



# Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF

IE00BHZRR253

Fonds Factsheet | Renten Europa | 31. März 2022

## Werbemitteilung (M)

### Fondsinformationen

Fondswährung	EUR
Fondsvolumen (EUR)	86 Mio.
Auflegungsdatum	29.04.2019
Anlageuniversum	Bloomberg MSCI Euro Green Bond Index
ISIN	IE00BHZRR253
WKN	A2PB5T
Gesamtkostenquote (TER) (31.12.2021)	0,30
Sitz	Irland
OGAW	Ja
Struktur des Produkts	Physisch
Verwendung der Erträge	Thesaurierend
Geschäftsjahresende	30 Juni
Umlaufende Anteile	3,500,000

### Zusammenfassung der Anlageziele

Das Anlageziel des Fonds ist es, bei gleichzeitiger Maximierung der Gesamterträge ein Engagement am europäischen Markt für grüne Anleihen zu bieten. Der Fonds investiert mindestens 75% seines Nettoinventarwerts in Anleihen, die als "grün" eingestuft sind, während der Rest in klimagerechte Anleihen investiert wird. Die meisten Anleihen, in die der Fonds investiert, lauten auf europäische Währungen.

### Fondsmanagement

David Zahn, CFA: Großbritannien  
Rod MacPhee, CFA: Großbritannien

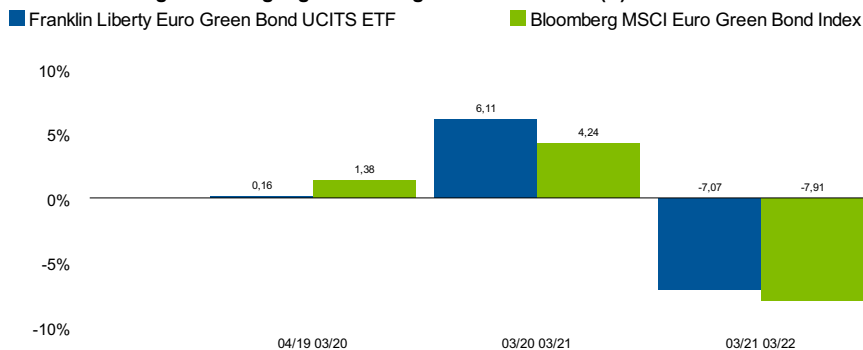
Die Gebühren stellt der Fonds den Anlegern in Rechnung, um die Kosten für den Betrieb des Fonds abzudecken. Zusätzliche Kosten, einschließlich Transaktionsgebühren, fallen ebenfalls an. Diese Kosten werden vom Fonds abgezogen und beeinflussen die Gesamterträge des Fonds. Die Fondsgbühren fallen in mehreren Währungen an, sodass die Zahlungen infolge von Wechselkursschwankungen unterschiedlich hoch sein können.

### Handelsinformationen

Börse	Ticker	Handelswährung	Bloomberg ID	Reuters ID	SEDOL Code
Borsa Italiana	FLRG	EUR	FLRG IM	FLRG.MI	BJ31693
Deutsche Börse Xetra	FLRG	EUR	FLRG GR	FLRG.DE	BJ31682
Euronext Amsterdam Exchange	FLRG	EUR	FLRG NA	FLR1.AS	BKY8CR0
London Stock Exchange	FLRG	EUR	FLRG LN	FLRG.L	BHZRR25
London Stock Exchange	FVUG	GBP	FVUG LN	FVUG.L	BJ31671
SIX Swiss Exchange	FLRG	EUR	FLRG SW	FLRG.S	BJ316B5

### Wertentwicklung

Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftigen Renditen. Wertentwicklung seit Auflegung in Währung der Anteilsklasse (%)



### Wertentwicklung in Währung der Anteilsklasse (%)

	Kumuliert	Jährlich	1 Jahr	Seit Aufl.	Seit Aufl.
Fonds (NIW-Renditen)			-7,07	-1,24	-0,43
Bloomberg MSCI Euro Green Bond Index in EUR			-7,91	-2,68	-0,93

### Wertentwicklung nach Kalenderjahren in Währung der Anteilsklasse (%)

	2021	2020
Fonds (NIW-Renditen)	-3,05	5,50
Bloomberg MSCI Euro Green Bond Index in EUR	-3,36	4,82

