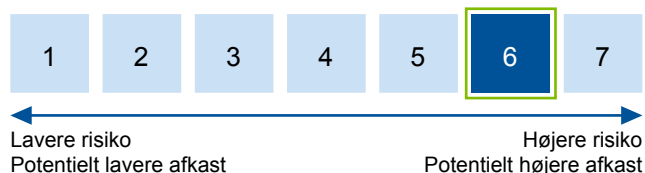
Der findes yderligere oplysninger om fondens mål og investeringspolitik i afsnittet "Investment Objectives and Strategy" ("Investeringsmål og -strategi") til det aktuelle prospekt for Franklin LibertyShares ICAV og fondens bilag.

Definition af begreber

Derivater: Finansielle instrumenter, hvis egenskaber og værdi afhænger af resultaterne af et eller flere underliggende aktiver, typisk værdipapirer, indekser, valutaer eller renter.

Large cap-aktier: aktier i virksomheder med høj børsværdi, der generelt udgør de akkumulerede øverste 70 % af værdien af et indenlandsk aktiemarked.

Risk/reward-profil



Hvad betyder denne indikator, og hvad er grænserne?

Denne indikator er beregnet til at give Dem et måleredskab til kursbevægelsen for denne aktieklasser baseret på historisk adfærd.

Historiske data giver ikke nødvendigvis et pålideligt billede af fondens fremtidige risikoprofil. Den angivne kategori forbliver ikke nødvendigvis uændret og kan ændre sig med tiden.

Den laveste kategori er ikke ensbetydende med en risikofri investering.

Da aktieklassen ikke har tilstrækkelige historiske data, er der i stedet blevet anvendt simulerede data med udgangspunkt i en repræsentativ porteføljemodel eller et repræsentativt benchmark.

Hvorfor er fonden placeret i denne kategori?

Fonden har til hensigt at følge resultatet fra indekset, der er sammensat af amerikanske large cap-aktier, som udvælges fra det overordnede indeks. Sådanne aktiver har tidligere været underlagt kursbevægelser grundet faktorer som f.eks. generel aktiemarkedsvolatilitet, ændringer i de finansielle udsigter eller udsving i valutamarkedene. Derfor kan fondens resultater

være præget af betydelige udsving set over relativt korte tidsperioder.

Risici, der er væsentlige, men som indikatoren ikke tager tilstrækkelig højde for:

Modpartsrisiko: Finansielle institutioners eller agents (når disse agerer som modpart til finansielle kontrakter) risiko for ikke at opfylde deres forpligtelser enten som følge af insolvens, konkurs eller andre årsager.

Risiko ved afledte finansielle instrumenter: risikoen for tab ved et instrument, hvor en lille ændring i den underliggende investerings værdi kan have en større indvirkning på værdien af dette instrument. Afledte finansielle instrumenter kan indebære yderligere likviditets-, kredit- og modpartsrisici.

Valutakursrisiko: risikoen for tab som følge af valutakursudsving eller grundet valutarestriktioner.

Indeksrelateret risiko: risikoen for, at kvantitative teknikker, der anvendes til fastlæggelsen af det tilpassede indeks, som fonden tilstræber at følge, ikke genererer det tilsigtede resultat, eller risikoen for, at fondens porteføljefølgelse afviger fra indeksets sammensætning eller resultat.

Handelsrisiko på sekundært marked: den risiko, at aktierne købt på det sekundære marked normalt ikke kan sælges direkte tilbage til fonden, og investorer derfor skal betale mere end den indre værdi pr. aktie, når de køber aktier, eller modtager mindre end den nuværende indre værdi pr. aktie, når de sælger aktier.

En fuldstændig gennemgang af alle risici, der gælder for denne fond, fremgår af afsnittet "Risk Considerations" ("Risikohensyn") i Franklin LibertyShares ICAV's aktuelle prospekt.

Gebyrer

De gebyrer, De betaler, anvendes til at afholde investeringsinstituttets løbende omkostninger, herunder omkostninger i forbindelse med investeringsinstituttets markedsføring og distribution. Disse gebyrer begrænser investeringens potentielle vækst

Engangsgebyrer før eller efter investering

Indtrædelsesgebyr	Ikke relevant*
Udtrædelsesgebyr	Ikke relevant*
<i>Det beløb udtrykt i procent, der maksimalt kan fratrækkes, før midlerne investeres.</i>	

Gebyrer afholdt af fonden i løbet af et år

Løbende gebyrer	0.07% (Løbende gebyrer omfatter en fritagelse på 0.08 % frem til den 31.5.2023. Gebyrfritagelsen udløber den 1.6.2023).
------------------------	---

Gebyrer afholdt af fonden under visse særlige omstændigheder

Resultatbetinget honorar	Ikke relevant
---------------------------------	---------------

