

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

**Klasse SINGLCLASS • ISIN IE00BMDPBZ72 • Ein Teilfonds von Franklin LibertyShares ICAV**  
Die Verwaltungsgesellschaft ist Franklin Templeton International Services S.à r.l.

### Ziele und Anlagepolitik

Der Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF (der «Fonds») bietet ein Engagement in US-Aktien mit hoher Marktkapitalisierung, die mit dem Ziel des Übergangs zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft harmonisieren.

Der Fonds wird passiv verwaltet und zielt darauf ab, die Entwicklung des S&P 500 Paris-Aligned Climate Index (Net Return) (der «**Index**») so genau wie möglich nachzubilden, unabhängig davon, ob dieser steigt oder fällt.

Der Index bietet ein Engagement in ausgewählten US-Aktien mit hoher Marktkapitalisierung des S&P 500 Index (Net Return) (der «**übergeordnete Index**»), die besser an den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft angepasst sind, und er unterstützt Anleger bei der Anpassung ihrer Investments an das Pariser Klimaschutzabkommen. Der Index ist so konstruiert, dass er die Vorschriften hinsichtlich der auf das Übereinkommen von Paris abgestimmten EU-Referenzwerte (EU-PAB) (Verordnung (EU) 2019/2089) (die «PAB-Vorschriften») einhält. Der übergeordnete Index enthält 500 der an der Marktkapitalisierung gemessen grössten Unternehmen in den USA.

Der Index wurde so konstruiert, dass er auf den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft ausgerichtet ist. Im Vergleich zum übergeordneten Index (i) werden im Index Unternehmen übergewichtet, die sich zur Reduzierung ihrer Treibhausgasemissionen verpflichtet haben, wobei die Treibhausgasintensität anhand der in den PAB-Vorschriften beschriebenen Scope-1-, Scope-2- und Scope-3-Emissionen gemessen wird, und (ii) erreicht der Index eine Dekarbonisierung von 50 %. Ausserdem muss die Treibhausgasintensität des Index jährlich um insgesamt 7 % sinken. Diese Kriterien werden auf 100 % des übergeordneten Index angewandt und führen dazu, dass das gewichtete durchschnittliche ESG-Rating des Index mindestens so hoch ist wie das gewichtete durchschnittliche ESG-Rating des übergeordneten Index, nachdem die bei der ESG-Performance schwächsten 20 Prozent der Unternehmen aus dem Index entfernt und ihre Gewichtungen proportional auf die verbleibenden Bestandteile verteilt worden sind.

Weitere Informationen zum Index, einschliesslich seiner Regeln, Komponenten und Wertentwicklung, sind unter <https://us.spindices.com/index-family/esg/climate> verfügbar.

Der Fonds darf Derivate nur für eine effiziente Portfolioverwaltung verwenden.

Die Wertpapiere, in die der Fonds im Einklang mit den in den OGAW-Vorschriften dargelegten Grenzen investiert, sind überwiegend an anerkannten Märkten weltweit notiert oder werden dort gehandelt.

Bei thesaurierenden Anteilen werden die Anlageerträge erneut in den Fonds investiert, was sich im Preis der Anteile niederschlägt.

Dieser Fonds ist unter Umständen nicht für Anleger geeignet, die ihr Geld innerhalb eines Zeitraums von fünf (5) Jahren wieder aus dem Fonds zurückziehen wollen.

Die Anteile des Fonds sind an mindestens einer Börse notiert und werden dort gehandelt. Unter normalen Umständen können nur autorisierte Teilnehmer (z. B. ausgewählte Finanzinstitute) direkt mit dem Fonds Anteile handeln. Andere Anleger können täglich über einen Broker an den entsprechenden Börsen mit Anteilen handeln.

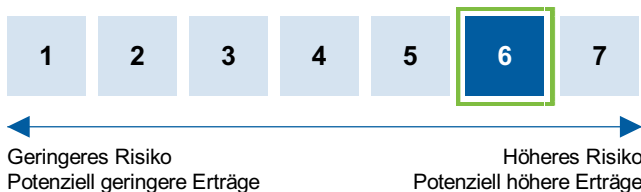
Weitere Informationen über die Ziele und Anlagepolitik des Fonds finden Sie im Abschnitt „Anlageziel und Strategie“ des aktuellen Verkaufsprospekts von Franklin LibertyShares ICAV und dem Fondsnachtrag.

### Begriffserklärungen

**Derivate:** Finanzinstrumente, deren Beschaffenheit und Wert von der Wertentwicklung eines oder mehrerer Basiswerte, typischerweise Wertpapiere, Indizes, Währungen oder Zinssätze, abhängen.

**Aktien mit hoher Marktkapitalisierung:** Aktien von Unternehmen mit hoher Marktkapitalisierung, die im Allgemeinen zusammengenommen die oberen 70 % der Kapitalisierung eines inländischen Aktienmarktes ausmachen.