Alle Performancedaten werden in der Basiswährung des Fonds angegeben. Die Angaben zur Wertentwicklung beruhen auf dem Nettoinventarwert (NIW) des ETF, der gegebenenfalls vom jeweiligen Marktkurs abweichen kann. Die von einzelnen Anteilseignern realisierten Renditen können von der Wertentwicklung des NIW abweichen. Alle Dividenden werden wiederangelegt. Die tatsächlichen Kosten können je nach ausführender Depotbank unterschiedlich ausfallen. Darüber hinaus können Einlagenkosten anfallen, die sich negativ auf die Wertentwicklung auswirken können. Die anfallenden Kosten können Sie den jeweiligen Preislisten der ausführenden Bank bzw. der Depotbank entnehmen. Änderungen der Wechselkurse können sich positiv oder negativ auf die Entwicklung in Euro auswirken. Angaben zur aktuellen Wertentwicklung finden Sie unter franklintempleton.de, nähere Einzelheiten sind dem Verkaufsprospekt zu entnehmen.

### Die zehn größten Werte (in % des Fondsvolumens)

Wertpapiername	Anteil (%)
Government of Netherlands, senior bond, 144A, Reg S, .50%, 1/15/40	4,92
Government of Ireland, senior bond, Reg S, 1.35%, 3/18/31	3,51
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Reg S, 8/15/30	3,01
Government of Belgium, Reg S, 1.25%, 4/22/33	2,42
Hungary Government International Bond, senior bond, Reg S, 1.75%, 6/05/35	2,32
Spain Government Bond, SR UNSECURED, Sr Unsecured, REG S, 144A, 1.00%, 7/30/42	2,22
Government of Chile, senior bond, .83%, 7/02/31	2,03
Government of France, Reg S, 144A, 1.75%, 6/25/39	1,92
SNCF EPIC, senior note, Reg S, .625%, 4/17/30	1,79
Orsted ASReg S,FRN, 1.75%, 12/09/3019	1,78

### Fondsmerkmale

Durchschnittliche Kreditqualität	A-
Durchschnittliche Duration	6,62 Jahre
Gew. durchschnitt. Restlaufzeit	8,18 Jahre
Rückzahlungsrendite	1,76%
Standardabweichung (1 Jahr)	4,32%

## Werbemitteilung (M)

## Fondsstruktur

■ Franklin Liberty Euro Green Bond UCITS ETF ■ Bloomberg MSCI Euro Green Bond Index

Ländergewichtung (Nominalwert)	in % des Fondsvolumens	Branchengewichtung (Nominalwert)	in % des Fondsvolumens
Frankreich	19,59 / 26,13	EUR IG Unternehmensanleihen	40,36 / 33,46
Niederlande	14,29 / 8,98	Quasi-staatlich	17,32 / 2,88
Spanien	10,78 / 7,24	Asien ohne Japan	7,93 / 6,20
Belgien	3,85 / 3,43	EUR HY Unternehmensanleihen	5,19 / 0,00
Deutschland	3,71 / 18,45	Staatl.- und Quasistaatl. Anleihen	4,34 / 1,90
Irland	3,51 / 2,08	Nicht-EWU-Europa	3,87 / 0,00
Großbritannien	3,37 / 1,15	EWU-Staatsanleihen	2,47 / 24,15
Schweden	2,95 / 1,24	Währungsderivate	0,08 / 0,00
Ungarn	2,32 / 0,30	Verbriefungen	0,00 / 5,11
Sonstige	17,89 / 31,01	Sonstige	0,70 / 26,29
Liquide Mittel	0,69 / 0,00	Liquide Mittel	0,69 / 0,00

## Angaben zu Derivaten im Portfolio

Die Zahlen zum Marktwert spiegeln den Handelswert der Anlagen wieder. Die Angaben zum Nominalwert dienen dazu, das Risiko des Portfolios einschätzen zu können. Sie enthalten auch abgesicherte Risikopositionen oder Positionen mit erhöhtem Risiko, die sich aus im Portfolio gehaltenen Derivaten (bzw. deren zugrundeliegenden Basiswerten) ergeben. Die Angaben zur durchschnittlichen Duration, zur gewichteten Durchschnittslaufzeit und zur Rückzahlungsrendite berücksichtigen bestimmte im Portfolio gehaltene Derivate (oder die zugrundeliegenden Basiswerte). Aufgrund von Rundungen, eingesetzten Derivaten, noch nicht abgewickelten Transaktionen oder anderen Faktoren ergeben die Prozentangaben zur Aufgliederung des Portfolios in Summe möglicherweise nicht 100 % und sind eventuell negativ.