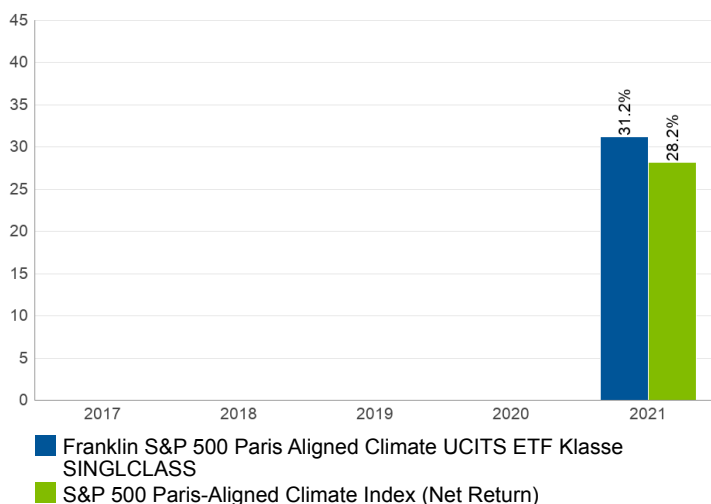
*Der skal ikke betales indtrædelses- eller udtrædelsesgebyrer, når investorer handler med aktier i det sekundære marked, f.eks. når aktier købes eller sælges på børsen. I sådanne tilfælde skal investorer muligvis betale gebyrer opkrævet af deres mægler. Autoriserede deltagere, der handler direkte med fonden, skal eventuelt betale et indtrædelsesgebyr på maksimalt 3 % og et udtrædelsesgebyr på maksimalt 2 %.

De viste indtrædelses- og udtrædelsesgebyrer er maksimumsbeløb, for i visse tilfælde betaler De muligvis mindre. Bed din finansielle rådgiver om yderligere oplysninger.

Tallet for de løbende gebyrer er et skøn. Vi har anvendt skøn, da de tidligere tal ikke længere nødvendigvis giver et retvisende billede i lyset af de seneste ændringer i fondens gebyrstruktur. Nærmere oplysninger om opkrævede gebyrer findes i Franklin LibertyShares ICAV årsberetning for hvert enkelt regnskabsår.

Der findes yderligere oplysninger om gebyrer i afsnittet "Fees and Expenses" ("Gebyrer og udgifter") til det aktuelle prospekt for Franklin LibertyShares ICAV og fondens bilag.

Tidligere resultater



- Tidligere resultater er ikke vejledende for fremtidige resultater.
- De tidligere resultater, der vises her, omfatter alle løbende gebyrer.
- Tidligere resultater beregnes i den aktuelle aktieklasses valuta.
- Fonden blev oprettet i 2020.

Praktiske oplysninger

- Depotbanken for Franklin LibertyShares ICAV er State Street Custodial Services (Ireland) Limited.
- Du kan få yderligere oplysninger om fonden, kopier af dens prospekter, bilag og de seneste års- og halvårsrapporter på hjemmesiden www.franklintempleton.com, eller de kan indhentes gratis hos forvalteren, State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, eller hos din finansielle rådgiver. Disse dokumenter står alle til rådighed på engelsk og nogle andre sprog.
- Den seneste indre værdi og andre praktiske oplysninger om fonden kan rekvireres hos forvalteren, State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, eller på www.franklintempleton.com
- Den vejledende indre værdi findes på de store investeringsportaler med markedsdata.
- Bemærk, at skattelovgivning i Irland kan have en indvirkning på din personlige skattemæssige stilling. Rådfør dig med din finansielle rådgiver eller skatterådgiver, før du beslutter dig for at investere.
- Franklin Templeton International Services S.à.r.l kan kun drages til ansvar for oplysninger i dette dokument, hvis de er vildledende, unøjagtige eller ikke i overensstemmelse med de relevante dele i fondens prospekt.
- Denne fond er en afdeling i Franklin LibertyShares ICAV. Prospektet og de årlige og halvårslige rapporter henviser alle til afdelinger i Franklin LibertyShares ICAV. Alle fonde i Franklin LibertyShares ICAV har adskilte aktiver og passiver. Det betyder, at hver fond drives uafhængigt af hinanden.
- Du kan ikke ombytte aktier med en anden afdeling i Franklin LibertyShares ICAV.
- Detaljerne i den ajourførte aflønningspolitik for forvaltningsvirksomheden, inklusive, men ikke begrænset til, en beskrivelse af, hvorledes aflønning og afkast beregnes, identiteten af de personer, der er ansvarlige for tildeling af aflønning og afkast, herunder sammensætningen af udvalget, findes på www.franklintempleton.lu og kan erhverves i papirkopi uden beregning.
- S&P's hjemmeside (www.standardandpoors.com) indeholder flere detaljerede oplysninger om indekset.