### Risiko- und Ertragsprofil



#### Was bedeutet dieser Indikator und was sind seine Grenzen?

Dieser Indikator zeigt Ihnen die Preisbewegungen dieser Anteilsklasse auf der Grundlage historischer Daten an.

Es handelt sich hierbei um keinen zuverlässigen Indikator für das zukünftige Risikoprofil des Fonds. Es kann nicht garantiert werden, dass die angezeigte Kategorie fortan unverändert bleibt.

Die niedrigste Kategorie ist nicht gleichbedeutend mit völliger Risikofreiheit.

Da für die Anteilsklasse keine ausreichenden Daten zur Entwicklung in der Vergangenheit vorliegen, wurden stattdessen simulierte Daten, die auf einem repräsentativen Portfoliomodell oder Referenzwerten basieren, verwendet.

#### Warum ist der Fonds in dieser spezifischen Kategorie?

Der Fonds beabsichtigt, die Entwicklung des Index nachzubilden, der sich aus ausgewählten US-Aktien mit hoher Marktkapitalisierung aus dem übergeordneten Index zusammensetzt.

Solche Anlagen waren in der Vergangenheit Preisschwankungen aufgrund von Faktoren wie der allgemeinen Aktienmarktvolatilität, Änderungen der finanziellen Aussichten oder Devisenmarktschwankungen ausgesetzt. Aufgrund dessen kann die Wertentwicklung des Fonds während relativ kurzer Zeiträume erheblich schwanken.

#### Risiken von erheblicher Relevanz, die vom Indikator nicht angemessen

#### widergespiegelt werden:

**Kontrahentenrisiko:** Das Risiko, dass Finanzinstitute oder andere Unternehmen im Finanzsektor (die als Kontrahenten von Finanzkontrakten agieren) ihren Verpflichtungen aufgrund von Insolvenz, Konkurs oder aus anderen Gründen nicht nachkommen können.

**Fremdwährungsrisiko:** Das Risiko eines Verlusts aufgrund von Wechselkursschwankungen oder aufgrund von devisenrechtlichen Bestimmungen.

**Risiken derivativer Instrumente:** Das Verlustrisiko im Zusammenhang mit einem Finanzinstrument, wenn eine geringfügige Veränderung des Werts einer Basisanlage einen grösseren Einfluss auf den Wert des betreffenden Finanzinstruments haben kann. Derivate können zusätzlichen Liquiditäts-, Kredit- und Kontrahentenrisiken unterliegen.

**Indexbezogenes Risiko:** Das Risiko, dass quantitative Techniken, die zur Zusammenstellung des Index verwendet werden, den der Fonds nachbilden soll, nicht das beabsichtigte Ergebnis erzielen, und das Risiko, dass das Portfolio des Fonds von der Zusammensetzung oder Wertentwicklung des Index abweicht.

**Sekundärmarkt handelsrisiko:** Das Risiko, dass am Sekundärmarkt gekaufte Anteile normalerweise nicht direkt an den Fonds zurückverkauft werden können und dass Anleger daher eventuell mehr als den Nettoinventarwert pro Anteil zahlen, wenn sie Anteile kaufen, oder dass sie weniger als den aktuellen Nettoinventarwert pro Anteil erhalten, wenn sie Anteile verkaufen.

Eine umfassende Erörterung aller für diesen Fonds massgeblichen Risiken finden Sie im Abschnitt „Risikoabwägungen“ des aktuellen Verkaufsprospekts von Franklin LibertyShares ICAV.

## Kosten

Die von Ihnen getragenen Kosten werden zur laufenden Verwaltung des Fonds verwendet, einschliesslich der Vermarktung und des Vertriebs der Fondsanteile. Diese Kosten beschränken das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage.

### Einmalige Kosten vor bzw. nach der Anlage

<b>Ausgabeaufschlag</b>	Nicht zutreffend*
<b>Rücknahmeabschlag</b>	Nicht zutreffend*

*Dabei handelt es sich um den Höchstbetrag, der von Ihrer Anlage vor der Anlage abgezogen wird.*

### Kosten, die vom Fonds im Laufe des Jahres abgezogen werden.

<b>Laufende Kosten</b>	0,07%(Auf die laufenden Kosten wird bis 31.05.22 ein Erlass in Höhe von 0,08 % gewährt. Der Gebührenerlass endet am 01.06.22).
------------------------	--

### Kosten, die der Fonds unter bestimmten Umständen zu tragen hat

<b>An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren</b>	Nicht zutreffend
--	------------------

\* Es werden keine Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge erhoben, wenn Anleger am Sekundärmarkt mit Anteilen handeln – d. h., wenn Anteile an einer Börse ge- und verkauft werden. In solchen Fällen zahlen die Anleger eventuell von ihrem Broker erhobene Gebühren. Autorisierte Teilnehmer, die direkt mit dem Fonds handeln, zahlen gegebenenfalls einen Ausgabeaufschlag von bis zu 3 % und einen Rücknahmeabschlag von bis zu 2 %.