## Wichtige Fondsinformationen

## Chancen:

- Ermöglicht einen Zugang zum europäischen Markt für „grüne“ Anleihen, dem größten regionalen Markt für grüne Anleihen
- Investition in umwelt- bzw. klimafreundliche Anleihen
- Berücksichtigung von ESG Kriterien bei der Identifizierung von Anlagechancen
- Das Portfolio bildet nicht die Entwicklung einer Benchmark nach, sondern es ermöglicht Anlegern die Chancen einer aktiv verwalteten ETF Anlagestrategie.

## Risiken:

- Der Fonds investiert vornehmlich in grüne Anleihen, während gleichzeitig das Kapital erhalten werden soll. Wertpapiere dieser Art sind erfahrungsgemäß recht stabil und werden nur in begrenztem Maße durch Zinsänderungen oder Bewegungen des Rentenmarktes beeinflusst. Daher kann die Wertentwicklung des Fonds im Laufe der Zeit mäßig schwanken und unter Umständen zum Kapitalverlust Ihrer Anlage führen.
- Weitere Risiken von erheblicher Relevanz sind: **Kontrahentenrisiko, Kreditrisiko, Derivatrisiko and Sekundärmarkthandelsrisiko.**
- Wir verweisen zusätzlich auf die detaillierte Beschreibung der mit der Anlagepolitik des Fonds verbundenen Risiken, die in den „Wesentlichen Anlegerinformationen“ (KIID) sowie im Abschnitt „Risikoabwägungen“ des aktuellen Verkaufsprospektes aufgeführt werden.

## Glossar

**Durchschnittliche Duration:** Ein Maß für die Kurssensibilität (Wert des Kapitalbetrags) einer festverzinslichen Anlage gegenüber einer Änderung der Zinssätze. Die Duration wird als eine Anzahl von Jahren angegeben. Die gewichtete durchschnittliche Duration eines Fonds spiegelt die effektive Duration der zugrunde liegenden Werte wieder, basierend auf der Größe jeder Position.

**Durchschnittliche Qualität:** Die durchschnittliche Bonität spiegelt die Positionen auf die zugrunde liegenden Emissionen nach Maßgabe der Größe der einzelnen Positionen sowie die Ratings wider, die ihnen auf Basis der Beurteilung ihrer Bonität durch Rating-Agenturen zugewiesen wurden.

**Gew. durchschnitt. Restlaufzeit:** Eine Schätzung der Anzahl der Jahre bis zur Fälligkeit für die zugrunde liegenden Positionen unter Berücksichtigung der Möglichkeit vorzeitiger Zahlungen.

**Rückzahlungsrendite:** Auch bezeichnet als Brutto-Effektivverzinsung oder Effektivverzinsung. Der erwartete Ertrag einer Anleihe, wenn sie bis zum Fälligkeitsdatum gehalten wird. Die Rückzahlungsrendite ist eine Rendite für langfristige Anleihen, ausgedrückt in Prozent pro Jahr. Bei der Berechnung der Rückzahlungsrendite werden der aktuelle Kurs, der Nennwert, der Festzins und die Restlaufzeit berücksichtigt. Es wird zudem unterstellt, dass alle Zinserträge zum gleichen Zins wieder angelegt werden.

**Standardabweichung:** Eine Angabe über das Ausmaß, in dem die Rendite eines Fonds von seinen früheren Renditen abweicht. Je höher die Standardabweichung ist, umso größer ist die Wahrscheinlichkeit (und das Risiko), dass die Entwicklung eines Fonds von der durchschnittlichen Rendite abweicht.

## Wichtige Hinweise

Dieser Fonds wurde als Fonds klassifiziert, der unter Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor fällt. Dabei handelt es sich um Fonds mit einem ESG-Integrationsansatz, verbindlichen Merkmalen im Hinblick auf Umwelt und/oder Soziales und einem klaren nachhaltigen Anlageziel.

Weitere Informationen über die nachhaltigkeitsbezogenen Aspekte des Fonds sind erhältlich auf [www.franklinresources.com/countries](http://www.franklinresources.com/countries). Bitte machen Sie sich vor einer Anlage mit allen Zielen und Merkmalen des Fonds vertraut.

## Werbemittelung (M)

**Wichtige Hinweise (Fortsetzung)**

Herausgegeben von Franklin Templeton International Services S.à r.l., Niederlassung Deutschland. Sofern nicht anders angegeben, entsprechen die Quellen der von Franklin Templeton angegebenen Daten und Informationen dem Stand zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Dokuments. Diese Unterlagen dienen ausschließlich dem allgemeinen Interesse und sind nicht als persönliche Anlageberatung oder Empfehlung oder Aufforderung zum Kauf, Verkauf oder Halten eines Wertpapiers oder zur Übernahme einer Anlagestrategie zu verstehen. Sie stellen keine juristische oder steuerrechtliche Beratung dar.

Die Anlagerenditen und Kapitalwerte von Franklin LibertyShares ICAV („der ETF“) ändern sich in Abhängigkeit von den Marktbedingungen, und Anleger können beim Verkauf ihrer Anteile einen Gewinn oder Verlust verzeichnen. Angaben zur standardisierten und zur jüngsten Wertentwicklung zum Monatsende für Franklin LibertyShares ICAV finden Sie unter [franklintempleton.at](http://franklintempleton.at). Es kann nicht garantiert werden, dass eine Strategie ihr Ziel erreicht. Anlagen in Franklin LibertyShares ICAV bergen Risiken, und Anleger können Verluste erleiden.

Alle Daten zur Wertentwicklung werden in der Basiswährung des Fonds angegeben. Die Angaben zur Wertentwicklung beruhen auf dem Nettoinventarwert (NIW) des ETF, der gegebenenfalls vom jeweiligen Marktkurs abweichen kann.

Die von Privatanlegern realisierten Renditen können von der Wertentwicklung des NIW abweichen. **Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist weder ein Indikator noch eine Garantie für die zukünftige Wertentwicklung.** Die tatsächlichen Kosten können je nach ausführender Depotbank unterschiedlich ausfallen. Darüber hinaus können Einlagenkosten anfallen, die sich negativ auf den Wert auswirken können. Die anfallenden Kosten können Sie den jeweiligen Preislisten der ausführenden Bank bzw. der Depotbank entnehmen. Änderungen der Wechselkurse können sich positiv oder negativ auf dieses Investment auswirken. Angaben zur aktuellen Wertentwicklung finden Sie unter [franklintempleton.at](http://franklintempleton.at). Nähere Einzelheiten sind dem aktuellen Verkaufsprospekt oder dessen Anhängen zu entnehmen. Die Angaben beziehen sich auf die Vergangenheit und entsprechen nicht unbedingt den aktuellen oder künftigen Portfoliomerkmalen. Alle Portfoliopositionen unterliegen Veränderungen.

Eine Anlage in Franklin LibertyShares ICAV ist mit verschiedenen Risiken verbunden, die im aktuellen Verkaufsprospekt oder dessen Anhängen sowie in den jeweiligen „Wesentlichen Anlegerinformationen“ (KIID) beschrieben sind.

Franklin LibertyShares ICAV (außerhalb der USA oder Kanadas domiziliert) dürfen Gebietsansässigen der Vereinigten Staaten von Amerika oder Kanada weder direkt noch indirekt angeboten oder verkauft werden. ETFs werden wie Aktien gehandelt. Ihr Marktwert schwankt, und sie können zu Kursen gehandelt werden, die über oder unter ihrem Nettoinventarwert liegen.

Maklerprovisionen und ETF-Aufwendungen schmälern die Renditen.

Indizes werden nicht gemanagt und es ist nicht möglich, direkt in einen Index zu investieren. Gebühren, Kosten oder Ausgabeaufschläge sind nicht berücksichtigt. Die Fondsdokumente erhalten Sie in Englisch, Deutsch und Französisch bei Ihrem Franklin Templeton Vertreter vor Ort. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte steht zudem auf

[www.franklintempleton.lu/summary-of-investor-rights](http://www.franklintempleton.lu/summary-of-investor-rights) zur Verfügung. Die Zusammenfassung ist in englischer Sprache verfügbar. Das Franklin LibertyShares ICAV ist in mehreren EU-Mitgliedstaaten für die Vermarktung gemäß OGAW-Richtlinie registriert. Das Franklin LibertyShares ICAV kann diese Registrierung für jede Anteilsklasse und/oder jeden Teilfonds jederzeit unter Anwendung des Verfahrens in Artikel 93a der OGAW-Richtlinie beenden.