Die angegebenen Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge sind Höchstwerte: In manchen Fällen ist der zu zahlende Betrag möglicherweise niedriger. Weitere Informationen dazu erhalten Sie von Ihrem Finanzberater.

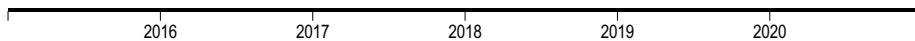
Bei den an dieser Stelle ausgewiesenen laufenden Kosten handelt es sich um eine Kostenschätzung. Wir haben geschätzte Zahlen verwendet, da wir gemäss der gegenwärtigen Gesetzgebung die laufenden Kosten von Anteilsklassen nicht mit Daten für weniger als 12 Monate berechnen dürfen. Der Franklin LibertyShares ICAV-Jahresbericht für jedes Geschäftsjahr enthält Einzelheiten zu den genauen berechneten Kosten.

Ausführliche Informationen zu den Kosten finden Sie im Abschnitt „Gebühren und Aufwendungen“ im aktuellen Verkaufsprospekt von Franklin LibertyShares ICAV und im Fondsnachtrag.

## Frühere Wertentwicklung

- Der Fonds wurde im Jahr 2020 aufgelegt.

Gemäss der gegenwärtigen Gesetzgebung dürfen wir keine Daten zur Wertentwicklung für weniger als ein volles Kalenderjahr bereitstellen.



## Praktische Informationen

- Die Verwahrstelle von Franklin LibertyShares ICAV ist State Street Custodial Services (Ireland) Limited.
- Die Zahlstelle der Franklin LibertyShares ICAV in der Schweiz ist BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zürich.
- Der Vertreter der Franklin LibertyShares ICAV in der Schweiz ist Franklin Templeton Switzerland Ltd., Stockerstrasse 38, 8002 Zürich.
- Die relevanten Unterlagen wie etwa der Verkaufsprospekt und das Dokument mit wesentlichen Informationen für den Anleger (KIID), die Satzung sowie der Jahres- und Halbjahresbericht sind kostenlos bei der Vertretung in der Schweiz, Franklin Templeton Switzerland Ltd., Stockerstrasse 38, 8002 Zürich (Tel. + 41 44 217 81 81), sowie unter [www.franklintempleton.ch](http://www.franklintempleton.ch) und [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com) erhältlich.
- Der aktuelle Nettoinventarwert und sonstige praktische Informationen zum Fonds sind bei der Verwaltungsveranstaltung, State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, erhältlich, oder auf [www.franklintempleton.ch](http://www.franklintempleton.ch).
- Der indikative Nettoinventarwert wird auf den Terminals der bedeutendsten Marktdatenanbieter angezeigt.
- Bitte beachten Sie, dass die irischen Steuergesetze Auswirkungen auf Ihre persönliche Steuersituation haben können. Bitte sprechen Sie mit Ihrem

- Finanz- oder Steuerberater, bevor Sie sich zu einer Anlage entschliessen.
- Franklin Templeton International Services S.à r.l kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, nicht korrekt oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Verkaufsprospekts des Fonds vereinbar ist.
- Der vorliegende Fonds ist ein Teilfonds von Franklin LibertyShares ICAV. Der Verkaufsprospekt und die Jahres- und Halbjahresberichte beziehen sich auf alle Teilfonds von Franklin LibertyShares ICAV. Alle Fonds von Franklin LibertyShares ICAV haben separate Vermögenswerte und Verbindlichkeiten. Aufgrund dessen werden alle Fonds separat geführt.
- Sie können keine Anteile gegen Anteile anderer Teilfonds von Franklin LibertyShares ICAV umtauschen.
- Die Einzelheiten zur aktuellen Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft, unter anderem eine Beschreibung, wie die Vergütungen und Vergünstigungen berechnet werden, und die Identität der für die Gewährung der Vergütungen und Vergünstigungen zuständigen Personen, einschliesslich der Zusammensetzung des Vergütungsausschusses, sind verfügbar unter [www.franklintempleton.lu](http://www.franklintempleton.lu) und sind kostenlos als gedrucktes Dokument erhältlich.
- Die Website von S&P ([www.standardandpoors.com](http://www.standardandpoors.com)) enthält genauere Angaben zum Index.

Dieser Fonds ist in Irland zugelassen und wird von der Central Bank of Ireland reguliert.

Franklin Templeton International Services S.à r.l. ist im Grossherzogtum Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier reguliert.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 24/08/2021.