Wir weisen Sie darauf hin, dass Sie Anteile/Aktien an dem Fonds erwerben und nicht unmittelbar in die zugrunde liegenden Vermögenswerte des Fonds investieren, wenn Sie sich für eine Anlage entscheiden.

**Vergleichsindex:** Alle MSCI-Daten „wie übernommen“. Die hier beschriebenen Fonds wird nicht von MSCI unterstützt oder gefördert. Auf keinen Fall haften MSCI, ihre Tochtergesellschaften oder Datenanbieter von MSCI auf irgendeine Weise in Verbindung mit den MSCI-Daten oder den Fonds gemäß dieser Beschreibung. Kopieren oder Vertrieb der MSCI-Daten ist streng untersagt.

**Fonds Management:** CFA® und Chartered Financial Analyst® sind Marken des CFA Institute.

Der Nettoinventarwert (NIW) steht für den Wert eines ETF je Anteil. Der NIW je Anteil errechnet sich, indem der Nettoinventarwert des Fonds durch die Anzahl der umlaufenden Anteile dividiert wird.

**Wertentwicklung:** Wenn die Wertentwicklung entweder des Portfolios oder seiner Benchmark umgerechnet wurde, werden für das Portfolio und seine Benchmark gegebenenfalls unterschiedliche Devisenschlusskurse verwendet.

**Die zehn größten Werte:** Die Top-Positionen sind die größten Positionen des Fonds zum angegebenen Datum. Diese Wertpapiere stellen nicht alle gekauften, verkauften oder Advisory-Kunden empfohlenen Wertpapiere dar und der Leser sollte nicht davon ausgehen, dass die Anlage in die aufgeführten Wertpapiere gewinnbringend war oder sein wird.

**Fondsmerkmale:** Die Bewertung der durchschnittlichen Kreditqualität (Average Credit Quality, ACQ) kann sich mit der Zeit verändern. Das Portfolio selbst ist nicht von einer unabhängigen Ratingagentur bewertet worden. Das Buchstabenrating, das auf Anleihenratings von verschiedenen Agenturen (bzw. bei nicht gerateten Anleihen sowie bei Barmitteln und Barmitteläquivalenten auf internen Bewertungen) basieren kann, zeigt das durchschnittliche Kreditrating der zugrundeliegenden Anlagen im Portfolio und reicht generell von AAA (bestes Rating) bis D (schlechtestes Rating). Nicht gerateten Anleihen sowie Barmitteln und Barmitteläquivalenten kann ein Rating zugewiesen werden, das auf dem Rating des Emittenten oder auf dem Rating der entsprechenden Positionen in einem gepoolten Anlageinstrument oder auf anderen relevanten Kriterien basiert. Die ACQ bestimmt sich durch die Zuordnung aufeinanderfolgender ganzer Zahlen zu allen Kreditratings von AAA bis D. Dafür wird ein einfacher vermögensgewichteter Durchschnitt der Anlagen nach Marktwert gebildet und auf das nächstgelegene Rating gerundet. Das Ausfallrisiko steigt mit abnehmendem Rating einer Anleihe, wobei jedoch die angegebene ACQ keine statistische Messgröße für das Ausfallrisiko des Portfolios ist, weil ein einfacher gewichteter Durchschnitt das höhere Risikoniveau schlechter bewerteter Anleihen nicht entsprechend berücksichtigt. Die ACQ kann niedriger sein, wenn Barmittel und Barmitteläquivalente bei der Berechnung nicht berücksichtigt werden. Die ACQ wird ausschließlich zu Informationszwecken angegeben. Derivate sind in der ACQ nicht enthalten.

Angaben zur Rendite sind nicht als Hinweis auf den erzielten oder zu erzielenden Ertrag zu verstehen. Renditezahlen beruhen auf den dem Portfolio zugrundeliegenden Beständen. Es handelt sich nicht um Auszahlungsbeträge des Portfolios.

© 2022 Franklin Templeton. Alle Rechte vorbehalten.